

## 第 4 期 貸 借 対 照 表

(平成 25 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	6,474,411	流 動 負 債	5,859,139
現 金 ・ 預 金	281,891	ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	1,863,041
預 託 金	223,839	商 品 有 価 証 券 等	1,703,422
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	2,913,561	デ リ バ テ ィ ブ 取 引	159,618
商 品 有 価 証 券 等	2,764,903	信 用 取 引 負 債	7,757
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	148,658	信 用 取 引 借 入 金	673
約 定 見 返 勘 定	49,920	信 用 取 引 貸 証 券 受 入 金	7,084
信 用 取 引 資 産	52,286	有 価 証 券 担 保 借 入 金	2,049,102
信 用 取 引 貸 付 金	49,490	有 価 証 券 貸 借 取 引 受 入 金	1,689,320
信 用 取 引 借 証 券 担 保 金	2,795	現 先 取 引 借 入 金	359,782
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	2,752,609	預 り 金	173,898
借 入 有 価 証 券 担 保 金	2,752,609	受 入 保 証 金	28,839
募 集 等 払 込 金	58,126	短 期 借 入 金	1,224,700
短 期 差 入 保 証 金	58,336	一 年 以 内 返 済 予 定 長 期 借 入 金	200,000
前 払 費 用	2,973	コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー	257,500
未 収 収 益	18,374	一 年 以 内 償 還 予 定 の 社 債	9,750
繰 延 税 金 資 産	27,569	未 払 金	7,791
そ の 他	34,959	未 払 費 用	8,203
貸 倒 引 当 金	△ 38	未 払 法 人 税 等	5,565
固 定 資 産	190,241	賞 与 引 当 金	22,270
有 形 固 定 資 産	7,536	資 産 除 去 債 務	41
建 物	5,592	そ の 他	676
器 具 ・ 備 品	1,412	固 定 負 債	295,735
土 地	17	社 債 債	190,535
リ ー ス 資 産	513	長 期 借 入 金	101,000
無 形 固 定 資 産	36,557	退 職 給 付 引 当 金	1,630
商 標 権	24,088	資 産 除 去 債 務	1,943
ソ フ ト ウ ェ ア	1,411	そ の 他	626
の れ ん	10,466	特 別 法 上 の 準 備 金	159
そ の 他	591	金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金	159
投 資 そ の 他 の 資 産	146,148	負 債 合 計	6,155,033
投 資 有 価 証 券	54,488	(純資産の部)	
関 係 会 社 株 式	56,416	株 主 資 本	500,242
長 期 貸 付 金	13,696	資 本 金	10,000
長 期 差 入 保 証 金	14,621	資 本 剰 余 金	378,395
長 期 前 払 費 用	120	そ の 他 資 本 剰 余 金	378,395
繰 延 税 金 資 産	5,612	利 益 剰 余 金	111,847
そ の 他	7,487	そ の 他 利 益 剰 余 金	111,847
貸 倒 引 当 金	△ 6,294	繰 越 利 益 剰 余 金	111,847
		評 価 ・ 換 算 差 額 等	9,377
		そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	9,377
資 産 合 計	6,664,653	純 資 産 合 計	509,619
		負 債 ・ 純 資 産 合 計	6,664,653

## 第 4 期 損 益 計 算 書

(自平成 24 年 4 月 1 日 至平成 25 年 3 月 31 日)

(単位：百万円)

科 目	金 額	額
営 業 収 益		280,503
受 入 手 数 料	138,709	
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	119,764	
金 融 収 益	22,029	
金 融 費 用		12,506
<b>純 営 業 収 益</b>		<b>267,996</b>
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費		195,285
取 引 関 係 費	29,505	
人 件 費	93,631	
不 動 産 関 係 費	18,455	
事 務 費	33,214	
減 価 償 却 費	7,261	
租 税 公 課	1,867	
そ の 他	11,349	
<b>営 業 利 益</b>		<b>72,710</b>
営 業 外 収 益		1,368
営 業 外 費 用		642
<b>経 常 利 益</b>		<b>73,435</b>
特 別 利 益		555
投 資 有 価 証 券 売 却 益	555	
特 別 損 失		2,446
固 定 資 産 除 却 損	76	
投 資 有 価 証 券 売 却 損	824	
投 資 有 価 証 券 等 評 価 損	593	
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入	60	
減 損 損 失	581	
過 怠 金 等	309	
<b>税 引 前 当 期 純 利 益</b>		<b>71,544</b>
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税		5,109
法 人 税 等 調 整 額		21,498
<b>当 期 純 利 益</b>		<b>44,936</b>

## 第 4 期 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

(自平成 24 年 4 月 1 日 至平成 25 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	66,910	455,305	252	455,558
当期変動額						
当期純利益			44,936	44,936		44,936
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）					9,124	9,124
当期変動額合計	-	-	44,936	44,936	9,124	54,061
当期末残高	10,000	378,395	111,847	500,242	9,377	509,619

## 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 24 年 7 月 6 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 24 年 3 月 19 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。

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当会計年度より平成 24 年 4 月 1 日以降に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法等に基づく減価償却の方法に変更しております。

なお、この変更により計算書類に与える影響は軽微であります。

### (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。

[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 740,521 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 433,171 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 655 百万円

短期借入金 850,600 百万円

---

計 851,255 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 8,221 百万円

信用取引借入金の本担保証券 660 百万円

消費貸借契約により貸し付けた有価証券 1,687,912 百万円

現先取引で売却した有価証券 359,166 百万円

差入保証金代用有価証券 23,997 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 2,754 百万円

信用取引貸付金の本担保証券 50,168 百万円

消費貸借契約により借り入れた有価証券 2,916,167 百万円

その他担保として受け入れた有価証券 2,185 百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 15,800 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	9,980	住宅融資制度に伴う金融機関借入金
S M B C N i k k o Securities (Singapore) Pte. Ltd	2,651	シンガポール通貨庁に対するシンガポール拠点の債務保証

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	31,572 百万円
長期金銭債権	9,414 百万円
短期金銭債務	219,869 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	1,201 百万円
営業費用	50,311 百万円
営業取引以外の取引による取引高	183 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。

## [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、市場バリュー・アット・リスク（VaR）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。

### <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、様々な市場のリスク・ファクターに跨る市場リスクの総量を定量的に把握するために市場 VaR による管理を平成 24 年 10 月 1 日より開始し、これに限度枠を設定しております。市場 VaR の算定にあたっては、ヒストリカル・シミュレーション法（保有期間：1 日、信頼水準 99%、観測期間：3 年）を採用しております。平成 25 年 3 月 31 日現在でのトレーディング業務に係る市場 VaR は 666 百万円となっております。

なお、当社では市場 VaR と損益を比較するバックテストを実行しています。市場 VaR による管理開始以降の平成 24 年 10 月 1 日から平成 25 年 3 月 29 日までの 119 営業日におけるバックテストの結果、損失が市場 VaR を超えた回数は 0 回であり、十分な精度により市場リスクを捉えているものと考えております。ただし、市場 VaR は過去の相場変動を前提に統計的に算出した市場リスク量であるため、前提条件が満たされない相場状況下におけるリスクは捕捉できない場合があります。

#### (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、市場 VaR の計測を平成 24 年 10 月 1 日より開始しております。市場 VaR の算定にあたっては、ヒストリカル・シミュレーション法（保有期間：1 日、信頼水準 99%、観測期間：3 年）を採用しております。平成 25 年 3 月 31 日現在での投資有価証券（上場株式）に係る市場 VaR は 1,078 百万円となっております。なお、市場 VaR による管理開始以降の平成 24 年 10 月 1 日から平成 25 年 3 月 29 日までの 119 営業日におけるバックテストの結果、損失が市場 VaR を超えた回数は 1 回であり、十分な精度により市場リスクを捉えているものと考えております。ただし、市場 VaR は過去の相場変動を前提に統計的に算出した市場リスク量であるため、前提条件が満たされない相場状況下におけるリスクは捕捉できない場合があります。

## 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 25 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	281,891	281,891	—
(2) 預託金	223,839	223,839	—
(3) 商品有価証券等および投資有価証券	2,808,278	2,808,278	—
① 商品有価証券等	2,764,903	2,764,903	—
② 投資有価証券（注 1）（注 2）	43,375	43,375	—
(4) 約定見返勘定	49,920	49,920	—
(5) 信用取引資産	52,286	52,286	—
(6) 有価証券担保貸付金	2,752,609	2,752,609	—
(7) 募集等払込金	58,126	58,126	—
(8) 短期差入保証金	58,336	58,336	—
(9) 長期貸付金（注 2）	13,696		
貸倒引当金(*1)	△130		
	13,566	13,566	—
資産計	6,298,855	6,298,855	—
負債			
(1) 商品有価証券等	1,703,422	1,703,422	—
(2) 信用取引負債（注 3）	7,757	7,757	—
(3) 有価証券担保借入金（注 3）	2,049,102	2,049,102	—
(4) 預り金	173,898	173,898	—
(5) 受入保証金	28,839	28,839	—
(6) 短期借入金（注 3）	1,224,700	1,224,700	—
(7) コマーシャル・ペーパー（注 3）	257,500	257,500	—
(8) 未払金	7,791	7,791	—
(9) 未払法人税等	5,565	5,565	—
(10) 社債（一年以内償還予定の社債を含む）（注 3）	200,285	200,285	—
(11) 長期借入金（一年以内返済予定の長期借入金を含む）（注 3）	301,000	301,000	—
負債計	5,959,863	5,959,863	—
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	(10,959)	(10,959)	—
(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	(10,959)	(10,959)	—

(\*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、債券については業者間気配を参考に算出した価格等、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、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15,464百万円です。
- ② 投資有価証券の当事業年度中の売却額は985百万円で、売却損の合計額は212百万円です。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	26,850	39,694	12,843
	(2) 債券	—	—	—
	① 国債・地方債等	—	—	—
	② 社債	—	—	—
	③ その他	—	—	—
	(3) その他	—	—	—
	小計	26,850	39,694	12,843
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	3,894	3,681	△213
	(2) 債券	—	—	—
	① 国債・地方債等	—	—	—
	② 社債	—	—	—
	③ その他	—	—	—
	(3) その他	—	—	—
	小計	3,894	3,681	△213
合計		30,745	43,375	12,629

- 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567百万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) 約定見返勘定

約定見返勘定については、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) 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。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 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。

(9) 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、債券については業者間気配を参考に算出した価格等にそれぞれよっております。

### (2) 信用取引負債、(5) 受入保証金、(6) 短期借入金、(7) コマーシャル・ペーパー、(8) 未払金、(9) 未払法人税等

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。

### (3) 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。

### (4) 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（一年以内返済予定の長期借入金を含む）

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	489,305	412,866	△67,383	2,426
	買建	479,822	408,873	66,142	8,946
	為替予約取引	373,253	11,830	1,806	1,806
	通貨スワップ取引	291,893	234,048	△907	△907
合計		1,634,274	1,067,619	△342	12,271

(\*) 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		
店頭	金利スワップ取引				
	受取固定・支払変動	2,701,613	2,357,514	58,787	58,787
	受取固定・支払固定	68,400	68,400	16	16
	受取変動・支払固定	2,564,635	2,243,655	△60,351	△60,351
	受取変動・支払変動	458,400	453,400	26	26
	金利スワップオプション取引				
	売建	61,000	—	△623	73
	買建	58,600	—	276	49
	金利キャップ取引				
	売建	8,857	8,857	△20	23
	買建	8,857	8,857	20	△16
合計		5,930,363	5,140,683	△1,869	△1,392

(\*) 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。

## (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	193,534	—	△7,996	△7,996
	買建	4,203	—	12	12
	株価指数オプション取引				
	売建	20,072	4,350	△845	△92
	買建	13,287	1,250	429	37
店頭	有価証券店頭先渡取引				
	売建	—	—	—	—
	買建	16,984	—	745	745
	有価証券店頭オプション 取引				
	売建	371	119	△52	△38
	買建	5,378	119	840	789
	有価証券店頭指数等スワ ップ取引	35,535	31,485	△16	△16
合計		289,366	37,323	△6,884	△6,560

(\*) 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	150,924	—	△372	△372
	買建	151,791	—	△222	△222
店頭	債券店頭オプション取引				
	売建	138,870	—	△102	182
	買建	93,865	—	118	△18
合計		535,452	—	△579	△430

(\*) 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	215,000	207,100	379	379
	買建	218,575	212,975	△1,664	△1,664
合計		433,575	420,075	△1,285	△1,285

(\*) 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)	67,060
② 組合出資金 (*3)	438
③ その他 (*1)	30
④ 長期差入保証金 (*4)	14,621
合計	82,150

(\*1) 非上場株式およびその他については、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 55,742 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 21 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	—	39	429	—
長期貸付金 (*)	—	0	19	—
合計	—	39	448	—

(\*) 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	7,757	—	—	—
有価証券担保借入金	2,049,102	—	—	—
短期借入金	1,224,700	—	—	—
コマーシャル・ペーパー	257,500	—	—	—
社債（一年以内償還予定の社債を含む）	9,750	112,660	10,775	67,100
長期借入金（一年以内返済予定の長期借入金を含む）	200,000	2,000	44,500	54,500
合計	3,748,810	114,660	55,275	121,600

[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)	—	一年以内返済 予定長期借入 金	200,000
				資金の返済 (注2)	—		未払費用
				利息の支払	2,267		
				有価証券貸借 取引(注3)	—	借入有価証券 担保金	—
				支払品借料	31	未払費用	—
				受取利息	11	未収収益	—

(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	21,893	前払費用	1,671
						未払金	275

(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	2,548,086円00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	509,619百万円
普通株式に係る純資産の部	509,619百万円
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	224,683円63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	44,936百万円
普通株式に係る当期純利益	44,936百万円
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。