

2023年9月末
連結自己資本規制および
連結流動性規制に関する開示

金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）
第208条の28第1項の規定に基づき、金融庁長官が定める場合及び
金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第57条の17第2項の経営の健全性の
状況を記載した書面に記載すべき事項に基づき行う開示

事業年度 自 2023年4月1日
(第120期) 至 2023年9月30日

野村ホールディングス株式会社

(注) 2024年3月29日付で、連結自己資本規制比率等の訂正を実施しております。

目次

第1部 連結自己資本規制に関する開示	3
第1章 自己資本の構成に関する開示事項	4
第2章 定性的な開示事項	14
第3章 定量的な開示事項	18
第4章 自己資本調達手段に関する契約内容	55
第5章 自己資本調達手段に関する契約内容（その他外部TLAC調達手段の概要）	65
第6章 連結レバレッジ比率に関する開示事項	85
第7章 TLAC規制	87
第2部 連結流動性規制に関する開示	99
第1章 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項	100
第2章 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項	101
第3章 連結安定調達比率に関する定量的開示事項	102
第4章 連結安定調達比率に関する定性的開示事項	104
第3部 開示方針	105

第1部 連結自己資本規制に関する開示 (経営の健全性の状況)

金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が自己資本の充実の状況を記載した書面に記載すべき事項を定める件（平成22年金融庁告示第132号）に基づき行う開示

第1章 自己資本の構成に関する開示事項

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の 該当番号	項目	イ		ロ
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目(1)				
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	2,845,473	2,843,847	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,285,334	1,275,228	1a
2	うち、利益剰余金の額	1,639,513	1,628,286	2
1c	うち、自己株式の額(△)	79,375	59,667	1c
26	うち、社外流出予定額(△)	—	—	
	うち、上記以外に該当するものの額	—	—	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	—	—	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	442,562	418,102	3
5	普通株式等Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分の額	—	—	
6	普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額(イ)	3,288,035	3,261,949	
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)				
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	160,673	151,743	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	35,574	34,931	
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	125,099	116,812	
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	1,820	4,257	
11	繰延ヘッジ損益の額	—	—	
12	適格引当金不足額	46,018	38,857	
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—	—	
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	64,119	86,202	
15	退職給付に係る資産の額	9,163	9,121	
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	491	674	
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	—	—	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	—	—	

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ		ロ	
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目	
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	—	—		
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	—		
20	うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。）に関連するものの額	—	—		
21	うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額	—	—		
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	—	—		
23	うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	—		
24	うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。）に関連するものの額	—	—		
25	うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額	—	—		
27	その他Tier1 資本不足額	—	—		
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	282,287	290,856		
普通株式等Tier1 資本					
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)－(ロ)) (ハ)	3,005,748	2,971,093		
その他Tier1 資本に係る基礎項目(3)					
30	31a	その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	—	—	
	31b	その他Tier1 資本調達手段に係る新株予約権の額	—	—	
	32	その他Tier1 資本調達手段に係る負債の額	375,000	374,400	
		特別目的会社等の発行するその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
34－35	その他Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分等の額	1,693	1,517		
33+35	適格旧Tier1 資本調達手段の額のうちその他Tier1 資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	—		
33	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特定目的会社等の発行する資本調達手段の額	—	—		
35	うち、最終指定親会社の連結子法人等（最終指定親会社の特別目的会社等を除く。）の発行する資本調達手段の額	—	—		
36	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 (ニ)	376,693	375,917		

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ		ロ
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
その他Tier1 資本に係る調整項目				
37	自己保有その他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
40	その他金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—	—	
42	Tier2 資本不足額	—	—	
43	その他Tier1 資本に係る調整項目の額 (ホ)	—	—	
その他Tier1 資本				
44	その他Tier1 資本の額((ニ)－(ホ)) (ヘ)	376,693	375,917	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)＋(ヘ)) (ト)	3,382,441	3,347,011	
Tier2 資本に係る基礎項目(4)				
46	Tier2 資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	—	—	
	Tier2 資本調達手段に係る新株予約権の額	—	—	
	Tier2 資本調達手段に係る負債の額	—	—	
	特別目的会社等の発行するTier2 資本調達手段の額	—	—	
48－49	Tier2 資本に係る調整後非支配株主持分等の額	398	357	
47＋49	適格旧Tier2 資本調達手段の額のうちTier2 資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	—	
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特定目的会社等の発行する資本調達手段の額	—	—	
49	うち、最終指定親会社の連結子法人等（最終指定親会社の特別目的会社を除く。）の発行する資本調達手段の額	—	—	
50	一般貸倒引当金Tier2 算入額及び適格引当金Tier2 算入額の合計額	—	—	
50a	うち、一般貸倒引当金Tier2 算入額	—	—	
50b	うち、適格引当金Tier2 算入額	—	—	
51	Tier2 資本に係る基礎項目の額 (チ)	398	357	

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ		ロ
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
Tier2資本に係る調整項目(5)				
52	自己保有Tier2 資本調達手段の額	—	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の 額	—	—	
54	少数出資金融機関等のTier2 資本調達手段及び その他外部TLAC関連調達手段の額	—	—	
54a	少数出資金融機関等のその他外部TLAC関連調達手 段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該 当しなくなったものの額	—	—	
55	その他金融機関等のTier2 資本調達手段及びそ の他外部TLAC関連調達手段の額	—	—	
57	Tier2 資本に係る調整項目の額 (リ)	—	—	
Tier2 資本				
58	Tier2 資本の額((チ)－(リ)) (ヌ)	398	357	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)＋(ヌ)) (ル)	3,382,840	3,347,368	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	18,212,210	17,833,741	
連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)／(ヲ))	16.50%	16.65%	
62	連結Tier1 比率((ト)／(ヲ))	18.57%	18.76%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))	18.57%	18.76%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.25%	3.13%	
65	うち、資本保全バッファ比率	2.50%	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.25%	0.13%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率	0.50%	0.50%	
68	連結資本バッファ比率	10.57%	10.76%	
調整項目に係る参考事項(8)				
72	少数出資金融機関等の対象資本調達手段に係る調 整項目不算入額	184,164	169,969	
73	その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち 普通株式に係る調整項目不算入額	221,862	177,775	
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライ ツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に 係る調整項目不算入額	8,905	8,424	

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	イ		ロ
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2) の参照項目
Tier2 資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項(9)				
76	一般貸倒引当金の額	—	—	
77	一般貸倒引当金に係るTier2 資本算入上限額	6,341	6,322	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	—	—	
79	適格引当金に係るTier2 資本算入上限額	41,724	40,445	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項(10)				
82	適格旧Tier1 資本調達手段に係る算入上限額	—	—	
83	適格旧Tier1 資本調達手段の額から適格旧Tier1 資本調達手段に係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	—	—	
84	適格旧Tier2 資本調達手段に係る算入上限額	—	—	
85	適格旧Tier2 資本調達手段の額から適格旧Tier2 資本調達手段に係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	17,046	19,036	

(単位：百万円、%)

自己資本の構成		
国際様式の 該当番号	項目	2022年9月末
普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目(1)		
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	2,767,002
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	1,281,790
2	うち、利益剰余金の額	1,605,082
1c	うち、自己株式の額(△)	119,869
26	うち、社外流出予定額(△)	—
	うち、上記以外に該当するものの額	—
1b	普通株式に係る新株予約権の額	—
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	392,489
5	普通株式等Tier1 資本に係る調整後非支配株主持分の額	—
6	普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額(イ)	3,159,491
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)		
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	122,578
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	17,188
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	105,389
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	2,401
11	繰延ヘッジ損益の額	—
12	適格引当金不足額	7,820
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	—
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	110,657
15	前払年金費用の額	9,619
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く)の額	282
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	—
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	—

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2022年9月末	
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	—	
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	
20	うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。）に関連するものの額	—	
21	うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額	—	
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	—	
23	うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	
24	うち、無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。）に関連するものの額	—	
25	うち、繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に関連するものの額	—	
27	その他Tier1 資本不足額	—	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	253,359	
普通株式等Tier1 資本			
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	2,906,132	
その他Tier1 資本に係る基礎項目(3)			
30	31a	その他Tier1 資本調達手段に係る株主資本の額	—
	31b	その他Tier1 資本調達手段に係る新株予約権の額	—
	32	その他Tier1 資本調達手段に係る負債の額	374,900
		特別目的会社等の発行するその他Tier1 資本調達手段の額	—
34-35	その他Tier1 資本調達手段に係る調整後非支配株主持分等の額	1,861	
33+35	適格旧Tier1 資本調達手段の額のうちその他Tier1 資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	
33	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特定目的会社等の発行する資本調達手段の額	—	
35	うち、最終指定親会社の連結子法人等（最終指定親会社の特別目的会社等を除く。）の発行する資本調達手段の額	—	
36	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 (ニ)	376,761	

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2022年9月末
その他Tier1 資本に係る調整項目		
37	自己保有その他Tier1 資本調達手段の額	—
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—
39	少数出資金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—
40	その他金融機関等のその他Tier1 資本調達手段の額	—
42	Tier2 資本不足額	—
43	その他Tier1 資本に係る調整項目の額 (ホ)	—
その他Tier1 資本		
44	その他Tier1 資本の額((二)－(ホ)) (へ)	376,761
45	Tier1 資本の額((ハ)＋(へ)) (ト)	3,282,893
Tier2 資本に係る基礎項目(4)		
46	Tier2 資本調達手段に係る株主資本の額	—
	Tier2 資本調達手段に係る新株予約権の額	—
	Tier2 資本調達手段に係る負債の額	—
	特別目的会社等の発行するTier2 資本調達手段の額	—
48－49	Tier2 資本調達手段に係る調整後非支配株主持分等の額	437
47＋49	適格旧Tier2 資本調達手段の額のうちTier2 資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特定目的会社等の発行する資本調達手段の額	—
49	うち、最終指定親会社の連結子法人等（最終指定親会社の特別目的会社を除く。）の発行する資本調達手段の額	—
50	一般貸倒引当金Tier2 算入額及び適格引当金Tier2 算入額の合計	—
50a	うち、一般貸倒引当金Tier2 算入額	—
50b	うち、適格引当金Tier2 算入額	—
51	Tier2 資本に係る基礎項目の額 (チ)	437

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2022年9月末
Tier2資本に係る調整項目(5)		
52	自己保有Tier2 資本調達手段の額	—
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2 資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の 額	—
54	少数出資金融機関等のTier2 資本調達手段及び その他外部TLAC関連調達手段の額	—
54a	少数出資金融機関等のその他外部TLAC関連調達手 段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該 当しなくなったものの額	—
55	その他金融機関等のTier2 資本調達手段及びそ の他外部TLAC関連調達手段の額	—
57	Tier2 資本に係る調整項目の額 (リ)	—
Tier2 資本		
58	Tier2 資本の額((チ)－(リ)) (ヌ)	437
総自己資本		
59	総自己資本の合計((ト)＋(ヌ)) (ル)	3,283,331
リスク・アセット(6)		
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	17,169,832
連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)		
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)／(ヲ))	16.92%
62	連結Tier1 比率((ト)／(ヲ))	19.12%
63	連結総自己資本規制比率((ル)／(ヲ))	19.12%
64	最低連結資本バッファ比率	3.01%
65	うち、資本保全バッファ比率	2.50%
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.01%
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率	0.50%
68	連結資本バッファ比率	11.12%
調整項目に係る参考事項(8)		
72	少数出資金融機関等の対象資本調達手段に係る調 整項目不算入額	183,129
73	その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち 普通株式に係る調整項目不算入額	154,688
74	無形固定資産（モーゲージ・サービシング・ライ ツに係るものに限る。）に係る調整項目不算入額	—
75	繰延税金資産（一時差異に係るものに限る。）に 係る調整項目不算入額	3,000

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2022年9月末
Tier2 資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項(9)		
76	一般貸倒引当金の額	—
77	一般貸倒引当金に係るTier2 資本算入上限額	5,745
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	—
79	適格引当金に係るTier2 資本算入上限額	40,642
資本調達手段に係る経過措置に関する事項(10)		
82	適格旧Tier1 資本調達手段に係る算入上限額	—
83	適格旧Tier1 資本調達手段の額から適格旧Tier1 資本調達手段に係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	—
84	適格旧Tier2 資本調達手段に係る算入上限額	—
85	適格旧Tier2 資本調達手段の額から適格旧Tier2 資本調達手段に係る算入上限額を控除した額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）	24,941

第2章 定性的な開示事項

1. 連結の範囲

- (1) 「最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準を定める件」(平成22年12月金融庁告示第130号。以下、「連結自己資本規制比率告示」といいます。)第2条に規定する連結自己資本規制比率を算出する対象となる会社の集団(以下、「会社グループ」といいます。)に属する会社と連結財務諸表提出会社として作成された連結財務諸表における連結の範囲(以下、「会計連結範囲」といいます。)に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因

連結保険子法人等について、連結自己資本規制比率告示第3条第3項に基づき、連結自己資本規制比率算出においては非連結子会社としての取り扱いをしております。

また、連結変動持分事業体(以下、「VIE」といいます。)については、経済実態に即し、連結自己資本規制比率算出においては非連結子会社としての取り扱いを行っております。具体的には、会社グループ内エンティティとの間のカウンターパーティ・リスクは内部消去を行わずにこれを信用リスク・アセットの額として算出し、同じく会社グループ内エンティティによる当該VIEの運用する資産に対する投資については、信用リスク・アセットの額またはマーケット・リスク相当額を算出しております。

- (2) 会社グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容

2023年9月末において、野村證券株式会社(日本・証券業)、ノムラ・インターナショナルPLC(英国・証券業)、ノムラ・セキュリティーズ・インターナショナルInc.(米国・証券業)、ノムラ・インターナショナル(ホンコン)LIMITED(香港・証券業)、野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス株式会社(日本・証券業)など187社。

- (3) 連結自己資本規制比率告示第9条の規定が適用される金融業務を営む関連会社等の数並びに当該金融業務を営む関連会社等の名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容
該当ありません。

- (4) 会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容
会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないものについては、該当ありません。

会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものについては、2023年9月末において、
Nomura Reinsurance ICC Limited (ガーンジー、保険業、総資産0.6億円、純資産0.6億円)、
Nomura Reinsurance 1 IC Limited (ガーンジー、保険業、総資産1,196億円、純資産22億円)、
Nomura Reinsurance 5IC Limited (ガーンジー、保険業、総資産1億円、純資産1億円)、
US CB Reinsurance 1 IC Limited (ガーンジー、保険業、総資産17億円、純資産17億円)、
Nomura Americas Re Ltd. (バミューダ、保険業、総資産2,950億円、純資産77億円)、
Nomura Americas US Re Ltd. (バミューダ、保険業、総資産45億円、純資産45億円)、
その他VIE1, 383社が該当します。

- (5) 会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

会社グループの持株会社並びに子会社等に適用される法令の要件を適切に満たす自己資本の額が確保されること、また、各会社の業務の運営を損なうことなくかつ支払い能力・流動性・収益性に悪影響が及ばないこと等を十分考慮した上で適切に運営されております。

2. 連結自己資本規制比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表に関する事項

2023年9月末

(単位：百万円)

CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係			
項目	イ	ロ	ハ
	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲 に基づく連結貸借 対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部			
現金および現金同等物	4,105,049	4,069,861	
定期預金	454,861	454,861	
取引所預託金およびその他の顧客分別金	316,894	316,894	
貸付金	4,724,587	4,656,029	
顧客に対する受取債権	340,112	337,858	
顧客以外に対する受取債権	1,052,927	1,041,150	
貸倒引当金	△5,780	△5,780	
売戻条件付買入有価証券	16,973,370	16,973,370	
借入有価証券担保金	4,796,490	4,796,490	
トレーディング資産	19,520,628	18,469,481	
プライベート・エクイティ投資	111,212	66,098	
建物、土地、器具備品および設備	462,872	432,286	
トレーディング目的以外の負債証券	390,620	309,524	
投資持分証券	106,421	106,421	
関連会社に対する投資および貸付金	450,359	450,359	
その他	1,014,663	1,011,053	
資産の部合計	54,815,292	53,485,961	
負債の部			
短期借入	1,065,078	989,169	
顧客に対する支払債務	1,328,775	1,328,775	
顧客以外に対する支払債務	2,560,593	2,560,462	
受入銀行預金	2,064,278	2,064,278	
買戻条件付売却有価証券	18,591,260	18,552,566	
貸付有価証券担保金	1,739,100	1,745,096	
その他の担保付借入	291,383	291,383	
トレーディング負債	11,141,358	11,248,418	
その他の負債	1,219,157	1,122,238	
長期借入	11,442,057	10,727,223	
負債の部合計	51,443,044	50,629,612	
純資産の部			
資本金	594,492	594,492	1a
資本剰余金	690,841	690,841	1a
利益剰余金	1,642,918	1,639,636	2
累積的その他の包括利益	442,562	442,562	3
自己株式	△79,375	△79,375	1c
非支配持分	80,808	80,808	
純資産の部合計	3,372,248	3,368,966	
負債及び純資産の部合計	54,815,292	53,998,578	

2023年6月末

(単位：百万円)

CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係			
項目	イ	ロ	ハ
	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲 に基づく連結貸借 対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部			
現金および現金同等物	4,051,660	4,011,681	
定期預金	381,110	381,110	
取引所預託金およびその他の顧客分別金	326,950	326,950	
貸付金	4,393,935	4,323,401	
顧客に対する受取債権	338,779	325,592	
顧客以外に対する受取債権	866,732	918,876	
貸倒引当金	△5,947	△5,947	
売戻条件付買入有価証券	14,787,617	14,787,617	
借入有価証券担保金	4,357,488	4,357,488	
トレーディング資産	20,516,523	19,468,142	
プライベート・エクイティ投資	113,469	76,827	
建物、土地、器具備品および設備	460,044	429,396	
トレーディング目的以外の負債証券	362,133	281,037	
投資持分証券	98,214	98,214	
関連会社に対する投資および貸付金	417,498	417,498	
その他	1,027,029	1,024,267	
資産の部合計	52,493,240	51,222,155	
負債の部			
短期借入	827,318	772,419	
顧客に対する支払債務	1,522,697	1,522,697	
顧客以外に対する支払債務	2,444,351	2,444,102	
受入銀行預金	2,137,388	2,137,388	
買戻条件付売却有価証券	16,405,548	16,373,800	
貸付有価証券担保金	1,610,217	1,616,223	
その他の担保付借入	345,929	345,929	
トレーディング負債	11,750,705	11,844,321	
その他の負債	1,130,374	1,021,337	
長期借入	10,972,871	10,281,489	
負債の部合計	49,147,401	48,359,710	
純資産の部			
資本金	594,492	594,492	1a
資本剰余金	680,735	680,735	1a
利益剰余金	1,631,771	1,628,489	2
累積的其他の包括利益	418,102	418,102	3
自己株式	△59,667	△59,667	1c
非支配持分	80,403	80,403	
純資産の部合計	3,345,838	3,342,556	
負債及び純資産の部合計	52,493,240	51,702,267	

2022年9月末

(単位：百万円)

CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係			
項目	イ	ロ	ハ
	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲 に基づく連結貸借 対照表	別紙様式第一号 (自己資本の構成) の参照項目
資産の部			
現金および現金同等物	3,675,554	3,646,877	
定期預金	346,653	346,653	
取引所預託金およびその他の顧客分別金	383,873	383,824	
貸付金	4,203,402	4,032,144	
顧客に対する受取債権	531,382	530,871	
顧客以外に対する受取債権	1,302,564	1,296,560	
貸倒引当金	△72,154	△72,154	
売戻条件付買入有価証券	15,828,900	15,828,577	
借入有価証券担保金	5,011,798	5,011,798	
トレーディング資産	18,074,120	17,162,357	
プライベート・エクイティ投資	63,733	55,503	
建物、土地、器具備品および設備	430,674	422,055	
トレーディング目的以外の負債証券	447,788	370,353	
投資持分証券	127,255	127,255	
関連会社に対する投資および貸付金	390,113	390,113	
その他	786,316	784,953	
資産の部合計	51,531,980	50,317,748	
負債の部			
短期借入	1,273,660	1,187,981	
顧客に対する支払債務	1,665,335	1,665,335	
顧客以外に対する支払債務	2,168,015	2,167,933	
受入銀行預金	2,039,013	2,039,013	
買戻条件付売却有価証券	15,964,194	15,955,660	
貸付有価証券担保金	1,585,933	1,591,928	
その他の担保付借入	326,875	326,875	
トレーディング負債	12,212,463	12,295,794	
その他の負債	974,536	916,823	
長期借入	10,094,650	9,365,316	
負債の部合計	48,304,678	47,512,664	
純資産の部			
資本金	594,492	594,492	1a
資本剰余金	687,297	687,297	1a
利益剰余金	1,608,564	1,605,082	2
累積的其他の包括利益	392,489	392,489	3
自己株式	△119,869	△119,869	1c
非支配持分	64,327	64,327	
純資産の部合計	3,227,301	3,223,819	
負債及び純資産の部合計	51,531,980	50,736,483	

(注)

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

第3章 定量的な開示事項

1. その他金融機関等であって、最終指定親会社の子法人等であるものの自己資本
 その他金融機関等（連結自己資本規制比率告示第8条第8項第1号に規定するその他金融機関等をいう。）であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称および所要自己資本を下回った額の総額については、該当ありません。
2. 信用リスクに関する次に掲げる事項
 リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額

(単位：百万円)

	エクスポージャーの額 2023年9月末
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	-
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	-
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	-
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	62,652
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	6,078

(単位：百万円)

	エクスポージャーの額 2022年9月末
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	8,389
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	-
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	-
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	76,647
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	10,869

3. その他定量的な開示事項

(1) 主要な指標

KM1：主要な指標

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	3,005,748	2,971,093	2,828,797	2,871,061	2,906,132
2	Tier1資本の額	3,382,441	3,347,011	3,203,714	3,247,793	3,282,893
3	総自己資本の額	3,382,840	3,347,368	3,204,118	3,248,223	3,283,331
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	18,212,210	17,833,741	17,323,921	17,934,115	17,169,832
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	16.50%	16.65%	16.32%	16.00%	16.92%
6	連結Tier1比率	18.57%	18.76%	18.49%	18.10%	19.12%
7	連結総自己資本比率	18.57%	18.76%	18.49%	18.11%	19.12%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー比率	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
9	カウンター・シクリカル・バッ ファー比率	0.25%	0.13%	0.12%	0.11%	0.01%
10	G-SIB/D-SIBバッファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
11	最低連結資本バッファー比率	3.25%	3.13%	3.12%	3.11%	3.01%
12	連結資本バッファー比率	10.57%	10.76%	10.49%	10.11%	11.12%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	65,283,968	61,835,108	56,865,053	58,706,412	60,577,625
14	連結レバレッジ比率	5.18%	5.41%	5.63%	5.53%	5.41%

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2024年3月期 第2四半期	2024年3月期 第1四半期	2023年3月期 第4四半期	2023年3月期 第3四半期	2023年3月期 第2四半期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	6,035,514	6,479,694	6,529,743	5,895,882	5,893,472
16	純資金流出額	3,130,968	3,142,419	3,225,612	3,274,287	3,044,837
17	連結流動性カバレッジ比率	193.7%	207.1%	203.8%	181.1%	194.8%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	17,449,924	16,719,876	15,971,165	15,323,658	15,736,865
19	所要安定調達額	15,564,259	14,646,910	13,317,821	12,602,939	13,893,170
20	連結安定調達比率	112.1%	114.1%	119.9%	121.5%	113.2%

KM2：主要な指標（TLAC要件）

（単位：百万円、％）

KM2：主要な指標（TLAC要件）						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末
1	外部TLACの額	6,756,476	6,402,186	6,046,709	5,880,071	6,087,591
2	リスク・アセットの額	18,212,210	17,833,741	17,323,921	17,934,115	17,169,832
3	資本バッファ勘案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率	37.09%	35.89%	34.90%	32.78%	35.45%
3a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	33.84%	32.76%	31.78%	29.67%	32.44%
4	総エクスポージャーの額	65,283,968	61,835,108	56,865,053	58,706,412	60,577,625
5	総エクスポージャーベース外部TLAC比率	10.34%	10.35%	10.63%	10.01%	10.04%
6a	法令の規定に基づいて除外債務がベイルインの対象から除外される法域か否か					
6b	特例外部TLAC調達手段が認められる法域か否か					
6c	特例外部TLAC調達手段のうちその他外部TLAC調達手段に相当するとして認められているものが占める割合					

(2) リスク・アセットの概要
 OV1：リスク・アセットの概要

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	2,180,327	2,090,709	181,032	173,542
2	うち、標準的手法適用分	456,734	434,870	36,538	34,789
3	うち、内部格付手法適用分	1,376,217	1,309,438	116,703	111,040
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	—	—	—	—
	その他	347,375	346,400	27,790	27,712
4	カウンターパーティ信用リスク	3,644,339	3,577,706	301,430	295,589
5	うち、SA-CCR適用分	625,427	591,841	52,914	49,974
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,071,166	1,053,146	90,834	89,306
	うち、CVAリスク	1,127,076	1,134,003	90,166	90,720
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	432,914	445,759	34,633	35,660
	その他	387,755	352,955	32,881	29,927
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	1,915,263	1,885,310	162,414	159,874
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	—	141,812	—	12,025
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	250,609	223,050	21,251	18,914
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	75,976	76,054	6,078	6,084
11	未決済取引	6,811	7,242	576	611
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	—	—	—	—
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—	—	—
14	うち、外部格付準拠方式適用分	—	—	—	—
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	6,575,210	6,339,777	526,016	507,182
17	うち、標準的方式適用分	1,214,358	1,083,992	97,148	86,719
18	うち、内部モデル方式適用分	5,360,851	5,255,785	428,868	420,462
19	オペレーショナル・リスク	2,615,675	2,667,507	209,254	213,400
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	2,615,675	2,667,507	209,254	213,400
22	うち、先進的計測手法適用分	—	—	—	—
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	576,921	465,501	48,922	39,474
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計（スケーリング・ファクター勘案後）	18,212,210	17,833,741	1,456,976	1,426,699

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式 の該当 番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年9月末	2022年9月末	2023年9月末	2022年9月末
1	信用リスク	2,180,327	1,963,076	181,032	162,782
2	うち、標準的手法適用分	456,734	419,548	36,538	33,563
3	うち、内部格付手法適用分	1,376,217	1,195,187	116,703	101,351
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	—	—	—	—
	その他	347,375	348,339	27,790	27,867
4	カウンターパーティ信用リスク	3,644,339	3,482,477	301,430	288,172
5	うち、SA-CCR適用分	625,427	551,314	52,914	46,705
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,071,166	1,130,000	90,834	95,824
	うち、CVAリスク	1,127,076	1,083,190	90,166	86,655
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	432,914	394,838	34,633	31,587
	その他	387,755	323,133	32,881	27,401
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	1,915,263	1,945,118	162,414	164,946
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	—	104,862	—	8,892
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	250,609	306,588	21,251	25,998
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	75,976	135,863	6,078	10,869
11	未決済取引	6,811	21,682	576	1,820
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	—	—	—	—
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—	—	—
14	うち、外部格付準拠方式適用分	—	—	—	—
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	6,575,210	5,892,363	526,016	471,389
17	うち、標準的方式適用分	1,214,358	1,217,701	97,148	97,416
18	うち、内部モデル方式適用分	5,360,851	4,674,662	428,868	373,972
19	オペレーショナル・リスク	2,615,675	2,566,057	209,254	205,284
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	2,615,675	2,566,057	209,254	205,284
22	うち、先進的計測手法適用分	—	—	—	—
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	576,921	394,223	48,922	33,430
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計（スケーリング・ファクター勘案後）	18,212,210	17,169,832	1,456,976	1,373,586

(3) 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び信用リスク・アセットのみなし計算に係る信用リスクを除く。）に関する事項

CR1：資産の信用の質

2023年9月末

(単位：百万円)

CR1：資産の信用の質					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		帳簿価額の総額		引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)
		デフォルトした エクスポージャー	非デフォルト エクスポージャー		
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	-	1,330,031	-	1,330,031
2	有価証券（うち負債性のもの）	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの 資産（うち負債性のもの）	-	-	-	-
4	オン・バランスシートの資産の 合計（1+2+3）	-	1,330,031	-	1,330,031
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	-	47,642	-	47,642
6	コミットメント等	-	266,658	-	266,658
7	オフ・バランスシートの資産の 合計（5+6）	-	314,300	-	314,300
合計					
8	合計（4+7）	-	1,644,332	-	1,644,332

2022年9月末

(単位：百万円)

CR1：資産の信用の質					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		帳簿価額の総額		引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)
		デフォルトした エクスポージャー	非デフォルト エクスポージャー		
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	67,757	1,155,842	67,729	1,155,869
2	有価証券（うち負債性のもの）	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの 資産（うち負債性のもの）	-	-	-	-
4	オン・バランスシートの資産の 合計（1+2+3）	67,757	1,155,842	67,729	1,155,869
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	-	22,582	-	22,582
6	コミットメント等	-	233,218	-	233,218
7	オフ・バランスシートの資産の 合計（5+6）	-	255,800	-	255,800
合計					
8	合計（4+7）	67,757	1,411,643	67,729	1,411,670

(注)

デフォルトとは債務の不履行、著しく不利益となる契約条件への変更、法的破綻又はこれに類似した状態になった場合、及び債務者又は案件の信用力が非常に脆弱であり、債務の履行の不確実性が非常に高い場合をいい、株式等エクスポージャーを除く信用リスク・アセットの計測対象となる資産について、重大な損失（投下元本の30%を超える損失をいう。）を伴う売却を行う場合を含みます。

CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動

2023年9月末

(単位：百万円)

CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動			
項番		金額	
1	前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高	-	
2	貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の当期中の要因別の変動額	デフォルトした額	-
3		非デフォルト状態へ復帰した額	-
4		償却された額	-
5		その他の変動額	-
6	当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等うち負債性のもの）の残高（1+2-3-4+5）	-	

CR3：信用リスク削減手法

2023年9月末

(単位：百万円)

CR3：信用リスク削減手法						
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		非保全 エクスポ ージャー	保全された エクスポ ージャー	担保で 保全された エクスポ ージャー	保証で 保全された エクスポ ージャー	クレジット・ デリバティブ で保全された エクスポ ージャー
1	貸出金	800,495	529,535	529,535	-	-
2	有価証券（負債性のもの）	-	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	-	-	-	-	-
4	合計（1+2+3）	800,495	529,535	529,535	-	-
5	うちデフォルトしたもの	-	-	-	-	-

2022年9月末

(単位：百万円)

CR3：信用リスク削減手法						
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		非保全 エクスポ ージャー	保全された エクスポ ージャー	担保で 保全された エクスポ ージャー	保証で 保全された エクスポ ージャー	クレジット・ デリバティブ で保全された エクスポ ージャー
1	貸出金	720,089	435,780	435,780	-	-
2	有価証券（負債性のもの）	-	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	-	-	-	-	-
4	合計（1+2+3）	720,089	435,780	435,780	-	-
5	うちデフォルトしたもの	67,757	-	-	-	-

CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

2023年9月末

(単位：百万円、%)

CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果							
項番	資産クラス	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	63,418	-	63,418	-	0	0.00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	50,318	-	50,318	-	2,199	4.37%
4	国際決済銀行等向け	372	-	372	-	0	0.00%
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	7,505	-	7,505	-	1,508	20.10%
7	国際開発銀行向け	-	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	63,197	-	63,197	-	18,517	29.30%
12	法人等向け	984,830	-	455,294	-	431,482	94.76%
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	2,017	-	2,017	-	3,025	149.99%
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21	出資等（重要な出資を除く。）	-	-	-	-	-	-
22	合計	1,171,659	-	642,123	-	456,734	71.12%

2022年9月末

(単位：百万円、%)

CR4：標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果													
項番	資産クラス	イ		ロ		ハ		ニ		ホ		ヘ	
		CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額		リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)					
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額								
1	現金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	34,698	-	34,698	-	-	-	0	-	0.00%	-	-	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	3,052	-	3,052	-	-	-	792	-	25.95%	-	-	
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	22	-	22	-	-	-	5	-	26.52%	-	-	
7	国際開発銀行向け	6	-	6	-	-	-	0	-	0.00%	-	-	
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	27,026	-	27,026	-	-	-	8,788	-	32.51%	-	-	
12	法人等向け	880,792	-	445,012	-	-	-	405,171	-	91.04%	-	-	
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	3,193	-	3,193	-	-	-	4,790	-	150.00%	-	-	
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
21	出資等（重要な出資を除く。）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
22	合計	948,792	-	513,012	-	-	-	419,548	-	81.78%	-	-	

CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

2023年9月末

(単位：百万円)

CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー												
項番	リスク・ウェイト 資産クラス	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)										
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%	合計
1	現金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	63,418	-	-	-	-	-	-	-	-	-	63,418
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	45,274	-	1,073	-	3,970	-	-	-	-	-	50,318
4	国際決済銀行等向け	372	-	-	-	-	-	-	-	-	-	372
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	7,495	-	-	-	9	-	-	-	7,505
7	国際開発銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	52,389	-	5,536	-	5,271	-	-	-	63,197
12	法人等向け	-	-	29,374	-	625	-	425,294	-	-	-	455,294
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	-	-	-	-	-	-	-	2,017	-	-	2,017
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	出資等（重要な出資を除く。）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	合計	109,065	-	90,332	-	10,132	-	430,576	2,017	-	-	642,123

2022年9月末

(単位：百万円)

CR5：標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー												
項番	リスク・ウェイト 資産クラス	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)										
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1250%	合計
1	現金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	34,698	-	-	-	-	-	-	-	-	-	34,698
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	1,448	-	33	-	1,570	-	-	-	-	-	3,052
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	20	-	-	-	1	-	-	-	22
7	国際開発銀行向け	6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	19,896	-	4,641	-	2,488	-	-	-	27,026
12	法人等向け	-	-	49,536	-	423	-	395,052	-	-	-	445,012
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	-	-	-	-	-	-	-	3,193	-	-	3,193
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	出資等（重要な出資を除く。）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	合計	36,152	-	69,487	-	6,635	-	397,543	3,193	-	-	513,012

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

2023年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

CR6：内部格付手法－ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バ ランスシ ート・グ ロスエク スポー ジャーの額	CCF・信用 リスク削 減手法適 用前のオ フ・バラ ンスシ ート・エク スポー ジャーの額	平均CCF	CCF・信用 リスク削 減手法適 用後EAD	平均PD	債務者の 数	平均LGD	平均残存 期間	信用リス ク・アセ ットの額	リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	EL	適格 引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	2,558,112	-	-	2,558,112	0.00%	100件未満	45.00%	1.0	3	0.00%	0	
2	0.15以上0.25未満	22	-	-	22	0.18%	100件未満	45.00%	1.0	6	28.11%	0	
3	0.25以上0.50未満	814	-	-	814	0.26%	100件未満	45.00%	1.0	292	35.87%	0	
4	0.50以上0.75未満	8	-	-	8	0.55%	100件未満	45.00%	1.0	4	55.27%	0	
5	0.75以上2.50未満	8	-	-	8	1.71%	100件未満	45.00%	1.0	7	90.69%	0	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	49	-	-	49	26.31%	100件未満	45.00%	1.0	116	234.07%	5	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	2,559,014	-	-	2,559,014	0.00%	100件未満	45.00%	1.0	429	0.01%	6	-
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	1,985,957	-	-	1,985,957	0.04%	0.1	45.00%	1.0	262,751	13.23%	362	
2	0.15以上0.25未満	41,453	-	-	41,453	0.18%	100件未満	45.00%	2.9	20,882	50.37%	33	
3	0.25以上0.50未満	36,762	-	-	36,762	0.27%	100件未満	45.00%	1.1	18,104	49.24%	44	
4	0.50以上0.75未満	9,813	-	-	9,813	0.55%	100件未満	45.00%	4.8	12,847	130.92%	24	
5	0.75以上2.50未満	1,657	-	-	1,657	0.86%	100件未満	45.00%	4.1	2,295	138.45%	6	
6	2.50以上10.00未満	187	2,401	100.00%	2,588	7.65%	100件未満	45.00%	4.8	6,128	236.75%	89	
7	10.00以上100.00未満	14,048	-	-	14,048	26.31%	100件未満	45.00%	1.2	37,265	265.25%	1,663	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	2,089,881	2,401	100.00%	2,092,282	0.23%	0.2	45.00%	1.1	360,275	17.21%	2,225	-
事業法人向けエクスポージャー (中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)													
1	0.00以上0.15未満	68,961	1,121	100.00%	70,082	0.04%	0.1	45.00%	1.6	12,330	17.59%	14	
2	0.15以上0.25未満	3,118	-	-	3,118	0.18%	100件未満	45.00%	1.2	1,021	32.74%	2	
3	0.25以上0.50未満	1,146	23,546	100.00%	24,692	0.34%	100件未満	45.00%	4.8	20,437	82.76%	37	
4	0.50以上0.75未満	204	10,365	100.00%	10,570	0.55%	100件未満	45.00%	4.9	10,771	101.90%	26	
5	0.75以上2.50未満	2,176	4,329	100.00%	6,506	0.94%	100件未満	45.00%	4.9	8,504	130.70%	27	
6	2.50以上10.00未満	2,978	3,236	100.00%	6,214	6.78%	100件未満	45.00%	4.9	13,172	211.96%	189	
7	10.00以上100.00未満	124,921	2,643	100.00%	127,564	26.31%	0.6	45.00%	2.2	349,394	273.89%	15,107	
8	100.00 (デフォルト)	408	-	-	408	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%	183	
9	小計	203,916	45,241	100.00%	249,158	13.90%	1.0	45.00%	2.5	415,632	166.81%	15,590	-
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CR6：内部格付手法—ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
株式等エクスポージャー（PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る。）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権（事業法人等向け）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権（リテール向け）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CR6：内部格付手法—ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）	EL	適格引当金
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合計（全てのポートフォリオ）		4,852,813	47,642	100.00%	4,900,456	0.80%	1.3	45.00%	1.1	776,337	15.84%	17,822	-

CR6：内部格付手法—ポートフォリオ及びデフォルト率 (PD) 区分別の信用リスク・エクスポージャー													
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バ ランスシ ート・グ ロスエク スポー ジャーの額	CCF・信用 リスク削 減手法適 用前のオ フ・バラ ンスシ ート・エク スポー ジャーの額	平均CCF	CCF・信用 リスク削 減手法適 用後EAD	平均PD	債務者の 数	平均LGD	平均残存 期間	信用リス ク・アセ ットの額	リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	EL	適格 引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	2,298,183	-	-	2,298,183	0.00%	100件未満	45.00%	1.0	7	0.00%	0	
2	0.15以上0.25未満	219	-	-	219	0.18%	100件未満	45.00%	1.0	62	28.62%	0	
3	0.25以上0.50未満	326	-	-	326	0.27%	100件未満	45.00%	1.0	119	36.54%	0	
4	0.50以上0.75未満	69	-	-	69	0.57%	100件未満	45.00%	1.0	39	56.30%	0	
5	0.75以上2.50未満	36	-	-	36	0.84%	100件未満	45.00%	1.0	24	67.75%	0	
6	2.50以上10.00未満	22	-	-	22	8.04%	100件未満	45.00%	1.0	35	160.31%	-	
7	10.00以上100.00未満	186	-	-	186	27.14%	100件未満	45.00%	1.0	438	234.77%	22	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	2,299,043	-	-	2,299,043	0.00%	100件未満	45.00%	1.0	726	0.03%	24	-
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	1,751,816	-	-	1,751,816	0.04%	0.1	45.00%	1.1	248,230	14.16%	340	
2	0.15以上0.25未満	50,960	-	-	50,960	0.18%	100件未満	45.00%	2.5	21,720	42.62%	42	
3	0.25以上0.50未満	53,809	-	-	53,809	0.27%	100件未満	45.00%	1.1	25,397	47.19%	65	
4	0.50以上0.75未満	3,884	-	-	3,884	0.57%	100件未満	45.00%	4.6	5,063	130.35%	10	
5	0.75以上2.50未満	280	-	-	280	0.84%	100件未満	45.00%	2.8	321	114.63%	1	
6	2.50以上10.00未満	616	-	-	616	7.90%	100件未満	45.00%	1.0	1,036	168.20%	21	
7	10.00以上100.00未満	13,576	1,274	100.00%	14,850	27.14%	100件未満	45.00%	1.7	39,613	266.75%	1,813	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	1,874,943	1,274	100.00%	1,876,217	0.27%	0.2	45.00%	1.1	341,383	18.19%	2,295	-
事業法人向けエクスポージャー (中堅中小企業向けエクスポージャー及び特定貸付債権を除く。)													
1	0.00以上0.15未満	113,887	322	100.00%	114,210	0.04%	0.1	45.00%	1.6	21,283	18.63%	23	
2	0.15以上0.25未満	1,999	234	100.00%	2,233	0.18%	100件未満	45.00%	3.0	1,281	57.38%	1	
3	0.25以上0.50未満	6,073	3,008	100.00%	9,081	0.35%	100件未満	45.00%	2.4	5,325	58.63%	14	
4	0.50以上0.75未満	5,760	6,483	100.00%	12,243	0.57%	100件未満	45.00%	3.5	11,115	90.78%	31	
5	0.75以上2.50未満	399	87	100.00%	486	1.27%	100件未満	45.00%	3.7	568	116.96%	2	
6	2.50以上10.00未満	2,531	990	100.00%	3,522	7.96%	100件未満	45.00%	4.9	7,266	206.30%	126	
7	10.00以上100.00未満	96,262	10,181	100.00%	106,444	27.14%	0.4	45.00%	2.1	287,507	270.10%	13,000	
8	100.00 (デフォルト)	79,990	-	-	79,990	100.00%	100件未満	45.00%	4.3	-	-	35,995	67,729
9	小計	306,903	21,308	100.00%	328,211	33.30%	0.6	45.00%	2.5	334,348	101.86%	49,196	67,729
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CR6：内部格付手法—ポートフォリオ及びデフォルト率（PD）区分別の信用リスク・エクスポージャー													
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		オン・バ ランスシ ート・グ ロスエク スポー ジャーの額	CCF・信用 リスク削 減手法適 用前のオ フ・バラ ンスシ ート・エク スポー ジャーの額	平均CCF	CCF・信用 リスク削 減手法適 用後EAD	平均PD	債務者の 数	平均LGD	平均残存 期間	信用リス ク・アセ ットの額	リスク・ ウェイト の加重平 均値（RWA density）	EL	適格 引当金
株式等エクスポージャー（PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る。）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権（事業法人等向け）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
購入債権（リテール向け）													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00（デフォルト）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CR6：内部格付手法—ポートフォリオ及びデフォルト率 (PD) 区分別の信用リスク・エクスポージャー													
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
項番	PD区分	オン・バランスシート・グロスエクスポージャーの額	CCF・信用リスク削減手法適用前のオフ・バランスシート・エクスポージャーの額	平均CCF	CCF・信用リスク削減手法適用後EAD	平均PD	債務者の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)	EL	適格引当金
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	0.15以上0.25未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	0.25以上0.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	0.50以上0.75未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	0.75以上2.50未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合計 (全てのポートフォリオ)		4,480,890	22,582	100.00%	4,503,473	2.54%	1.0	45.00%	1.1	676,459	15.02%	51,516	67,729

(注)

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

CR7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

2023年9月末

(単位：百万円)

CR7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響			
項番	ポートフォリオ	イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リスク・ アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー－FIRB	429	429
2	ソブリン向けエクスポージャー－AIRB	-	-
3	金融機関等向けエクスポージャー－FIRB	360,275	360,275
4	金融機関等向けエクスポージャー－AIRB	-	-
5	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－FIRB	415,632	415,632
6	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－AIRB	-	-
7	特定貸付債権－FIRB	-	-
8	特定貸付債権－AIRB	-	-
9	リテール－適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	-	-
10	リテール－居住用不動産向けエクスポージャー	-	-
11	リテール－その他リテール向けエクスポージャー	-	-
12	株式－FIRB	-	-
13	株式－AIRB	-	-
14	購入債権－FIRB	-	-
15	購入債権－AIRB	-	-
16	合計	776,337	776,337

2022年9月末

(単位：百万円)

CR7：内部格付手法－信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響			
項番	ポートフォリオ	イ	ロ
		クレジット・デリバティブ 勘案前の信用リスク・ アセットの額	実際の信用リスク・ アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー－FIRB	726	726
2	ソブリン向けエクスポージャー－AIRB	-	-
3	金融機関等向けエクスポージャー－FIRB	341,383	341,383
4	金融機関等向けエクスポージャー－AIRB	-	-
5	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－FIRB	334,348	334,348
6	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）－AIRB	-	-
7	特定貸付債権－FIRB	-	-
8	特定貸付債権－AIRB	-	-
9	リテール－適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	-	-
10	リテール－居住用不動産向けエクスポージャー	-	-
11	リテール－その他リテール向けエクスポージャー	-	-
12	株式－FIRB	-	-
13	株式－AIRB	-	-
14	購入債権－FIRB	-	-
15	購入債権－AIRB	-	-
16	合計	676,459	676,459

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

(単位：百万円)

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点（2023年6月末）における信用リスク・アセットの額	3,988,160	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	164,336
3		ポートフォリオの質	31,383
4		モデルの更新	—
5		手法及び方針	—
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	13,521
8		その他	—
9		当四半期末時点（2023年9月末）における信用リスク・アセットの額	4,197,401

(注)

モデルの更新により格付区分に変更のあった債務者の変動額はすべて項番4「モデルの更新」に含めております。また、項番2「資産の規模」には項番3から項番8で特定された変動額以外の変動額を記載していません。

CR10：内部格付手法－特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）

2023年9月末

(単位：百万円、%)

CR10：内部格付手法－特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）																
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ					
特定貸付債権（スロットティング・クライテリア方式）																
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）以外																
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）					信用リスク・アセットの額	期待損失					
					PF	OF	CF	IPRE	合計							
優（Strong）	2.5年未満	383,612	91,450	50.00%	16,727	-	-	435,472	452,200	226,100	-					
	2.5年以上	154,289	50,854	70.00%	88,743	-	-	103,687	192,430	134,701	769					
良（Good）	2.5年未満	38,985	25,555	70.00%	36,387	-	-	21,764	58,152	40,706	232					
	2.5年以上	105,558	89,644	90.00%	122,925	-	-	49,866	172,791	155,512	1,382					
可（Satisfactory）		30,402	9,153	115.00%	27,944	-	-	9,323	37,268	42,858	1,043					
弱い（Weak）		-	-	250.00%	-	-	-	-	-	-	-					
デフォルト（Default）		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
合計		712,849	266,658	-	292,728	-	-	620,114	912,843	599,879	3,428					
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）																
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）					信用リスク・アセットの額	期待損失					
優（Strong）	2.5年未満	-	-	-						-	-					
	2.5年以上	-	-	-						-	-					
良（Good）	2.5年未満	-	-	-						-	-					
	2.5年以上	-	-	-						-	-					
可（Satisfactory）		-	-	-						-	-					
弱い（Weak）		-	-	-						-	-					
デフォルト（Default）		-	-	-						-	-					
合計		-	-	-						-	-					
株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）																
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー																
カテゴリー	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）						信用リスク・アセットの額	期待損失					
簡易手法－上場株式	417,784	-	300.00%							417,784	1,253,352					
簡易手法－非上場株式	165,477	-	400.00%						165,477	661,910						
内部モデル手法	-	-	-						-	-						
合計	583,261	-	-						583,261	1,915,263						
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー																
連結自己資本規制比率告示第百四十三条第一項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	-	-	100.00%						-	-						

CR10：内部格付手法－特定貸付債権（スロッシング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）											
イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権（スロッシング・クライテリア方式）											
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）以外											
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシート の額	オフ・バランスシート の額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）					信用リスク・アセットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE	合計		
優（Strong）	2.5年未満	249,529	73,084	50.00%	40,682	-	-	263,660	304,343	152,171	-
	2.5年以上	173,250	52,420	70.00%	88,852	-	-	123,712	212,565	148,795	850
良（Good）	2.5年未満	83,917	25,749	70.00%	53,324	-	-	49,904	103,229	72,260	412
	2.5年以上	47,003	72,360	90.00%	93,596	-	-	7,677	101,274	91,146	810
可（Satisfactory）		40,060	9,603	115.00%	29,790	-	-	17,473	47,263	54,353	1,323
弱い（Weak）		-	-	250.00%	-	-	-	-	-	-	-
デフォルト（Default）		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合計		593,762	233,218	-	306,246	-	-	462,429	768,676	518,728	3,396
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（HVCRE）											
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシート の額	オフ・バランスシート の額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）					信用リスク・アセットの額	期待損失
優（Strong）	2.5年未満	-	-	-						-	-
	2.5年以上	-	-	-						-	-
良（Good）	2.5年未満	-	-	-						-	-
	2.5年以上	-	-	-						-	-
可（Satisfactory）		-	-	-						-	-
弱い（Weak）		-	-	-						-	-
デフォルト（Default）		-	-	-						-	-
合計		-	-	-						-	-
株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー	オン・バランスシート の額	オフ・バランスシート の額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（EAD）					信用リスク・アセットの額	期待損失	
簡易手法－上場株式	448,439	-	300.00%						448,439	1,345,319	
簡易手法－非上場株式	149,949	-	400.00%						149,949	599,799	
内部モデル手法	-	-	-						-	-	
合計	598,389	-	-						598,389	1,945,118	
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー											
連結自己資本規制比率告示第百四十三条第一項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	-	-	100.00%						-	-	

(4) カウンターパーティ信用リスクに関する事項

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	202,876	432,680		1.4	941,435	625,427
2	期待エクスポージャー方式			4,107,057	1.4	5,868,369	1,071,166
3	信用リスク削減手法における簡便手法					-	-
4	信用リスク削減手法における包括的手法					8,669,898	387,755
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						2,084,348

2022年9月末

(単位：百万円)

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		再構築コスト	アドオン	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
1	SA-CCR	248,785	347,694		1.4	884,891	551,314
2	期待エクスポージャー方式			4,140,389	1.4	5,876,141	1,130,000
3	信用リスク削減手法における簡便手法					-	-
4	信用リスク削減手法における包括的手法					8,053,071	323,133
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						2,004,448

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	3,051,573	744,534
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		245,889
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		498,644
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	941,435	382,541
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	3,993,009	1,127,076

2022年9月末

(単位：百万円)

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	3,315,168	735,817
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		189,370
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		546,446
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	884,891	347,373
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	4,200,059	1,083,190

CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー										
項番	業種	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額（信用リスク削減効果勘案後）								
		0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	37	-	-	-	-	-	37
3	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	国際開発銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	8,700	23	-	1,114	-	-	9,838
11	法人等向け	-	-	-	-	-	22,489	-	-	22,489
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13	上記以外	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	合計	-	-	8,737	23	-	23,604	-	-	32,365

2022年9月末

(単位：百万円)

CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー										
項番	業種	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額（信用リスク削減効果勘案後）								
		0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	2,867	-	-	-	-	-	-	-	2,867
3	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	国際開発銀行向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	9,684	192	-	17	-	-	9,894
11	法人等向け	-	-	-	-	-	7,664	-	-	7,664
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13	上記以外	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	合計	2,867	-	9,684	192	-	7,681	-	-	20,425

CCR4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

2023年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

CCR4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	平均PD	取引相手方 の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセット	リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,778,237	0.01%	0.1	43.66%	0.7	41,632	2.34%
2	0.15以上0.25未満	2,817	0.18%	100件未満	45.00%	0.3	637	22.61%
3	0.25以上0.50未満	14,201	0.26%	100件未満	45.00%	0.5	4,422	31.14%
4	0.50以上0.75未満	64	0.55%	100件未満	45.00%	1.0	35	55.27%
5	0.75以上2.50未満	7,433	0.89%	100件未満	45.00%	0.0	4,210	56.64%
6	2.50以上10.00未満	726	3.62%	100件未満	45.00%	1.0	852	117.21%
7	10.00以上100.00未満	3	26.31%	100件未満	45.00%	1.0	8	234.06%
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	1,803,484	0.02%	0.1	43.68%	0.7	51,798	2.87%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	5,167,034	0.05%	0.3	24.41%	0.6	400,997	7.76%
2	0.15以上0.25未満	218,801	0.18%	100件未満	34.03%	1.0	60,850	27.81%
3	0.25以上0.50未満	259,508	0.30%	0.1	20.30%	1.1	53,638	20.66%
4	0.50以上0.75未満	41,891	0.55%	100件未満	36.42%	1.8	28,735	68.59%
5	0.75以上2.50未満	218,216	1.48%	100件未満	11.25%	0.7	49,123	22.51%
6	2.50以上10.00未満	128,165	7.38%	100件未満	4.79%	2.3	21,164	16.51%
7	10.00以上100.00未満	10,693	26.31%	100件未満	7.83%	1.7	4,624	43.24%
8	100.00 (デフォルト)	18	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%
9	小計	6,044,329	0.32%	0.8	23.75%	0.7	619,135	10.24%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	3,622,117	0.05%	5.8	30.89%	0.6	367,145	10.13%
2	0.15以上0.25未満	338,056	0.18%	0.6	44.51%	1.0	115,469	34.15%
3	0.25以上0.50未満	939,490	0.34%	0.4	13.84%	0.3	141,053	15.01%
4	0.50以上0.75未満	1,822,907	0.55%	0.2	3.56%	0.0	97,389	5.34%
5	0.75以上2.50未満	400,884	1.08%	0.3	21.84%	0.6	178,081	44.42%
6	2.50以上10.00未満	209,670	6.54%	0.3	25.07%	0.4	183,670	87.59%
7	10.00以上100.00未満	261,057	26.31%	1.4	20.27%	0.5	305,242	116.92%
8	100.00 (デフォルト)	5,340	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%
9	小計	7,599,524	1.42%	9.3	21.84%	0.5	1,388,051	18.26%
合計 (全てのポートフォリオ)		15,447,338	0.82%	10.3	25.14%	0.6	2,058,985	13.32%

2022年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

CCR4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	平均PD	取引相手方の 数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセット	リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	2,341,977	0.01%	0.1	31.77%	0.3	32,266	1.37%
2	0.15以上0.25未満	3,552	0.18%	100件未満	45.00%	0.5	862	24.28%
3	0.25以上0.50未満	16,642	0.27%	100件未満	45.00%	0.6	5,593	33.60%
4	0.50以上0.75未満	36	0.57%	100件未満	45.00%	1.0	20	56.30%
5	0.75以上2.50未満	6,646	0.95%	100件未満	45.00%	0.0	3,894	58.59%
6	2.50以上10.00未満	-	-	-	-	-	-	-
7	10.00以上100.00未満	795	27.14%	100件未満	45.00%	0.0	1,800	226.23%
8	100.00 (デフォルト)	-	-	-	-	-	-	-
9	小計	2,369,651	0.03%	0.1	31.92%	0.3	44,437	1.87%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	5,343,318	0.04%	0.3	22.30%	0.5	379,190	7.09%
2	0.15以上0.25未満	189,920	0.18%	100件未満	36.24%	1.0	53,614	28.23%
3	0.25以上0.50未満	173,984	0.31%	0.1	24.00%	1.0	42,774	24.58%
4	0.50以上0.75未満	54,088	0.57%	100件未満	15.81%	1.0	17,217	31.83%
5	0.75以上2.50未満	260,476	1.54%	100件未満	6.97%	0.7	33,062	12.69%
6	2.50以上10.00未満	110,595	7.30%	100件未満	6.83%	1.8	25,062	22.66%
7	10.00以上100.00未満	15,419	27.14%	100件未満	25.87%	1.3	21,910	142.09%
8	100.00 (デフォルト)	139	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%
9	小計	6,147,942	0.32%	0.7	21.81%	0.6	572,832	9.31%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	3,019,383	0.05%	4.9	34.93%	0.9	364,515	12.07%
2	0.15以上0.25未満	323,773	0.18%	0.5	44.50%	0.9	109,381	33.78%
3	0.25以上0.50未満	747,950	0.29%	0.4	20.79%	0.5	173,725	23.22%
4	0.50以上0.75未満	1,413,395	0.57%	0.2	7.45%	0.1	159,903	11.31%
5	0.75以上2.50未満	451,237	1.16%	0.3	24.76%	0.8	243,091	53.87%
6	2.50以上10.00未満	167,050	6.63%	0.2	21.96%	0.8	126,984	76.01%
7	10.00以上100.00未満	153,292	27.14%	1.6	22.70%	0.7	199,862	130.38%
8	100.00 (デフォルト)	0	100.00%	100件未満	45.00%	1.0	0	0.00%
9	小計	6,276,083	1.12%	8.4	26.17%	0.7	1,377,463	21.94%
合計 (全てのポートフォリオ)		14,793,677	0.61%	9.4	25.28%	0.6	1,994,733	13.48%

(注)

ハ欄「取引相手方の数」について、100件未満の場合には、概数で記載しております。

CCR5：担保の内訳

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR5：担保の内訳							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金（国内通貨）	-	1,286,420	-	1,884,932	4,071,682	7,692,280
2	現金（外国通貨）	14,050	3,443,096	-	1,975,315	41,542,515	42,218,719
3	国内ソブリン債	164,749	368,533	1,329,076	113,203	7,192,366	4,620,012
4	その他ソブリン債	592,232	528,980	53,468	117,993	37,995,422	31,983,146
5	政府関係機関債	2,315	7,979	0	-	1,070,756	3,774,722
6	社債	212,215	225,681	133,513	30,464	3,606,561	12,205,408
7	株式	107,006	395,644	5,934	473,665	4,091,700	4,871,324
8	その他担保	108	16,348	408	-	7,619	269,303
9	合計	1,092,679	6,272,684	1,522,402	4,595,575	99,578,624	107,634,916

2022年9月末

(単位：百万円)

CCR5：担保の内訳							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金（国内通貨）	-	1,260,556	-	2,054,044	2,657,113	7,189,203
2	現金（外国通貨）	679	3,414,055	-	1,907,540	37,943,936	39,259,521
3	国内ソブリン債	172,750	308,836	1,108,222	66,121	7,069,665	5,529,092
4	その他ソブリン債	566,027	584,756	20,669	61,322	36,735,124	28,207,504
5	政府関係機関債	67	8,313	498	-	1,116,518	3,024,444
6	社債	142,822	211,729	7,276	32,086	3,557,147	12,846,767
7	株式	4,391	527,120	2,380	421,656	3,514,816	4,266,284
8	その他担保	-	18,995	-	-	3,464	49,980
9	合計	886,738	6,334,363	1,139,047	4,542,770	92,597,787	100,372,798

CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
	想定元本		
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	7,631,776	8,120,895
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	6,588,915	6,838,817
3	トータル・リターン・スワップ	1,105,067	623,951
4	クレジットオプション	83,441	50,938
5	その他のクレジット・デリバティブ	-	-
6	想定元本合計	15,409,200	15,634,602
	公正価値		
7	プラスの公正価値 (資産)	192,691	20,896
8	マイナスの公正価値 (負債)	△37,802	△173,156

2022年9月末

(単位：百万円)

CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
	想定元本		
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	8,487,430	8,811,935
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	10,870,577	11,412,538
3	トータル・リターン・スワップ	1,466,948	467,745
4	クレジットオプション	34,012	63,773
5	その他のクレジット・デリバティブ	-	-
6	想定元本合計	20,858,969	20,755,993
	公正価値		
7	プラスの公正価値 (資産)	196,251	20,905
8	マイナスの公正価値 (負債)	△52,498	△171,606

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

(単位：百万円)

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点（2023年6月末）における信用リスク・アセットの額	1,053,146	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	6,504
3		取引相手方の信用力	△14,723
4		モデルの更新（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	—
5		手法及び方針（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	—
6		買収又は売却	—
7		為替の変動	26,239
8		その他	—
9	当四半期末時点（2023年9月末）における信用リスク・アセットの額	1,071,166	

CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー（信用リスク削減手法適用後）	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		222,285
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	5,545,766	110,915
3	（i）派生商品取引（上場以外）	4,121,668	82,433
4	（ii）派生商品取引（上場）	929,649	18,592
5	（iii）レポ形式の取引	494,448	9,888
6	（iv）クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	-	-
7	分別管理されている当初証拠金	-	
8	分別管理されていない当初証拠金	669,058	13,381
9	事前拋出された清算基金	154,481	97,989
10	未拋出の清算基金	-	-
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		210,628
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	144,234	95,281
13	（i）派生商品取引（上場以外）	68,186	67,088
14	（ii）派生商品取引（上場）	7,176	7,048
15	（iii）レポ形式の取引	68,871	21,145
16	（iv）クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	-	-
17	分別管理されている当初証拠金	-	
18	分別管理されていない当初証拠金	90,611	90,588
19	事前拋出された清算基金	1,980	24,759
20	未拋出の清算基金	-	-

2022年9月末

(単位：百万円)

CCR 8：中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー（信用リスク削減手法適用後）	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		172,363
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	5,035,377	100,707
3	（i）派生商品取引（上場以外）	3,773,718	75,474
4	（ii）派生商品取引（上場）	845,575	16,911
5	（iii）レポ形式の取引	416,083	8,321
6	（iv）クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	-	-
7	分別管理されている当初証拠金	-	
8	分別管理されていない当初証拠金	496,631	9,932
9	事前拋出された清算基金	155,782	61,723
10	未拋出の清算基金	-	-
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		222,475
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	138,960	102,881
13	（i）派生商品取引（上場以外）	70,915	63,371
14	（ii）派生商品取引（上場）	19,939	19,662
15	（iii）レポ形式の取引	48,105	19,847
16	（iv）クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合のネットting・セット	-	-
17	分別管理されている当初証拠金	-	
18	分別管理されていない当初証拠金	90,934	90,908
19	事前拋出された清算基金	2,294	28,684
20	未拋出の清算基金	-	-

(5) 証券化エクスポージャーに関する事項

SEC 1：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーについては、該当ございません。

SEC 2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

2023年9月末

（単位：百万円）

SEC 2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）										
項番	原資産の種類	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
		資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール（合計）	—	—	—	71,119	—	71,119	96,580	—	96,580
2	担保付住宅ローン	—	—	—	71,119	—	71,119	92,612	—	92,612
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	1,894	—	1,894
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	2,074	—	2,074
6	ホールセール（合計）	—	—	—	—	—	—	41,858	—	41,858
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	41,540	—	41,540
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	319	—	319
9	リース債権及び売掛債権	416	—	—	—	—	—	623	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

2022年9月末

（単位：百万円）

SEC 2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）										
項番	原資産の種類	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
		資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計	資産譲渡型証券化取引	合成型証券化取引	小計
1	リテール（合計）	—	—	—	58,172	—	58,172	74,191	—	74,191
2	担保付住宅ローン	—	—	—	58,172	—	58,172	70,942	—	70,942
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	3,239	—	3,239
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	9	—	9
6	ホールセール（合計）	—	—	—	—	—	—	36,304	87	36,391
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	35,731	—	35,731
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	500	87	587
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	71	—	71
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

SEC 3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）

信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーについては、該当ございません。

SEC 4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）

信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーについては、該当ございません。

(6) マーケット・リスクに関する事項

MR 1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位：百万円)

MR 1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額			
項番		リスク・アセット (リスク相当額を8パーセントで除して得た額)	
		2023年9月末	2022年9月末
1	金利リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額	-	-
2	株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額	-	-
3	外国為替リスクの額	-	-
4	コモディティ・リスクの額	-	-
	オプション取引		
5	簡便法により算出した額	-	-
6	デルタ・プラス法により算出した額	-	-
7	シナリオ法により算出した額	-	-
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	1, 213, 645	1, 217, 701
9	合計	1, 213, 645	1, 217, 701

MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

(単位：百万円)

MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュエーション・リスク	ストレステスト・バリュエーション・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計	
1a	前四半期末（2023年6月末）におけるリスク・アセット	939, 471	1, 821, 239	2, 242, 127	252, 946		5, 255, 785	
1b	前四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	1.08	0.92	1.00	1.00		0.98	
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	866, 719	1, 963, 349	2, 242, 127	252, 946		5, 325, 142	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	82, 091	△298, 477	5, 171	13, 487		△197, 727
3		モデルの更新又は変更	△7, 449	△19, 986	-	-		△27, 436
4		手法及び方針	-	-	-	-		-
5		買収及び売却	-	-	-	-		-
6		為替の変動	26, 997	47, 174	64, 451	7, 641		146, 264
7		その他	-	-	-	-		-
8a		当四半期末（2023年9月末）の算出基準日における内部モデル方式の算出額	968, 358	1, 692, 059	2, 311, 749	274, 075		5, 246, 243
8b	当四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	1.05	1.03	1.00	1.00		1.01	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	1, 020, 390	1, 754, 636	2, 311, 749	274, 075		5, 360, 851	

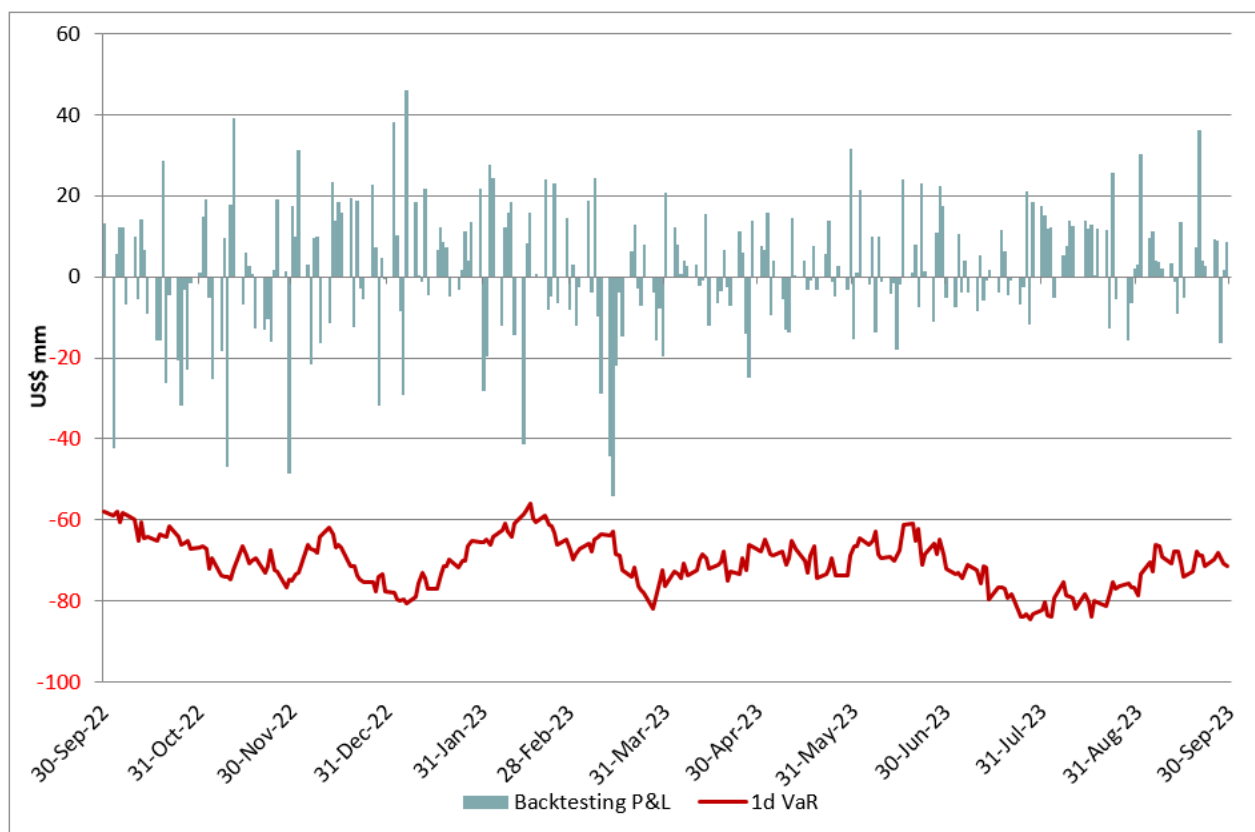
MR 3 : 内部モデル方式の状況 (マーケット・リスク)

(単位 : 百万円)

MR 3 : 内部モデル方式の状況 (マーケット・リスク)			
項番		2023年9月末	2022年9月末
バリュー・アット・リスク (保有期間10営業日、片側信頼区間99%)			
1	最大値	35,073	35,517
2	平均値	26,355	24,244
3	最小値	20,836	17,302
4	期末	25,823	31,178
ストレス・バリュー・アット・リスク (保有期間10営業日、片側信頼区間99%)			
5	最大値	73,893	74,141
6	平均値	48,283	44,987
7	最小値	28,394	23,950
8	期末	45,122	74,141
追加的リスクの額 (片側信頼区間99.9%)			
9	最大値	191,681	169,984
10	平均値	174,850	149,576
11	最小値	144,478	140,160
12	期末	184,940	148,228
包括的リスクの額 (片側信頼区間99.9%)			
13	最大値	22,187	13,826
14	平均値	19,810	12,236
15	最小値	17,536	9,999
16	期末	21,926	12,756
17	フロア (修正標準的方式)	2,332	12,756

MR 4 : 内部モデル方式のバック・テストの結果

2023年9月30日以前の12か月において、野村グループの1日分の損失が、(現在の規制資本計算の要件である)信頼水準99%VaRを超過した日はございませんでした。



(7) 非トレーディング勘定における金利リスクに関する事項

① 金利ショックに対する経済的価値の減少額として計測されるもの (Δ EVE)

第三の柱に関する告示の定めるパラレルシフト・シナリオに基づき推計される Δ EVEは、2023年9月期末において弊社グループのTier1の額の1%未満であるため、重要性が低いものと考えられることから、詳細数値の開示を省略しております。

② 金利ショックに対する金利収益の減少額として計測されるもの (Δ NII)

野村の資産負債構成における Δ NIIは、非トレーディング勘定において貸出金と預金が重要な位置を占める商業銀行の一般的なビジネス・モデルにおける Δ NIIと比較して重要性が低く、かつ比較可能性に欠けるものであることから、開示は省略しております。

(8) マクロプルーデンス監督措置に関する事項

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

(単位：百万円, %)

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
オーストラリア	1.00%	11,171		
フランス	0.50%	54,223		
ドイツ	0.75%	28,717		
香港	1.00%	28,142		
ルクセンブルク	0.50%	124,122		
オランダ	1.00%	43,414		
スウェーデン	2.00%	3,142		
英国	2.00%	725,348		
小計		1,018,282		
合計		6,426,078	0.25%	1,925,863

(注)

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

第4章 自己資本調達手段に関する契約内容

1. 野村ホールディングス株式会社 普通株式 自己資本調達手段（普通株式）

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要		
1	発行者	野村ホールディングス株式会社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	JP3762600009
3	準拠法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	-
	規制上の取扱い(2)	-
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1 資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	-
	連結自己資本規制比率	594,493百万円
9	額面総額(5)	-
10	表示される科目の区分(6)	株主資本
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日(7)	-
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-
	剰余金の配当又は利息の支払	-
17	配当率又は利率の種別(11)	-
18	配当率又は利率(12)	-
19	配当等停止条項の有無(13)	-
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	-
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	-
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	-
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無

24	転換が生じる場合(15)	-
25	転換の範囲(16)	-
26	転換の比率(17)	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-
33	元本回復特約の有無(22)	-
34	その概要	-
34a	劣後性の手段(23)	-
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無(25)	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-

2. 野村ホールディングス株式会社 第2回任意償還条項付無担保永久社債（債務免除特約及び劣後特約付）
自己資本調達手段（劣後債）

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要		
1	発行者	野村ホールディングス株式会社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	JP376260AL69
3	準拠法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	-
	規制上の取扱い(2)	
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-
7	銘柄、名称又は種類	第2回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約及び劣後特約付)
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	
	連結自己資本規制比率	150,000百万円
9	額面総額(5)	150,000百万円
10	表示される科目の区分(6)	負債
	連結貸借対照表	負債
11	発行日(7)	2020年6月18日
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	初回償還可能日：2025年7月18日 償還金額：各社債の金額100円につき100円
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	2025年7月18日以降の各利払日（本社債の元金につき損失吸収事由に係る債務免除がなされている場合を除く。）、又は税務事由若しくは資本事由（発行者が金融庁その他の監督当局と協議した結果、金融庁その他の監督当局が定める自己資本規制比率基準に照らして、本社債が発行者のその他Tier1資本として扱われなくなるおそれが軽微でないと判断した場合）が発生した場合において、任意償還可能
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	2025年7月18日以降の各利払日
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別(11)	固定から変動

18	配当率又は利率(12)	2020年6月19日から2025年7月18日まで： 年1.80パーセント 2025年7月18日の翌日以降： 6か月物ユーロ円LIBOR + 1.84パーセント
19	配当等停止条項の有無(13)	有
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合(15)	-
25	転換の範囲(16)	-
26	転換の比率(17)	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	有
31	元本の削減が生じる場合(20)	(i) 損失吸収事由：発行者が報告又は公表した連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 (ii) 実質破綻事由：内閣総理大臣が、発行者について、預金保険法に定める特定第二号措置を講ずる必要がある旨の特定認定を行った場合 (iii) 倒産手続開始事由：発行者につき倒産手続開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲(21)	全部削減または一部削減
33	元本回復特約の有無(22)	有
34	その概要	元金回復がなされた後においても、十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払債務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
34a	劣後性の手段(23)	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	劣後債務
36	非充足資本等要件の有無(25)	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-

3. 野村ホールディングス株式会社 第3回任意償還条項付無担保永久社債（債務免除特約及び劣後特約付）
自己資本調達手段（劣後債）

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要		
1	発行者	野村ホールディングス株式会社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	JP376260AM68
3	準拠法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	-
	規制上の取扱い(2)	
4	2023年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額
5	2023年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-
7	銘柄、名称又は種類	第3回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約及び劣後特約付)
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	
	連結自己資本規制比率	225,000百万円
9	額面総額(5)	225,000百万円
10	表示される科目の区分(6)	負債
	連結貸借対照表	負債
11	発行日(7)	2021年6月15日
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	初回償還可能日：2026年7月15日 償還金額：各社債の金額100円につき100円
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	2026年7月15日及びその5年後毎の応当日に到来する各利率改定日（本社債の元金につき損失吸収事由に係る債務免除がなされている場合を除く。）、又は税務事由若しくは資本事由（発行者が金融庁その他の監督当局と協議した結果、金融庁その他の監督当局が定める自己資本規制比率基準に照らして、本社債が発行者のその他Tier1資本として扱われなくなるおそれが軽微でないと判断した場合）が発生した場合において、任意償還可能
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	2026年7月15日から5年後毎の応当日に到来する各利率改定日
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別(11)	固定から変動

18	配当率又は利率(12)	2021年6月16日から2026年7月15日まで： 年1.30パーセント 2026年7月15日の翌日以降： 5年国債金利 + 1.388パーセント
19	配当等停止条項の有無(13)	有
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合(15)	-
25	転換の範囲(16)	-
26	転換の比率(17)	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	有
31	元本の削減が生じる場合(20)	(i) 損失吸収事由：発行者が報告又は公表した連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 (ii) 実質破綻事由：内閣総理大臣が、発行者について、預金保険法に定める特定第二号措置を講ずる必要がある旨の特定認定を行った場合 (iii) 倒産手続開始事由：発行者につき倒産手続開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲(21)	全部削減または一部削減
33	元本回復特約の有無(22)	有
34	その概要	元金回復がなされた後においても、十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払債務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
34a	劣後性の手段(23)	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	劣後債務
36	非充足資本等要件の有無(25)	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-

4. 野村ホールディングス株式会社 第2回無担保社債（劣後特約付）

自己資本調達手段（劣後債）

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要		
1	発行者	野村ホールディングス株式会社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	JP376260AAB8
3	準拠法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	-
	規制上の取扱い(2)	
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	無
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-
7	銘柄、名称又は種類	野村ホールディングス株式会社第2回無担保社債（劣後特約付）
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	
	連結自己資本規制比率	-
9	額面総額(5)	39,500百万円
10	表示される科目の区分(6)	負債
	連結貸借対照表	負債
11	発行日(7)	2010年11月26日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2025年11月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別(11)	固定
18	配当率又は利率(12)	年2.649パーセント
19	配当等停止条項の有無(13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	裁量なし
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無

23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合(15)	-
25	転換の範囲(16)	-
26	転換の比率(17)	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-
33	元本回復特約の有無(22)	-
34	その概要	-
34a	劣後性の手段(23)	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	一般債務
36	非充足資本等要件の有無(25)	有
37	非充足資本等要件の内容(25)	実質破綻認定時損失吸収条項

5. 非支配株主持分

自己資本調達手段（非支配株主持分）

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要		
1	発行者	株式会社杉村倉庫、Nomura Asset Management Taiwan Ltd. 他
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-
3	準拠法	日本法、香港法 他
3 a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	-
	規制上の取扱い(2)	
4	2023年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
5	2023年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2 資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	
	連結自己資本規制比率	2,092百万円
9	額面総額(5)	-
10	表示される科目の区分(6)	非支配株主持分
	連結貸借対照表	非支配株主持分
11	発行日(7)	-
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別(11)	-
18	配当率又は利率(12)	-
19	配当等停止条項の有無(13)	-
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	-
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	-
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	-
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無

24	転換が生じる場合(15)	-
25	転換の範囲(16)	-
26	転換の比率(17)	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-
33	元本回復特約の有無(22)	-
34	その概要	-
34a	劣後性の手段(23)	-
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無(25)	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-

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

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2025年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2030年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2025年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:US65535HAP47	ISIN:US65535HAQ20	ISIN:US65535HAR03
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	契約	契約
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 1,500	USD 1,500	USD 1,500
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2020年1月16日	2020年1月16日	2020年7月13日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2025年1月16日	2030年1月16日	2025年7月16日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	2.648%	3.103%	1.851%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2030年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2026年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2028年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:US65535HAS85	ISIN:US65535HAW97	ISIN: US65535HAY53
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	契約	契約
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 1,000	USD 1,250	USD 1,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2020年7月13日	2021年7月12日	2021年7月12日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2030年7月16日	2026年7月14日	2028年7月14日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	2.679%	1.653%	2.172%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2031年償還）	野村ホールディングス株式会社第3回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2027年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN: US65535HAX70	ISIN: JP376260AM92	ISIN: US65535HAZ29
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	日本法	米国ニューヨーク州法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	無	契約
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 1,000	JPY 120,000	USD 1,250
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2021年7月12日	2021年9月6日	2022年1月11日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2031年7月14日	2026年9月4日	2027年1月22日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	2.608%	0.28%	2.329%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2029年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2032年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2025年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:US65535HBB42	ISIN:US65535HBA68	ISIN:US65535HBE80
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	契約	契約
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 500	USD 750	USD 800
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2022年1月11日	2022年1月11日	2022年7月6日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2029年1月22日	2032年1月22日	2025年7月3日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	2.71%	2.999%	5.099%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2027年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2029年償還）	野村ホールディングス株式会社第4回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN: US65535HBF55	ISIN: US65535HBC25	ISIN: JP376260AN91
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	契約	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 500	USD 600	JPY 42,500
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2022年7月6日	2022年7月6日	2022年9月5日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2027年7月6日	2029年7月6日	2025年9月5日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	5.386%	5.605%	0.6%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社第5回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	野村ホールディングス株式会社第6回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2026年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN:JP376260BN90	ISIN:JP376260CN99	ISIN:US65535HBG39
3	準拠法	日本法	日本法	米国ニューヨーク州法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	契約
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	JPY 16,500	JPY 4,500	USD 600
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2022年9月5日	2022年9月5日	2023年1月11日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2027年9月3日	2032年9月3日	2026年1月9日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	0.75%	0.9%	5.709%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2028年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2033年償還）	野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2028年償還）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN: US65535HBH12	ISIN: US65535HBK41	ISIN:US65535HBM07
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法	米国ニューヨーク州法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	契約	契約
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 550	USD 750	USD 900
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2023年1月11日	2023年1月11日	2023年7月12日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2028年1月18日	2033年1月18日	2028年7月12日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	5.842%	6.181%	6.07%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		野村ホールディングス株式会社米ドル建固定利付普通社債（2033年償還）	第7回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	第8回無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	ISIN: US65535HBP38	ISIN: JP376260AP99	ISIN: JP376260BP98
3	準拠法	米国ニューヨーク州法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	契約	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債	TLAC適格シニア社債
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 600	JPY 30,000	JPY 20,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2023年7月12日	2023年9月6日	2023年9月6日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2033年7月12日	2026年9月4日	2028年9月6日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	固定	固定	固定
18	配当率又は利率(12)	6.087%	0.68%	0.959%
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 210	USD 45	USD 50
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2018年8月2日	2018年9月26日	2018年9月28日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2025年8月4日	2025年9月26日	2025年9月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2019年11月5日、全額	2019年12月26日、全額	2019年12月30日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 30	USD 50	JPY 5,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2018年11月30日	2018年12月21日	2019年1月7日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2025年11月28日	2025年12月22日	2029年1月9日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年2月28日、全額	2020年3月23日、全額	2020年4月7日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 18	USD 20	JPY 5,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年1月11日	2019年1月28日	2019年2月12日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年1月13日	2026年1月28日	2029年2月13日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年4月13日、全額	2020年4月28日、全額	2020年5月12日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 28	JPY 5,000	USD 82
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年2月22日	2019年3月27日	2019年3月29日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2026年2月24日	2029年3月27日	2026年3月31日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年5月22日、全額	2020年6月29日、全額	2020年6月30日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 100	USD 30	USD 30
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2019年3月29日	2019年7月12日	2019年11月15日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2029年3月29日	2026年7月15日	2026年11月16日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2020年6月29日、全額	2020年7月15日、全額	2021年2月15日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	固定	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 46	USD 30	USD 47
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2020年3月27日	2020年9月24日	2020年9月28日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2025年3月27日	2027年9月24日	2025年9月29日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2021年6月28日、全額	2022年3月24日、全額	2021年12月28日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	固定	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 50	USD 83	JPY 5,000
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2021年3月26日	2021年5月27日	2022年3月25日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2028年3月27日	2028年5月31日	2032年3月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2022年6月27日、全額	2022年8月31日、全額	2023年6月26日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	固定
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 30	USD 50	USD 70
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2022年3月25日	2022年3月31日	2022年5月18日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2032年3月25日	2029年3月30日	2032年5月18日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2023年6月26日、全額	2023年6月30日、全額	2023年8月18日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 50	JPY 2,000	USD 50
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2022年9月12日	2022年10月31日	2022年11月30日
12	償還期限の有無	有	有	有g
13	その日付	2027年9月12日	2027年10月29日	2027年11月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2023年12月12日、全額	2024年1月31日、全額	2024年2月29日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-	-	-
1	発行者	野村ホールディングス	野村ホールディングス	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-	-	-
3	準拠法	日本法	日本法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無	無	無
	規制上の取扱い(2)			
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-	-	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-	-	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)			
	連結自己資本規制比率	-	-	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 20	USD 45	USD 46
10	表示される科目の区分(6)			
	連結貸借対照表	負債	負債	負債
11	発行日(7)	2022年12月28日	2023年4月11日	2023年6月28日
12	償還期限の有無	有	有	有
13	その日付	2027年12月28日	2028年4月11日	2028年6月28日
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2024年3月28日、全額	2024年7月11日、全額	2024年9月30日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無	無	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-	-
26	転換の比率(17)	-	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-	-
34	その概要	-	-	-
34a	劣後性的手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし	該当なし	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無	無	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-	-	-

CCA：自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要（その他外部TLAC調達手段の概要）		-
1	発行者	野村ホールディングス
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	-
3	準拠法	日本法
3a	外国法令に準拠する手段（その他外部TLAC 調達手段に限る。）(1)	無
	規制上の取扱い(2)	
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	-
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	-
7	銘柄、名称又は種類	TLAC適格シニアローン
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	
	連結自己資本規制比率	-
9	額面総額(5)（単位：百万通貨単位）	USD 50
10	表示される科目の区分(6)	
	連結貸借対照表	負債
11	発行日(7)	2023年9月29日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2033年9月29日
14	償還等を可能とする特約の有無	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2025年9月29日、全額
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別(11)	固定
18	配当率又は利率(12)	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	無
21	ステップ・アップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合(15)	-
25	転換の範囲(16)	-
26	転換の比率(17)	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-
33	元本回復特約の有無(22)	-
34	その概要	-
34a	劣後性の手段(23)	劣後要件の例外としての構造劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類(24)	該当なし
36	非充足資本等要件の有無(25)	無
37	非充足資本等要件の内容(25)	-

(注)

配当率又は利率を一般に公表していない円建て資本調達手段について、基準日時点の加重平均金利は、0.378%(小数点第4位四捨五入)です。
配当率又は利率を一般に公表していないドル建て資本調達手段について、基準日時点の加重平均金利は、6.832%(小数点第4位四捨五入)です。
LIBOR (London Interbank Offered Rate) の公表停止に伴いSOFR (Secured Overnight Financing Rate) を参照する場合は、基準日時点の0/Nの金利を用いて算出しております。

第6章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2023年9月末	2023年6月末	2022年9月末	
オン・バランス資産の額(1)						
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	29,067,981	29,162,882	26,681,491	
	1 a	1	連結貸借対照表における総資産の額	53,020,162	50,510,956	50,093,517
	1 b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)(注1)	334,986	323,193	314,408
	1 c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子法人の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	—	—	—
	1 d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	23,617,195	21,024,880	23,097,617
2		7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	218,167	204,654	142,701
3			オン・バランス資産の額(イ)	28,849,813	28,958,227	26,538,790
デリバティブ取引等に関する額(2)						
4			デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	3,170,791	2,863,451	3,427,301
5			デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	5,865,673	5,560,530	5,069,839
6			連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	2,058,058	1,804,406	2,025,580
7			デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	1,967,150	1,776,881	2,091,403
8			清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)			
9			クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	16,853,088	15,398,075	20,769,703
10			クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	15,040,691	13,715,852	19,317,351
11	4		デリバティブ取引等に関する額(ロ)	10,939,769	10,133,730	9,883,670

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2023年9月末	2023年6月末	2022年9月末
レポ取引等に関する額(3)					
12		レポ取引等に関する資産の額	44,788,586	42,910,618	43,244,813
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額 (△)	23,018,724	23,765,512	22,404,113
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リ スクのエクスポージャーの額	1,739,729	1,554,601	1,447,686
15		代理取引のエクスポージャーの額			
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	23,509,591	20,699,707	22,288,385
オフ・バランス取引に関する額(4)					
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	3,255,859	3,305,785	3,066,652
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャー の額への変換調整の額(△)	1,271,065	1,262,343	1,199,872
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	1,984,794	2,043,442	1,866,779
連結レバレッジ比率(5)					
20		資本の額 (ホ)	3,382,441	3,347,011	3,282,893
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	65,283,968	61,835,108	60,577,625
22		連結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ))	5.18%	5.41%	5.41%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)					
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	65,283,968	61,835,108	60,577,625
		日本銀行に対する預け金の額	1,795,129	1,982,284	1,438,462
		日本銀行に対する預け金を算入する 場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	67,079,098	63,817,393	62,016,088
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連 結レバレッジ比率 ((ホ) / (ヘ'))	5.04%	5.24%	5.29%

(注)

「最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準の補完的指標として定めるレバレッジに係る健全性を判断するための基準」(平成31年金融庁告示13号)第3条第3項に基づき、連結保険子法人等について、連結レバレッジ比率算出において、非連結子会社としての取り扱いをしております。

第7章 TLAC規制

(単位：百万円、%)

TLAC 1 : TLACの構成			
国際様式の該当番号	項目	イ	ロ
		2023年9月末	2022年9月末
想定される処理方針について(1)			
当グループについて想定されている望ましい処理方針はSPE (Single Point of Entry) アプローチです。具体的には、主要子会社である野村証券、野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス又はNomura Europe Holdings PLCに財務上の危機が生じた場合、関連当局のイニシアチブの下、持株会社である野村ホールディングスが損失の集約先となり法的破産手続の下で処理される一方、健全性を回復した主要子会社は預金保険機構が出資する承継持株会社の傘下に移転した上で通常通り営業を続けることが想定されます。			
自己資本比率規制上の外部TLAC(2)			
1	普通株式等Tier 1 資本の額 (イ)	3,005,748	2,906,132
2	TLAC調整項目適用前のその他Tier 1 資本の額 (ロ)	376,693	376,761
3	子会社発行のTLAC非適格その他Tier 1 資本の額 (ハ)	-	-
4	その他のその他Tier 1 資本に係る調整項目 (ニ)	1,693	1,861
5	外部TLAC適格のその他Tier 1 資本の額 ((ロ) - (ハ) - (ニ)) (ホ)	375,000	374,900
6	TLAC調整項目適用前のTier 2 資本の額 (ヘ)	398	437
7	残存期間が1年以上5年以下のTier 2 資本のうち、自己資本比率の算定上控除されている額 (ト)	-	-
8	子会社発行のTLAC非適格Tier 2 資本の額 (チ)	-	-
9	その他のTier 2 資本に係る調整項目 (リ)	398	437
10	外部TLAC適格のTier 2 資本の額 ((ヘ) - (ト) - (チ) - (リ)) (ヌ)	-	-
11	自己資本比率規制上の外部TLACの額 ((イ) + (ホ) + (ヌ)) (ル)	3,380,748	3,281,032
自己資本比率規制外の外部TLAC(3)			
12	その他外部TLACの額 (ヲ)	2,927,149	2,377,377
13	特例外部TLAC調達手段 (=劣後性要件を除く全ての外部TLAC適格要件を満たすもの) の総額		
14	特例外部TLAC調達手段のうち、外部TLACへの算入が認められている額		
15	TLAC完全適用以前に資金調達ビークルによって発行された外部TLAC		
16	資本再構築のための事前のコミットメント相当額 (ワ)	455,305	429,245
17	調整項目適用前の自己資本比率規制外の外部TLACの額 ((ヲ) + (ワ)) (カ)	3,382,454	2,806,623
自己資本比率規制外の外部TLAC (調整項目) (4)			
18	外部TLACの額 (調整前) ((ル) + (カ)) (ヨ)	6,763,203	6,087,655
19	破綻処理グループ間のエクスポージャー (タ)	-	-
20	自己保有のその他TLAC負債の額 (レ)	6,726	64
21	その他調整項目 (ソ)	-	-

(単位：百万円、%)

国際様式 の該 当番号	項目	イ	ロ
		2023年9月末	2022年9月末
22	外部TLACの額（調整後）（(ヨ) - (タ) - (レ) - (ソ)）（ツ）	6,756,476	6,087,591
リスク・アセットの額及び総エクスポージャー(5)			
23	リスク・アセットの額（ネ）	18,212,210	17,169,832
24	総エクスポージャーの額（ナ）	65,283,968	60,577,625
外部TLAC比率及び資本バッファー(6)			
25	資本バッファー勘案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率（(ツ) / (ネ)）	37.09%	35.45%
25a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	33.84%	32.44%
26	総エクスポージャーベース外部TLAC比率（(ツ) / (ナ)）	10.34%	10.04%
27	連結資本バッファー比率	10.57%	11.12%
28	最低連結資本バッファー比率	3.25%	3.01%
29	うち、資本保全バッファー比率	2.50%	2.50%
30	うち、カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.25%	0.01%
31	うち、G-SIB/D-SIBバッファー比率	0.50%	0.50%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーベース外部TLAC比率(7)			
	総エクスポージャーの額（ナ）	65,283,968	60,577,625
	日本銀行に対する預け金の額	1,795,129	1,438,462
	日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額（ナ'）	67,079,098	62,016,088
	日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーベース外部TLAC比率（(ツ) / (ナ'））	10.07%	9.81%

2023年9月末

(単位：百万円)

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

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

2023年9月末

(単位：百万円)

TLAC 2：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）									
野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス（単体）									
国際様式 の該当 番号	項目	債務者順位						合計	
		1		2		3			
		最劣後				最優先			
1	破綻処理対象法人が債権者か否か	✓	－	✓	－	✓	－		
2	債権者順位に関する説明	普通株式		長期劣後債務・ 短期劣後債務		その他内部TLAC 調達手段			
3	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法 勘案後）（イ）	353,500	－	306,000	－	－	－	659,500	
4	うち除外債務（ロ）	－	－	－	－	－	－	－	
5	資本及び負債の合計（除外債務控除後） （（イ）－（ロ））	353,500	－	306,000	－	－	－	659,500	
6	うち内部TLAC適格のもの	353,500	－	306,000	－	－	－	659,500	
7	残存 期間	1年以上2年未満		－	－	－	－	－	
8		2年以上5年未満		－	－	－	－	－	
9		5年以上10年未満		－	－	306,000	－	－	306,000
10		10年以上（永久債を除く）		－	－	－	－	－	－
11		満期がないもの（永久債を含む）		353,500	－	－	－	－	353,500

TLAC 2：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）									
野村ファイナンシャル・プロダクツ・サービス（単体）									
国際様式 の該当 番号	項目	債務者順位						合計	
		1 最劣後		2		3 最優先			
1	破綻処理対象法人が債権者か否か	✓	-	✓	-	✓	-		
2	債権者順位に関する説明	普通株式		長期劣後債務・ 短期劣後債務		その他内部TLAC 調達手段			
3	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法 勘案後）（イ）	353,500	-	298,902	-	-	-	652,402	
4	うち除外債務（ロ）	-	-	-	-	-	-	-	
5	資本及び負債の合計（除外債務控除後） （（イ）－（ロ））	353,500	-	298,902	-	-	-	652,402	
6	うち内部TLAC適格のもの	353,500	-	298,902	-	-	-	652,402	
7	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	223,045	-	-	-	223,045
8		2年以上5年未満	-	-	-	-	-	-	-
9		5年以上10年未満	-	-	75,857	-	-	-	75,857
10		10年以上（永久債を除く）	-	-	-	-	-	-	-
11		満期がないもの（永久債を含む）	353,500	-	-	-	-	-	353,500

2023年9月末

(単位：百万円)

TLAC 2 : 内部TLAC等の債権者順位 (主要子会社別)									
Nomura Europe Holdings PLC (サブ連結)									
国際様式 の該当 番号	項目	債務者順位						合計	
		1		2		3			
		最劣後				最優先			
1	破綻処理対象法人が債権者か否か	✓	-	✓	-	✓	-		
2	債権者順位に関する説明	普通株式		Tier2資本 調達手段		その他内部TLAC 調達手段			
3	資本及び負債の合計 (信用リスク削減手法 勘案後) (イ)	506,972	-	322,218	-	179,010	-	1,008,200	
4	うち除外債務 (ロ)	-	-	-	-	-	-	-	
5	資本及び負債の合計 (除外債務控除後) ((イ) - (ロ))	506,972	-	322,218	-	179,010	-	1,008,200	
6	うち内部TLAC適格のもの	506,972	-	322,218	-	179,010	-	1,008,200	
7	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	-	179,010	-	179,010	
8		2年以上5年未満	-	-	-	-	-	-	
9		5年以上10年未満	-	-	322,218	-	-	-	322,218
10		10年以上 (永久債を除く)	-	-	-	-	-	-	-
11		満期がないもの (永久債を含む)	506,972	-	-	-	-	-	506,972

2022年9月末

(単位：百万円)

TLAC 2 : 内部TLAC等の債権者順位 (主要子会社別)									
Nomura Europe Holdings PLC (サブ連結)									
国際様式 の該 当番号	項目	債務者順位						合計	
		1		2		3			
		最劣後				最優先			
1	破綻処理対象法人が債権者か否か	✓	-	✓	-	✓	-		
2	債権者順位に関する説明	普通株式		Tier2資本 調達手段		その他内部TLAC 調達手段			
3	資本及び負債の合計 (信用リスク削減手法 勘案後) (イ)	491,050	-	312,098	-	173,388	-	976,537	
4	うち除外債務 (ロ)	-	-	-	-	-	-	-	
5	資本及び負債の合計 (除外債務控除後) ((イ) - (ロ))	491,050	-	312,098	-	173,388	-	976,537	
6	うち内部TLAC適格のもの	491,050	-	312,098	-	173,388	-	976,537	
7	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	-	173,388	-	173,388	
8		2年以上5年未満	-	-	-	-	-	-	
9		5年以上10年未満	491,050	-	312,098	-	-	-	803,149
10		10年以上 (永久債を除く)	-	-	-	-	-	-	-
11		満期がないもの (永久債を含む)	491,050	-	-	-	-	-	491,050

TLAC 2：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）										
Nomura International PLC（単体）										
国際様式 の該当 番号	項目	債務者順位								合計
		1		2		3		4		
		最劣後						最優先		
1	破綻処理対象法人が債権者か 否か	✓	-	✓	-	✓	-	✓	-	
2	債権者順位に関する説明	普通株式		Tier2資本 調達手段		長期劣後債務・ 短期劣後債務		その他内部TLAC 調達手段		
3	資本及び負債の合計（信用リ スク削減手法勘案後）（イ）	487,609	-	187,960	-	365,478	-	-	-	1,041,048
4	うち除外債務（ロ）	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	資本及び負債の合計（除外債 務控除後） （（イ）－（ロ））	487,609	-	187,960	-	365,478	-	-	-	1,041,048
6	うち内部TLAC適格のもの	487,609	-	187,960	-	365,478	-	-	-	1,041,048
7	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	-	365,478	-	-	-	365,478
8		2年以上5年未満	-	-	-	-	-	-	-	-
9		5年以上10年未満	-	-	187,960	-	-	-	-	187,960
10		10年以上 （永久債を除く）	-	-	-	-	-	-	-	-
11		満期がないもの （永久債を含む）	487,609	-	-	-	-	-	-	-

2022年9月末

(単位：百万円)

TLAC 2：内部TLAC等の債権者順位（主要子会社別）										
Nomura International PLC（単体）										
国際様式 の該 当番号	項目	債務者順位								合計
		1 最劣後		2		3		4 最優先		
1	破綻処理対象法人が債権者か 否か	✓	-	✓	-	✓	-	✓	-	
2	債権者順位に関する説明	普通株式		Tier2資本 調達手段		長期劣後債務・ 短期劣後債務		その他内部TLAC 調達手段		
3	資本及び負債の合計（信用リ スク削減手法勘案後）（イ）	472,295	-	182,057	-	354,000	-	-	-	1,008,353
4	うち除外債務（ロ）	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	資本及び負債の合計（除外債 務控除後） （（イ）－（ロ））	472,295	-	182,057	-	354,000	-	-	-	1,008,353
6	うち内部TLAC適格のもの	472,295	-	182,057	-	354,000	-	-	-	1,008,353
7	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	-	354,000	-	-	-	354,000
8		2年以上5年未満	-	-	-	-	-	-	-	-
9		5年以上10年未満	-	-	182,057	-	-	-	-	182,057
10		10年以上 （永久債を除く）	-	-	-	-	-	-	-	-
11		満期がないもの （永久債を含む）	472,295	-	-	-	-	-	-	-

(注)

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

2023年9月末

(単位：百万円)

TLAC 3：外部TLAC等の債権者順位						
野村ホールディングス（単体）		債務者順位				合計
国際様式 の該 当番号	項目	1	2	3	4	
		最劣後			最優先	
1	債権者の優先順位に関する説明	普通株式	その他 Tier1資本 調達手段	Tier2資本 調達手段	無担保シニア債	
2	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）	1,154,169	375,000	-	4,139,860	5,669,029
3	うち除外債務（ロ）	-	-	-	37,805	37,805
4	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））	1,154,169	375,000	-	4,102,054	5,631,223
5	うち外部TLAC適格のもの	1,154,169	375,000	-	2,927,149	4,456,318
6	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	661,277	661,277
7		2年以上5年未満	-	-	1,197,146	1,197,146
8		5年以上10年未満	-	-	1,068,725	1,068,725
9		10年以上（永久債を除く）	-	-	-	-
10		満期がないもの（永久債を含む）	1,154,169	375,000	-	-

2022年9月末

(単位：百万円)

TLAC 3：外部TLAC等の債権者順位							
野村ホールディングス（単体）		債務者順位				合計	
国際様式 の該 当番号	項目	1	2	3	4		
		最劣後			最優先		
1	債権者の優先順位に関する説明	普通株式	その他 Tier1資本 調達手段	Tier2資本 調達手段	無担保シニア債		
2	資本及び負債の合計（信用リスク削減手法勘案後）（イ）	1,154,169	374,900	-	4,090,048	5,619,117	
3	うち除外債務（ロ）	-	-	-	27,575	27,575	
4	資本及び負債の合計（除外債務控除後）（（イ）－（ロ））	1,154,169	374,900	-	4,062,472	5,591,542	
5	うち外部TLAC適格のもの	1,154,169	374,900	-	2,377,377	3,906,446	
6	残存 期間	1年以上2年未満	-	-	-	107,844	107,844
7		2年以上5年未満	-	-	-	1,272,124	1,272,124
8		5年以上10年未満	-	-	-	997,408	997,408
9		10年以上（永久債を除く）	-	-	-	-	-
10		満期がないもの（永久債を含む）	1,154,169	374,900	-	-	1,529,069

(注)

- 1 Tier2資本調達手段には、適格旧Tier2資本調達手段を含みます。
- 2 無担保シニア債については、グループ内取引を控除しています。
- 3 除外債務については、金額的な重要性を考慮の上、保守的に計上しています

第2部 連結流動性規制に関する開示 (流動性に係る経営の健全性の状況)

金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が流動性に係る経営の健全性の状況を記載した書面に記載すべき事項を定める件（平成27年金融庁告示第9号）に基づき行う開示

第1章 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目		当最終指定親会社四半期 (2024年3月期 第2 四半期)		前最終指定親会社四半期 (2024年3月期 第1 四半期)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	6,035,514		6,479,694	
資金流出額 (2)		資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額	資金流出率を 乗じる前の額	資金流出率を 乗じた後の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	652,847	74,547	653,582	91,969
3	うち、安定預金の額	—	—	—	—
4	うち、準安定預金の額	652,847	74,547	653,582	91,969
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,600,950	2,269,508	2,629,831	2,311,586
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性 有価証券以外のホールセール無担保資金調達 に係る資金の額	2,053,122	1,721,680	2,034,543	1,716,298
8	うち、負債性有価証券の額	547,828	547,828	595,288	595,288
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			3,269,552	
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与 信・流動性ファシリティに係る資金流出額	2,848,577	2,328,725	2,717,958	2,238,466
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,992,491	1,992,491	1,960,776	1,960,776
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金 流出額	856,086	336,234	757,182	277,691
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,066,088	904,722	4,159,057	826,939
15	偶発事象に係る資金流出額	818,456	364,199	764,662	342,799
16	資金流出合計額	9,360,667		9,081,310	
資金流入額 (3)		資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額	資金流入率を 乗じる前の額	資金流入率を 乗じた後の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	36,517,531	2,773,061	34,451,407	2,653,116
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	1,951,091	1,791,284	1,758,867	1,615,791
19	その他資金流入額	4,547,204	1,665,354	4,926,951	1,669,984
20	資金流入合計額	43,015,827	6,229,699	41,137,225	5,938,890
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額	6,035,514		6,479,694	
22	純資金流出額	3,130,968		3,142,419	
23	連結流動性カバレッジ比率	193.7%		207.1%	
24	平均値計算用データ数	62		62	

第2章 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

会社グループの第2四半期連結会計期間の日次平均適格流動資産の合計額は前四半期比4,441億80百万円減の6兆355億14百万円となりました。有担保資金調達等に係る資金流出額が同1,494億13百万円増の3兆4,189億65百万円、貸付金等の回収に係る資金流入額が同1,754億93百万円増の1兆7,912億84百万円、有担保資金運用等に係る資金流入額が同1,199億45百万円増の2兆7,730億61百万円、純資金流出額は同114億51百万円減の3兆1,309億68百万円となりました。

この結果、流動性カバレッジ比率の第2四半期連結会計期間の日次平均は193.7%となりました。

会社グループの連結流動性カバレッジ比率が変動する主な要因としては、顧客との有価証券売買および貸借取引に伴うトレーディング在庫の変動、無担保および有担保資金調達・運用等による資金流出入金額の変化等が挙げられます。

2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

会社グループの第2四半期連結会計期間の日次平均連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低要求水準を十分に上回っております。

また、会社グループでは、連結流動性カバレッジ比率に関するリスク・アベタイトを定め、同比率が法令上の最低要求水準を上回る水準であることを日次で確認しております。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

算入可能適格流動資産の内容について著しい変動はありませんでした。

4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

該当する重要な事項はございません。

第3章 連結安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%)

項番		当最終指定親会社四半期末 (2023年9月末)					前最終指定親会社四半期末 (2023年6月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額
		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上	
利用可能安定調達額(1)											
1	資本の額	3,665,127	-	-	-	3,665,127	3,638,224	-	-	-	3,638,224
2	うち、普通株式等 Tier1資本、その他 Tier1資本及び Tier2資本（基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。）に係る基礎項目の額	3,665,127	-	-	-	3,665,127	3,638,224	-	-	-	3,638,224
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	個人及び中小企業等からの資金調達	223,922	315,961	90,300	33,005	600,171	229,290	302,990	88,125	26,052	584,416
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	223,922	315,961	90,300	33,005	600,171	229,290	302,990	88,125	26,052	584,416
7	ホールセール資金調達	3,523,864	18,995,401	1,340,295	11,415,811	13,038,728	3,450,238	16,910,500	1,025,407	10,866,615	12,338,857
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	3,523,864	18,995,401	1,340,295	11,415,811	13,038,728	3,450,238	16,910,500	1,025,407	10,866,615	12,338,857
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	9,489,030	2,917,362	43,862	43,707	145,898	9,822,691	3,200,711	46,121	208,633	158,379
12	うち、デリバティブ負債の額									153,166	
13	うち、上記に含まれない負債の額	9,489,030	2,917,362	43,862	43,707	145,898	9,822,691	3,200,711	46,121	55,467	158,379
14	利用可能安定調達額合計					17,449,924					16,719,876
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額					1,890,998					1,902,784
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	184,766	11,046	-	-	97,906	211,712	14,460	-	-	113,086
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	3,089,928	22,054,546	2,215,782	5,942,108	9,979,045	2,954,090	19,758,738	2,121,626	5,286,475	9,196,269
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	1,799	13,307,771	92,851	58,297	237,733	-	11,303,657	52,533	30,538	182,872
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	1,591,223	6,653,064	1,114,860	3,018,005	4,983,449	1,352,326	6,054,764	1,077,212	2,496,671	4,287,322
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額（項番18、19及び22に該当する額を除く。）	10,191	1,855,816	226,110	795,525	1,149,858	7,960	2,181,029	226,704	816,618	1,144,692
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	8,430	522	39,412	25,619	-	805	8,131	51,341	33,377
22	うち、住宅ローン債権	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	1,486,716	237,896	781,962	2,070,282	3,608,005	1,593,804	219,288	765,177	1,942,647	3,581,383
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

項番		当最終指定親会社四半期末 (2023年9月末)					前最終指定親会社四半期末 (2023年6月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額
		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上	
26	その他の資産等	505,636	383,093	-	3,173,650	3,323,614	509,934	238,598	-	3,012,754	3,173,321
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	-				-	-				-
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金(連結貸借対照表に計上されないものを含む。)				2,371,144	2,015,473				2,329,108	1,979,742
29	うち、デリバティブ資産の額				136,889	136,889				-	-
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減ずる前)の額				203,440	203,440				205,609	205,609
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	505,636	383,093	-	462,177	967,813	509,934	238,598	-	478,037	987,970
32	オフ・バランス取引				1,370,444	272,694				1,264,673	261,451
33	所要安定調達額合計					15,564,259					14,646,910
34	連結安定調達比率					112.1%					114.1%

第4章 連結安定調達比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項

会社グループの第2四半期連結会計期末の利用可能安定調達額合計は前四半期比7,300億48百万円増の17兆4,499億24百万円、所要安定調達額合計は同9,173億49百万円増の15兆5,642億59百万円となりました。ホールセール資金調達における利用可能安定調達額が同6,998億71百万円増の13兆387億28百万円、貸出金又はレボ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額における所要安定調達額が同7,827億76百万円増の9兆9,790億45百万円、その他の資産等における所要安定調達額が同1,502億93百万円増の3兆3,236億14百万円となりました。

この結果、会社グループの第2四半期連結会計期末における連結安定調達比率は、112.1%となりました。

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

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

会社グループの連結安定調達比率において適用対象となるものはございません。

3. その他連結安定調達比率に関する事項

会社グループの第2四半期末の連結安定調達比率は法令上の最低要求水準を上回っており、会社グループの営業活動に伴って保有しているトレーディング在庫等の資産に対して、適切な安定調達を維持しております。また、会社グループでは連結安定調達比率に関するリスク・アペタイトを定め、同比率が法令上の最低要求水準を上回る水準を維持するよう運営を行っております。

第3部 開示方針

「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」に基づき、開示情報の信頼性を維持・確保することを目的として、「最終指定親会社の経営の健全性の状況に係る開示方針」（以下、「当開示方針」といいます。）を定め、経営会議にて承認を得ております。

当開示方針に従い、情報開示委員会及びCFOは、本開示が、作成部署により定められた手続きに従って適切に作成されていることを確認しております。本開示はCFOによる承認後、公衆の縦覧および経営会議に報告されます。また、手続きの有効性については、定期的にインターナル・オーディット部門の内部監査を受けております。

