

第 7 期 貸 借 対 照 表

(平成 28 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	10,138,870	流動負債	9,046,716
現金・預金	667,574	トレーディング商品	2,464,579
預託金	308,132	商品有価証券等	1,907,003
トレーディング商品	3,673,124	デリバティブ取引	557,575
商品有価証券等	3,111,007	信用取引負債	8,098
デリバティブ取引	562,117	信用取引借入金	390
約定見返勘定	80,138	信用取引貸証券受入金	7,708
信用取引資産	75,113	有価証券担保借入金	5,104,859
信用取引貸付金	72,285	有価証券貸借取引受入金	3,865,744
信用取引借証券担保金	2,827	現先取引借入金	1,239,114
有価証券担保貸付金	5,007,451	預り金	231,438
借入有価証券担保金	5,000,521	受入保証金	86,738
現先取引貸付金	6,930	短期借入金	690,500
短期差入保証金	232,291	コマーシャル・ペーパー	367,000
前払費用	4,064	1年内償還予定の社債	54,546
未収収益	15,121	未払金	4,494
繰延税金資産	6,405	未払費用	11,836
その他	69,455	未払法人税等	1,341
貸倒引当金	△ 2	賞与引当金	20,300
固定資産	207,358	資産除去債務	73
有形固定資産	6,662	その他	908
建物	4,650	固定負債	627,881
器具・備品	1,198	社債	494,099
土地	0	長期借入金	124,100
リース資産	813	退職給付引当金	2,227
無形固定資産	24,710	繰延税金負債	4,476
商標	12,969	資産除去債務	2,011
ソフトウェア	2,279	その他	966
のれん	8,556	特別法上の準備金	1,129
その他	905	金融商品取引責任準備金	1,129
投資その他の資産	175,984	負債合計	9,675,727
投資有価証券	60,678	(純資産の部)	
関係会社株式	94,372	株主資本	656,689
長期貸付金	4,938	資本金	10,000
長期差入保証金	15,004	資本剰余金	378,395
長期前払費用	852	その他資本剰余金	378,395
その他	2,121	利益剰余金	268,294
貸倒引当金	△ 1,983	その他利益剰余金	268,294
		繰越利益剰余金	268,294
		評価・換算差額等	13,811
		その他有価証券評価差額金	13,811
資産合計	10,346,228	純資産合計	670,500
		負債・純資産合計	10,346,228

第 7 期 損 益 計 算 書

(自平成 27 年 4 月 1 日 至平成 28 年 3 月 31 日)

(単位：百万円)

科 目	金	額
営 業 収 益		297,929
受 入 手 数 料	158,380	
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	111,223	
金 融 収 益	28,324	
金 融 費 用		15,918
純 営 業 収 益		282,010
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費		235,029
取 引 関 係 費	41,853	
人 件 費	100,713	
不 動 産 関 係 費	19,145	
事 務 費	50,706	
減 価 償 却 費	6,655	
租 税 公 課	2,975	
そ の 他	12,979	
営 業 利 益		46,981
営 業 外 収 益		1,898
営 業 外 費 用		566
経 常 利 益		48,313
特 別 利 益		4,869
関 係 会 社 株 式 売 却 益	4,869	
特 別 損 失		5,106
投 資 有 価 証 券 等 評 価 損	126	
子 会 社 清 算 関 連 損 失	4,370	
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入	374	
減 損 損 失	235	
税 引 前 当 期 純 利 益		48,077
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税		9,925
法 人 税 等 調 整 額		5,034
当 期 純 利 益		33,117

第 7 期 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

(自平成 27 年 4 月 1 日 至平成 28 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	235,176	623,571	24,389	647,960
当期変動額						
当期純利益			33,117	33,117		33,117
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					△10,577	△10,577
当期変動額合計	-	-	33,117	33,117	△10,577	22,539
当期末残高	10,000	378,395	268,294	656,689	13,811	670,500

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）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）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）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 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払いに備えるため、支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

年金受給権者等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。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時に一括して費用処理しております。

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」（昭和 23 年法律第 25 号）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」（平成 19 年内閣府令第 52 号）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 279,843 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、借入有価証券等 101,171 百万円を担保として差し入れております。

(2) 担保資産の対象となる債務

短期借入金 150,000 百万円

計 150,000 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	7,808 百万円
信用取引借入金の本担保証券	373 百万円
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,855,653 百万円
現先取引で売却した有価証券	1,239,695 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	2,757 百万円
信用取引貸付金の本担保証券	64,591 百万円
消費貸借契約により借り入れた有価証券	5,161,182 百万円
現先取引で買い付けた有価証券	7,469 百万円
その他担保として受け入れた有価証券	95,724 百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 16,859 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	5,803	住宅融資制度に伴う金融機関借入金
SMBC Nikko Securities (Singapore) Pte. Ltd	2,919	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	54,425 百万円
長期金銭債権	367 百万円
短期金銭債務	1,223,748 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 6,833 百万円

営業費用 64,810 百万円

営業取引以外の取引による取引高 2,842 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、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 28 年法律第 15 号）が平成 28 年 3 月 29 日に成立し、平成 28 年 4 月 1 日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の 32.26%から、平成 28 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 30.86%に、平成 30 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 30.62%となります。この税率変更により繰延税金負債の純額が 49 百万円減少し、その他有価証券評価差額金は 259 百万円増加し、法人税等調整額は 309 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。

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取引先・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、事業推進等の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、リスク管理の基本方針を定めた「リスク管理規程」の下、各種リスクに対する管理方針を明文化しています。

① 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、市場リスク資本、信用リスク資本、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。リスク資本は、月次(平成28年4月1日基準より日次)でリスク資本枠の遵守状況を管理し、経営会議構成員若しくはリスクマネジメント委員会構成員に報告を行っております。

② 市場リスク

自己資本等の経営体力を勘案して定めるリスク資本やトレーディング業務の運用方針等を勘案し、市場リスク資本枠、市場バリュエーション・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。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、市場リスクの状況についてはリスク管理部が日々モニターするとともに定期的に経営会議構成員若しくはリスクマネジメント委員会構成員に報告を行っています。

<市場リスクに係る定量的情報>

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おり、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。

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。

(ア) トレーディング目的の金融商品

平成 28 年 3 月末現在でのトレーディング業務に係る市場 VaR は 10 億円となっております。

なお市場 VaR と損益を比較するバックテストの結果、直近 250 営業日において損失が市場 VaR を超えた回数は 2 回に止まっております。

(イ) トレーディング目的以外の金融商品

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。平成 28 年 3 月末現在での投資有価証券（上場株式）に係る市場 VaR は 22 億円となっております。

③ 信用リスク

当社は、自己資本等の経営体力を勘案して定めるリスク資本やトレーディング業務の運用方針等を勘案し、下記(ア)・(イ)を行っております。

(ア) 与信管理

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。

(イ) 信用リスク全体管理

信用リスク全体については、信用リスク資本枠、信用バリュー・アット・リスク (VaR) 限度枠等を設定し管理しています。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、信用リスクの状況については定期的に経営会議構成員若しくはリスクマネジメント委員会構成員に報告を行っています。

④ 資金調達に係る流動性リスクの管理

当社は、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。流動性リスクの状況については、定期的に経営会議構成員若しくはリスクマネジメント委員会構成員等に報告を行っております。

(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 28 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	667,574	667,574	—
(2) 預託金	308,132	308,132	—
(3) 商品有価証券等および投資有価証券	3,161,395	3,161,395	—
① 商品有価証券等	3,111,007	3,111,007	—
② 投資有価証券（注 1）（注 2）	50,387	50,387	—
(4) 約定見返勘定	80,138	80,138	—
(5) 信用取引資産	75,113	75,113	—
(6) 有価証券担保貸付金	5,007,451	5,007,451	—
(7) 短期差入保証金	232,291	232,291	—
(8) 長期貸付金（注 2）	4,938	4,938	—
資産計	9,537,035	9,537,035	—
負債			
(1) 商品有価証券等	1,907,003	1,907,003	—
(2) 信用取引負債（注 3）	8,098	8,098	—
(3) 有価証券担保借入金（注 3）	5,104,859	5,104,859	—
(4) 預り金	231,438	231,438	—
(5) 受入保証金	86,738	86,738	—
(6) 短期借入金（注 3）	690,500	690,500	—
(7) コマーシャル・ペーパー（注 3）	367,000	367,000	—
(8) 未払金	4,494	4,494	—
(9) 未払法人税等	1,341	1,341	—
(10) 社債（1 年内償還予定の社債を含む）（注 3）	548,646	548,646	—
(11) 長期借入金（1 年内返済予定の長期借入金を含む）（注 3）	124,100	124,100	—
負債計	9,074,221	9,074,221	—
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	4,541	4,541	—
(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	4,541	4,541	—

（*）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。

- 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△ 65,256 百万円です。
- ② 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	27,085	46,295	19,209
	(2) 債券	—	—	—
	① 国債・地方債等	—	—	—
	② 社債	—	—	—
	③ その他	—	—	—
	(3) その他	—	—	—
	小計	27,085	46,295	19,209
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1) 株式	4,614	4,092	△522
	(2) 債券	—	—	—
	① 国債・地方債等	—	—	—
	② 社債	—	—	—
	③ その他	—	—	—
	(3) その他	—	—	—
	小計	4,614	4,092	△522
合計		31,700	50,387	18,687

- 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あります。当事業年度において、投資有価証券について103百万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、従来その他有価証券として保有していた株式（貸借対照表計上額 6,000 百万円）を関係会社株式に変更しております。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) 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) 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

資産(3)の商品有価証券等と同様となっております。

(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（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。

(11) 長期借入金（1年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	779,525	626,608	△ 70,413	15,155
	買建	688,548	558,718	63,366	893
	為替予約取引	452,629	70,089	3,324	3,324
	通貨スワップ取引	1,518,598	1,375,676	17,831	17,831
	合計	3,439,302	2,631,092	14,108	37,204

(*) 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	24,820	—	3	3
	買建	—	—	—	—
店頭	金利スワップ取引				
	受取固定・支払変動	9,833,655	8,849,545	360,578	360,578
	受取固定・支払固定	123,200	120,600	2,018	2,018
	受取変動・支払固定	9,593,657	8,525,324	△ 342,602	△ 342,602
	受取変動・支払変動	1,830,064	1,657,314	1,705	1,705
	金利スワップション取引				
	売建	897,559	379,000	△ 30,624	△ 11,886
	買建	627,709	350,000	7,892	871
	金利キャップ取引				
	売建	13,857	8,000	△ 414	100
	買建	39,857	34,000	775	△ 665
	金利フロア取引				
	売建	5,000	5,000	△ 154	30
買建	16,000	16,000	330	△ 45	
合計		23,005,380	19,944,784	△ 491	10,108

(*) 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	540,556	—	△ 1,859	△ 1,859
	買建	152,261	23,912	△ 1,804	△ 1,804
	株価指数オプション取引				
	売建	206,423	118,394	△ 19,465	2,151
	買建	139,845	67,456	8,501	△ 2,235
店頭	有価証券店頭先渡取引				
	売建	4,236	—	151	151
	買建	7,722	400	333	333
	有価証券店頭オプション 取引				
	売建	23,237	5,588	△ 2,960	△ 53
	買建	18,498	7,805	2,673	1,272
	有価証券店頭指数等スワ ップ取引	202,199	164,789	8,599	8,599
合計		1,294,982	388,346	△ 5,831	6,554

(*) 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	312,623	—	△ 264	△ 264
	買建	384,469	—	△ 772	△ 772
	債券先物オプション取引				
	売建	139,950	—	△ 364	△ 102
	買建	18,300	—	15	△ 15
店頭	債券店頭オプション取引				
	売建	155,731	—	△ 427	△ 138
	買建	159,658	—	324	38
合計		1,170,732	—	△ 1,488	△ 1,254

(*) 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	387,115	346,615	2,502	2,502
	買建	394,115	340,165	△ 4,257	△ 4,257
合計		781,230	686,780	△ 1,755	△ 1,755

(*) 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)	103,949
② 組合出資金 (*3)	713
③ 長期差入保証金(*4)	15,004
合計	119,667

(*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、非上場株式会社には子会社株式 46,521 百万円、関連会社株式 47,851 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 16 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いません。
- (*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いません。

(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	—	369	—	295
長期貸付金(*)	—	—	12	—
合計	—	369	12	295

(*)長期貸付金のうち、償還予定期日の見込が困難な 4,926 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	8,098	—	—	—
有価証券担保借入金	5,104,859	—	—	—
短期借入金	690,500	—	—	—
コマーシャル・ペーパー	367,000	—	—	—
社債(1年内償還予定の社債を含む)	54,546	236,399	49,815	207,884
長期借入金(1年内返済予定の長期借入金を含む)	—	2,500	34,500	87,100
合計	6,225,004	238,899	84,315	294,984

[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（注1）	科目	期末残高（注1）
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	—	1年以内返済 予定の長期借 入金	—
				資金の返済	80,000		
				利息の支払	525	未払費用	—
				有価証券貸借 取引（注2） 貸借料の受取	— 4	借入有価証券 担保金 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）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記載しております。

（注3）取引条件および取引条件の決定方針等

市場実勢等を勘案して取引条件を決定しております。

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（注1）	科目	期末残高（注1）
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 役員の兼任	情報サービス 等の受入	33,792	前払費用	2,619
						未払金	247
関連会社	SMBC Nikko Capital Markets Limited	所有： 直接 15.15%	現先取引 役員の兼任	現先取引 （注2）	—	現先取引借入 金	437,090
				現先取引費用	856	未払費用	210
関連会社	SMBC Nikko Securities America, Inc.	所有： 直接 20%	現先取引	現先取引 （注2）	—	現先取引借入 金	781,237
				現先取引費用	2,479	未払費用	474

（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記載しております。

（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条件または市場実勢等を勘案して取引条件を決定しております。

3. 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	3,352,487円81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	670,500百万円
普通株式に係る純資産の部	670,500百万円
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	165,588円67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	33,117百万円
普通株式に係る当期純利益	33,117百万円
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。