

## 第 5 期 貸 借 対 照 表

(平成 26 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	6,937,073	流 動 負 債	6,068,865
現 金 ・ 預 金	508,556	ト レーディング商品	1,871,360
預 託 金	262,797	商品有価証券等	1,713,083
ト レーディング商品	3,053,662	デリバティブ取引	158,277
商品有価証券等	2,901,840	約 定 見 返 勘 定	49,272
デリバティブ取引	151,822	信 用 取 引 負 債	6,182
信 用 取 引 資 産	83,414	信 用 取 引 借 入 金	1,519
信 用 取 引 貸 付 金	80,509	信 用 取 引 貸 証 券 受 入 金	4,662
信 用 取 引 借 証 券 担 保 金	2,904	有 価 証 券 担 保 借 入 金	2,526,101
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	2,864,875	有 価 証 券 貸 借 取 引 受 入 金	1,912,459
借 入 有 価 証 券 担 保 金	2,864,875	現 先 取 引 借 入 金	613,641
募 集 等 払 込 金	20,262	預 り 金	181,338
短 期 差 入 保 証 金	73,301	受 入 保 証 金	45,604
前 払 費 用	3,202	短 期 借 入 金	1,033,000
未 収 収 益	14,255	コマーシャル・ペーパー	277,500
繰 延 税 金 資 産	20,118	1 年 内 償 還 予 定 の 社 債	14,550
そ の 他	32,636	未 払 金	5,596
貸 倒 引 当 金	11	未 払 費 用	10,510
固 定 資 産	188,503	未 払 法 人 税 等	16,598
有 形 固 定 資 産	6,794	賞 与 引 当 金	28,250
建 器 具 ・ 備 品	5,191	資 産 除 去 債 務	75
土 地	1,312	そ の 他	2,923
リ ー ス 資 産	272	固 定 負 債	481,804
無 形 固 定 資 産	32,301	社 債	274,280
商 標	20,381	長 期 借 入 金	198,000
ソ フ ト ウ ェ ア	1,362	退 職 給 付 引 当 金	1,330
の れ ん	9,824	繰 延 税 金 負 債	5,780
そ の 他	732	資 産 除 去 債 務	1,932
投 資 そ の 他 の 資 産	149,407	そ の 他	481
投 資 有 価 証 券	59,597	特 別 法 上 の 準 備 金	402
関 係 会 社 株 式	60,063	金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金	402
長 期 貸 付 金	13,609	負 債 合 計	6,551,071
長 期 差 入 保 証 金	14,733	(純資産の部)	
長 期 前 払 費 用	133	株 主 資 本	561,705
そ の 他	6,943	資 本 金	10,000
貸 倒 引 当 金	5,672	資 本 剰 余 金	378,395
		そ の 他 資 本 剰 余 金	378,395
		利 益 剰 余 金	173,310
		そ の 他 利 益 剰 余 金	173,310
		繰 越 利 益 剰 余 金	173,310
		評 価 ・ 換 算 差 額 等	12,799
		そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	12,799
資 産 合 計	7,125,577	純 資 産 合 計	574,505
		負 債 ・ 純 資 産 合 計	7,125,577

## 第 5 期 損 益 計 算 書

(自平成 25 年 4 月 1 日 至平成 26 年 3 月 31 日)

(単位：百万円)

科 目	金 額	
営 業 収 益		333,430
受 入 手 数 料	184,069	
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	126,854	
金 融 収 益	22,505	
金 融 費 用		14,859
純 営 業 収 益		318,570
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費		221,895
取 引 関 係 費	40,035	
人 件 費	103,548	
不 動 産 関 係 費	18,311	
事 務 費	39,674	
減 価 償 却 費	6,685	
租 税 公 課	2,123	
そ の 他	11,515	
営 業 利 益		96,675
営 業 外 収 益		1,545
営 業 外 費 用		1,032
経 常 利 益		97,188
特 別 利 益		45
投 資 有 価 証 券 売 却 益	45	
特 別 損 失		610
固 定 資 産 除 却 損	80	
投 資 有 価 証 券 売 却 損	0	
投 資 有 価 証 券 等 評 価 損	219	
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入	243	
減 損 損 失	57	
過 剰 金 等	10	
税 引 前 当 期 純 利 益		96,623
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税		18,205
法 人 税 等 調 整 額		16,955
当 期 純 利 益		61,463

## 第 5 期 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

( 自平成 25 年 4 月 1 日 至平成 26 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	111,847	500,242	9,377	509,619
当期変動額						
当期純利益			61,463	61,463		61,463
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額 ( 純額 )					3,422	3,422
当期変動額合計	-	-	61,463	61,463	3,422	64,885
当期末残高	10,000	378,395	173,310	561,705	12,799	574,505

## 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 25 年 5 月 20 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 25 年 12 月 11 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

##### 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。

##### 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。

[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 479,662 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 214,590 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 1,519 百万円

短期借入金 284,600 百万円

計 286,119 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 4,815 百万円

信用取引借入金の本担保証券 1,568 百万円

消費貸借契約により貸し付けた有価証券 1,910,634 百万円

現先取引で売却した有価証券 612,103 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 2,950 百万円

信用取引貸付金の本担保証券 73,279 百万円

消費貸借契約により借り入れた有価証券 3,055,757 百万円

その他担保として受け入れた有価証券 140,587 百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 15,802 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	8,486	住宅融資制度に伴う金融機関借入金
S M B C 日興セキュリティーズ (シンガポール)	2,863	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	43,064 百万円
長期金銭債権	9,328 百万円
短期金銭債務	89,418 百万円
長期金銭債務	80,000 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	1,695 百万円
営業費用	58,069 百万円
営業取引以外の取引による取引高	228 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等であり  
ます。

また、「所得税法等の一部を改正する法律」（平成 26 年法律第 10 号）が平成 26 年 3 月 31 日に公布  
され、平成 26 年 4 月 1 日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が廃止されることとなりました。  
これに伴い、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、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 38.01%から 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 1,338 百万円減少し、法人税等調整額は 1,339 百万円  
増加しております。

## [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、お客様のさまざまな資産運用・資金調達ニーズに応えるべく、有価証券の売買等および売買等の委託の媒介、有価証券の引受けおよび売出し、有価証券の募集および売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い、ならびに金融業等を営んでおります。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、健全な財務基盤の維持を行っております。

#### (2) 金融商品の内容およびそのリスク

当社の保有する主な金融商品は、トレーディング商品の商品有価証券等およびデリバティブ取引であります。

デリバティブ取引には、取引所取引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等があり、取引所以外の取引には、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。これらトレーディング商品は、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、トレーディング商品以外で保有する有価証券は、主に株式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。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は、リスク管理全般に関する基本的な考え方等を明確化し、リスク管理に関するあらゆる規程が踏まえるべき基本的事項をリスク管理規程に定めております。

##### 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、担保の徴求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。なお、与信残高については、日次でモニタリングを行っており、与信先の信用状態については、経常的および決算時のモニタリングにより把握しています。また、信用リスク全体については、取引先リスク限度枠（単体および連結ベース）、信用バリュエーション・リスク（VaR）限度枠（単体ベース）を設定し管理しています。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。



## 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、市場リスク限度枠、市場バリュー・アット・リスク（VaR）限度枠、ポジション限度枠、損失ガイドライン等を設定し市場リスクを管理しております。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、定期的に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 による管理を行っています。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 26 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 575 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。直近 250 営業日（平成 25 年 3 月 25 日～平成 26 年 3 月 31 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 3 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、トレーディング商品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 の計測を行っています。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 26 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 1,944 百万円となっております。

なお、直近 250 営業日（平成 25 年 3 月 25 日～平成 26 年 3 月 31 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 9 回となっております。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。

平成 25 年 5 月～7 月においては、過去から統計的に予想される相場変動を上回る下落が発生し、この期間に 7 回の超過が発生しております。

## 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います。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。

#### 総合的なリスク管理

当社では、リスクカテゴリー横断的に独自の基準で算出したリスク量(以下、「リスク資本」)を用いて総合的なリスク管理を行い、リスクの総量を経営として許容できる水準にコントロールする態勢を構築しています。リスク資本の内訳として、信用リスク資本、市場リスク資本、投資有価証券リスク資本、オペレーショナルリスク資本を算出し、その合計額を当社の自己資本額対比で許容可能な割合に収まるよう制御しています。リスク資本による管理は平成 25 年 10 月より開始し、月次で計測を実施しています。

#### (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 26 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
<b>資産</b>			
(1) 現金・預金	508,556	508,556	
(2) 預託金	262,797	262,797	
(3) 商品有価証券等および投資有価証券	2,951,017	2,951,017	
商品有価証券等	2,901,840	2,901,840	
投資有価証券(注1)(注2)	49,177	49,177	
(4) 信用取引資産	83,414	83,414	
(5) 有価証券担保貸付金	2,864,875	2,864,875	
(6) 募集等払込金	20,262	20,262	
(7) 短期差入保証金	73,301	73,301	
(8) 長期貸付金(注2)	13,609		
貸倒引当金(*1)	45		
	13,563	13,563	
<b>資産計</b>	<b>6,777,789</b>	<b>6,777,789</b>	
<b>負債</b>			
(1) 商品有価証券等	1,713,083	1,713,083	
(2) 約定見返勘定	49,272	49,272	
(3) 信用取引負債(注3)	6,182	6,182	
(4) 有価証券担保借入金(注3)	2,526,101	2,526,101	
(5) 預り金	181,338	181,338	
(6) 受入保証金	45,604	45,604	
(7) 短期借入金(注3)	1,033,000	1,033,000	
(8) コマーシャル・ペーパー(注3)	277,500	277,500	
(9) 未払金	5,596	5,596	
(10) 未払法人税等	16,598	16,598	
(11) 社債(1年内償還予定の社債を含む)(注3)	288,830	288,830	
(12) 長期借入金(注3)	198,000	198,000	
<b>負債計</b>	<b>6,341,108</b>	<b>6,341,108</b>	
<b>デリバティブ取引(*2)</b>			
(1) ヘッジ会計が適用されていないもの	(6,454)	(6,454)	
(2) ヘッジ会計が適用されているもの			
<b>デリバティブ取引計</b>	<b>(6,454)</b>	<b>(6,454)</b>	

(\*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。

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。

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 13,043 百万円です。

投資有価証券の種類ごとの取得原価または償却原価、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	22,734	40,980	18,245
	(2) 債券			
	国債・地方債等			
	社債			
	その他			
	(3) その他			
	小計	22,734	40,980	18,245
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	8,816	8,197	619
	(2) 債券			
	国債・地方債等			
	社債			
	その他			
	(3) その他			
	小計	8,816	8,197	619
合計		31,551	49,177	17,626

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194百万円の減損処理を行っております。

当事業年度中において、従来その他有価証券として保有していた株式を関係会社株式に変更（貸借対照表計上額 828 百万円）しております。これは、当該株式に対する持分比率の増加により関係会社株式に該当することとなったため変更したものです。

(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) 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、(10) 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。

### (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。

### (11) 社債（1年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。

### (12) 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また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	485,817	390,136	58,421	10,271
	買建	456,403	369,556	54,238	458
	為替予約取引	417,410	23,620	2,501	2,501
	通貨スワップ取引	381,095	357,353	1,746	1,746
合計		1,740,725	1,140,667	4,937	9,975

(\*) 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	998		0	0
	買建	998		0	0
店頭	金利スワップ取引				
	受取固定・支払変動	4,013,212	3,541,645	58,886	58,886
	受取固定・支払固定	81,500	79,900	576	576
	受取変動・支払固定	3,981,872	3,358,367	58,816	58,816
	受取変動・支払変動	707,130	707,130	854	854
	金利スワップオプション取引				
	売建	118,000	43,000	1,959	427
	買建	64,700	5,000	537	228
	金利キャップ取引				
	売建	8,857	8,857	4	38
	買建	11,857	11,857	269	63
	金利フロア取引				
	売建				
	買建	1,000	1,000	88	6
合計		8,990,125	7,756,756	431	2,124

(\*) 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。

## (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	286,108		1,816	1,816
	買建	79,830		1,077	1,077
	株価指数オプション取引				
	売建	81,075	31,150	4,721	679
	買建	65,400	18,150	3,106	593
店頭	有価証券店頭先渡取引				
	売建				
	買建	14,995	381	262	262
	有価証券店頭オプション 取引				
	売建	298	298	33	21
	買建	8,887	5,722	1,558	1,478
	有価証券店頭指数等スワ ップ取引	31,583	29,550	521	521
合計	568,180	85,252	569	1,063	

(\*) 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	160,964		430	430
	買建	237,367		190	190
店頭	債券店頭オプション取引				
	売建	77,673		61	5
	買建	77,673		91	8
	債券先渡契約				
	売建	302		2	2
合計	553,980		271	244	

(\*) 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	263,050	250,200	3,641	3,641
	買建	265,650	251,000	5,292	5,292
合計		528,700	501,200	1,651	1,651

(\*) 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
非上場株式 (*1) (*2)	70,035
組合出資金 (*3)	417
その他 (*1)	30
長期差入保証金 (*4)	14,733
合計	85,217

(\*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、非上場株式には子会社株式 55,742 百万円、関連会社株式 4,320 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 24 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	30	6	410	
長期貸付金 (*)		0	16	
合計	30	7	427	

(\*) 長期貸付金のうち、破産更生債権等および償還予定日の見込が困難な 13,591 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	6,182			
有価証券担保借入金	2,526,101			
短期借入金	1,033,000			
コマーシャル・ペーパー	277,500			
社債(1年内償還予定の社債を含む)	14,550	121,555	18,475	134,250
長期借入金		83,000	47,500	67,500
合計	3,857,334	204,555	65,975	201,750

[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	80,000	長期借入金	80,000
				資金の返済	200,000		
				利息の支払	2,051	未払費用	1
				有価証券貸借 取引(注2) 支払品借料	1	借入有価証券 担保金 未払費用	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) 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3) 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	24,743	前払費用	1,889
						未払金	180
関係会社	SMB C日興セキ ュリティーズ・ア メリカ会社	所有： 直接 20%	現先取引 役員の兼任	現先取引 (注2) 現先取引費用	93	現先取引借入 金 未払費用	68,070 3

(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) 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3) 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

(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
親会社の子会社	英国S M B C 日興キャピタル・マーケット 会社		現先取引 役員の兼任	現先取引 (注2) 現先取引費用	17	現先取引借入金 未払費用	111,203 9

(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) 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3) 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。

### 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 2,872,512円28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 574,505百万円

普通株式に係る純資産の部 574,505百万円

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 307,315円59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 61,463百万円

普通株式に係る当期純利益 61,463百万円

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。