

第 11 期 貸 借 対 照 表

(2020 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	11,811,309	流動負債	10,733,722
現金・預金	978,559	トレーディング商品	2,687,785
預託金	656,655	商品有価証券等	1,830,488
トレーディング商品	3,296,436	デリバティブ取引	857,297
商品有価証券等	2,366,587	信用取引負債	83,133
デリバティブ取引	929,848	信用取引借入金	235
約定見返勘定	93,647	信用取引貸証券受入金	82,897
信用取引資産	110,223	有価証券担保借入金	5,560,921
信用取引貸付金	101,217	有価証券貸借取引受入金	1,555,878
信用取引借証券担保金	9,006	現先取引借入金	4,005,042
有価証券担保貸付金	6,172,183	預り金	455,776
借入有価証券担保金	4,047,831	受入保証金	248,815
現先取引貸付金	2,124,351	短期借入金	1,185,250
短期差入保証金	409,907	コマーシャル・ペーパー	294,000
前払費用	4,418	1年内償還予定の社債	164,434
未収収益	21,258	未払金	11,604
その他の他	68,062	未払費用	13,641
貸倒引当金	44	未払法人税等	4,151
固定資産	279,641	賞与引当金	20,210
有形固定資産	10,740	資産除去債務	169
建物	7,164	その他の他	3,829
器具・備品	1,694	固定負債	549,504
土地	0	社債	421,639
リース資産	1,880	長期借入金	114,700
無形固定資産	14,338	退職給付引当金	3,315
商標	2	繰延税金負債	5,869
ソフトウェア	6,714	資産除去債務	2,756
のれん	6,021	その他の他	1,224
その他の他	1,599	特別法上の準備金	3,145
投資その他の資産	254,562	金融商品取引責任準備金	3,145
投資有価証券	96,808	負債合計	11,286,372
関係会社株式	103,451	(純資産の部)	
長期貸付金	34,935	株主資本	770,252
長期差入保証金	16,038	資本	10,000
長期前払費用	3,034	資本剰余金	457,714
その他の他	1,681	その他資本剰余金	457,714
貸倒引当金	1,386	利益剰余金	302,538
		利益準備金	2,500
		その他利益剰余金	300,038
		繰越利益剰余金	300,038
		評価・換算差額等	34,325
		その他有価証券評価差額金	34,325
資産合計	12,090,950	純資産合計	804,578
		負債・純資産合計	12,090,950

第 11 期 損 益 計 算 書

(自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日)

(単位：百万円)

科 目	金	額
営 業 収 益		378,017
受 入 手 数 料	193,699	
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	103,639	
金 融 収 益	80,678	
金 融 費 用		74,691
純 営 業 収 益		303,326
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費		264,318
取 引 関 係 費	40,464	
人 件 費	111,613	
不 動 産 関 係 費	22,536	
事 務 費	61,210	
減 価 償 却 費	7,523	
租 税 公 課	5,430	
そ の 他	15,541	
営 業 利 益		39,007
営 業 外 収 益		4,214
営 業 外 費 用		600
経 常 利 益		42,621
特 別 利 益		2,653
投 資 有 価 証 券 売 却 益	2,653	
特 別 損 失		3,383
減 損 損 失	525	
投 資 有 価 証 券 等 評 価 損	2,217	
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入	297	
店 舗 解 約 違 約 金	343	
税 引 前 当 期 純 利 益		41,891
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税		11,815
法 人 税 等 調 整 額		2,091
当 期 純 利 益		32,167

第 11 期 株 主 資 本 等 変 動 計 算 書

(自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 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	457,714	2,500	276,290	746,504	42,429	788,934	
当期変動額								
剰余金の配当				8,420	8,420		8,420	
当期純利益				32,167	32,167		32,167	
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						8,103	8,103	
当期変動額合計	-	-	-	23,747	23,747	8,103	15,643	
当期末残高	10,000	457,714	2,500	300,038	770,252	34,325	804,578	

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。なお、投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方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、2016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) 無形固定資産および長期前払費用

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、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。

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[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

デリバティブ取引および資金決済等の取引に係る担保として、以下のものを差し入れています。

トレーディング商品 60,840 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 128,654 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 81,476 百万円

信用取引借入金の本担保証券 210 百万円

消費貸借契約により貸し付けた有価証券 1,708,996 百万円

現先取引で売却した有価証券 4,043,014 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 8,644 百万円

信用取引貸付金の本担保証券 82,385 百万円

消費貸借契約により借り入れた有価証券 4,360,439 百万円

現先取引で買い付けた有価証券 2,109,517 百万円

その他担保として受け入れた有価証券 138,190 百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 15,957 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	2,249	住宅融資制度に伴う金融機関借入金
SMBN Nikko Securities (Singapore) Pte. Ltd	3,436	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 30,460 百万円

長期金銭債権 266 百万円

短期金銭債務 1,463,345 百万円

長期金銭債務 13 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	5,107 百万円
営業費用	72,008 百万円
営業取引以外の取引による取引高	464 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)
2019年6月17日定時株主総会	普通株式	8,420

[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、リスク管理に係る重要事項については、取締役会または「経営会議の一部を構成する会議」であるリスクマネジメント会議にて決定される体制となっております。リスクマネジメント会議では、定期的にはリスク管理に関する全般的方針および具体的方針の策定、見直しを行っております。

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、リスクマネジメ

ント会議構成員に報告を行っております。

当社では、RAF (Risk Appetite Framework) の枠組を通じて、多様化しているリスクを認識、適切に管理、コントロールし、当社の健全性を維持しながら収益性の向上が図れるようリスク管理体制の整備と実践に取り組んでいます。

また、顕在化した際に当社への影響が大きいリスク事象をトップリスクとして選定し、経営レベルでリスク管理体制の充分性または必要性ならびに資本の充分性を検討する体制を整備することにより、経営の安定性と健全性の確保に取り組んでいます。

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リスクマネジメント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リスクマネジメント会議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

2020 年 3 月末現在でのトレーディング業務に係る市場 VaR は 7 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、2020 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 27 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、リスクマネジメント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リスクマネジメント会議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、定期的にリスクマネジメント会議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

2020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	978,559	978,559	
(2) 預託金	656,655	656,655	
(3) 商品有価証券等および投資有価証券	2,448,668	2,448,668	
商品有価証券等	2,366,587	2,366,587	
投資有価証券(注1)(注2)	82,080	82,080	
(4) 約定見返勘定	93,647	93,647	
(5) 信用取引資産(注2)	110,223	110,223	
(6) 有価証券担保貸付金	6,172,183	6,172,183	
(7) 短期差入保証金	409,907	409,907	
(8) 長期貸付金(注2)	34,935	33,773	1,161
資産計	10,904,781	10,903,619	1,161
負債			
(1) 商品有価証券等	1,830,488	1,830,488	
(2) 信用取引負債(注3)	83,133	83,133	
(3) 有価証券担保借入金(注3)	5,560,921	5,560,921	
(4) 預り金	455,776	455,776	
(5) 受入保証金	248,815	248,815	
(6) 短期借入金(注3)	1,185,250	1,185,250	
(7) コマーシャル・ペーパー(注3)	294,000	294,000	
(8) 未払金	11,604	11,604	
(9) 未払法人税等	4,151	4,151	
(10) 社債(1年内償還予定の社債を含む)(注3)	586,073	586,073	
(11) 長期借入金(1年内返済予定の長期借入金を含む)(注3)	114,700	114,700	
負債計	10,374,914	10,374,914	
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	72,551	72,551	
(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	72,551	72,551	

(*) 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) 商品有価証券等および投資有価証券

株式等については取引所の価格等によっており、債券等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 2,904 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	18,207	68,672	50,465
	(2) 債券			
	国債・地方債等			
	社債			
	その他			
	(3) その他			
	小計	18,207	68,672	50,465
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	15,120	13,408	1,712
	(2) 債券			
	国債・地方債等			
	社債			
	その他			
	(3) その他			
	小計	15,120	13,408	1,712
合計		33,328	82,080	48,752

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2,212百万円の減損処理を行っております。

(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。なお、一部の長期貸付金については、約定金利により算出した将来キャッシュ・フローの見積額を貸付先の信用状況を勘案したレートにて割り引いた現在価値をもって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	1,110,697	703,722	61,363	19,487
	買建	905,475	557,112	54,592	5,164
	為替予約取引	717,313	106,847	1,585	1,585
	通貨スワップ取引	3,378,257	2,938,631	98,326	98,326
	合計	6,111,744	4,306,313	89,970	111,064

(*) 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	17,382,059	15,179,602	500,695	500,695
	受取固定・支払固定	63,502	43,902	1,138	1,138
	受取変動・支払固定	17,060,498	15,117,306	485,576	485,576
	受取変動・支払変動	3,025,179	2,548,298	568	568
	金利スワップション取引				
	売建	2,843,615	1,354,792	56,301	19,080
	買建	2,175,820	946,180	23,625	883
	金利キャップ取引				
	売建	28,984	28,984	99	722
	買建	85,000	70,000	76	1,756
	金利フロア取引				
	売建	108,000	108,000	731	131
買建	57,000	42,000	378	405	
	合計	42,829,659	35,439,066	16,225	2,942

(*) 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	365,463	3,250	4,631	4,631
	買建	184,386	30,247	897	897
	株価指数等オプション取引				
	売建	625,316	253,364	69,629	15,540
	買建	471,035	197,739	31,349	1,452
店頭	有価証券店頭先渡取引				
	売建				
	買建	2,614	28	448	448
	有価証券店頭オプション取引				
	売建	121,132	22,442	23,662	12,608
	買建	121,205	38,253	24,614	17,113
	有価証券店頭指数等スワップ取引	327,382	182,498	32,907	32,907
	合計	2,218,537	727,825	9,500	18,243

(*) 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等によっております。

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	39,321		256	256
	買建	59,978		286	286
	債券先物オプション取引				
	買建	2,992		10	0
店頭	債券店頭オプション取引				
	売建	298,310		119	1,242
	買建	298,310		8,252	6,675
	債券先渡契約				
	買建	499		0	0
合計		699,412		8,174	7,949

(*) 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	822,675	717,221	8,580	8,580
	買建	786,098	691,327	8,712	8,712
合計		1,608,773	1,408,549	132	132

(*) 時価の算定方法

金利、取引期間、参照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)	118,178
長期差入保証金 (*3)	16,038
合計	134,217

- (*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55,599百万円、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2百万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日後の償還予定額

(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			4,915	65
信用取引資産(*)	95,713			
長期貸付金(*)		30,008	—	
合計	95,713	30,008	4,915	65

(*)信用取引資産のうち、期間の定めのないものである14,509百万円および長期貸付金のうち、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(*)	22,200			
有価証券担保借入金	5,560,921			
短期借入金	1,185,250			
コマーシャル・ペーパー	294,000			
社債(1年内償還予定の社債を含む)	164,434	192,563	86,428	142,646
長期借入金(1年内返済予定の長期借入金を含む)		6,000	10,700	98,000
合計	7,226,807	198,563	97,128	240,646

(*)信用取引負債のうち、期間の定めのないものである60,932百万円は、上記の区分に含めておりません。

[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	36,071	前払費用 未払金	3,098 294
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	1,064	現先取引借入金 未収収益	261,818 99
関連会社	SMBC Nikko Securities America, Inc.	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	20,128	現先取引借入金 未払費用	1,193,775 1,800

(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 資金の返済 利息の支払	12,170,500 12,020,500 25	短期借入金 未払費用	350,000 1

(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	4,022,872 円 27 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	804,578 百万円
普通株式に係る純資産の部	804,578 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	160,837 円 17 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	32,167 百万円
普通株式に係る当期純利益	32,167 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]

(会社分割)

当社は 2020 年 2 月 17 日付けで締結した吸収分割契約に基づき、2020 年 4 月 1 日付で日興プロパティーズ株式会社 (以下「NP」) が営む一切の事業に関して NP が有する権利義務の一部を当社に承継させる吸収分割 (以下「本吸収分割」) を実施いたしました。

(1) 本吸収分割の目的

株式会社三井住友フィナンシャルグループ (以下「SMFG」) は、NP を母体会社とし、グループ各社が利用する不動産の工事・施設保守業務を集約 (シェアードサービス化) することといたしました。そのため、NP が営む事業に関して NP が有する権利義務の一部を当社に継承させる吸収分割を行ったうえで、当社が保有する NP 株式を SMFG へ現物配当することにより、NP を SMFG の直接の子会社としております。

(2) 吸収分割によって承継する事業の内容等及び資産及び負債の帳簿価額

事業の内容

不動産の管理並びに賃借

信用保証業務

吸収分割によって承継する事業の経営成績 (2020 年 3 月期)

売上高 1,887 百万円

売上高には連結内部売上高を含んでおります。

吸収分割によって承継する資産及び負債の帳簿価額（2020年3月期）

資産の額	12,860 百万円
負債の額	5,068 百万円

（3）本吸収分割の時期

2020年4月1日

（4）本吸収分割の方式

当社を継承会社とし、NPを分割会社とする吸収分割（簡易吸収分割）

（5）本吸収分割に際して交付する金銭等

本吸収分割は、当社と当社100%子会社であるNPとの間で行われるため、本吸収分割に際して当社からNPへ株式その他の金銭等の交付は行いません。

（6）実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成31年1月16日）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」（企業会計基準適用指針第10号 平成31年1月16日）に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（7）その他の重要な事項

子会社株式の現物配当

当社は本吸収分割が効力を生じることを条件として、以下のとおり現物配当を行いました。

配当財産の種類及び帳簿価額の総額

配当財産の種類：NPの普通株式10,000株

帳簿価額の総額：1,233百万円（2020年3月31日現在）

但し、本吸収分割の効力発生により、帳簿価額の総額は1百万円となります。

配当財産の割当てに関する事項

当社の株主に対し、その保有する当社の株式1株につき、NPの株式の普通株式200,001分の10,000株を割り当てる。

現物配当が効力を生ずる日

2020年4月1日

[その他の注記]

該当事項はありません。