

第 3 期 貸 借 対 照 表

(平成 24 年 3 月 31 日現在)

(単位：百万円)

科 目	金 額	科 目	金 額
(資産の部)		(負債の部)	
流動資産	7,928,530	流動負債	7,287,137
現金・預金	120,506	トレーディング商品	1,987,306
預託金	145,126	商品有価証券等	1,841,572
トレーディング商品	3,723,457	デリバティブ取引	145,734
商品有価証券等	3,583,960	約定見返勘定	35,723
デリバティブ取引	139,497	信用取引負債	9,098
信用取引資産	30,455	信用取引借入金	305
信用取引貸付金	25,090	信用取引貸証券受入金	8,793
信用取引借証券担保金	5,365	有価証券担保借入金	2,320,427
有価証券担保貸付金	3,766,893	有価証券貸借取引受入	1,209,844
借入有価証券担保金	3,766,893	現先取引借入金	1,110,582
募集等払込金	15,092	預り金	126,760
短期差入保証金	74,938	受入保証金	19,571
前払費用	3,181	短期借入金	2,571,000
未収収益	15,526	コマーシャル・ペーパー	185,000
繰延税金資産	24,139	一年以内償還予定の社債	2,500
その他	9,277	未払金	4,775
貸倒引当金	△ 67	未払費用	7,719
固定資産	218,422	未払法人税等	704
有形固定資産	8,783	賞与引当金	15,430
建物	6,208	資産除去債務	206
器具・備品	1,650	その他	914
土地	17	固定負債	404,157
リース資産	907	社債	83,415
無形固定資産	41,403	長期借入金	316,000
商標	27,794	退職給付引当金	2,104
ソフトウェア	1,843	資産除去債務	1,683
のれん	11,194	その他	954
その他	571	特別法上の準備金	98
投資その他の資産	168,235	金融商品取引責任準備金	98
投資有価証券	44,666	負債合計	7,691,394
関係会社株式	54,295	(純資産の部)	
出資金	3	株主資本	455,305
長期貸付金	13,717	資本金	10,000
長期差入保証金	16,032	資本剰余金	378,395
長期前払費用	149	その他資本剰余金	378,395
繰延税金資産	34,329	利益剰余金	66,910
その他	12,850	その他利益剰余金	66,910
貸倒引当金	△ 7,808	繰越利益剰余金	66,910
		評価・換算差額等	252
		その他有価証券評価差額金	252
資産合計	8,146,952	純資産合計	455,558
		負債・純資産合計	8,146,952

第 3 期 損 益 計 算 書

(自平成 23 年 4 月 1 日 至平成 24 年 3 月 31 日)

(単位：百万円)

科 目	金	額
営 業 収 益		233,618
受 入 手 数 料	114,570	
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	102,298	
金 融 収 益	16,749	
金 融 費 用		12,296
純 営 業 収 益		221,321
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費		181,350
取 引 関 係 費	26,403	
人 件 費	84,056	
不 動 産 関 係 費	18,207	
事 務 費	32,225	
減 価 償 却 費	7,478	
租 税 公 課	1,568	
そ の 他	11,411	
営 業 利 益		39,970
営 業 外 収 益		1,190
営 業 外 費 用		858
経 常 利 益		40,303
特 別 利 益		1,033
投 資 有 価 証 券 売 却 益	985	
関 係 会 社 株 式 売 却 益	47	
特 別 損 失		2,492
固 定 資 産 除 却 損	141	
投 資 有 価 証 券 売 却 損	192	
投 資 有 価 証 券 等 評 価 損	426	
関 係 会 社 株 式 評 価 損	798	
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入	29	
減 損 損 失	117	
商 号 変 更 費 用	787	
税 引 前 当 期 純 利 益		38,844
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税		144
法 人 税 等 調 整 額		22,059
当 期 純 利 益		16,641

第 3 期 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

(自平成 23 年 4 月 1 日 至平成 24 年 3 月 31 日)

(単位：百万円)

	株主資本				評価・換算差額等	純資産 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	株主資本 合計	その他有 価証券評 価差額金	
		その他資 本剰余金	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金			
当期首残高	10,000	378,395	50,269	438,664	546	439,210
当期変動額						
当期純利益			16,641	16,641		16,641
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）					△ 293	△ 293
当期変動額合計	-	-	16,641	16,641	△ 293	16,347
当期末残高	10,000	378,395	66,910	455,305	252	455,558

個 別 注 記 表

当社の計算書類は、「会社計算規則」（平成 18 年法務省令第 13 号 最終改正平成 23 年 11 月 16 日）の規定のほか、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号 最終改正平成 23 年 12 月 26 日）、および「有価証券関連業経理の統一に関する規則」（昭和 49 年 11 月 14 日付日本証券業協会自主規制規則 最終改正平成 22 年 3 月 16 日）に基づいて作成しております。

記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

[重要な会計方針に係る事項に関する注記]

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) トレーディング商品

トレーディング商品に属する有価証券等およびデリバティブ取引等については、時価法を採用しております。

(2) 子会社株式および関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(3) その他有価証券

① 時価のある有価証券

決算日の市場価格等に基づく時価をもって貸借対照表価額としております。なお、移動平均法による取得原価との評価差額は、全部純資産直入法によっております。

② 投資事業組合等への出資

純資産を当社の出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております。ただし、子会社に該当する投資事業組合、その他重要性のある出資については、当該組合等の財務諸表を基礎とし、当社の出資持分相当額を総額で取り込む方法によっております。

③ 時価のない有価証券

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

主として定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、ソフトウェアの耐用年数は社内における利用可能期間、商標権およびのれんについては20年以内の期間としております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

役員および従業員に対する賞与の支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

年金受給権者の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務および年金資産に基づき計上しております。

4. 特別法上の準備金の計上基準

特別法上の準備金は、金融商品取引責任準備金であり、証券事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項および「金融商品取引業等に関する内閣府令」第175条の規定に定めるところにより算出した額を計上しております。

5. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理方法

消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(追加情報)

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

[貸借対照表に関する注記]

1. 担保に供している資産及び担保に係る債務

(1) 担保に供している資産

トレーディング商品 1,512,737 百万円

(注1) 資産の額は貸借対照表計上額によっております。

(注2) 上記のほか、短期借入金の担保として借入有価証券 1,275,848 百万円を差し入れております。

(2) 担保資産の対象となる債務

信用取引借入金 293 百万円

短期借入金 2,329,400 百万円

計 2,329,693 百万円

2. 差入有価証券等

(1) 差し入れている有価証券

信用取引貸証券 9,551 百万円

信用取引借入金の本担保証券 300 百万円

消費貸借契約により貸し付けた有価証券 1,213,397 百万円

現先取引で売却した有価証券 1,110,504 百万円

差入保証金代用有価証券 16,998 百万円

(注) 担保に供している有価証券（上記「1. 担保に供している資産及び担保に係る債務 (1) 担保に供している資産」のトレーディング商品および借入有価証券）を除いております。

(2) 受け入れた有価証券

信用取引借証券 5,282 百万円

信用取引貸付金の本担保証券 25,098 百万円

消費貸借契約により借り入れた有価証券 3,946,569 百万円

その他担保として受け入れた有価証券 1,084 百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 15,018 百万円

4. 保証債務の内容及び金額

(単位：百万円)

被保証者	保証金額	被保証債務の内容
当社従業員	11,607	住宅融資制度に伴う金融機関借入金

5. 関係会社に対する金銭債権及び金銭債務（区分表示したものを除く）

短期金銭債権	112,282 百万円
長期金銭債権	12,043 百万円
短期金銭債務	19,801 百万円
長期金銭債務	200,000 百万円

[損益計算書に関する注記]

関係会社との取引高

営業取引による取引高

営業収益	2,393 百万円
営業費用	47,546 百万円
営業取引以外の取引による取引高	3 百万円

[株主資本等変動計算書に関する注記]

発行済株式に関する事項

普通株式	200,001 株
------	-----------

[税効果会計に関する注記]

繰延税金資産の発生の主な原因は、会社分割時に生じた資産調整勘定や賞与引当金の否認であります。

また、「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成 23 年法律第 114 号）および「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成 23 年法律第 117 号）が平成 23 年 12 月 2 日に公布され、平成 24 年 4 月 1 日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げおよび復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用される法定実効税率は従来の 40.69%から、平成 24 年 4 月 1 日に開始する事業年度から平成 26 年 4 月 1 日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については 38.01%に、平成 27 年 4 月 1 日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については 35.64%となります。この税率変更により繰延税金資産の純額が 4,790 百万円減少し、法人税等調整額は 4,800 百万円増加しております。

[リースにより使用する固定資産に関する注記]

貸借対照表に計上した固定資産のほか、オンライン端末機、パーソナル・コンピューター等の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しております。

[金融商品に関する注記]

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、トレーディング業務を行っており、有価証券等の売買取引のほか、デリバティブ取引についても、原則として顧客のさまざまなニーズに対応した商品、取引等を提供していくための業務として取り組んでおります。そのために生じるトレーディング商品のポジションに関するリスク管理は極めて重要であると認識しており、リスクの所在およびリスクの種類・特性を明確にし、各種リスクの測定、モニタリングおよび管理等の手法により、適正なリスク管理態勢を整備しております。

(2) 金融商品の内容およびそのリスク

当社の保有する金融資産は、トレーディング目的の有価証券等であります。トレーディング目的の有価証券等は、金利変動リスク、為替変動リスク、株価変動リスクおよび発行体の信用リスク等に晒されております。また、トレーディング目的以外で保有する有価証券は、主に株式や組合出資金等の投資有価証券であり、純投資目的および事業推進目的で保有しております。これらは、価格変動リスクおよび発行体の信用リスク等に晒されております。

借入金、社債およびコマーシャル・ペーパーは、一定の環境の下で当社が市場を利用できなくなる場合など、支払期日にその支払いを実行できなくなる流動性リスクに晒されております。

デリバティブ取引には、取引所取引においての株価指数先物取引、債券先物取引、金利先物取引およびこれらのオプション取引ならびに株券オプション取引があります。取引所以外の取引においては、金利および通貨スワップ、先物外国為替取引、選択権付債券売買取引および通貨オプション取引等があります。当社では、これらをトレーディングポジションとして保有しており、金利変動リスク、為替変動リスク、株価変動リスクおよび信用リスク等に晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク

当社は、信用リスクに関する管理規程に従い、取引先の与信審査、社内格付の付与、与信限度額の設定、モニタリング、担保の徴収および問題債権への対応等与信管理に関する体制を整備し運営しております。これらの信用リスク管理は、リスク管理部により行われ、信用リスクに関する重要な事項は、経営会議で協議決定されます。また、信用リスクの状況については、定期的に経営会議等に報告されます。

② 市場リスク

当社は、市場リスクに関する管理規程に従い、自己資本等の経営体力やトレーディング業務の運用方針等を勘案し、マーケットリスク限度枠、ポジション限度枠、損失ガイドラインを設定し管理しております。これらの市場リスク管理は、リスク管理部により行われ、市場リスクに関する重要な事項は、経営会議で協議決定されます。また、市場リスクの状況については、経営会議等に報告されます。

(i) 金利リスクの管理

トレーディング目的で保有する債券および金利スワップ等の金利デリバティブ取引のポジションについて、マーケットリスク限度枠、ポジション限度枠等を設定しモニタリングを行い、金利変動リスクを管理しております。

(ii) 為替リスクの管理

トレーディング目的で保有する外貨資産、先物為替取引および通貨デリバティブ取引のポジションについて、マーケットリスク限度枠、ポジション限度枠等を設定しモニタリングを行い、為替変動リスクを管理しております。

(iii) 株式リスクの管理

トレーディング目的で保有する株式およびエクイティデリバティブ取引のポジションについて、マーケットリスク限度枠、ポジション限度枠等を設定しモニタリングを行い、株価変動リスクを管理しております。

(iv) 市場リスクに係る定量的情報

(ア) トレーディング目的の金融商品

当社では、トレーディング目的で保有する有価証券等に係る市場リスクの算定にあたっては、金利、為替、株価等の様々な市場のリスク・ファクターの変動を捉えるため、取扱商品ごとに市場リスク管理に適したポジション管理指標を選定し、これに限度枠を設定しております。

当社が保有する有価証券等のうち、債券、金利スワップ等の金利商品については、ベース・ポイント・バリュー（金利が0.01%上昇した時の時価変化額）をポジション管理指標として限度枠を設定しております。平成24年3月30日現在での当社全体での円金利におけるネットベースのベース・ポイント・バリューは、39百万円であり、外貨金利におけるネットベースのベース・ポイント・バリューは、192千ドルであります。

株式、ETF等のエクイティ商品については、時価金額をポジション管理指標として限度枠を設定しております。平成24年3月30日現在でのネットベースの時価金額は、5億円であります。

ポジション限度枠の使用状況については、経営会議等に報告されます。

(イ) トレーディング目的以外の金融商品

当社において、トレーディング目的以外で保有する有価証券は、主に投資有価証券であり、投資有価証券のうち、上場株式については、株価変動リスクに晒されるため、取引所の価格によって時価金額を把握し、ストレステストを実施しております。平成 24 年 3 月 30 日現在市場リスクを管理している上場投資有価証券の時価金額は、325 億円です。ストレステストのシナリオとしては、リーマンショック前後の株価の年間下落率を参考に 50%の株価下落を想定しており、想定損失額は、162 億円となります。

投資有価証券のポジション状況およびストレステストの結果は、経営会議等に報告されます。

③ 資金調達に係る流動性リスクの管理

当社は、流動性リスクに関する管理規程に従い、当社の資金繰り状況を適切に把握・管理し、いかなる金融情勢下であっても、流動性が確保されるよう資金の調達・運用の効率的な管理を行っております。また、当該リスクが顕在化するおそれがある場合には、直ちに具体的方針および対応策を作成し、実行することとしております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、以下のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
資産			
(1) 現金・預金	120,506	120,506	—
(2) 預託金	145,126	145,126	—
(3) 商品有価証券等および投資有価証券	3,616,855	3,616,855	—
① 商品有価証券等	3,583,960	3,583,960	—
② 投資有価証券（注1）（注2）	32,895	32,895	—
(4) 信用取引資産	30,455	30,455	—
(5) 有価証券担保貸付金	3,766,893	3,766,893	—
(6) 募集等払込金	15,092	15,092	—
(7) 短期差入保証金	74,938	74,938	—
(8) 長期貸付金（注2）	13,717		
貸倒引当金(*1)	△130		
	13,586	13,586	—
資産計	7,783,456	7,783,456	—
負債			
(1) 商品有価証券等	1,841,572	1,841,572	—
(2) 約定見返勘定	35,723	35,723	—
(3) 信用取引負債（注3）	9,098	9,098	—
(4) 有価証券担保借入金（注3）	2,320,427	2,320,427	—
(5) 預り金	126,760	126,760	—
(6) 受入保証金	19,571	19,571	—
(7) 短期借入金（注3）	2,571,000	2,571,000	—
(8) コマーシャル・ペーパー（注3）	185,000	185,000	—
(9) 未払金	4,775	4,775	—
(10) 社債（一年以内償還予定の社債を含む）（注3）	85,915	85,915	—
(11) 長期借入金（注3）	316,000	316,000	—
負債計	7,515,843	7,515,843	—
デリバティブ取引（*2）			
(1) ヘッジ会計が適用されていないもの	(6,237)	(6,237)	—
(2) ヘッジ会計が適用されているもの	—	—	—
デリバティブ取引計	(6,237)	(6,237)	—

(*1) 長期貸付金に対して個別に計上している貸倒引当金を控除しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

金融商品の時価の算定方法ならびに有価証券およびデリバティブ取引に関する事項は以下のとおりです。

資 産

(1) 現金・預金

満期のない預金および残存期間が6ヶ月以内の満期のある預金については、時価が帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある6ヶ月を超える預金は取り扱っておりません。

(2) 預託金

預託金については、短期間で市場金利を反映するため、時価は帳簿価額と近似していることから当該帳簿価額によっております。

(3) 商品有価証券等および投資有価証券

株式については取引所の価格によっており、債券については取引所等の価格、投資信託については、公表されている基準価額にそれぞれによっております。組合出資金については、組合財産を時価評価できるものには時価評価を行ったうえ、当該時価に対する持分相当額を組合出資金の時価とみなして計上しております。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものも含めた保有目的ごとの有価証券に関する注記事項は以下のとおりです。

- ① 商品有価証券等において、当事業年度の損益に含まれた評価差額は13,497百万円です。
- ② 投資有価証券の当事業年度中の売却額は22,285百万円で、売却益の合計額は1,033百万円、売却損の合計額は192百万円です。また、投資有価証券の種類ごとの取得原価又は償却原価、貸借対照表計上額およびこれらの差額については、次のとおりです。

(単位：百万円)

	種類	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1) 株式	16,417	18,443	2,026
	(2) 債券	—	—	—
	① 国債・地方債等	—	—	—
	② 社債	—	—	—
	③ その他	—	—	—
	(3) その他	—	—	—
	小計	16,417	18,443	2,026
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	82,175	80,464	△1,711
	(2) 債券	30	30	—
	① 国債・地方債等	—	—	—
	② 社債	—	—	—
	③ その他	30	30	—
	(3) その他	23	23	—
	小計	82,228	80,517	△1,711
合計		98,646	98,961	314

- ③ 上記の表中にある「取得原価」は減損処理後の帳簿価額です。当事業年度において、投資有価証券については1,213百万円の減損処理を行っております。
- ④ 当事業年度中において、保有目的が変更となった有価証券はありません。

(4) 信用取引資産

信用取引貸付金および信用取引借証券担保金については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券担保貸付金

有価証券担保貸付金については、短期間で市場金利を反映するため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(6) 募集等払込金

募集等払込金については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(7) 短期差入保証金

短期差入保証金については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(8) 長期貸付金

長期貸付金については、変動金利によるものは短期間で市場金利を反映し、また、貸付先の信用状態は実行後大きく異なっていないことから、時価は貸倒引当金控除後の帳簿価額と近似していると考えられるため、当該価額を時価としております。

負債

(1) 商品有価証券等

株式については取引所の価格、債券については取引所等の価格にそれぞれっております。

(2) 約定見返勘定、(3) 信用取引負債、(6) 受入保証金、(7) 短期借入金、(8) コマーシャル・ペーパー、(9) 未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4) 有価証券担保借入金

有価証券担保借入金については、短期間で市場金利を反映し、また、当社の信用状態は実行後大きく異なっていないことから、時価は帳簿価額と近似していると考えられるため、当該帳簿価額によっております。

(5) 預り金

預り金については、決算日に要求された場合の支払額（帳簿価額）を時価とみなしていることから、当該帳簿価額によっております。

(10) 社債（一年以内償還予定の社債を含む）

社債については、変動金利で調達しており市場金利を短期間で反映し、また、当社の信用状態は発行後大きく異なっていないことから、時価は帳簿価額と近似していると考えられるため、当該帳簿価額によっております。

(11) 長期借入金

長期借入金については、変動金利で調達しており市場金利を短期間で反映し、また、当社の信用状態は実行後大きく異なっていないことから、時価は帳簿価額と近似していると考えられるため、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

(1) ヘッジ会計が適用されていないもの

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価および評価損益ならびに当該時価の算定方法は、次のとおりです。

(a) 通貨関連

(単位：百万円)

区分	デリバティブ取引の種類等	契約額等		時価(*)	評価損益
			うち1年超		
店頭	通貨オプション取引				
	売建	513,098	427,293	△95,777	△24,139
	買建	517,021	431,540	97,927	36,782
	為替予約取引	167,769	786	923	923
	通貨スワップ取引	389,453	286,742	△3,028	△3,028
合計		1,587,343	1,146,362	45	10,537

(*) 時価の算定方法

割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(b) 金利関連

(単位：百万円)

区分	デリバティブ取引の種類等	契約額等		時価(*)	評価損益
			うち1年超		
取引所	金利先物取引				
	売建	89,697	—	△0	△0
	買建	—	—	—	—
店頭	金利スワップ取引				
	受取固定・支払変動	2,233,486	1,723,647	26,937	26,937
	受取固定・支払固定	2,600	2,600	△0	△0
	受取変動・支払固定	2,118,025	1,690,325	△29,032	△29,032
	受取変動・支払変動	273,800	268,800	59	59
	金利スワップション取引				
	売建	82,821	—	△719	268
買建	75,621	—	593	266	
合計		4,876,051	3,685,442	△2,162	△1,501

(*) 時価の算定方法

取引所取引につきましては、取引を行う取引所が定める清算価格によっております。

店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(c) 株式関連

(単位：百万円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価(*)	評価損益
			うち1年超		
取引所	株価指数先物取引				
	売建	199,034	—	△5,246	△5,246
	買建	—	—	—	—
店頭	有価証券店頭先渡取引				
	売建	—	—	—	—
	買建	21,965	—	822	822
	有価証券店頭オプション 取引				
	売建	1,803	—	△81	△35
	買建	6,068	—	263	194
	有価証券店頭指数等スワ ップ取引	18,290	15,190	△2	△2
合計	247,161	15,190	△4,244	△4,266	

(*) 時価の算定方法

取引所取引につきましては、取引を行う取引所が定める清算指数によっております。

店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(d) 債券関連

(単位：百万円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価(*)	評価損益
			うち1年超		
取引所	債券先物取引				
	売建	125,175	—	57	57
	買建	79,492	—	33	33
	債券先物オプション取引				
	売建	—	—	—	—
店頭	債券店頭オプション取引				
	売建	38,894	—	△53	11
	買建	38,894	—	115	20
	債券先渡契約				
	売建	1,150	—	126	126
	買建	2,924	—	30	30
	合計	299,640	—	319	276

(*) 時価の算定方法

取引所取引につきましては、取引を行う取引所が定める清算値段によっております。

店頭取引につきましては、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(e) クレジットデリバティブ取引

(単位：百万円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価(*)	評価損益
			うち1年超		
店頭	クレジット・デフォルト・スワップ取引				
	売建	84,450	83,350	△1,589	△1,589
	買建	87,450	87,450	1,393	1,393
合計		171,900	170,800	△196	△196

(*) 時価の算定方法

金利、取引期間、相手先のクレジット等を基に価格計算モデル等により算定しております。

「売建」は信用リスクの引受取引、「買建」は信用リスクの引渡取引であります。

(2) ヘッジ会計が適用されているもの

該当事項はありません。

(注1) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
① 非上場株式 (*1) (*2)	66,053
② 組合出資金 (*3)	12
③ 長期差入保証金 (*4)	16,032
合計	82,098

(*1) 非上場株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。なお、子会社株式 53,621 百万円、関連会社株式 673 百万円を含んでおります。

(*2) 当事業年度において、非上場株式について 1,007 百万円の減損処理を行っております。

(*3) 組合出資金のうち、組合財産が非上場株式など時価を把握することが極めて困難と認められるもので構成されているものについては、時価開示の対象とはしておりません。

(*4) 長期差入保証金については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注2) 金銭債権および満期のある有価証券の決算後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
投資有価証券	0	42	—	—
長期貸付金 (*)	18	—	0	21
合計	18	42	0	21

(*) 長期貸付金のうち、破産更生債権等および償還予定期日の見込が困難な 13,677 百万円については、上記の区分に含めておりません。

(注3) 社債、長期借入金およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
信用取引負債	9,098	—	—	—
有価証券担保借入金	2,320,427	—	—	—
短期借入金	2,571,000	—	—	—
コマーシャル・ペーパー	185,000	—	—	—
社債（一年以内償還予定 の社債を含む）	2,500	38,915	13,200	31,300
長期借入金	—	202,000	76,500	37,500
合計	5,088,025	240,915	89,700	68,800

[関連当事者との取引に関する注記]

1. 親会社

(単位：百万円)

属性	会社等の名称	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	株式会社 三井住友銀行	被所有： 直接 100%	資金の借入 有価証券の 貸借 役員の兼任	資金の借入 (注2)	—	長期借入金	200,000
				資金の返済 (注2)	—		
				利息の支払	3,280	未払費用	690
				有価証券貸借 取引(注3)	—	借入有価証券 担保金	99,861
				支払品借料	35	未払費用	11
				受取利息	62	未収収益	0

(注1) 取引金額および期末残高には、消費税等は含まれておりません。

(注2) 取引金額は、純額で記載しております。

(注3) 反復的かつ多額な市場性取引であるため、取引金額については期末残高のみを開示しております。

(注4) 取引条件および取引条件の決定方針等

取引条件は、市場実勢等を勘案して決定しております。

2. 子会社及び関連会社等

(単位：百万円)

属性	会社等の名称	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	日興システムソ リューションズ 株式会社	所有： 直接 100%	役務の受入	情報サービス 等の受入	20,553	前払費用	1,594
						未払金	178

(注1) 取引金額および期末残高には、消費税等は含まれておりません。

(注2) 取引条件および取引条件の決定方針等

独立第三者間取引と同様の一般的な取引条件により行っております。

3. 兄弟会社等

該当事項はありません。

4. 役員等

該当事項はありません。

[1株当たり情報に関する注記]

1. 1株当たり純資産額	2,277,779円57銭
1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりです。	
純資産の部の合計額	455,558百万円
普通株式に係る純資産の部	455,558百万円
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	200千株
2. 1株当たり当期純利益	83,205円72銭
1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下のとおりです。	
当期純利益	16,641百万円
普通株式に係る当期純利益	16,641百万円
普通株式の期中平均株式数	200千株

[重要な後発事象に関する注記]

該当事項はありません。