

第 9 期 貸 借 対 照 表

(平成 30 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	10,289,385	流動負債	8,981,432
現金・預金	883,338	トレーディング商品	2,494,694
預託金	611,280	商品有価証券等	1,993,514
トレーディング商品	3,179,742	デリバティブ取引	501,179
商品有価証券等	2,681,112	約定見返勘定	55,326
デリバティブ取引	498,629	信用取引負債	14,844
信用取引資産	212,033	信用取引借入金	2,498
信用取引貸付金	192,717	信用取引貸証券受入金	12,345
信用取引借証券担保金	19,315	有価証券担保借入金	5,006,004
有価証券担保貸付金	5,027,756	有価証券貸借取引受入金	4,042,870
借入有価証券担保金	4,956,494	現先取引借入金	963,134
現先取引貸付金	71,261	預り金	416,289
短期差入保証金	259,258	受入保証金	130,384
前払費用	4,421	短期借入金	488,700
未収収益	20,620	1年内返済予定の長期借入金	100,000
繰延税金資産	10,383	コマーシャル・ペーパー	145,700
その他	80,562	1年内償還予定の社債	68,160
貸倒引当金	12	未払金	11,871
固定資産	262,491	未払費用	13,183
有形固定資産	9,056	未払法人税等	2,935
建物	6,477	賞与引当金	31,863
器具・備品	1,780	資産除去債務	476
土地	4	その他	999
リース資産	793	固定負債	785,572
無形固定資産	18,466	社債	585,836
商標	5,559	長期借入金	175,550
ソフトウェア	4,688	退職給付引当金	2,559
のれん	7,289	繰延税金負債	18,916
その他	930	資産除去債務	1,986
投資その他の資産	234,968	その他	723
投資有価証券	114,266	特別法上の準備金	2,397
関係会社株式	95,023	金融商品取引責任準備金	2,397
長期貸付金	4,937	負債合計	9,769,402
長期差入保証金	17,573	(純資産の部)	
長期前払費用	2,853	株主資本	735,758
その他の	1,902	資本	10,000
貸倒引当金	1,589	資本剰余金	457,714
		その他資本剰余金	457,714
		利益剰余金	268,044
		利益準備金	2,500
		その他利益剰余金	265,544
		繰越利益剰余金	265,544
		評価・換算差額等	46,715
		その他有価証券評価差額金	46,715
資産合計	10,551,876	純資産合計	782,473
		負債・純資産合計	10,551,876

第 9 期 損 益 計 算 書

(自平成 29 年 4 月 1 日 至平成 30 年 3 月 31 日)

(単位 : 百万円)

科 目	金	額
営 業 収 益		376,016
受 入 手 数 料	188,550	
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	147,326	
金 融 収 益	40,140	
金 融 費 用		30,792
純 営 業 収 益		345,223
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費		260,333
取 引 関 係 費	39,925	
人 件 費	116,361	
不 動 産 関 係 費	20,552	
事 務 費	57,492	
減 価 償 却 費	7,496	
租 税 公 課	4,573	
そ の 他	13,930	
営 業 利 益		84,890
営 業 外 収 益		3,088
営 業 外 費 用		481
経 常 利 益		87,497
特 別 利 益		-
特 別 損 失		6,298
減 損 損 失	414	
投 資 有 価 証 券 等 評 価 損	118	
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入	665	
統 合 関 連 費 用	5,099	
税 引 前 当 期 純 利 益		81,199
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税		16,368
法 人 税 等 調 整 額		7,076
当 期 純 利 益		57,754

第 9 期 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

(自平成 29 年 4 月 1 日 至平成 30 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	利益準備金	その他利 益剰余金 繰越利益 剰余金				
当期首残高	10,000	378,395	2,500	105,227	496,122	16,515	512,638	
当期変動額								
剰余金の配当				11,830	11,830		11,830	
当期純利益				57,754	57,754		57,754	
合併による増加		79,319		114,391	193,710	28,725	222,436	
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)						1,474	1,474	
当期変動額合計	-	79,319	-	160,316	239,635	30,200	269,835	
当期末残高	10,000	457,714	2,500	265,544	735,758	46,715	782,473	

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「有価証券関連業經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

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。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備および構築物については定額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(5年)、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の見込額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

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

当社は、当事業年度より株式会社三井住友フィナンシャルグループを連結納税親会社とする連結納税制度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

デリバティブ取引等に係る担保として、以下のものを差し入れています。

トレーディング商品 17,921 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 25,789 百万円を担保として差し入れています。

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 12,573 百万円

信用取引借入金の本担保証券 2,461 百万円

消費貸借契約により貸し付けた有価証券 4,055,746 百万円

現先取引で売却した有価証券 963,414 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」のトレーディング商品および借入有価証券等)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 19,457 百万円

信用取引貸付金の本担保証券 178,929 百万円

消費貸借契約により借り入れた有価証券 5,268,881 百万円

現先取引で買い付けた有価証券 71,438 百万円

その他担保として受け入れた有価証券 138,315 百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 18,012 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	3,799	住宅融資制度に伴う金融機関借入金
SMBN Nikko Securities (Singapore) Pte. Ltd	2,836	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

短期金銭債権 42,237 百万円

長期金銭債権 340 百万円

短期金銭債務 717,804 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	6,128 百万円
営業費用	64,353 百万円
営業取引以外の取引による取引高	229 百万円

[株主資本等変動計算書に関する注記]

1. 発行済株式に関する事項

普通株式	200,001 株
------	-----------

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)
平成 29 年 6 月 26 日定時株主総会	普通株式	11,830

[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、繰延税金負債の発生の主な原因は、
その他有価証券評価差額等であります。

[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、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、引受け等を中核とする営業活動を営んでおり、様々な金融商品を保有しております。また、これらの業務を行うにあたり、コール、CP、ミディアム・ターム・ノート、仕組みローン等の短期・長期調達手段を分散することで安定的な資金調達を実施しております。

当社では、保有する金融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、財務の健全性維持・向上のため、リスクの所在及びリスクの種類・特性を明確にし、各種リスクの測定、モニタリング及び管理等により、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

当社のトレーディング業務において保有する主な金融商品は、株式や債券等の現物取引、取引所デリバティブ取引（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等）および店頭デリバティブ取引（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これらのオプション取引等）であり、顧客需要への対応やマーケットメーカー業務、保有金融商品のヘッジ等からポジションが発生しております。

これらの金融商品は、金利・為替・株価等の市場リスク、取引先・発行体の信用リスク、取引の執行にかかる流動性リスクに晒されております。

トレーディング業務以外で保有する金融商品は、事業推進目的で保有している株式等の投資有価証券であり、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。

レポ取引やコールマネー等は、一定の環境の下で当社が市場を利用できなくなり必要な資金確保が困難になるなどの資金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

金融商品を多額に保有している当社では、取締役会の決議により「リスク管理規程」をリスク管理の基本方針として定め、また取締役会の諮問機関としてリスクマネジメント委員会を設置しております。同委員会では定期的にリスク管理に関する全般的方針および具体的方針を協議し、審議事項等の結果ならびに重要事項および異例事項等については取締役会に報告しております。

総合的なリスク管理

当社は、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、統合的なリスク管理をしております。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、その合計額に対してリスク資本枠を設定し、当社の自己資本額対比で許容可能な水準に収まるよう管理しております。リスク資本の状況については、日次でリスク資本枠の遵守状況をモニタリングし、経営会議構成員および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。

市場リスク

当社は、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。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リングするとともに定期的に経営会議構成員および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。

< 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ます。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、市場 VaR と損益を比較するバックテストの定期的な実施により有効性を確認しております。

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を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 30 年 3 月末現在でのトレーディング業務に係る市場 VaR は 6 億円となっております。

(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、平成 30 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 47 億円となっております。

信用リスク

当社は、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おります。

(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おります。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および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。

資金流動性リスクの管理

当社は、トレーディング業務の運用方針等を勘案し、資金ギャップ枠、資金ポジション枠等を設定し資金流動性リスクを管理しており、当該リスク顕在化時およびその虞がある場合に備え、コンティンジェンシープランを策定しております。また、資金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および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。

(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、異なった条件等で算出された場合には、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 30 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	883,338	883,338	
(2) 預託金	611,280	611,280	
(3) 商品有価証券等および投資有価証券	2,783,519	2,783,519	
商品有価証券等	2,681,112	2,681,112	
投資有価証券(注1)(注2)	102,406	102,406	
(4) 信用取引資産	212,033	212,033	
(5) 有価証券担保貸付金	5,027,756	5,027,756	
(6) 短期差入保証金	259,258	259,258	
(7) 長期貸付金(注2)	4,937	4,937	
資産計	9,782,124	9,782,124	
負債			
(1) 商品有価証券等	1,993,514	1,993,514	
(2) 約定見返勘定	55,326	55,326	
(3) 信用取引負債(注3)	14,844	14,844	
(4) 有価証券担保借入金(注3)	5,006,004	5,006,004	
(5) 預り金	416,289	416,289	
(6) 受入保証金	130,384	130,384	
(7) 短期借入金(注3)	488,700	488,700	
(8) コマーシャル・ペーパー(注3)	145,700	145,700	
(9) 未払金	11,871	11,871	
(10) 未払法人税等	2,935	2,935	
(11) 社債(1年内償還予定の社債を含む)(注3)	653,997	653,997	
(12) 長期借入金(1年内返済予定の長期借入金を含む)(注3)	275,550	275,550	
負債計	9,195,117	9,195,117	
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	(2,550)	(2,550)	
(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	(2,550)	(2,550)	

(*) 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等によっており、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、取引所の価格又は公表されている基準価額等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 3,434 百万円です。

投資有価証券の種類ごとの取得原価、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	31,745	98,457	66,711
	(2) 債券			
	国債・地方債等			
	社債			
	その他			
	(3) その他			
	小計	31,745	98,457	66,711
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	4,554	3,949	605
	(2) 債券			
	国債・地方債等			
	社債			
	その他			
	(3) その他			
	小計	4,554	3,949	605
合計		36,300	102,406	66,105

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 97 百万円の減損処理を行っております。

(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) 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。

(7) 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) 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。

(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（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	840,466	594,616	57,357	22,837
	買建	755,475	498,137	49,828	4,819
	為替予約取引	344,155	64,989	1,691	1,691
	通貨スワップ取引	2,137,929	2,043,791	38,913	38,913
	合計	4,078,027	3,201,534	33,076	58,623

(*) 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	17,752,117	14,818,148	119,175	119,175
	受取固定・支払固定	63,402	48,902	1,483	1,483
	受取変動・支払固定	17,384,234	14,553,300	127,634	127,634
	受取変動・支払変動	2,357,231	2,223,945	2,354	2,354
	金利スワップション取引				
	売建	2,388,926	1,056,025	24,164	7,316
	買建	1,848,045	729,600	10,741	6,844
	金利キャップ取引				
	売建	15,000	15,000	218	374
	買建	85,000	85,000	441	1,391
	金利フロア取引				
	売建	72,000	72,000	178	166
	買建	57,000	57,000	277	506
	合計	42,022,956	33,658,921	17,721	5,505

(*) 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	252,802	9,744	4,674	4,674
	買建	96,337	3,140	1,142	1,142
	株価指数オプション取引				
	売建	824,858	374,414	68,330	8,239
	買建	715,922	327,012	41,873	1,959
店頭	有価証券店頭先渡取引				
	売建				
	買建	7,564	207	537	537
	有価証券店頭オプション 取引				
	売建	115,375	44,950	12,214	1,274
	買建	127,577	30,605	15,708	6,561
	有価証券店頭指数等スワ ップ取引	241,252	198,870	6,957	6,957
	合計	2,381,690	988,945	19,001	2,970

(*) 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	203,237		853	853
	買建	165,562		83	83
	債券先物オプション取引				
	売建	257,434		84	20
	買建	45,157		11	3
店頭	債券店頭オプション取引				
	売建	43,576		150	66
	買建	43,576		112	12
	債券先渡契約				
	売建	900		2	2
	買建	5,359		40	40
合計		764,803		1,005	956

(*) 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	463,200	404,700	6,851	6,851
	買建	473,660	401,410	4,750	4,750
合計		936,860	806,110	2,101	2,101

(*) 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
非上場株式等 (*1) (*2)	106,883
長期差入保証金 (*3)	17,573
合計	124,456

- (*1) 非上場株式等については、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いません。なお、非上場株式等には子会社株式47,171百万円、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、非上場株式等について14百万円の減損処理を行っております。
- (*3) 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		327	1,500	—
長期貸付金(*)		11	—	
合計		339	1,500	

(*)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	14,844			
有価証券担保借入金	5,006,004			
短期借入金	488,700			
コマーシャル・ペーパー	145,700			
社債(1年内償還予定の社債を含む)	68,160	275,091	75,225	235,519
長期借入金(1年内返済予定の長期借入金を含む)	100,000	6,550	37,100	131,900
合計	5,823,409	281,641	112,325	367,419

[関連当事者との取引に関する注記]

1. 親会社

該当事項はありません。

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	システムの開発と保守と運用	39,960	前払費用	3,096
						未払金	3,638
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) 現先取引費用	1,891	現先取引借入金 未払費用	185,035 75
関連会社	SMBC Nikko Securities America, Inc.	所有： 直接 20%	現先取引	現先取引(注2) 現先取引費用	7,766	現先取引借入金 未払費用	522,270 829

(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。

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(注1)	科目	期末残高(注1)
親会社の 子会社	株式会社 三井住友銀行		資金の借入 役員の兼任	資金の借入	366	1年内返済予定の長期借入金	100,000
				資金の返済		未払費用	6
				利息の支払			

(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

市場実勢等を勘案して取引条件を決定しております。

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	3,912,349 円 67 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	782,473 百万円
普通株式に係る純資産の部	782,473 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	288,772 円 18 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	57,754 百万円
普通株式に係る当期純利益	57,754 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。

[その他の注記]

(企業結合等に関する注記)

当社とS M B C フレンド証券株式会社との合併について

当社は平成 28 年 9 月 30 日付合併契約に基づき、S M B C フレンド証券株式会社と、平成 30 年 1 月 1 日付で合併いたしました。

合併に関する取引の概要および実施した会計処理の概要は次のとおりであります。

(1) 取引の概要

結合当事企業の名称およびその事業の内容

項目	結合企業	被結合企業
結合当事企業の名称	S M B C 日興証券株式会社	S M B C フレンド証券株式会社
事業の内容	金融商品取引業	金融商品取引業

企業結合日

平成 30 年 1 月 1 日

企業結合の法的形式

当社を存続会社、S M B Cフレンド証券株式会社を消滅会社とする吸収合併方式

なお、当社およびS M B Cフレンド証券株式会社の発行済株式は、本件合併の効力発生の直前において、当社の親会社である株式会社三井住友フィナンシャルグループがその全てを所有しているため、本件合併に際し、S M B Cフレンド証券株式会社の株主に対する株式または金銭などの交付はありません。

結合後企業の名称

S M B C日興証券株式会社

その他取引の概要に関する事項

当社およびS M B Cフレンド証券株式会社の合併により、(ア)商品・リサーチの多様化、各種チャネルの充実、コンサルティング型営業の強化を通じ、顧客満足度の一層の向上を図ること、(イ)競争力強化、業界内の地位向上によって、両社の役職員に対し、より働きがいのある活躍の場を提供すると共に、全体最適な営業員再配置による生産性向上を図ること、(ウ)重複機能、システム及び販売チャネル等の経営インフラの統廃合によるコストシナジーを実現し、強靱な経営体質へと転換を図ることを企図しております。

(2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」および「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の適正な帳簿価額ならびに引き継いだ純資産の額とこれらの主な内訳

流動資産	255,638 百万円
固定資産	51,634 百万円
資産合計	307,273 百万円
流動負債	71,577 百万円
固定負債	12,987 百万円
特別法上の準備金	272 百万円
負債合計	84,837 百万円
資本剰余金	79,319 百万円
利益剰余金	114,391 百万円
その他有価証券評価差額金	28,725 百万円
純資産合計	222,436 百万円

損益計算書に含まれている被結合企業の業績の期間

平成 30 年 1 月 1 日から平成 30 年 3 月 31 日まで

企業結合が当事業年度の開始の日に完了したと仮定した場合の当事業年度の損益計算書に及ぼす影響の概算額及びその算定方法

純営業収益	23,439 百万円
経常利益	510 百万円

(概算額の算定方法)

被結合企業の事業年度開始の日から企業結合日の前日までの業績情報を、影響の概算額としております。なお、当該概算額は監査証明の対象外です。