

業務及び財産の状況に関する説明書

【平成29年3月期】

この説明書は、金融商品取引法第46条の4および第57条の4の規定に基づき、全ての営業所又は事務所に備え置き、公衆の縦覧に供するため作成したものです。

三菱UFJモルガン・スタンレー証券

目 次

| | 頁 |
|--|----|
| I. 当社の概況および組織 | 1 |
| 1. 商号 | 1 |
| 2. 登録年月日（登録番号） | 1 |
| 3. 沿革および経営の組織 | 1 |
| (1) 会社の沿革 | 1 |
| (2) 経営の組織 | 2 |
| 4. 主な株主の名称、保有株式数および議決権の保有割合 | 5 |
| 5. 役員の氏名又は名称 | 5 |
| 6. 政令で定める使用人の氏名 | 6 |
| (1) 金融商品取引業に関し、法令等を遵守するための指導に関する業務を統括する 使用人の氏名 | 6 |
| (2) 投資助言業務又は投資運用業に関し、助言又は運用を行う部門を統括する使用 人の氏名 | 6 |
| 7. 業務の種別 | 6 |
| 8. 金融商品取引法第 3 条各号に掲げる有価証券又は金融商品取引所に上場されてい ない有価証券についての電子募集取扱業務 | 6 |
| 9. 本店その他の営業所又は事務所の名称および所在地 | 7 |
| 10. 他にしている業務の種類 | 8 |
| 11. 加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の 名称 | 8 |
| 12. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号 | 8 |
| 13. 加入する投資者保護基金の名称 | 8 |
| 14. 金融商品取引業等に関する内閣府令第 7 条第 3 号イ及び第 4 号から第 9 号までに 掲げる事項 | 8 |
| 15. 苦情処理及び紛争解決の体制 | 9 |
| II. 業務の状況 | 10 |
| 1. 当期の業務の概要 | 10 |
| 2. 業務の状況を示す指標 | 13 |
| (1) 経営成績等の推移 | 13 |
| (2) 受入手数料の内訳 | 13 |
| (3) トレーディング損益の内訳 | 14 |
| (4) その他の自己取引に係る損益の内訳 | 14 |
| (5) 株券売買高 | 14 |
| (6) 有価証券の引受け及び売出し並びに特定投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の 募集、売出し及び私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況 | 15 |
| (7) その他業務の状況 | 17 |
| (8) 自己資本規制比率の状況 | 19 |

| | |
|--|----|
| (9) 使用人の総数および外務員の総数 | 19 |
| III. 財産の状況 | 20 |
| 1. 経理の状況 | 20 |
| (1) 貸借対照表 | 20 |
| (2) 損益計算書 | 23 |
| (3) 株主資本等変動計算書 | 24 |
| (4) 注記事項 | 26 |
| 2. 借入金の主要な借入先および借入金額 | 32 |
| (1) 短期借入金 | 32 |
| (2) 1年内返済予定の長期借入金 | 32 |
| (3) 長期借入金 | 32 |
| (4) 信用取引借入金 | 32 |
| 3. 保有有価証券の時価等（トレーディングに係るもの以外） | 33 |
| 4. デリバティブ取引の契約額等（トレーディングに係るもの以外） | 34 |
| 5. 財務諸表に関する監査法人による監査の有無 | 35 |
| IV. 管理の状況 | 36 |
| 1. 内部管理の状況の概要 | 36 |
| (1) コンプライアンス体制 | 36 |
| (2) リスク管理体制 | 37 |
| (3) 危機管理体制 | 39 |
| (4) 内部監査体制 | 39 |
| 2. 分別管理等の状況 | 40 |
| (1) 金融商品取引法第43条の2の規定に基づく分別管理の状況 | 40 |
| (2) 金融商品取引法第43条の2の2の規定に基づく区分管理の状況 | 41 |
| (3) 金融商品取引法第43条の3の規定に基づく区分管理の状況 | 41 |
| V. 当社及びその子法人等の概況 | 42 |
| 1. 特別金融商品取引業者の商号 | 42 |
| 2. 特別金融商品取引業者の登録年月日（登録番号） | 42 |
| 3. 特別金融商品取引業者の届出日 | 42 |
| 4. 主要な事業の内容及び組織の構成 | 42 |
| 5. 子法人等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、 事業の内容等 | 44 |
| VI. 当社及びその子法人等の業務の状況 | 45 |
| 1. 当連結会計年度の業務の概要 | 45 |
| (1) 受入手数料 | 45 |
| (2) トレーディング損益 | 45 |
| (3) 金融収支 | 45 |

| | |
|--|-----------|
| (4) 販売費・一般管理費 | 45 |
| (5) 特別損益 | 45 |
| 2. 業務の状況を示す指標 | 46 |
| VII. 当社及びその子法人等の財産の状況に関する事項 | 47 |
| 1. 経理の状況 | 47 |
| (1) 連結貸借対照表 | 47 |
| (2) 連結損益計算書及び連結包括利益計算書 | 50 |
| (3) 連結株主資本等変動計算書 | 51 |
| (4) 注記事項 | 52 |
| 2. 借入金の主要な借入先および借入金額 | 58 |
| (1) 短期借入金 | 58 |
| (2) 1年内返済予定の長期借入金 | 58 |
| (3) 長期借入金 | 58 |
| (4) 信用取引借入金 | 58 |
| 3. 保有する有価証券（トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券 を除く。）の取得価額、時価及び評価損益 | 58 |
| (1) 満期保有目的の債券で時価のあるもの | 58 |
| (2) その他有価証券で時価のあるもの | 59 |
| (3) 時価を把握することが極めて困難と認められる主な有価証券の内容等 | 59 |
| 4. デリバティブ取引（トレーディング商品に属するものとして経理された取引を 除く。）の契約価額、時価及び評価損益 | 59 |
| (1) ヘッジ会計が適用されていないもの | 59 |
| (2) ヘッジ会計が適用されているもの | 59 |
| 5. 経営の健全性の状況 | 60 |

I. 当社の概況および組織

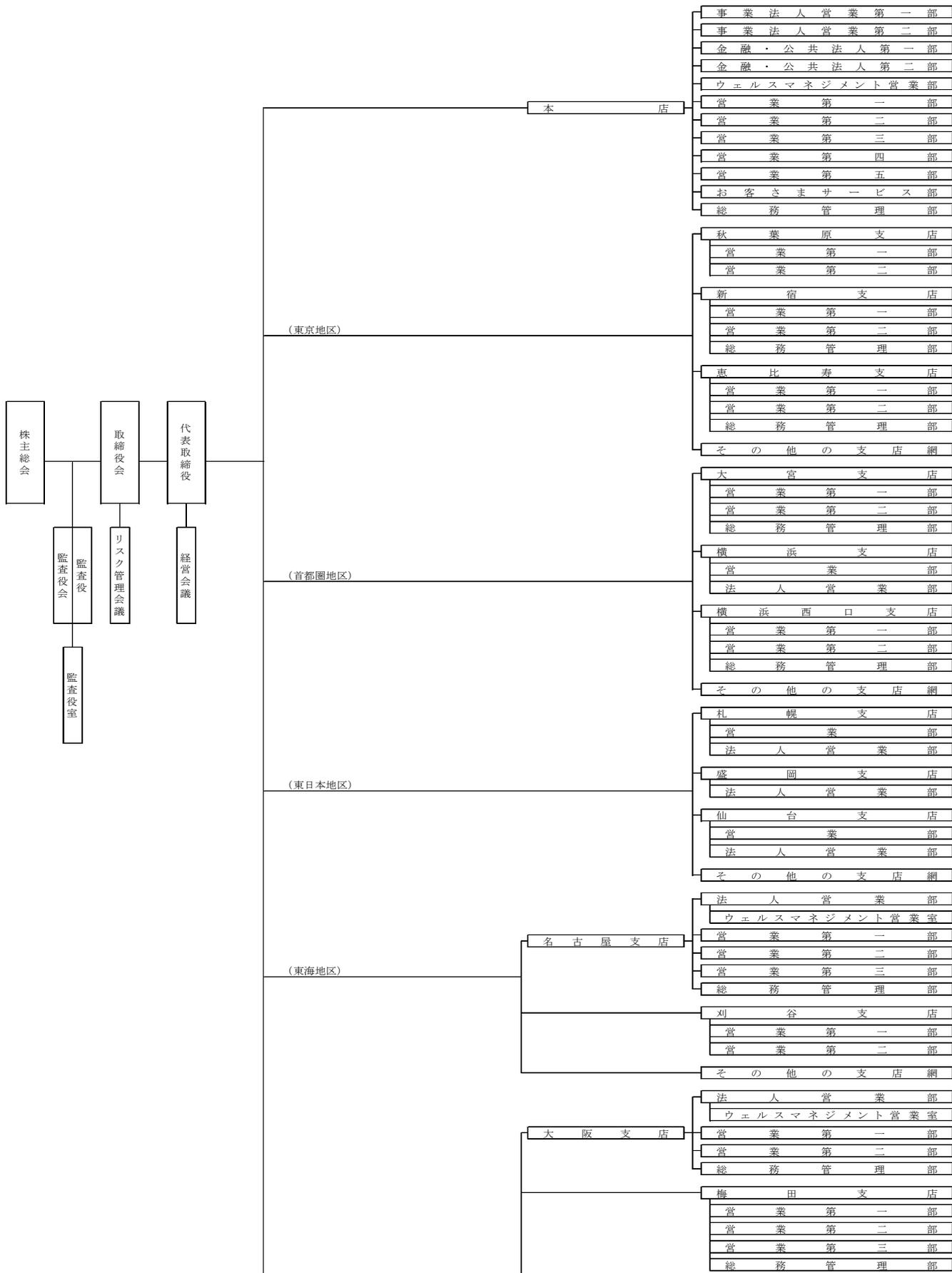
1. 商 号 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
2. 登録年月日 金融商品取引業者登録 平成22年2月10日
(登録番号) (関東財務局長(金商)第2336号)
3. 沿革および経営の組織

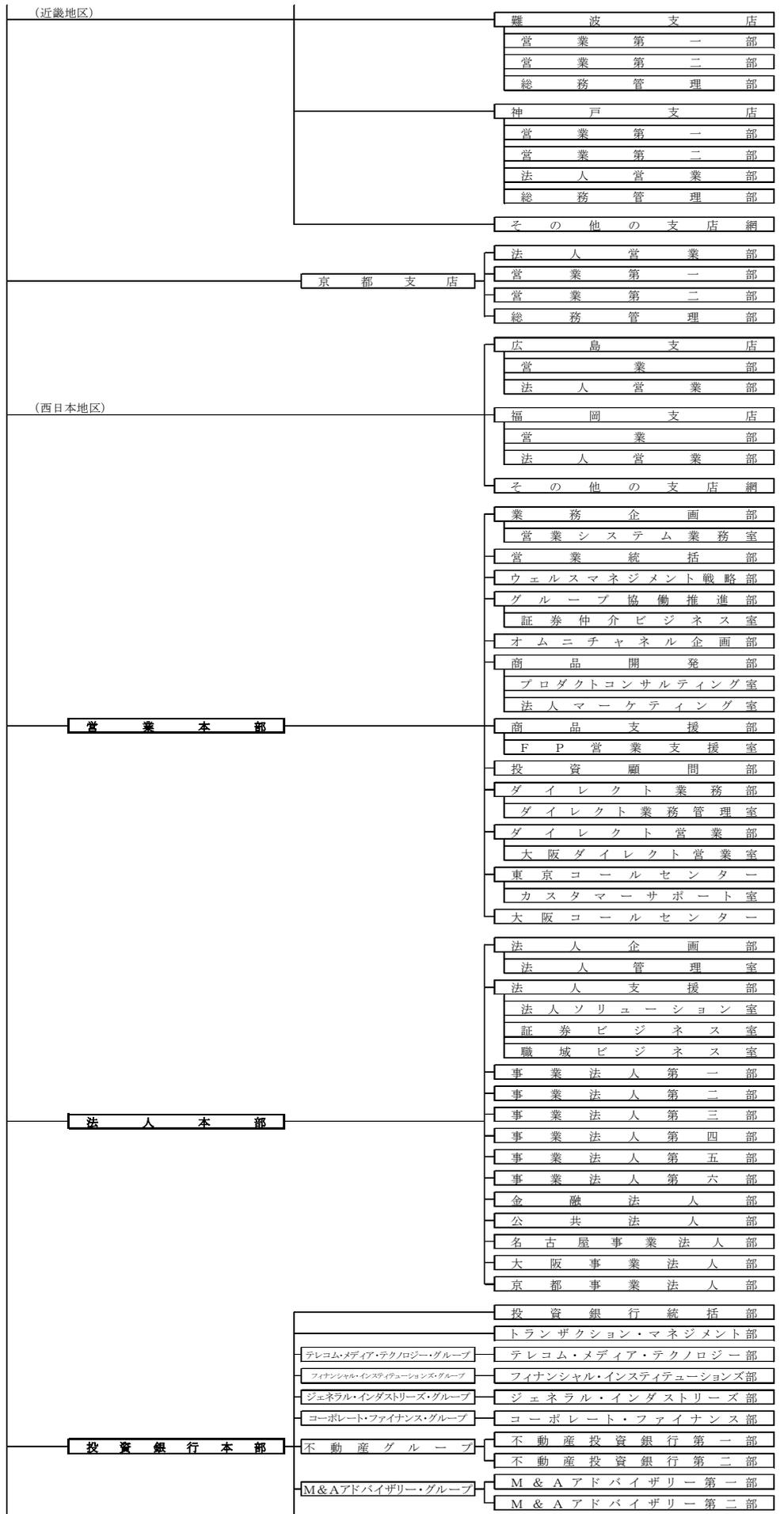
(1) 会社の沿革

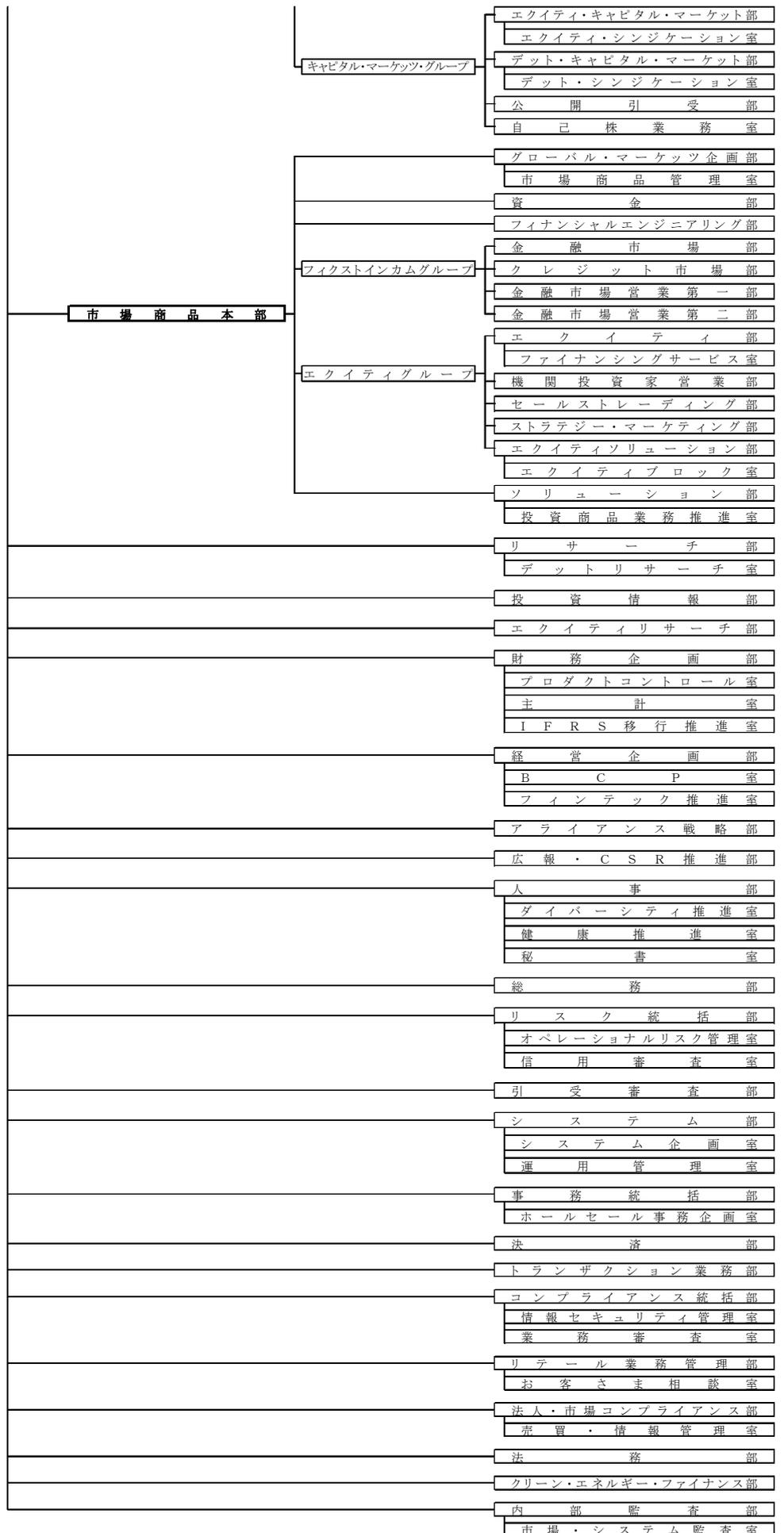
| 年 月 | 沿 革 |
|----------|---|
| 平成21年12月 | 三菱UFJ証券分割準備株式会社として設立。 |
| 22年 2月 | 第一種および第二種金融商品取引業ならびに投資運用業登録。 |
| 22年 4月 | 三菱UFJ証券株式会社(現三菱UFJ証券ホールディングス株式会社)より金融商品取引業等を承継し、三菱UFJ証券株式会社に商号変更。 |
| 22年 5月 | モルガン・スタンレー証券株式会社(現モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社)のインベストメントバンキング業務を統合し、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社に商号変更。 |
| 26年 3月 | 三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社(旧三菱UFJメリルリンチPB証券株式会社)を子会社化。 |
| 26年 6月 | 投資助言・代理業登録。 |

(2) 経営の組織

(平成 29 年 6 月 30 日現在)







4. 主な株主の名称、保有株式数および議決権の保有割合

(平成29年6月30日現在)

| 株 主 名 | 保 有 株 式 数 | 議 決 権 の 保 有 割 合 |
|---------------------|-------------------------------------|--------------------|
| 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 | B種種類株式 60株 C種種類株式 26,765株 | 60.00% |
| M M パ ー ト ナ ー シ ッ プ | A種種類株式 40株 D種種類株式 112,400株 | 40.00% |
| 計 2 名 | 139,265株 | 100.00% |

5. 役員の氏名又は名称

(平成29年6月30日現在)

| 役 職 名 | 氏 名 | 代表権の有無 | 常勤・非常勤の別 |
|--------|--------------|--------|----------|
| 取締役会長 | ジョナサン・キンドレッド | 無 | 非常勤 |
| 取締役社長 | 長 岡 孝 | 有 | 常 勤 |
| 取締役副社長 | 佐 藤 清 | 有 | 常 勤 |
| 取締役副社長 | 中 村 春 雄 | 有 | 常 勤 |
| 取締役副社長 | 浅 井 滋 | 有 | 常 勤 |
| 専務取締役 | 二 宮 明 雄 | 無 | 常 勤 |
| 常務取締役 | 中 村 哲 也 | 無 | 常 勤 |
| 常務取締役 | 三 杯 力 | 無 | 常 勤 |
| 常務取締役 | 円 城 寺 貢 | 無 | 常 勤 |
| 取 締 役 | 楨 原 稔 | 無 | 非常勤 |
| 取 締 役 | 小 野 寺 隆 実 | 無 | 常 勤 |
| 取 締 役 | 面 圭 史 | 無 | 非常勤 |
| 取 締 役 | 佐 藤 保 雄 | 無 | 非常勤 |
| 取 締 役 | クリストファー・ダーク | 無 | 非常勤 |
| 取 締 役 | 池 垣 真 里 | 無 | 非常勤 |
| 常勤監査役 | 熊 田 充 男 | 無 | 常 勤 |
| 監 査 役 | 細 見 昌 裕 | 無 | 非常勤 |
| 常勤監査役 | 額 額 良 二 | 無 | 常 勤 |
| 監 査 役 | 五 十 嵐 誠 | 無 | 非常勤 |

(注) 取締役のジョナサン・キンドレッド、楨原 稔、面 圭史、佐藤 保雄、クリストファー・ダークおよび池垣 真里は社外取締役であり、また、監査役の額額 良二、五十嵐 誠は社外監査役であります。

6. 政令で定める使用人の氏名

- (1) 金融商品取引業に関し、法令等を遵守するための指導に関する業務を統括する使用人の氏名
(平成 29 年 6 月 30 日現在)

| 氏 名 | 役 職 名 |
|-------|-------------------|
| 春日 博 | コンプライアンス統括部長 |
| 関川 猛 | リテール業務管理部長 |
| 奥山 栄俊 | 法人・市場コンプライアンス部長 |
| 長澤 明人 | リテール業務管理部お客さま相談室長 |

- (2) 投資助言業務又は投資運用業に関し、助言又は運用を行う部門を統括する使用人の氏名
(平成 29 年 6 月 30 日現在)

| 氏 名 | 役 職 名 |
|-------|-----------------------|
| 早川 洋一 | 投資顧問部長 |
| 宮本 諭 | 投資顧問部 投資顧問課長 |
| 迫 良二 | 投資顧問部 投資顧問課 副参事 |
| 増山 潤 | 投資顧問部 投資顧問課 部長代理 |
| 清水 利彦 | 投資顧問部 投資顧問課 部長代理 |
| 斉藤 伴幸 | ウェルスマネジメント営業部 第二課長 |
| 大町 法生 | ウェルスマネジメント営業部 第一課 副参事 |

7. 業務の種別 (平成 29 年 6 月 30 日現在)

- ・金融商品取引法第 28 条第 1 項第 1 号に掲げる行為に係る業務
 - ① 有価証券の売買、市場デリバティブ取引又は外国市場デリバティブ取引
 - ② 有価証券の売買、市場デリバティブ取引又は外国市場デリバティブ取引の媒介、取次ぎ又は代理
 - ③ 取引所金融商品市場における有価証券の売買又は市場デリバティブ取引の委託の媒介、取次ぎ又は代理
 - ④ 外国金融商品市場における有価証券の売買又は外国市場デリバティブ取引の委託の媒介、取次ぎ又は代理
 - ⑤ 有価証券等清算取次ぎ
 - ⑥ 有価証券の売出し又は特定投資家向け売付け勧誘等
 - ⑦ 有価証券の募集若しくは売出しの取扱い又は私募若しくは特定投資家向け売付け勧誘等の取扱い
- ・金融商品取引法第 28 条第 1 項第 2 号に掲げる行為に係る業務
 - ① 店頭デリバティブ取引又はその媒介、取次ぎ若しくは代理
 - ② 店頭デリバティブ取引についての有価証券等清算取次ぎ
- ・金融商品取引法第 28 条第 1 項第 3 号イに掲げる行為に係る業務
有価証券の元引受けであって、損失の危険の管理の必要性の高いもの
- ・金融商品取引法第 28 条第 1 項第 3 号ロに掲げる行為に係る業務
有価証券の元引受けであって、損失の危険の管理の必要性の高いもの以外のもの
- ・金融商品取引法第 28 条第 1 項第 3 号ハに掲げる行為に係る業務
有価証券の引受けであって、有価証券の元引受け以外のもの
- ・有価証券等管理業務
- ・第二種金融商品取引業
- ・投資助言・代理業
- ・投資運用業

8. 金融商品取引法第 3 条各号に掲げる有価証券又は金融商品取引所に上場されていない有価証券についての電子募集取扱業務

該当なし

9. 本店その他の営業所又は事務所の名称および所在地（平成29年6月30日現在）

| (名 称) | (所 在 地) |
|-----------------|--------------------|
| (本 店 等) | |
| 本 店 | 千代田区丸の内 2-5-2 |
| 本店大手町本館 | 千代田区大手町 1-9-2 |
| 本店大手町別館 | 千代田区大手町 1-9-7 |
| 本店目白台別館 | 文京区目白台 3-29-20 |
| (北 海 道 ・ 東 北) | |
| 札 幌 支 店 | 札幌市中央区北二条西 3-1 |
| 盛 岡 支 店 | 盛岡市大通 1-9-12 |
| 仙 台 支 店 | 仙台市青葉区一番町 4-6-1 |
| 福 島 支 店 | 福島市本町 5-6 |
| (東 京 都 内) | |
| 秋 葉 原 支 店 | 千代田区外神田 3-16-8 |
| 新 宿 支 店 | 新宿区新宿 4-1-6 |
| 恵 比 寿 支 店 | 渋谷区恵比寿 4-20-3 |
| 玉 川 支 店 | 世田谷区玉川 2-21-1 |
| 池 袋 支 店 | 豊島区東池袋 1-17-8 |
| 立 川 支 店 | 立川市曙町 2-37-7 |
| 吉 祥 寺 支 店 | 武蔵野市吉祥寺南町 1-6-1 |
| 町 田 支 店 | 町田市森野 1-13-14 |
| (関 東) | |
| 水 戸 支 店 | 水戸市泉町 3-1-28 |
| 宇 都 宮 支 店 | 宇都宮市大通り 1-2-11 |
| 前 橋 支 店 | 前橋市表町 2-2-6 |
| 所 沢 支 店 | 所沢市日吉町 18-1 |
| 大 宮 支 店 | さいたま市大宮区宮町 1-109-1 |
| 市 川 支 店 | 市川市市川 1-23-6 |
| 柏 支 店 | 柏市末広町 7-3 |
| 千 葉 支 店 | 千葉市中央区新町 1-19 |
| 横 浜 支 店 | 横浜市中区羽衣町 1-2-8 |
| 横 浜 西 口 支 店 | 横浜西区北幸 1-11-11 |
| 湘 南 支 店 | 藤沢市南藤沢 4-3 |
| 小 田 原 支 店 | 小田原市本町 2-1-35 |
| 川 崎 支 店 | 川崎市川崎区砂子 2-4-13 |
| 甲 府 支 店 | 甲府市丸の内 2-16-5 |
| (愛 知 県 内) | |
| 名 古 屋 支 店 | 名古屋市中区錦 3-21-24 |
| 名 古 屋 駅 前 支 店 | 名古屋市中村区名駅南 1-24-20 |
| 豊 橋 支 店 | 豊橋市駅前大通 1-27 |
| 刈 谷 支 店 | 刈谷市相生町 1-1-1 |

| (名 称) | (所 在 地) |
|---------------|----------------------|
| (中 部 ・ 北 陸) | |
| 新 潟 支 店 | 新潟市中央区東大通 1-3-1 |
| 富 山 支 店 | 富山市桜橋通り 6-13 |
| 金 沢 支 店 | 金沢市香林坊 2-3-25 |
| 長 野 支 店 | 長野市南千歳 1-19-4 |
| 岐 阜 支 店 | 岐阜市神田町 7-7-6 |
| 浜 松 支 店 | 浜松市中区鍛冶町 140-4 |
| 三 島 支 店 | 三島市中央町 1-36 |
| 静 岡 支 店 | 静岡市葵区御幸町 5-9 |
| 津 支 店 | 津市東丸之内 22-14 |
| (大 阪 府 内) | |
| 大 阪 支 店 | 大阪市中央区北浜 1-9-11 |
| 梅 田 支 店 | 大阪市北区梅田 1-8-17 |
| 難 波 支 店 | 大阪市中央区難波 2-2-3 |
| 堺 東 支 店 | 堺市堺区北瓦町 2-4-13 |
| (近 畿) | |
| 京 都 支 店 | 京都市下京区四条通烏丸東入長刀鉾町 10 |
| 神 戸 支 店 | 神戸市中央区明石町 48 |
| 姫 路 支 店 | 姫路市豊沢町 140 |
| 奈 良 支 店 | 奈良市西大寺東町 2-1-56 |
| 和 歌 山 支 店 | 和歌山市十番丁 19 |
| (中 国 ・ 四 国) | |
| 岡 山 支 店 | 岡山市北区平和町 1-1 |
| 福 山 支 店 | 福山市伏見町 4-38 |
| 広 島 支 店 | 広島市中区基町 13-9 |
| 下 関 支 店 | 下関市細江町 1-2-7 |
| 高 松 支 店 | 高松市南新町 1-1 |
| 松 山 支 店 | 松山市一番町 4-1-1 |
| 高 知 支 店 | 高知市本町 1-1-3 |
| (九 州 ・ 沖 縄) | |
| 北 九 州 支 店 | 北九州市小倉北区京町 2-7-8 |
| 福 岡 支 店 | 福岡市博多区博多駅中央街 8-1 |
| 長 崎 支 店 | 長崎市賑町 7-12 |
| 熊 本 支 店 | 熊本市中央区水道町 7-16 |
| 鹿 児 島 支 店 | 鹿児島市千日町 15-5 |
| 那 覇 支 店 | 那覇市久茂地 2-14-3 |

10. 他に行っている業務の種類（平成 29 年 6 月 30 日現在）

- ・ 金融商品取引法第 35 条第 2 項第 2 号に係る業務
商品の価格その他の指標に係る変動、市場間の格差等を利用して行う取引に係る業務
- ・ 金融商品取引法第 35 条第 2 項第 3 号に係る業務
貸金業その他金銭の貸付け又は金銭の貸借の媒介に係る業務
- ・ 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 68 条第 1 号に係る業務
金地金の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 4 号に係る業務
貸出参加契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 5 号に係る業務
保険募集に係る業務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 8 号に係る業務
他の事業者の業務に関する電子計算機のプログラムの作成又は販売を行う業務及び計算受託業務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 12 号に係る業務
信託業務を営む金融機関が行う以下の業務に係る契約の締結の媒介（当該信託業務を営む金融機関のための行うものに限る。）に係る業務
 - （1） 財産に関する遺言の執行に係る業務、又は、財産の取得、処分若しくは貸借に関する代理若しくは媒介に係る業務のうち遺言の執行に関するもの
 - （2） 次に掲げる業務のうち遺産の整理に関するもの
 - ① 財産の取得、処分又は貸借に関する代理又は媒介
 - ② 財産の整理又は清算に関する代理事務
 - ③ 債権の取立てに関する代理事務
 - ④ 債務の履行に関する代理事務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 16 号に係る業務
算定割当量の取得若しくは譲渡に関する契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理を行う業務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 20 号に係る業務
債務の保証又は引受けに係る契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ・ 金融商品取引業等に関する内閣府令第 68 条第 21 号に係る業務
当社が行う業務に係る顧客に対し他の事業者のあっせん又は紹介を行う業務

11. 加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称

（平成 29 年 6 月 30 日現在）

金融商品取引業協会：

- ・ 日本証券業協会
- ・ 一般社団法人 日本投資顧問業協会
- ・ 一般社団法人 金融先物取引業協会
- ・ 一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

12. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号（平成 29 年 6 月 30 日現在）

- ・ 株式会社東京証券取引所
- ・ 株式会社名古屋証券取引所
- ・ 株式会社大阪取引所
- ・ 証券会員制法人福岡証券取引所
- ・ 証券会員制法人札幌証券取引所
- ・ 株式会社東京金融取引所

13. 加入する投資者保護基金の名称（平成 29 年 6 月 30 日現在）

- ・ 日本投資者保護基金

14. 金融商品取引業等に関する内閣府令第 7 条第 3 号イ及び第 4 号から第 9 号までに掲げる事項

（平成 29 年 6 月 30 日現在）

- ・ 有価証券関連業
- ・ 不動産信託受益権等売買等業務
- ・ 不動産関連特定投資運用業

15. 苦情処理及び紛争解決の体制（平成 29 年 6 月 30 日現在）

第一種金融商品取引業については、金融商品取引法第 37 条の 7 第 1 項第 1 号イの規定に基づき、金融庁から指定紛争解決機関として指定を受けた特定非営利活動法人証券・金融商品あっせん相談センター（F I N M A C）との間で手続実施基本契約を締結する措置を講じています。

第二種金融商品取引業については、金融商品取引法第 37 条の 7 第 1 項第 2 号ロに規定する苦情処理措置および紛争解決措置として、一般社団法人第二種金融商品取引業協会（F I N M A C に業務委託）または一般社団法人金融先物取引業協会（F I N M A C に業務委託）を利用する措置を講じています。

投資運用業については、金融商品取引法第 37 条の 7 第 1 項第 4 号ロに規定する苦情処理措置および紛争解決措置として、一般社団法人日本投資顧問業協会（F I N M A C に業務委託）を利用する措置を講じています。

尚、貸金業務については、日本貸金業協会と手続実施基本契約を締結し、同協会が運営する貸金業相談・紛争解決センターを利用して、貸金業務に関する苦情・紛争の解決を図っております。

II. 業務の状況

1. 当期の業務の概要

当期の我が国の景気は、緩やかな回復基調で推移しました。海外景気が持ち直す中、輸出が増加し、製造業の生産回復を後押ししました。個人消費は総じて底堅く、調整局面が続いた設備投資も持ち直しつつあります。住宅投資は夏場に弱含みましたが、その後は貸家を中心に回復しています。夏場から年末にかけて低迷が続いた公共投資は、10月に成立した平成28年度第2次補正予算の本格執行を受けて、増加に転じました。

株式市場では、16,719円でスタートした日経平均株価が、18,909円で終了しました。株価は当初、資源高や円安を好感して堅調に推移したものの、英国のEU離脱決定などの悪材料が相次いだことから下落し、日経平均株価は6月に一時15,000円を割り込みました。しかし7月以降は、日銀の上場投資信託（ETF）買入れ増額などを反映して株価は反転し、11月以降は、米国大統領選挙に勝利したトランプ氏の経済政策への期待感や、石油輸出国機構（OPEC）加盟国と非加盟国の協調減産合意を背景に、株価は上昇基調を強めました。年明け1月には、英国がEU単一市場へのアクセスを失う「ハード・ブレグジット」への警戒感から株価は弱含みましたが、トランプ米大統領の経済政策へ期待感が強いこともあり、株価は再び持ち直しました。

債券市場では、長期金利（新発10年国債利回り）が▲0.040%で始まり、0.065%で終了しました。日銀のマイナス金利政策や英国のEU離脱などを反映して、10年債利回りは7月に一時▲0.300%まで低下しました。しかし、日銀がマイナス金利の深掘りを見送ったことから、長期金利は夏場にかけて急上昇しました。9月下旬には、欧州系銀行の財務不安などから長期金利が低下する局面もありましたが、その後はトランプ米大統領による財政支出の拡大観測や、米利上げ観測の高まりなどから、長期金利は上昇傾向を辿りました。年明け以降は、日銀の国債買入れの減額観測から、長期金利が一時0.15%まで上昇しましたが、日銀が指定する利回りで国債を無制限に買入れる指し値オペを実施したことを受けて、長期金利は低下基調に転じました。

このような環境の下、当期の営業収益は2,700億69百万円（前期比89.3%）、経常利益は504億82百万円（同64.9%）、純利益は357億20百万円（同64.1%）となりました。

当期の主要な収益・費用の概況は以下のとおりです。

① 受入手数料

受入手数料の合計は1,225億69百万円で前期比82.0%となりました。内訳は次のとおりです。

a. 委託手数料

当期の東証の1日平均売買高（内国普通株合計）は、株数で25億40百万株（前期比86.0%）、金額で2兆7,399億円（同88.9%）となりました。このような状況のもと、当社の株式委託手数料は277億37百万円（同85.4%）、債券委託手数料は26百万円（同24.1%）、受益証券委託手数料は13億46百万円（同75.0%）、その他の委託手数料は46百万円（同139.6%）となり、委託手数料は合計で291億56百万円（同84.7%）となりました。

b. 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料

株式発行市場は、民営化や大型の売出しが複数あったものの、発行会社による資本調達への慎重な姿勢が見られ、前年度と比べて発行量は大きく減少しました。当社はこのような環境の下、既公開会社の公募・売出しで8件、新規公開で5件、既公開REITの公募・売出しで7件、REITの新規公開で1件の主幹事をつとめました。

債券発行市場は、マイナス金利政策による超低金利環境を受けた超長期債の起債や、金融機関による資本規制に対応した起債、事業会社によるハイブリッド債の起債等により、発行量は前期比増加しました。当社はこのような環境の下、普通社債で273件、財投機関債で66件、地方債・地方公社債等で97件、円

建外債で34件の主幹事をつとめました。

以上の結果、当期の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は164億円（前期比86.4%）となりました。

c. 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料

募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は、その大半を投資信託の募集取扱手数料が占めています。当期は、グローバル・マクロ戦略を活用する「マクロ・トータル・リターン・ファンド」や、世界各国の転換社債等に投資を行う「世界好利回りCBファンド2016-09（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）（限定追加型）」等の新規募集を行いました。また、「LM・オーストラリア高配当株ファンド（毎月分配型/年2回決算型）」や「ダイワFEグローバル・バリュー（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）」等の新規取扱を開始したことに加え、従前よりニーズの高い「JPX日経400アクティブ・プレミアム・オープン（毎月決算型）」、「新光US-REITオープン」の継続募集にも注力しました。

販売額および募集取扱手数料は、年明け以降に公募投資信託の増加により回復したものの、それまでの不安定な市場環境を背景としたお客さまの様子見姿勢が影響し、前期比では減少する結果となりました。

当社の当期の投資信託の募集・売出し取扱高は5兆9,406億円（前期比81.7%）となり、当期末における投資信託の残存元本は、外国投資信託を含め5兆5,789億円（前年度末比98.4%）となりました。

以上の結果、当期の募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は256億95百万円（前期比67.2%）となりました。

d. その他の受入手数料

その他の受入手数料には、投資信託の代行手数料のほかに、M&A業務および財務アドバイザリー業務にかかる手数料、証券化・不動産ファイナンス業務などを含んでおります。投資信託の代行手数料は、純資産残高の減少により前期比で減少する結果となりました。M&A業務では、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループとMorgan Stanleyが有する国内外ネットワークや、プロダクトに関する豊富な知見・経験の活用を通じ、国内/クロスボーダーを問わず多くの実績を積み重ね、お客さまの企業価値向上に貢献いたしました。証券化業務では、ローン債権等の証券化商品2件の私募主取扱人をつとめるとともに、不動産証券化で8件のアレンジメントを行いました。

以上の結果、当期のその他の受入手数料は513億17百万円（前期比88.6%）となりました。

② トレーディング損益

国内株式市場では、6月に英国民投票の結果を受け日経平均株価は一時15,000円を下回りましたが、11月の米国大統領選挙以降は大幅に上昇し、1月以降は19,000円台を中心に推移する落ち着いた展開となりました。海外株式市場でも、ブレグジットにより米国株価指数が一時的に下落する局面がありましたが、米国大統領選挙をきっかけに大幅に上昇し、米経済の拡大基調を背景に過去最高値を更新しています。このような市場環境の下、当社はお客さまのニーズに応じた商品供給に努めました。

日本国債市場では、追加緩和期待と英国のEU離脱懸念から6月には10年物国債利回りが▲0.20%台まで切り下げ、7月に過去最低を更新しました。その後7月末の日銀金融政策決定会合を受け金利は上昇し、11月には米国大統領選挙直後の米金利急騰に伴いプラス圏に転じました。その後はプラス圏で緩やかに推移する展開となりました。

クレジット市場では期を通してクレジットスプレッドのタイト化が進みました。このような市場環境の下、当社はお客さまのニーズに応じた商品供給を行いました。

以上の結果、当期のトレーディング損益は、株券等によるものが321億37百万円（前期比97.0%）、債券等によるものが956億67百万円（同108.7%）、その他が17億34百万円の損失（前期は110億72百万円の益）、合計では1,260億70百万円（同95.3%）となりました。

③ 金融収支

当期の金融収益214億28百万円（前期比103.3%）から金融費用82億84百万円（同86.0%）を差し引いた金融収支は、131億43百万円の利益（同118.3%）となりました。

④ 販売費・一般管理費

当社一体となってコスト・コントロールに努めております。当期の販売費・一般管理費は2,182億19百万円(前期比96.6%)となりました。

⑤ 営業外損益

当期の営業外収益は72億23百万円(前期比63.7%)、営業外費用は3億5百万円(同67.8%)となりました。営業外収益のうち主なものは、投資有価証券に係る受取配当金45億73百万円、業務委託料11億66百万円であります。営業外費用のうち主なものは、固定資産除却損2億40百万円であります。

⑥ 特別損益

当期の特別利益は20百万円(前期は10億67百万円)、特別損失は19億65百万円(前期は10億66百万円)となりました。特別利益はすべて投資有価証券売却益であります。特別損失のうち主なものは、本社移転費用16億26百万円、減損損失2億97百万円、金融商品取引責任準備金繰入れ37百万円であります。

2. 業務の状況を示す指標

(1) 経営成績等の推移

| 区 分 \ 期 別 | 平成 27 年 3 月期 | 平成 28 年 3 月期 | 平成 29 年 3 月期 |
|-----------|--------------|--------------|--------------|
| 資 本 金 | 40,500百万円 | 40,500百万円 | 40,500百万円 |
| 発行済株式総数 | 139,265株 | 139,265株 | 139,265株 |
| 営 業 収 益 | 309,252百万円 | 302,534百万円 | 270,069百万円 |
| 受 入 手 数 料 | 142,156百万円 | 149,536百万円 | 122,569百万円 |
| トレーディング損益 | 138,038百万円 | 132,248百万円 | 126,070百万円 |
| 純 営 業 収 益 | 298,455百万円 | 292,897百万円 | 261,784百万円 |
| 経 常 利 益 | 96,153百万円 | 77,844百万円 | 50,482百万円 |
| 当 期 純 利 益 | 72,036百万円 | 55,749百万円 | 35,720百万円 |

(2) 受入手数料の内訳

(単位：百万円)

| 期 別 | 区 分 | 株 券 | 債 券 | 受益証券 | そ の 他 | 計 |
|--------------|----------------------------|--------|--------|--------|--------|---------|
| 平成27年 3月期 | 委 託 手 数 料 | 34,360 | 17 | 1,158 | 17 | 35,553 |
| | 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料 | 9,816 | 6,225 | — | — | 16,041 |
| | 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料 | — | 464 | 44,127 | — | 44,591 |
| | その他の受入手数料 | 1,863 | 1,761 | 16,452 | 25,891 | 45,969 |
| | 計 | 46,040 | 8,468 | 61,738 | 25,908 | 142,156 |
| 平成28年 3月期 | 委 託 手 数 料 | 32,489 | 112 | 1,795 | 32 | 34,429 |
| | 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料 | 13,464 | 5,528 | — | — | 18,993 |
| | 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料 | — | 580 | 37,631 | 5 | 38,216 |
| | その他の受入手数料 | 4,765 | 2,687 | 17,276 | 33,167 | 57,896 |
| | 計 | 50,719 | 8,908 | 56,702 | 33,205 | 149,536 |
| 平成29年 3月期 | 委 託 手 数 料 | 27,737 | 26 | 1,346 | 46 | 29,156 |
| | 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料 | 9,639 | 6,760 | — | — | 16,400 |
| | 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料 | — | 1,360 | 24,201 | 133 | 25,695 |
| | その他の受入手数料 | 3,364 | 2,516 | 16,013 | 29,423 | 51,317 |
| | 計 | 40,741 | 10,664 | 41,560 | 29,602 | 122,569 |

(3) トレーディング損益の内訳

(単位：百万円)

| 区 分 | 期 別 | 平成 27 年 3 月期 | | |
|---------------|-----|--------------|---------|---------|
| | | 実現損益 | 評価損益 | 計 |
| 株券等トレーディング損益 | | 31,040 | 510 | 31,551 |
| 債券等トレーディング損益 | | 113,351 | 25,896 | 139,248 |
| その他のトレーディング損益 | | △4,497 | △28,264 | △32,761 |
| 計 | | 139,894 | △1,856 | 138,038 |

(単位：百万円)

| 区 分 | 期 別 | 平成 28 年 3 月期 | | | 平成 29 年 3 月期 | | |
|---------------|-----|--------------|---------|---------|--------------|---------|---------|
| | | 実現損益 | 評価損益 | 計 | 実現損益 | 評価損益 | 計 |
| 株券等トレーディング損益 | | △4,135 | 37,267 | 33,132 | 49,381 | △17,243 | 32,137 |
| 債券等トレーディング損益 | | 40,295 | 47,747 | 88,043 | 107,231 | △11,564 | 95,667 |
| その他のトレーディング損益 | | △44,516 | 55,588 | 11,072 | △28,825 | 27,090 | △1,734 |
| 計 | | △8,355 | 140,603 | 132,248 | 127,787 | △1,717 | 126,070 |

(4) その他の自己取引に係る損益の内訳

① 営業投資有価証券等損益

(単位：百万円)

| 区分 | 期別 | 平成 27 年 3 月期 | 平成 28 年 3 月期 | 平成 29 年 3 月期 |
|-------------------|----|--------------|--------------|--------------|
| 営業投資有価証券等損益 (株券) | | △4 | 0 | 0 |
| 営業投資有価証券等損益 (その他) | | 4 | — | — |
| 計 | | △0 | 0 | 0 |

② その他の商品売買損益

(単位：百万円)

| 区分 | 期別 | 平成 27 年 3 月期 | 平成 28 年 3 月期 | 平成 29 年 3 月期 |
|------------|----|--------------|--------------|--------------|
| その他の商品売買損益 | | 1 | — | 0 |
| 計 | | 1 | — | 0 |

(5) 株券売買高

(単位：百万円)

| 期 別 | 区 分 | 受 託 | 自 己 | 合 計 |
|--------------|-----|------------|------------|------------|
| 平成 27 年 3 月期 | | 18,096,610 | 17,260,928 | 35,357,538 |
| 平成 28 年 3 月期 | | 20,519,080 | 15,850,800 | 36,369,880 |
| 平成 29 年 3 月期 | | 20,894,680 | 17,777,512 | 38,672,192 |

(6) 有価証券の引受け及び売出し並びに特定投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の募集、売出し及び
 私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況

① 株券

(単位：千株、百万円)

| 区分 期別 | 区 分 | 引 受 高 | 売 出 高 | 特定投資 家向け売 付け勧誘 等の総額 | 募集の 取扱高 | 売出しの 取扱高 | 私募の 取扱高 | 特定投資 家向け売付 け勧誘等の 取扱高 |
|-----------------|-----|---------|---------|------------------------------|------------|-------------|------------|-------------------------------|
| 平成 27 年 3 月期 | 株 数 | 85,800 | 98,249 | — | — | — | 443 | — |
| | 金 額 | 260,946 | 216,646 | — | — | — | 46,142 | — |
| 平成 28 年 3 月期 | 株 数 | 268,744 | 285,381 | — | — | — | 14 | — |
| | 金 額 | 530,148 | 505,734 | — | — | — | 18,001 | — |
| 平成 29 年 3 月期 | 株 数 | 92,679 | 102,773 | — | — | — | 26 | — |
| | 金 額 | 325,488 | 293,419 | — | — | — | 14,184 | — |

② 債券

(単位：額面金額、百万円)

| 区分 期別 | 種 類 | 引 受 高 | 売 出 高 | 特定投資 家向け売 付け勧誘 等の総額 | 募集の 取扱高 | 売出しの 取扱高 | 私募の 取扱高 | 特定投資 家向け売付 け勧誘等の 取扱高 |
|-----------------|---------|-----------|---------|------------------------------|------------|-------------|------------|-------------------------------|
| 平成 27 年 3 月期 | 国 債 | — | — | — | 97,275 | — | — | — |
| | 地 方 債 | 775,989 | — | — | 22,826 | — | — | — |
| | 特 殊 債 | 1,412,800 | — | — | 79,013 | — | — | — |
| | 社 債 | 2,241,895 | — | — | 243,360 | — | 1,990 | — |
| | 外 国 債 券 | 327,400 | 848,523 | — | 31,000 | — | — | — |
| | 合 計 | 4,758,084 | 848,523 | — | 473,476 | — | 1,990 | — |
| 平成 28 年 3 月期 | 国 債 | — | — | — | 100,484 | — | — | — |
| | 地 方 債 | 804,615 | — | — | 10,298 | — | — | — |
| | 特 殊 債 | 1,199,900 | — | — | 63,799 | — | — | — |
| | 社 債 | 2,547,301 | — | — | 365,450 | — | 4,339 | — |
| | 外 国 債 券 | 303,200 | 735,524 | — | 7,000 | — | — | — |
| | 合 計 | 4,855,016 | 735,524 | — | 547,032 | — | 4,339 | — |
| 平成 29 年 3 月期 | 国 債 | — | — | — | 296,280 | — | — | — |
| | 地 方 債 | 809,477 | — | — | 791 | — | — | — |
| | 特 殊 債 | 1,304,800 | — | — | 22,375 | — | — | — |
| | 社 債 | 2,858,689 | — | — | 458,994 | — | — | — |
| | 外 国 債 券 | 300,991 | 863,540 | — | 6,700 | — | — | — |
| | 合 計 | 5,273,957 | 863,540 | — | 785,141 | — | — | — |

③ 受益証券

(単位：百万円)

| 区分 期別 | 種 類 | 募集の 取扱高 | 売出しの 取扱高 | 私募の 取扱高 | 特定投資家向け 売付け勧誘等の 取扱高 |
|-----------------|-----------|------------|-------------|------------|---------------------------|
| 平成 27 年 3 月期 | 株 式 投 信 | 1,828,602 | — | 579,025 | — |
| | 公 社 債 投 信 | 4,297,540 | — | 23,636 | — |
| | 外 国 投 信 | 495,313 | — | 24,788 | — |
| | 合 計 | 6,621,455 | — | 627,450 | — |
| 平成 28 年 3 月期 | 株 式 投 信 | 1,526,178 | — | 944,755 | — |
| | 公 社 債 投 信 | 4,229,938 | — | 91,494 | — |
| | 外 国 投 信 | 477,305 | — | 12,500 | — |
| | 合 計 | 6,233,422 | — | 1,048,749 | — |
| 平成 29 年 3 月期 | 株 式 投 信 | 1,271,767 | — | 635,178 | — |
| | 公 社 債 投 信 | 3,629,142 | — | 207,600 | — |
| | 外 国 投 信 | 195,154 | — | 45,760 | — |
| | 合 計 | 5,096,064 | — | 888,538 | — |

(注) 引受高、売出高および特定投資家向け売付け勧誘等の総額の該当事項はありません。

④ その他

(単位：百万円)

| 区 分 期 別 | 種 類 | 引 受 高 | 私募の取扱高 |
|--------------|-------------|-------|--------|
| 平成 27 年 3 月期 | コマーシャル・ペーパー | — | — |
| | 外 国 証 書 | — | — |
| | そ の 他 | — | — |
| 平成 28 年 3 月期 | コマーシャル・ペーパー | — | — |
| | 外 国 証 書 | — | — |
| | そ の 他 | — | — |
| 平成 29 年 3 月期 | コマーシャル・ペーパー | — | — |
| | 外 国 証 書 | — | — |
| | そ の 他 | — | — |

(注) 売出高、特定投資家向け売付け勧誘等の総額、募集の取扱高、売出しの取扱高および特定投資家向け売付け勧誘等の取扱高の該当事項はありません。

(7) その他業務の状況

① 有価証券の保護預り業務

| | 有価証券の種類 | | 国内有価証券 | 外国有価証券 |
|------------------|--------------|--------|---------------|----------------|
| | | | | |
| 平成 27 年 3 月期末 | 株券 | 株数 | 14,553,726千株 | 12,762,236千株 |
| | 債券 | 額面金額 | 5,540,842百万円 | 4,392,030百万円 |
| | 受益証券(*1) | 口数 | 4,312,078 百万口 | 327,772 百万口 |
| | 新株予約権証券 | 数量 | 16,500 個 | 9,044,044 ワラント |
| | 受益証券発行信託(*2) | 金額(時価) | 1,001 百万円 | — |
| 平成 28 年 3 月期末 | 株券 | 株数 | 14,151,931千株 | 551,836,617千株 |
| | 債券 | 額面金額 | 5,693,412百万円 | 4,641,225百万円 |
| | 受益証券(*1) | 口数 | 4,742,110百万口 | 264,605百万口 |
| | 新株予約権証券 | 数量 | 0個 | 34,236,168ワラント |
| | 受益証券発行信託(*2) | 金額(時価) | 2,600百万円 | — |
| 平成 29 年 3 月期末 | 株券 | 株数 | 13,327,563千株 | 898,327,965千株 |
| | 債券 | 額面金額 | 5,889,666百万円 | 4,948,713百万円 |
| | 受益証券(*1) | 口数 | 4,640,057百万口 | 245,294百万口 |
| | 新株予約権証券 | 数量 | 0個 | 34,236,168ワラント |
| | 受益証券発行信託(*2) | 金額(時価) | 2,605百万円 | — |

(*1) 受益証券の外国有価証券にはステープル受益証券を含みます。

(*2) 受益証券発行信託は時価による表記となります。

② 信用取引にかかる融資および貸証券

(単位：千株、百万円)

| 区 分 期 別 | 顧客の委託に基づいておこなった融資額 とこれにより顧客が買付けている株数 | | 顧客の委託に基づいておこなった貸株数 とこれにより顧客が売付けている代金 | |
|---------------|---|--------|---|--------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 平成 27 年 3 月期末 | 53,944 | 46,107 | 27,037 | 25,719 |
| 平成 28 年 3 月期末 | 44,399 | 49,809 | 25,337 | 22,608 |
| 平成 29 年 3 月期末 | 39,975 | 44,924 | 50,697 | 44,027 |

③ 公社債元利金支払の代理業務

(単位：百万円)

| 区 分 期 別 | 元金支払取扱額 | 利金支払取扱額 | 合 計 |
|--------------|-----------|---------|-----------|
| 平成 27 年 3 月期 | 938,987 | 64,818 | 1,003,806 |
| 平成 28 年 3 月期 | 743,910 | 67,152 | 811,063 |
| 平成 29 年 3 月期 | 1,084,956 | 68,306 | 1,153,262 |

④ 証券投資信託受益証券の収益金、償還金および一部解約金支払の代理業務

(単位:百万円)

| 期 別 \ 区 分 | 収益金・償還金および一部解約金支払の取扱額 |
|--------------|-----------------------|
| 平成 27 年 3 月期 | 6,249,358 |
| 平成 28 年 3 月期 | 5,956,574 |
| 平成 29 年 3 月期 | 5,284,517 |

⑤ その他の商品の売買の状況

(単位:百万円)

| 期 別 \ 区 分 | 譲 渡 性 預 金 | 金 地 金 | そ の 他 |
|--------------|-----------|-------|-------|
| 平成 27 年 3 月期 | — | 8 | 1 |
| 平成 28 年 3 月期 | — | — | — |
| 平成 29 年 3 月期 | — | 8 | 0 |

⑥ 金融先物取引の状況

(単位:百万円)

| 期 別 \ 区 分 | 金 利 先 物 | | 通 貨 先 物 | |
|--------------|---------|---------|---------|-----|
| | 受 託 | 自 己 | 受 託 | 自 己 |
| 平成 27 年 3 月期 | — | 142,762 | — | — |
| 平成 28 年 3 月期 | — | — | — | — |
| 平成 29 年 3 月期 | — | 20,569 | — | — |

⑦ 金銭の相互支払に関する取引業務 (金利先物取引業務を含む)

(単位:百万円)

| 期 別 \ 区 分 | 想定元本 (期末残高) |
|---------------|-------------|
| 平成 27 年 3 月期末 | 312,110,481 |
| 平成 28 年 3 月期末 | 321,901,964 |
| 平成 29 年 3 月期末 | 389,935,155 |

当社が行っております上記以外のその他の業務の内容につきましては 8 頁の「他に行っている業務の種類」をご覧ください。

(8) 自己資本規制比率の状況

(単位：百万円)

| 期 別 | | 平成27年3月期末 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|------------------------------|------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 区 分 | | | | |
| 基本的項目 (A) | | 347,555 | 387,010 | 422,731 |
| 補完的項目 | その他有価証券評価 差額金(評価益)等 | 2,174 | 1,380 | 1,547 |
| | 金融商品取引責任準備金等 | 1,697 | 1,849 | 1,887 |
| | 一般貸倒引当金 | 2 | 0 | 0 |
| | 長期劣後債務 | - | 5,000 | 4,000 |
| | 短期劣後債務 | 163,300 | 158,300 | 159,300 |
| 計 (B) | | 167,174 | 166,529 | 166,734 |
| 控 除 資 産 (C) | | 116,485 | 137,416 | 163,332 |
| 固定化されていない自己資本(A)+(B)-(C) (D) | | 398,244 | 416,123 | 426,133 |
| リスク相当額 | 市場リスク相当額 | 58,399 | 67,289 | 54,620 |
| | 取引先リスク相当額 | 23,401 | 27,948 | 25,756 |
| | 基礎的リスク相当額 | 50,953 | 54,355 | 51,526 |
| | 計 (E) | 132,753 | 149,592 | 131,903 |
| 自己資本規制比率 (D)/(E)×100 | | 299.9% | 278.1% | 323.0% |

(9) 使用人の総数および外務員の総数

| 期 別 | | 平成27年 3月期末 | 平成28年 3月期末 | 平成29年 3月期末 |
|---------------------------|--|---------------|---------------|---------------|
| 区 分 | | | | |
| 従 業 員 数 (注) | | 4,952人 | 5,209人 | 5,264人 |
| 金 融 商 品 取 引 法 上 の 外 務 員 数 | | 4,702人 | 4,946人 | 4,993人 |

(注) 従業員数には、下記の執行役員を含めております。

平成27年3月期末 34名

平成28年3月期末 35名

平成29年3月期末 38名

Ⅲ. 財産の状況

1. 経理の状況

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

| 資 産 の 部 | | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
|---------------------|--|-----------------|-----------------|
| 科 目 | | | |
| 流 動 資 産 | | 13,930,229 | 14,742,137 |
| 現 金 ・ 預 金 | | 1,033,887 | 1,254,451 |
| 預 託 金 | | 165,020 | 219,359 |
| ト レ ー デ ィ ン グ 商 品 | | 9,038,850 | 8,254,950 |
| 商 品 有 価 証 券 等 | | 1,948,046 | 2,548,476 |
| デ リ バ テ ィ ブ 取 引 | | 7,090,804 | 5,706,474 |
| 約 定 見 返 勘 定 | | 40,054 | 267,563 |
| 営 業 投 資 有 価 証 券 等 | | 93 | 93 |
| 信 用 取 引 資 産 | | 52,635 | 47,887 |
| 信 用 取 引 貸 付 金 | | 49,809 | 44,924 |
| 信 用 取 引 借 証 券 担 保 金 | | 2,826 | 2,963 |
| 有 価 証 券 担 保 貸 付 金 | | 2,972,291 | 4,051,770 |
| 借 入 有 価 証 券 担 保 金 | | 2,972,291 | 3,624,868 |
| 現 先 取 引 貸 付 金 | | — | 426,901 |
| 立 替 金 | | 400 | 383 |
| 短 期 差 入 保 証 金 | | 577,074 | 599,085 |
| 短 期 貸 付 金 | | 109 | 109 |
| 繰 延 税 金 資 産 | | 15,186 | 14,031 |
| そ の 他 の 流 動 資 産 | | 34,625 | 32,450 |
| 貸 倒 引 当 金 | | △0 | △0 |
| 固 定 資 産 | | 134,372 | 158,679 |
| 有 形 固 定 資 産 | | 19,300 | 27,210 |
| 建 物 | | 8,602 | 16,807 |
| 器 具 備 品 | | 8,910 | 10,388 |
| 土 地 | | 0 | 0 |
| 建 設 仮 勘 定 | | 1,786 | 14 |
| 無 形 固 定 資 産 | | 46,990 | 61,228 |
| ソ フ ト ウ ェ ア | | 46,656 | 60,895 |
| そ の 他 | | 333 | 333 |
| 投 資 そ の 他 の 資 産 | | 68,081 | 70,240 |
| 投 資 有 価 証 券 式 | | 4,541 | 4,751 |
| 関 係 会 社 株 式 | | 44,911 | 44,911 |
| 長 期 貸 付 金 | | 30 | 22 |
| 前 払 年 金 費 用 | | — | 916 |
| 繰 延 税 金 資 産 | | 2,042 | 1,755 |
| そ の 他 | | 17,375 | 18,325 |
| 貸 倒 引 当 金 | | △819 | △442 |
| 資 産 合 計 | | 14,064,602 | 14,900,816 |

(単位：百万円)

| 負債の部 | | |
|---------------|------------|------------|
| 科目 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
| 流動負債 | 13,310,728 | 14,108,430 |
| トレーディング商品 | 8,036,932 | 7,819,175 |
| 商品有価証券等 | 1,019,958 | 2,135,607 |
| デリバティブ取引 | 7,016,974 | 5,683,567 |
| 信用取引負債 | 24,816 | 50,535 |
| 信用取引借入金 | 2,208 | 6,507 |
| 信用取引貸証券受入金 | 22,608 | 44,027 |
| 有価証券担保借入金 | 2,575,240 | 2,795,100 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 2,372,809 | 2,395,349 |
| 現先取引借入金 | 202,430 | 399,751 |
| 預り金 | 154,500 | 202,152 |
| 受入保証金 | 383,696 | 438,906 |
| 短期借入金 | 1,430,000 | 2,174,649 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | 34,500 | 64,500 |
| コマースナル・ペーパー | 617,500 | 504,000 |
| 未払法人税等 | 8,303 | 5,819 |
| 賞与引当金 | 11,598 | 11,404 |
| その他の流動負債 | 33,640 | 42,186 |
| 固定負債 | 363,633 | 366,221 |
| 長期借入金 | 356,400 | 355,300 |
| 退職給付引当金 | 2,120 | 1,839 |
| 資産除去債務 | 4,832 | 6,828 |
| その他の固定負債 | 279 | 2,253 |
| 特別法上の準備金 | 1,849 | 1,887 |
| 金融商品取引責任準備金 | 1,849 | 1,887 |
| 負債合計 | 13,676,210 | 14,476,538 |

(単位：百万円)

| 純 資 産 の 部 | | |
|-------------------------|-----------------|-----------------|
| 科 目 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
| 株 主 資 本 | 387,010 | 422,731 |
| 資 本 金 | 40,500 | 40,500 |
| 資 本 剰 余 金 | 183,555 | 183,555 |
| 資 本 準 備 金 | 37,500 | 37,500 |
| そ の 他 資 本 剰 余 金 | 146,055 | 146,055 |
| 利 益 剰 余 金 | 162,955 | 198,675 |
| そ の 他 利 益 剰 余 金 | 162,955 | 198,675 |
| 繰 越 利 益 剰 余 金 | 162,955 | 198,675 |
| 評 価 ・ 換 算 差 額 等 | 1,380 | 1,547 |
| そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金 | 1,380 | 1,547 |
| 純 資 産 合 計 | 388,391 | 424,278 |
| 負 債 ・ 純 資 産 合 計 | 14,064,602 | 14,900,816 |

(2) 損益計算書

(単位：百万円)

| 科 目 | 平成 28 年 3 月期 | 平成 29 年 3 月期 |
|---------------------------|--------------|--------------|
| 営 業 収 益 | 302,534 | 270,069 |
| 受 入 手 数 料 | 149,536 | 122,569 |
| ト レ ー デ ィ ン グ 損 益 | 132,248 | 126,070 |
| 営 業 投 資 有 価 証 券 等 損 益 | 0 | 0 |
| そ の 他 の 商 品 売 買 損 益 | — | 0 |
| 金 融 収 益 | 20,748 | 21,428 |
| 金 融 費 用 | 9,636 | 8,284 |
| 純 営 業 収 益 | 292,897 | 261,784 |
| 販 売 費 ・ 一 般 管 理 費 | 225,938 | 218,219 |
| 取 引 関 係 費 | 85,801 | 76,374 |
| 人 件 費 | 68,632 | 65,099 |
| 不 動 産 関 係 費 | 16,606 | 19,933 |
| 事 務 費 | 32,679 | 31,662 |
| 減 価 償 却 費 | 15,550 | 17,879 |
| 租 税 公 課 | 3,454 | 4,526 |
| そ の 他 | 3,214 | 2,743 |
| 営 業 利 益 | 66,958 | 43,564 |
| 営 業 外 収 益 | 11,336 | 7,223 |
| 受 取 配 当 金 | 8,783 | 4,573 |
| 不 動 産 賃 貸 料 | 374 | 464 |
| シ ス テ ム 使 用 料 | 391 | 397 |
| 業 務 委 託 料 | 1,241 | 1,166 |
| そ の 他 | 545 | 622 |
| 営 業 外 費 用 | 450 | 305 |
| 固 定 資 産 除 却 損 | 154 | 240 |
| デ リ バ テ ィ ブ 運 用 損 失 | 195 | — |
| そ の 他 | 100 | 64 |
| 経 常 利 益 | 77,844 | 50,482 |
| 特 別 利 益 | 1,067 | 20 |
| 投 資 有 価 証 券 売 却 益 | 1,067 | 20 |
| 特 別 損 失 | 1,066 | 1,965 |
| 減 損 損 失 | 667 | 297 |
| 金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入 | 151 | 37 |
| 海 外 税 務 関 連 損 失 | 245 | — |
| 本 社 移 転 費 用 | 2 | 1,626 |
| そ の 他 | — | 3 |
| 税 引 前 当 期 純 利 益 | 77,845 | 48,537 |
| 法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税 | 21,904 | 11,456 |
| 法 人 税 等 調 整 額 | 191 | 1,361 |
| 当 期 純 利 益 | 55,749 | 35,720 |

(3)株主資本等変動計算書

①平成28年3月期

(単位：百万円)

| | 株 主 資 本 | | | | | 株主資本計 合 計 |
|-----------------------------|---------|-----------|---------------|---------------|--------------|--------------|
| | 資 本 金 | 資 本 剰 余 金 | | 利 益 剰 余 金 | 株主資本計 合 計 | |
| | | 資本準備金 | その 他 資本剰余金 | 資本剰余金計 合 計 | | |
| | | | | 繰越利益 剰 余 金 | | |
| 平成27年4月1日 残高 | 40,500 | 37,500 | 146,055 | 183,555 | 159,518 | 383,574 |
| 事業年度中の変動額 | | | | | | |
| 剰 余 金 の 配 当 | | | | | △52,312 | △52,312 |
| 当 期 純 利 益 | | | | | 55,749 | 55,749 |
| 株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額(純額) | | | | | | |
| 事業年度中の変動額合計 | — | — | — | — | 3,436 | 3,436 |
| 平成28年3月31日 残高 | 40,500 | 37,500 | 146,055 | 183,555 | 162,955 | 387,010 |

(単位：百万円)

| | 評 価 ・ 換 算 差 額 等 | | 純 資 産 合 計 |
|-----------------------------|---------------------------|------------------------|-----------|
| | その 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金 | 評 価 ・ 換 算 差 額 等 合 計 | |
| 平成27年4月1日 残高 | 2,174 | 2,174 | 385,748 |
| 事業年度中の変動額 | | | |
| 剰 余 金 の 配 当 | | | △52,312 |
| 当 期 純 利 益 | | | 55,749 |
| 株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額(純額) | △794 | △794 | △794 |
| 事業年度中の変動額合計 | △794 | △794 | 2,642 |
| 平成28年3月31日 残高 | 1,380 | 1,380 | 388,391 |

②平成 29 年 3 月期

(単位：百万円)

| | 株 主 資 本 | | | | | 株主資本計 合 計 |
|-----------------------------|---------|-----------|----------------|-------------|--------------|--------------|
| | 資 本 金 | 資 本 剰 余 金 | | 利 益 剰 余 金 | | |
| | | 資本準備金 | そ の 他 資本剰余金 | 資本剰余金計 合 | その他 利益剰余金 | |
| | | | | | 繰越利益 剰余金 | |
| 平成28年4月1日 残高 | 40,500 | 37,500 | 146,055 | 183,555 | 162,955 | 387,010 |
| 事業年度中の変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | |
| 当期純利益 | | | | | 35,720 | 35,720 |
| 株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額(純額) | | | | | | |
| 事業年度中の変動額合計 | — | — | — | — | 35,720 | 35,720 |
| 平成29年3月31日 残高 | 40,500 | 37,500 | 146,055 | 183,555 | 198,675 | 422,731 |

(単位：百万円)

| | 評 価 ・ 換 算 差 額 等 | | 純 資 産 合 計 |
|-----------------------------|----------------------------|------------------------|-----------|
| | そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金 | 評 価 ・ 換 算 差 額 等 合 計 | |
| 平成28年4月1日 残高 | 1,380 | 1,380 | 388,391 |
| 事業年度中の変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | |
| 当期純利益 | | | 35,720 |
| 株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額(純額) | 166 | 166 | 166 |
| 事業年度中の変動額合計 | 166 | 166 | 35,886 |
| 平成29年3月31日 残高 | 1,547 | 1,547 | 424,278 |

(4) 注記事項

①平成 28 年 3 月期

当社の貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書は、「会社計算規則」（平成18年2月7日 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）に準拠して作成しております。

なお、記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

a. 重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. トレーディング商品の評価基準および評価方法

トレーディングに関する有価証券（売買目的有価証券）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。なお、当社は、証券市場を通じて顧客のニーズに対応したサービスや商品を提供することを目的としてトレーディングを行っており、有価証券の売買取引のほか、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引等をその範囲としております。

2. トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準および評価方法

(1) 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。

(2) その他有価証券

① 時価のあるもの

当事業年度末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

② 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～50年

器具備品 5～15年

(2) 無形固定資産および投資その他の資産

定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（主として5年）に基づく定額法によっております。

4. 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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、所定の計算方法による支払見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員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。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額の期間帰属方法は、給付算定式基準によっております。

過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（12年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（12年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理することとしております。

(4) 金融商品取引責任準備金

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の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」第175条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. 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、税抜き方式によっております。

b. 貸借対照表に関する注記

| | |
|---|------------|
| 1. 関係会社に対する短期金銭債権 | 52,784百万円 |
| 2. 関係会社に対する短期金銭債務 | 498,397百万円 |
| 関係会社に対する長期金銭債務 | 133,481百万円 |
| 3. 有形固定資産の減価償却累計額 | 19,393百万円 |
| 4. 担保に供している資産および担保に係る債務 | |
| 担保に供している資産 | |
| トレーディング商品 | 105,285百万円 |
| 上記のほか、短期借入金（共通担保資金供給オペレーション）の担保として消費貸借契約により借り入れた有価証券169,773百万円、その他担保として受け入れた有価証券191,113百万円を差し入れております。 | |

担保に係る債務

| | |
|------------------------|------------|
| 短期借入金（共通担保資金供給オペレーション） | 150,000百万円 |
| 信用取引借入金 | 2,208百万円 |
| 計 | 152,208百万円 |

5. 有価証券を担保とした金融取引および有価証券の消費貸借契約により差し入れた、または受け入れた有価証券の時価額は以下のとおりであります。

差し入れた有価証券

| | |
|--------------------|--------------|
| 信用取引貸証券 | 21,708百万円 |
| 信用取引借入金の本担保証券 | 2,208百万円 |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 2,358,165百万円 |
| 現先取引で売却した有価証券 | 203,015百万円 |
| その他担保として差し入れた有価証券 | 152,006百万円 |

（注）担保に供している資産に属するものは除いております。

受け入れた有価証券

| | |
|--------------------|--------------|
| 信用取引貸付金の本担保証券 | 44,005百万円 |
| 信用取引借証券 | 2,826百万円 |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 3,443,020百万円 |
| その他担保として受け入れた有価証券 | 254,905百万円 |

6. 1年内返済予定の長期借入金および長期借入金には、「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176条に定める劣後債務（劣後特約付借入金）163,300百万円が含まれております。

7. 保証債務

該当事項はありません。

c. 損益計算書に関する注記

関係会社との取引高

| | |
|------------------|-----------|
| 関係会社からの営業収益 | 1,605百万円 |
| 関係会社への営業費用 | 7,401百万円 |
| 関係会社との営業取引以外の取引高 | 10,406百万円 |

d. 株主資本等変動計算書に関する注記]

1. 当事業年度末における発行済株式の種類および総数

| | |
|--------|----------|
| A種種類株式 | 40株 |
| B種種類株式 | 60株 |
| C種種類株式 | 26,765株 |
| D種種類株式 | 112,400株 |

2. 当事業年度末における自己株式の総数
該当事項はありません。

3. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

| 決 議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり 配 当 額 | 基 準 日 | 効 力 発 生 日 |
|----------------------|-------|-----------------|----------------|------------|-------------|
| 平成27年6月23日 定時株主総会 | A種類株式 | 12 | 320,340円 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月23日 |
| | D種類株式 | 36,006 | 320,340円 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月23日 |
| 平成27年10月28日 取締役会 | A種類株式 | 5 | 144,910円 | 平成27年9月30日 | 平成27年11月13日 |
| | D種類株式 | 16,287 | 144,910円 | 平成27年9月30日 | 平成27年11月13日 |

4. 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当に関する事項
該当事項はありません。

②平成29年3月期

当社の貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書は、「会社計算規則」（平成18年2月7日法務省令第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）に準拠して作成しております。

なお、記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

a. 重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. トレーディング商品の評価基準および評価方法

トレーディングに関する有価証券（売買目的有価証券）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。なお、当社は、証券市場を通じて顧客のニーズに対応したサービスや商品を提供することを目的としてトレーディングを行っており、有価証券の売買取引のほか、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引等をその範囲としております。

2. トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準および評価方法

(1) 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。

(2) その他有価証券

① 時価のあるもの

当事業年度末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

② 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 6～50年

器具備品 5～15年

(2) 無形固定資産および投資その他の資産

定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（主として5年）に基づく定額法によっております。

4. 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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、所定の計算方法による支払見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員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。なお、年金資産の見込額が退職給付債務見込額に未認識過去勤務費用及び未認識数理計算上の差異を加減した額を超過している場合は、超過額を前払年金費用として計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額の期間帰属方法は、給付算定式基準によっております。

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（12年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（12年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。

(4) 金融商品取引責任準備金

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の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」第175条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. 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、税抜き方式によっております。

b. 表示方法の変更に関する注記

(損益計算書)

従来、特別損失の「その他」に含めておりました「本社移転費用」は、特別損失の総額に占める重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。

なお、前事業年度の特別損失の「その他」に含まれる「本社移転費用」は、2百万円であります。

c. 貸借対照表に関する注記

- | | |
|---|--------------|
| 1. 関係会社に対する短期金銭債権 | 49,153百万円 |
| 2. 関係会社に対する短期金銭債務 | 570,398百万円 |
| 関係会社に対する長期金銭債務 | 106,541百万円 |
| 3. 有形固定資産の減価償却累計額 | 19,517百万円 |
| 4. 担保に供している資産および担保に係る債務 | |
| 担保に供している資産 | |
| トレーディング商品 | 229,080百万円 |
| 上記のほか、短期借入金（共通担保資金供給オペレーション）の担保として消費貸借契約により借り入れた有価証券146,675百万円、その他担保として受け入れた有価証券10,137百万円を差し入れております。 | |
| 担保に係る債務 | |
| 短期借入金（共通担保資金供給オペレーション） | 161,704百万円 |
| 5. 有価証券を担保とした金融取引および有価証券の消費貸借契約により差し入れた、または受け入れた有価証券の時価額は以下のとおりであります。 | |
| 差し入れた有価証券 | |
| 信用取引貸証券 | 44,850百万円 |
| 信用取引借入金の本担保証券 | 6,422百万円 |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 2,379,764百万円 |
| 現先取引で売却した有価証券 | 406,577百万円 |
| その他担保として差し入れた有価証券 | 180,751百万円 |
| (注) 担保に供している資産に属するものは除いております。 | |
| 受け入れた有価証券 | |
| 信用取引貸付金の本担保証券 | 42,728百万円 |
| 信用取引借証券 | 2,911百万円 |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 3,955,177百万円 |
| 現先取引で買い付けた有価証券 | 424,953百万円 |
| その他担保として受け入れた有価証券 | 128,869百万円 |
| 6. 1年内返済予定の長期借入金および長期借入金には、「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176条に定める劣後債務（劣後特約付借入金）163,300百万円が含まれております。 | |
| 7. 保証債務 | |
| 該当事項はありません。 | |

| | |
|-----------------------------|----------|
| d. 損益計算書に関する注記 | |
| 関係会社との取引高 | |
| 関係会社からの営業収益 | 2,230百万円 |
| 関係会社への営業費用 | 6,816百万円 |
| 関係会社との営業取引以外の取引高 | 6,200百万円 |
| e. 株主資本等変動計算書に関する注記 | |
| 1. 当事業年度末における発行済株式の種類および総数 | |
| A種種類株式 | 40株 |
| B種種類株式 | 60株 |
| C種種類株式 | 26,765株 |
| D種種類株式 | 112,400株 |
| 2. 当事業年度末における自己株式の総数 | |
| 該当事項はありません。 | |
| 3. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項 | |
| 該当事項はありません。 | |
| 4. 当事業年度の末日後に行う剰余金の配当に関する事項 | |
| 該当事項はありません。 | |

2. 借入金の主要な借入先および借入金額

(1) 短期借入金

(単位：百万円)

| 種類または借入先 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|-----------------|-----------|-----------|
| コール・マネー | 880,000 | 1,550,000 |
| 共通担保資金供給オペレーション | 150,000 | 161,704 |
| 三菱UFJ証券ホールディングス | 400,000 | 462,945 |
| 合計 | 1,430,000 | 2,174,649 |

(2) 1年内返済予定の長期借入金

(単位：百万円)

| 借入先 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|-----------------|-----------|-----------|
| 三菱UFJ証券ホールディングス | 30,000 | 57,000 |
| その他 | 4,500 | 7,500 |
| 合計 | 34,500 | 64,500 |

(3) 長期借入金

(単位：百万円)

| 借入先 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|-----------------|-----------|-----------|
| 三菱UFJ証券ホールディングス | 133,300 | 106,300 |
| その他 | 223,100 | 249,000 |
| 合計 | 356,400 | 355,300 |

(注) 「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176条に定める劣後特約付借入金が含まれております。

(4) 信用取引借入金

(単位：百万円)

| 借入先 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|--------|-----------|-----------|
| 日本証券金融 | 2,208 | 6,507 |
| 合計 | 2,208 | 6,507 |

3. 保有有価証券の時価等（トレーディングに係るもの以外）

①平成28年3月期末

a. 満期保有目的債券

該当事項はありません。

b. 子会社有価証券および関連会社株式

(単位：百万円)

| 種 類 | 貸借対照表 計 上 額 | 時 価 | 差 額 |
|---------|----------------|--------|-----|
| 子会社有価証券 | 44,911 | 44,911 | - |
| 株式 | 44,911 | 44,911 | - |
| 関連会社株式 | - | - | - |

c. その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

| | 種類 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|------------------------------|--------|--------------|-------|-------|
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの | (1)株式 | 3,082 | 1,276 | 1,805 |
| | (2)債券 | - | - | - |
| | (3)その他 | - | - | - |
| | 小計 | 3,082 | 1,276 | 1,805 |
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | - | - | - |
| | (3)その他 | - | - | - |
| | 小計 | - | - | - |
| 合計 | | 3,082 | 1,276 | 1,805 |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額1,552百万円）については、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

d. 当期中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

| 種類 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|--------|-------|---------|---------|
| (1)株式 | 271 | 57 | - |
| (2)債券 | - | - | - |
| (3)その他 | 2,059 | 1,009 | - |
| 合計 | 2,330 | 1,067 | - |

e. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

②平成 29 年 3 月期末

a. 満期保有目的債券

該当事項はありません。

b. 子会社有価証券および関連会社株式

(単位：百万円)

| 種 類 | 貸借対照表 計上額 | 時 価 | 差 額 |
|---------|--------------|--------|-----|
| 子会社有価証券 | 44,911 | 44,911 | - |
| 株 式 | 44,911 | 44,911 | - |
| 関連会社株式 | - | - | - |

c. その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

| | 種 類 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差 額 |
|------------------------------|---------|--------------|-------|-------|
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの | (1) 株式 | 3,295 | 1,243 | 2,052 |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | - | - | - |
| | 小計 | 3,295 | 1,243 | 2,052 |
| 貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | - | - | - |
| | 小計 | - | - | - |
| 合計 | | 3,295 | 1,243 | 2,052 |

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,548 百万円）については、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

d. 当期中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

| 種 類 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---------|-----|---------|---------|
| (1) 株式 | 57 | 20 | - |
| (2) 債券 | - | - | - |
| (3) その他 | - | - | - |
| 合計 | 57 | 20 | - |

e. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

4. デリバティブ取引の契約額等（トレーディングに係るもの以外）

平成 28 年 3 月期

該当事項はありません。

平成 29 年 3 月期

該当事項はありません。

5. 財務諸表に関する監査法人による監査の有無

平成 28 年 3 月期（自 平成 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日）の財務諸表は、会社法第 436 条第 2 項第 1 号の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツの監査を受け、監査報告書を受領しております。

また、平成 29 年 3 月期（自 平成 28 年 4 月 1 日 至 平成 29 年 3 月 31 日）の財務諸表は、会社法第 436 条第 2 項第 1 号の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツの監査を受け、監査報告書を受領しております。

IV. 管理の状況

1. 内部管理の状況の概要(平成 29 年 6 月 30 日現在)

(1) コンプライアンス体制

当社は、コンプライアンスを経営の最重要課題の一つとして位置付け、内部管理統括責任者のもと取締役をはじめとした役職員が一体となりコンプライアンスの徹底に取り組んでおります。また、経営会議の諮問機関として、取締役社長、総括役員、本部長、経営企画部統括役員、人事部統括役員、リスク統括部統括役員、コンプライアンス統括部統括役員、コンプライアンス統括部長および社外弁護士をメンバーとする「コンプライアンス委員会」を設置し、当社の企業活動についてコンプライアンスの観点から検討し、当社のコンプライアンス体制が適切に機能しているかを検証し、もって当社のコンプライアンス向上のための諸施策を定めることを目的として、原則四半期毎に審議を行っております。

また当社では、より多くのお客さまからの満足と支持をいただき、かつ、もっとも模範的な金融市場の担い手となるため、業務を遂行するにあたっての基本的な価値観・活動指針として「経営ビジョン」を制定しております。また「経営ビジョン」の下に、役職員の具体的な判断基準・行動基準を示す「行動規範」・「コンプライアンスに関する G・G・S 規則」を定めております。

なおコンプライアンス体制を実効性あるものにするための実践計画として、コンプライアンス・プログラムを制定しており、また、コンプライアンスを実現するための具体的な手引書としてコンプライアンス・マニュアルを制定しております。

① コンプライアンス監視部署の分掌

本支店のリテール業務関連部署の担当としてリテール業務管理部を設置し、本社のホールセール業務関連部署の担当として法人・市場コンプライアンス部、全社的なコンプライアンス体制の統括部署としてコンプライアンス統括部を設置しております。また日本証券業協会規則、金融先物取引業協会規則に基づく内部管理責任者を各営業部店、法人・市場コンプライアンス部に配置し、コンプライアンスに関する日々の指導、モニタリング等を行っております。その他、業務上の事故の調査、処理および諸官庁への届出等についてはコンプライアンス統括部が担当し、法人関係情報等の管理・審査等、利益相反にかかる管理等、および株式、債券等の価格形成の審査、売買取引の管理については法人・市場コンプライアンス部が担当しております。

② 役職員に対するコンプライアンス教育・研修実施

営業部店および本社各部室においては、部室店長、内部管理責任者等による日常的な指導のほか、部店コンプライアンス研修の毎月実施や階層別（役員、部店長、内部管理責任者、新入社員等）研修、専門（中途採用者等）研修等を定期的に実施することによって、役職員に法令諸規則等の理解と遵守の徹底を図っております。コンプライアンス統括部は、研修等の内容および実施状況の報告を受け、その内容を把握・検証し、実効性を高めるよう努めております。

また、年に一度、全職員を対象に「コンプライアンステスト」を実施し、研修内容の理解、把握の定着に努めております。

③ お客さまからのご意見等への対応

お客さまからのご意見、ご要望等につきましては、営業店はもとより、本社「リテール業務管理部お客さま相談室」等においても真摯に承っております。「お客さまの声」をお客さまサービスの向上や業務改善に反映させるべく、本社と営業店が情報を共有し、課題の解決、改善に向け、積極的に取り組んでおります。本社ではリテール業務管理部が取り纏め部署となり関係部署と検討会を継続的に開催し、課題・改善策について協議・検討を行い、各種改善策の策定・実施を行っております。

改善実施状況等につきましては経営に報告するとともに、全社向けの各種媒体を通じて注意喚起、ならびに周知徹底を図っております。

(2) リスク管理体制

① リスクガバナンス

当社は、業務戦略・収益計画と各種リスクの運営方針を有機的に関連付け一体管理する枠組みとしてリスク・アパタイト・フレームワーク（RAF）を導入しています。RAFの基本方針は、「リスク・アパタイト・ステートメント（RAS）」として取締役会において定め、経営戦略およびこれに基づく収益計画を実現・達成するために、当社が許容すべきリスクの種類および量について、明文化しています。当社は、経営計画をRASに基づいて策定し、業務運営がRASに沿ってなされているかモニタリングを実施し、その結果は、定期的に取り締役会および後述するリスク管理会議に報告しています。また、当社は、取締役会からリスク管理に係る重要事項の決議を委任された「リスク管理会議」において、「市場リスク管理規程」「信用リスク管理規程」「資金流動性リスク管理規程」「自己資本規制に関するリスク管理規程」「モデル管理規程」「オペレーショナルリスク管理規程」「新商品・新種業務取扱規程」「既存商品・既存業務の期中管理に関する規程」等を制定し、当該規程に則りリスク管理を行っています。各種リスクの状況は、業務を執行する部署から独立したリスク管理部署がモニタリングするとともに、その結果を定期的、経営陣に、リスク管理会議および取締役会に報告しています。

金融商品の時価評価の状況は、財務部門であるプロダクト・コントロール部署が日次でモニタリングするとともに、独立した検証を行い、その結果を定期的に経営会議に報告しています。

② 市場リスク

市場リスクは、(a)市場リスク量による管理方法、(b)ストレステストによる管理方法、(c)感応度等による管理方法、等を通じて、それぞれに限度枠を設定し、リスク管理部署がその遵守状況をモニタリングすることにより管理を行っています。これら市場リスク管理の状況は、定期的な市場関連リスク管理委員会、リスク管理会議ならびに取締役会にリスク管理部署が取り纏めて報告しています。

(a)市場リスク量による管理方法

市場リスク量は、保有期間や信頼区間等の一定の前提条件の下、市場変化によって被る可能性のある損失額として定義されます。当社では、商品有価証券やデリバティブ取引等の全てのトレーディング・ポジションを対象として、金利、為替、株価等の代表的な市場変化に伴うリスクを表すVaR（バリュー・アット・リスク）と債券や株式等の個別銘柄事情に起因した価格変動リスクを表すVaI（バリュー・アット・イデオシンクラティック・リスク）を日次で計測しています。これらVaRおよびVaI（これらを合わせて「市場リスク量」といいます。）の算定に当たっては、保有期間10日間、信頼区間99%、観測期間701日間のヒストリカル・シミュレーション法を採用した計測モデルを用いています。こうして算出される市場リスク量について、各業務分野の本部、部、課などの組織階層毎に限度枠（市場リスク量枠）を設定し、その費消状況等を日次でモニタリングしています。これらの限度枠は、原則、半期毎に見直しを行っています。なお、上記市場リスク量は、月次でバック・テストを行い、計測モデルの妥当性を確認しています。加えて、当該市場リスク量の算出プロセスについて、内部監査部署による監査を定期的に行い、適切なモデル運営に努めています。

(b)ストレステストによる管理方法

当社では、市場リスク量だけでは捕捉し切れない大幅な市場変化等のストレス事象が発生した際に生じる想定損失額を一定限度に収めるため、ストレステストを週次で実施すると共に、そこで算出されたストレス損失額に対して、一定の限度枠を設定し、管理しています。当社のストレステストは、保有している市場リスク・ポジションについて、債券や株式等のように市場流動性の高いポジションとエキゾチック・デリバティブ等のように市場流動性の低いポジションに分別した上で、それぞれに市場流動性を反映したストレスシナリオを設定して、計測を行っています。特に、市場流動性の低いリスク・ポジションに対しては、別途内枠を設定し、当該リスク・ポジションが抑制的に運営されるよう管理しています。なお、ストレステストの計測手法は、保有するリスク・ポジション状況や市場変化等を考慮した上で、原則、半期毎に見直しを行っています。

(c) 感応度等による管理方法

上記市場リスク量やストレステストを通じた管理を補完するものとして、それぞれの商品・業務特性に応じて市場リスク・ファクターの各種感応度や取引残高に対して、様々な限度枠（「各種パラメータ枠」といいます。）を設定し、日次でモニタリングすることにより、きめ細かな管理を行っています。これら各種パラメータ枠は、市場リスク量枠等と整合性を確認しつつ、原則、半期毎に見直しを行っています。

当社では、バック・テストングを通じて、当該市場リスク量のモデルとしての妥当性を定期的に検証しています。平成28年度に関して実施したバック・テストングの結果、ポートフォリオを固定した場合において発生したと想定される損失額が市場リスク量を超えた事例はありません。

③ 信用リスク

信用リスクは、「与信リスク」、「発行体リスク」および「カントリーリスク」毎に、管理方法を定めています。与信リスクは取引先グループないし取引先毎に管理し、与信の供与は、リスク管理会議において決定するほか、リスク管理会議からの権限委譲に基づき決定しています。また、取引先破綻による損失の拡大を未然に防ぐため、与信ポートフォリオに対するストレステストを月次で実施し、与信リスクが抑制的に運営されるよう管理しています。当社のストレステストは、大幅な市場変化等のストレス事象が発生した際に生じる当社債権額の増加額、および取引先の破綻シナリオ（20万シナリオ）から推計されるストレス損失額を計測しています。発行体リスクは、集中度回避等を目的とするポートフォリオ管理を原則とし、当社がトレーディング目的で保有する有価証券等およびクレジット・デリバティブ取引における参照体に対し、格付別の上限額等を設定することにより管理しています。また、特定の発行体等へのリスクの集中を回避することを目的とし、発行体グループ別限度枠、業種別限度枠等を設定することにより管理しています。カントリーリスクは、対象国毎に当該国のリスクに晒されているカントリーリスク額の上限を設定することにより管理しています。これら信用リスク管理の状況は、定期的に市場関連リスク管理委員会、リスク管理会議ならびに取締役会にリスク管理部署が取り纏めて報告しています。

④ 資金流動性リスク

当社では、当社およびMUF Gグループの信用力の状況や資金調達市場の状況等に応じて、当社における資金流動性に係る危険度段階（流動性ステージ）を決定すること、ならびに決定されたステージに応じた資金流動性に係る行動計画およびコンティンジェンシー・プランを定めています。加えて、商品在庫を当社調達力の範囲内に抑え、資金調達が一時点に集中することを回避するために、日本国債を除く保有資産の総額（非国債総量枠）ならびに一定期間中の必要な市場調達額（要調達限度枠）に上限を設定し、これら費消を一定限度に抑えると共に、市場調達が停止する等のストレス状況下での資金繰り可能期間（生存期間）および資金流出額に対する良質な流動資産の割合（バーゼル規制の流動性カバレッジ比率（LCR））について、一定水準を確保する管理を行っています。なお、これら非国債総量枠、要調達限度枠、および生存期間は、日次でモニタリングし、当社の信用状況や市場調達環境を考慮しつつ、原則として、半期毎に見直しを行っています。また、当社では資金流動性ストレステストを日次で行い、調達市場の機能停止などの資金調達に係るストレス事象が発生した際の資金繰り状況について計測しています。これら資金流動性リスク管理の状況は、定期的に市場関連リスク管理委員会、リスク管理会議ならびに取締役会にリスク管理部署が取り纏めて報告しています。

⑤ オペレーショナルリスク

当社では、オペレーショナルリスクを、内部プロセス・人・システムが不適切であることもしくは機能しないこと、または外生的事象に起因する損失に係るリスクと定義し、具体的には「事務リスク」、「情報資産リスク」、「法的リスク」、「人材リスク」、「有形資産リスク」、「評判リスク」に分類のうえ、各々の規模・特性に応じた管理を行っています。オペレーショナルリスクは全ての業務に存在することから、コントロール・セルフ・アセスメント（CSA）等を実施し、重要な内部統制プロセスにおけるオペレーショナルリスクの認識・評価を行っています。オペレーショナルリスクの管理状況は、リスク管理部署が取り纏め、定期的にリスク管理会議および取締役会に報告しています。

(3) 危機管理体制

当社は、経営会議の諮問機関である「危機管理委員会」において、危機管理に関する総合的な計画を策定し、報告・審議する体制としています。

具体的には、災害等の危機が発生した際に、お客さまや市場に与える影響を最小限にとどめることができるよう、危機対応に関する基本的な考え方や判断基準を明確にしたうえで、事業継続に向けた基本方針を定め、業務継続計画やインフラ等の通常機能の回復に関する体制を整備しています。

① 事業継続に向けた基本方針

- ・お客さまおよび役職員の生命、身体等の安全確保を最優先とします。
- ・お客さまのデータおよび資産保護を図りつつ、迅速な復旧対策を講じます。
- ・非常時において当社の事業に支障が生じ、全ての業務を継続させることが困難となった場合には、お客さまの生活、経済活動および証券市場の機能維持の観点から優先する業務を再開・継続させるよう努めるとともに、お客さまへの影響の極小化に努めます。

② 業務継続計画の概要

- ・当社のシステムおよびネットワークは、重要な業務の再開・継続をサポートできるよう設計されております。
- ・業務部門およびシステム部門が協働して、業務の再開・継続に向けた対策を実施します。
- ・お客さまのお取引店がご注文等を承ることができない場合は、お電話をコールセンターに転送して承ることができるよう対応しております。

③ インフラの整備

- ・本社拠点が使用できない場合に備えて、重要な業務を継続・再開するためのバックアップサイトを設置しております。
- ・本社拠点およびバックアップサイトには、停電時に備え非常用発電機を設置しております。
- ・重要なシステムは、通常の処理を行うデータセンタ（メインセンタ）およびバックアップ用データセンタ（サブセンタ）双方に設置されており、業務の再開に必要なデータは予め定められた方法でサブセンタに保管されております。

当社では、災害のみならず、幅広い事象を対象とする業務継続体制を整備するとともに、その実効性を向上させるべく、訓練を定期的実施しております。

特に、大規模な地震などの自然災害等、およびその結果生じる大規模停電等については、その影響を大きく受けると考えられることから、業務継続計画の実効性を向上させるべく見直しを行うとともに、バックアップシステムの整備等業務継続体制の強化を図っています。

(4) 内部監査体制

① 内部監査部門の設置

業務の健全かつ適切な運営を確保するうえで必要不可欠なコンプライアンス態勢やリスク管理態勢を含む内部管理態勢の確認のため、社内各部門に対し監査を行う部署として内部監査部を設置しております。そして、内部監査部は組織上、社内の何れの部門にも属していない他、内部監査結果等は専任役員により取締役会へ直接報告しており、業務執行部門からの独立性が確保されております。

② 内部監査の実施

本社各部署および営業店における内部管理態勢の適切性・有効性を検証・評価し、結果を経営陣に対し報告するとともに、検出された問題点の改善策提言を行っております。

③ 監査役や外部監査人との協力関係

内部監査部長は、監査役および会計監査人等の外部監査人との間で協力関係を構築し、内部監査の効率的な実施に努めております。

2. 分別管理等の状況

(1) 金融商品取引法第43条の2の規定に基づく分別管理の状況

①顧客分別金信託の状況

| 項目 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|--------------------|------------|------------|
| 直近差替計算基準日の顧客分別金必要額 | 165,575百万円 | 210,436百万円 |
| 期末日現在の顧客分別金信託額 | 149,507百万円 | 218,946百万円 |
| 期末日現在の分別金必要額 | 155,161百万円 | 204,648百万円 |

②有価証券の分別管理の状況

イ 保護預り等有価証券

| 有価証券の種類 | | 平成28年3月期末 | | 平成29年3月期末 | |
|---------------------------|------|--------------|----------------|--------------|----------------|
| | | 国内有価証券 | 外国有価証券 | 国内有価証券 | 外国有価証券 |
| 株券 | 株数 | 14,151,783千株 | 551,836,764千株 | 13,327,563千株 | 898,327,965千株 |
| 債券 | 額面金額 | 5,693,412百万円 | 4,641,225百万円 | 5,889,666百万円 | 4,948,713百万円 |
| 受益証券 (※1) | 口数 | 4,742,110百万口 | 264,605百万口 | 4,640,057百万口 | 245,294百万口 |
| 新株予約権 証券 | 数量 | 0個 | 34,236,168ワラント | 0個 | 34,236,168ワラント |
| 受益証券発行 信託(JDR) (※2) | 金額 | 2,600百万円 | — | 2,065百万円 | — |

ロ 受入保証金代用有価証券

| 有価証券の種類 | | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|---------------------------|------|-----------|-----------|
| | | 数量 | 数量 |
| 株券 | 株数 | 62,721千株 | 58,634千株 |
| 債券 | 額面金額 | 1,396百万円 | 375百万円 |
| 受益証券 (※1) | 口数 | 27,757百万口 | 27,227百万口 |
| 受益証券発行 信託(JDR) (※2) | 金額 | 178百万円 | 184百万円 |

(※1) 受益証券の外国証券にはステーブル受益証券を含みます。

(※2) 受益証券発行信託(JDR)は時価による表記となります。

ハ 管理の状況

| 有価証券種類 | 当社の管理形態 |
|-------------|--|
| 国内株式 | 「社債、株式等の振替に関する法律」に基づく振替決済制度において取扱う国内株式は、株式会社証券保管振替機構で保管し、当社は口座管理機関としてお客さま毎の持分を直ちに判別できる状態で管理しています。 上記以外は、株式会社だいこう証券ビジネス等においてお客さま毎に、あるいは当社の帳簿等によりお客さま毎の持分が直ちに判別できるよう管理しています。 |
| 国内債券 | 「社債、株式等の振替に関する法律」に基づく振替決済制度において取扱う国内債券の内、国債は日本銀行において、その他債券は株式会社証券保管振替機構で保管し、当社は口座管理機関としてお客さま毎の持分を直ちに判別できる状態で管理しています。 上記以外は、株式会社だいこう証券ビジネス等においてお客さま毎に、あるいは当社の帳簿等によりお客さま毎の持分が直ちに判別できるよう管理しています。 |
| 国内投資信託受益証券等 | 「社債、株式等の振替に関する法律」に基づく振替決済制度において取扱う国内投資信託受益証券、および受益証券発行信託は、株式会社証券保管振替機構で保管し、当社は口座管理機関としてお客さま毎の持分を |

| | |
|-----------|--|
| | 直ちに判別できる状態で管理しています。 上記以外は、株式会社だいこう証券ビジネス等においてお客さま毎に、あるいは当社の帳簿等によりお客さま毎の持分が直ちに判別できるよう管理しています。 |
| 国内新株予約権証券 | 「社債、株式等の振替に関する法律」に基づく振替決済制度において取扱う国内新株予約権証券は、株式会社証券保管振替機構で保管し、当社は口座管理機関としてお客さま毎の持分を直ちに判別できる状態で管理しています。 |
| 累積投資商品 | 有価証券の種別に応じ、上記同様の管理をしています。 自己とお客さまとが共有している有価証券は、当社の帳簿等によりお客さま毎の持分が直ちに判別できるよう管理しています。 |
| 外国有価証券 | 国内で上場されている外国有価証券は、株式会社証券保管振替機構で保管し、当社の帳簿等によりお客さま毎の持分が直ちに判別できるよう管理しています。 上記以外は、原則海外の保管機関において保管しています。当社の帳簿等によりお客さま毎の持分が直ちに判別できるよう管理しています。(現地保管機関の国内の諸法令および慣行、ならびに現地保管機関の諸規則等に従って管理しています。) 一部、株式会社だいこう証券ビジネス等においてお客さま毎に管理しています。 |

③対象有価証券関連店頭デリバティブ取引等に係る分別管理の状況

| 項目 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|--------------------|-----------|-----------|
| 直近差替計算基準日の顧客分別金必要額 | 10,724百万円 | 0百万円 |
| 期末日現在の顧客分別金信託額 | 15,310百万円 | 50百万円 |
| 期末日現在の分別金必要額 | 11,729百万円 | 0百万円 |

(2) 金融商品取引法第43条の2の2の規定に基づく区分管理の状況

該当事項はありません。

(3) 金融商品取引法第43条の3の規定に基づく区分管理の状況

① 法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況

| | 有価証券の種類 | 管理の方法 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 | 内訳 | |
|-------|---------|----------|-----------|-----------|-----------|----------------------------------|
| | 金銭 | - | 金銭信託 | 90百万円 | 250百万円 | 三菱UFJ信託銀行 |
| 有価証券等 | 債券 | 第三者による管理 | | 22,015百万円 | 28,142百万円 | 日本銀行 |
| | | | | 1,350百万円 | 1,000百万円 | 証券保管振替機構 |
| | | | | 22,915百万円 | 21,475百万円 | Euroclear |
| | | | | 493百万円 | 1,604百万円 | Mitsubishi UFJ Investor Services |

② 法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況

該当事項はありません。

V. 当社及びその子法人等の概況

1. 特別金融商品取引業者の商号 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
2. 特別金融商品取引業者の登録年月日 金融商品取引業者登録 平成22年2月10日
(登録番号) (関東財務局長(金商)第2336号)
3. 特別金融商品取引業者の届出日 平成23年4月14日

4. 主要な事業の内容及び組織の構成

当社グループは、金融商品取引業を中心とする営業活動を各地域で展開し、主たる事業として投資・金融サービス業（有価証券の売買およびその委託の媒介等、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、その他の金融商品取引業ならびに貸金業等）を営んでおり、お客さまに対し資金調達、資金運用の両面で幅広いサービスを提供しております。

なお、当社グループの事業の系統図は次頁の通りであります。

(投資・金融サービス業)

(親会社)

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ

(親会社)

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社
(MUSHD)

(親会社であるMUSHDの
関連当事者)

株式会社三菱東京UFJ銀行
三菱UFJ信託銀行株式会社

証券業務

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

(当社の国内子会社)

三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社

(親会社であるMUSHDの国内子会社)

カブドットコム証券株式会社

(親会社であるMUSHDの海外(英国)子会社)

MUFGセキュリティーズEMEA

(親会社であるMUSHDの海外(米国)子会社)

MUFGセキュリティーズアメリカ※

MUFGセキュリティーズ(カナダ)※

その他

(親会社であるMUSHDの国内子会社)

MUSビジネスサービス株式会社
エム・ユー・エス情報システム株式会社
MMパートナーシップ

(親会社であるMUSHDの海外子会社)

MUFGセキュリティーズアジア
MUFGセキュリティーズアジア(シンガポール)
SL16, Limited
三菱UFJウェルスマネジメント銀行(スイス)

(親会社であるMUSHDの国内関連会社)

モルガン・スタンレーMUFG証券株式会社
三菱UFJ国際投信株式会社
丸の内キャピタル株式会社

※ 平成28年7月1日付でMUFGセキュリティーズアメリカおよびその子会社であるMUFGセキュリティーズ(カナダ)は当社の親会社であるMUSHDの連結範囲から除外されておりますが、社内収益管理は引き続き両社含めて行うため、当社グループに含めております。

5. 子法人等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等

(平成29年6月30日現在)

| 商号又は名称 | 主たる事務所の所在地 | 資本金の額 | 事業の内容 | 議決権の保有割合(%) |
|--|------------|----------|---------|----------------|
| (連結子会社) 三菱UFJモルガン・スタンレー PB証券株式会社 | 東京都千代田区 | 8,000百万円 | 金融商品取引業 | 75.0 (75.0) |
| (持分法適用関連会社) 0社 | — | — | — | — |
| (その他) 0社 | — | — | — | — |

(注)「議決権の保有割合」欄には、当社が保有する子法人等の議決権の数が、当該子法人等の総株主等の議決権の数に占める割合を記載し、同欄の()内には、当社及びその一の子法人等以外の子法人等が保有する当該一の子法人等の議決権の数が、当該一の子法人等の総株主等の議決権の数に占める割合を記載しております。

VI. 当社及びその子法人等の業務の状況

1. 当連結会計年度の業務の概要

当連結会計年度の経済概況等については、10頁の「当期の業務の概要」をご覧ください。

当社及び子法人等の当連結会計年度の営業収益は3,036億49百万円（前期比△11.1%）、経常利益は538億2百万円（同△32.9%）、親会社株主に帰属する当期純利益は344億29百万円（同△33.6%）となりました。

業績の概況は以下のとおりです。

(1) 受入手数料

受入手数料は1,391億46百万円（前期比△17.0%）となりました。内訳は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

| 区 分 | 期 別 | 平成 28 年 3 月 期 | 平成 29 年 3 月 期 |
|---|-----|-------------------------------|------------------------------|
| 委 託 手 数 料 (株 券) | | 35,060 (32,912) | 29,991 (28,398) |
| 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の 手 数 料 (株 券) (債 券) | | 18,993 (13,464) (5,528) | 16,400 (9,639) (6,760) |
| 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の 取 扱 手 数 料 | | 49,417 | 35,479 |
| そ の 他 の 受 入 手 数 料 | | 64,080 | 57,275 |
| 合 計 | | 167,551 | 139,146 |

(2) トレーディング損益

トレーディング損益は、1,429億30百万円の利益（前期比△6.4%）となりました。内訳は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

| 区 分 | 期 別 | 平成 28 年 3 月 期 | 平成 29 年 3 月 期 |
|---|-----|----------------------------------|----------------------------------|
| 株 券 等 ト レ ー デ ィ ン グ 損 益 | | 38,259 | 36,875 |
| 債 券 等 ・ そ の 他 の ト レ ー デ ィ ン グ 損 益 (債 券 等 ト レ ー デ ィ ン グ 損 益) (そ の 他 の ト レ ー デ ィ ン グ 損 益) | | 114,486 (102,910) (11,575) | 106,054 (107,263) (△1,208) |
| 合 計 | | 152,745 | 142,930 |

(3) 金融収支

金融収益から金融費用を差し引いた金融収支は130億4百万円の利益（前期比+16.4%）となりました。

(4) 販売費・一般管理費

販売費・一般管理費は2,426億42百万円（前期比△3.9%）となりました。

(5) 特別損益

当期の特別利益は20百万円、特別損失は19億65百万円となりました。特別利益は投資有価証券売却益であります。特別損失のうち主なものは、本社移転費用16億26百万円であります。

以上の結果、特別利益から特別損失を差し引いた特別損益は19億45百万円の損失となりました。

2. 業務の状況を示す指標

(単位:百万円)

| 区 分 | 期 別 | 平成 28 年 3 月 期 | 平成 29 年 3 月 期 |
|-------------------------------|-----|---------------|---------------|
| 営 業 収 益 | | 341,375 | 303,649 |
| 純 営 業 収 益 | | 331,470 | 295,082 |
| 経 常 利 益 | | 80,175 | 53,802 |
| 親 会 社 株 主 に 帰 属 す る 当 期 純 利 益 | | 51,813 | 34,429 |
| 包 括 利 益 | | 49,995 | 36,048 |
| 純 資 産 額 | | 392,960 | 427,529 |
| 総 資 産 額 | | 14,118,686 | 14,964,282 |
| 連 結 自 己 資 本 規 制 比 率 | | 279.3% | 324.7% |

VII. 当社及びその子法人等の財産の状況に関する事項

1. 経理の状況

(1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

| 資 産 の 部 | | |
|---------------------|-----------------|-----------------|
| 科 目 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
| 流 動 資 産 | 13,991,828 | 14,814,611 |
| 現 金 ・ 預 金 | 1,059,364 | 1,284,875 |
| 預 託 金 | 194,920 | 255,334 |
| ト レ ー デ ィ ン グ 商 品 | 9,038,868 | 8,254,973 |
| 商 品 有 価 証 券 等 | 1,948,046 | 2,548,476 |
| デ リ バ テ ィ ブ 取 引 | 7,090,821 | 5,706,497 |
| 約 定 見 返 勘 定 | 40,713 | 268,549 |
| 営 業 投 資 有 価 証 券 等 | 93 | 93 |
| 信 用 取 引 資 産 | 52,639 | 47,887 |
| 信 用 取 引 貸 付 金 | 49,813 | 44,924 |
| 信 用 取 引 借 証 券 担 保 金 | 2,826 | 2,963 |
| 有 価 証 券 担 保 貸 付 金 | 2,972,291 | 4,051,770 |
| 借 入 有 価 証 券 担 保 金 | 2,972,291 | 3,624,868 |
| 現 先 取 引 貸 付 金 | — | 426,901 |
| 立 替 金 | 3,104 | 2,589 |
| 短 期 差 入 保 証 金 | 577,074 | 599,085 |
| 短 期 貸 付 金 | 109 | 109 |
| 繰 延 税 金 資 産 | 16,444 | 15,192 |
| 未 収 還 付 法 人 税 等 | 69 | — |
| そ の 他 の 流 動 資 産 | 36,134 | 34,150 |
| 貸 倒 引 当 金 | △0 | △0 |
| 固 定 資 産 | 126,857 | 149,671 |
| 有 形 固 定 資 産 | 22,035 | 29,709 |
| 建 物 | 10,913 | 18,950 |
| 器 具 ・ 備 品 | 9,335 | 10,743 |
| 土 地 | 0 | 0 |
| 建 設 仮 勘 定 | 1,786 | 14 |
| 無 形 固 定 資 産 | 79,073 | 91,631 |
| ソ フ ト ウ ェ ア | 47,516 | 61,810 |
| の れ ん | 31,219 | 29,484 |
| そ の 他 | 338 | 336 |
| 投 資 そ の 他 の 資 産 | 25,748 | 28,329 |
| 投 資 有 価 証 券 | 4,541 | 4,751 |
| 長 期 貸 付 金 | 30 | 22 |
| そ の 他 | 21,996 | 23,999 |
| 貸 倒 引 当 金 | △819 | △442 |
| 資 産 合 計 | 14,118,686 | 14,964,282 |

(単位：百万円)

| 負債の部 | | |
|---------------------------|------------|------------|
| 科 目 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
| 流 動 負 債 | 13,346,958 | 14,154,791 |
| ト レ ー デ ィ ン グ 商 品 | 8,036,939 | 7,819,237 |
| 商 品 有 価 証 券 等 | 1,019,958 | 2,135,607 |
| デ リ バ テ ィ ブ 取 引 | 7,016,981 | 5,683,629 |
| 信 用 取 引 負 債 | 24,816 | 50,535 |
| 信 用 取 引 借 入 金 | 2,208 | 6,507 |
| 信 用 取 引 貸 証 券 受 入 金 | 22,608 | 44,027 |
| 有 価 証 券 担 保 借 入 金 | 2,575,240 | 2,795,100 |
| 有 価 証 券 貸 借 取 引 受 入 金 | 2,372,809 | 2,395,349 |
| 現 先 取 引 借 入 金 | 202,430 | 399,751 |
| 預 り 金 | 182,936 | 239,531 |
| 受 入 保 証 金 | 383,462 | 438,677 |
| 短 期 借 入 金 | 1,430,000 | 2,174,649 |
| 1 年 内 返 済 予 定 の 長 期 借 入 金 | 34,500 | 64,500 |
| コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー | 617,500 | 504,000 |
| 未 払 法 人 税 等 | 8,479 | 8,237 |
| 賞 与 引 当 金 | 14,921 | 14,226 |
| そ の 他 の 流 動 負 債 | 38,162 | 46,095 |
| 固 定 負 債 | 376,889 | 380,045 |
| 長 期 借 入 金 | 369,400 | 368,300 |
| 退 職 給 付 に 係 る 負 債 | 1,564 | 1,839 |
| 資 産 除 去 債 務 | 5,629 | 7,634 |
| そ の 他 の 固 定 負 債 | 294 | 2,272 |
| 特 別 法 上 の 準 備 金 | 1,878 | 1,916 |
| 金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 | 1,878 | 1,916 |
| 負 債 合 計 | 13,725,726 | 14,536,752 |

(単位：百万円)

| 純 資 産 の 部 | | |
|-------------------------|-----------------|-----------------|
| 科 目 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
| 株 主 資 本 | 385,716 | 420,145 |
| 資 本 金 | 40,500 | 40,500 |
| 資 本 剰 余 金 | 183,555 | 183,555 |
| 利 益 剰 余 金 | 161,660 | 196,089 |
| そ の 他 の 包 括 利 益 累 計 額 | 3,199 | 3,188 |
| そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金 | 1,380 | 1,547 |
| 退 職 給 付 に 係 る 調 整 累 計 額 | 1,818 | 1,641 |
| 非 支 配 株 主 持 分 | 4,044 | 4,195 |
| 純 資 産 合 計 | 392,960 | 427,529 |
| 負 債 ・ 純 資 産 合 計 | 14,118,686 | 14,964,282 |

(2) 連結損益計算書及び連結包括利益計算書

①連結損益計算書

(単位：百万円)

| 科 目 | 平成 28 年 3 月期 | 平成 29 年 3 月期 |
|---------------------------|--------------|--------------|
| 営 業 収 益 | 341,375 | 303,649 |
| 受 入 手 数 料 | 167,551 | 139,146 |
| ト レ ー デ ィ ン グ 損 益 | 152,745 | 142,930 |
| 営 業 投 資 有 価 証 券 等 損 益 | 0 | 0 |
| そ の 他 の 商 品 売 買 損 益 | — | 0 |
| 金 融 収 益 | 21,077 | 21,571 |
| 金 融 費 用 | 9,904 | 8,567 |
| 純 営 業 収 益 | 331,470 | 295,082 |
| 販 売 費 ・ 一 般 管 理 費 | 252,411 | 242,642 |
| 取 引 関 係 費 | 95,389 | 84,949 |
| 人 件 費 | 79,498 | 75,080 |
| 不 動 産 関 係 費 | 18,235 | 21,434 |
| 事 務 費 | 33,838 | 32,829 |
| 減 価 償 却 費 | 16,267 | 18,424 |
| 租 税 公 課 | 3,774 | 4,899 |
| そ の 他 | 5,406 | 5,023 |
| 営 業 利 益 | 79,059 | 52,440 |
| 営 業 外 収 益 | 1,658 | 1,695 |
| 受 取 配 当 金 | 145 | 133 |
| 不 動 産 賃 貸 料 | 347 | 438 |
| シ ス テ ム 利 用 料 | 391 | 397 |
| 業 務 委 託 費 | 163 | 45 |
| そ の 他 | 610 | 680 |
| 営 業 外 費 用 | 542 | 332 |
| 固 定 資 産 除 却 損 | 220 | 243 |
| デ リ バ テ ィ ブ 運 用 損 失 | 195 | — |
| そ の 他 | 125 | 89 |
| 経 常 利 益 | 80,175 | 53,802 |
| 特 別 利 益 | 1,067 | 20 |
| 投 資 有 価 証 券 売 却 益 | 1,067 | 20 |
| 特 別 損 失 | 1,068 | 1,965 |
| 減 損 損 失 | 667 | 297 |
| 金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金 繰 入 | 152 | 37 |
| 本 社 移 転 費 用 | 2 | 1,626 |
| そ の 他 | 245 | 3 |
| 税 金 等 調 整 前 当 期 純 利 益 | 80,174 | 51,857 |
| 法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税 | 25,108 | 14,391 |
| 法 人 税 等 調 整 額 | 1,107 | 1,409 |

| | | |
|-----------------|--------|--------|
| 当期純利益 | 53,958 | 36,056 |
| 非支配株主に帰属する当期純利益 | 2,145 | 1,627 |
| 親会社株主に帰属する当期純利益 | 51,813 | 34,429 |

② 連結包括利益計算書

(単位：百万円)

| 科目 | 平成28年3月期 | 平成29年3月期 |
|--------------|----------|----------|
| 当期純利益 | 53,958 | 36,056 |
| その他の包括利益 | | |
| その他有価証券評価差額金 | △794 | 166 |
| 退職給付に係る調整額 | △3,169 | △174 |
| その他の包括利益合計 | △3,963 | △7 |
| 包括利益 (内訳) | 49,995 | 36,048 |
| 親会社株主に係る包括利益 | 47,862 | 34,418 |
| 非支配株主に係る包括利益 | 2,133 | 1,630 |

(3) 連結株主資本等変動計算書

①平成28年3月期

(単位：百万円)

| | 株主資本 | | | | その他の包括利益累計額 | | | 非支配株主持分 | 純資産計 |
|---------------------|--------|---------|---------|---------|--------------|--------------|---------------|---------|---------|
| | 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 | 退職給付に係る調整累計額 | その他の包括利益累計額合計 | | |
| 当期首残高 | 40,500 | 183,555 | 162,159 | 386,215 | 2,174 | 4,975 | 7,150 | 4,790 | 398,156 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | △52,312 | △52,312 | | | | | △52,312 |
| 親会社株主に帰属する当期純利益 | | | 51,813 | 51,813 | | | | | 51,813 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | △794 | △3,156 | △3,951 | △746 | △4,697 |
| 当期変動額合計 | — | — | △499 | △499 | △794 | △3,156 | △3,951 | △746 | △5,196 |
| 当期末残高 | 40,500 | 183,555 | 161,660 | 385,716 | 1,380 | 1,818 | 3,199 | 4,044 | 392,960 |

②平成 29 年 3 月期

(単位：百万円)

| | 株 主 資 本 | | | | その他の包括利益累計額 | | | 非支配株主持分 | 純資産計 |
|---------------------|---------|---------|---------|---------|---------------|--------------|---------------|---------|---------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | 利益剰余金 | 株主資本合計 | その他の有価証券評価差額金 | 退職給付に係る調整累計額 | その他の包括利益累計額合計 | | |
| 当期首残高 | 40,500 | 183,555 | 161,660 | 385,716 | 1,380 | 1,818 | 3,199 | 4,044 | 392,960 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | | | |
| 親会社株主に帰属する当期純利益 | | | 34,429 | 34,429 | | | | | 34,429 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | 166 | △177 | △11 | 151 | 140 |
| 当期変動額合計 | — | — | 34,429 | 34,429 | 166 | △177 | △11 | 151 | 34,569 |
| 当期末残高 | 40,500 | 183,555 | 196,089 | 420,145 | 1,547 | 1,641 | 3,188 | 4,195 | 427,529 |

(4) 注記事項

①平成 28 年 3 月期

a. 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記

1. 連結の範囲に関する事項

連結子会社数は 1 社であります。

連結子会社名

三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社

2. 持分法の適用に関する事項

該当事項はありません。

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社（1社）の決算日は3月末であります。

4. 会計処理基準に関する事項

(1) トレーディングに関する有価証券等の評価基準および評価方法

トレーディングに関する有価証券(売買目的有価証券)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) トレーディング関連以外の有価証券等の評価基準および評価方法

その他有価証券

ア. 時価のあるもの

当連結会計年度末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)によっております。

イ. 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

(3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法

① 有形固定資産の減価償却の方法

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～50年

器具備品 5～15年

② 無形固定資産の減価償却の方法

定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(主として5年)に基づく定額法によっております。

(4) 重要な引当金の計上基準

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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、所定の計算方法による支払見込額を計上しております。

③ 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払に備えるため、連結子会社は内規に基づく当連結会計年度末要支給額を計上しております。

④ 金融商品取引責任準備金

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の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」第175条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) 重要なヘッジ会計の方法

該当事項はありません。

(6) 退職給付に係る会計処理の方法

① 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当連結会計年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

② 数理計算上の差異および過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として12年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、各連結会計年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として12年）による定額法により按分した額をそれぞれ主として発生の翌連結会計年度から費用処理しております。

(7) のれんの償却方法及び償却期間

のれんの償却については、発生の都度、子会社の実態に基づいて償却期間を見積り、20年以内の年数で均等償却しております。

(8) その他連結財務諸表作成のための重要な事項

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き方式によっております。

b. 表示方法の変更に関する注記

(連結財務諸表に関する会計基準の適用)

「連結財務諸表に関する会計基準」（企業会計基準第22号 平成25年9月13日）第39項に掲げられた定め等を適用し、当期純利益等の表示の変更および少数株主持分から非支配株主持分への表示の変更を行っております。当該表示の変更を反映させるため、前連結会計年度については、連結財務諸表の組替えを行っております。

c. 連結貸借対照表に関する注記

| | |
|---|------------|
| 1. 有形固定資産の減価償却累計額 | 20,218百万円 |
| 2. 担保に供している資産および担保に係る債務 | |
| 担保に供している資産 | |
| トレーディング商品 | 105,285百万円 |
| 上記のほか、短期借入金（共通担保資金供給オペレーション）の担保として消費貸借契約により借り入れた有価証券169,773百万円、その他担保として受け入れた有価証券191,113百万円を差し入れております。 | |
| 担保に係る債務 | |
| 短期借入金（共通担保資金供給オペレーション） | 150,000百万円 |
| 信用取引借入金 | 2,208百万円 |
| 計 | 152,208百万円 |

3. 有価証券を担保とした金融取引および有価証券の消費貸借契約により差し入れた、または受け入れた有価証券の時価額は以下のとおりであります。

(1) 差し入れた有価証券

| | |
|--------------------|--------------|
| 信用取引貸証券 | 21,708百万円 |
| 信用取引借入金の本担保証券 | 2,208百万円 |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 2,358,165百万円 |
| 現先取引で売却した有価証券 | 203,015百万円 |
| その他担保として差し入れた有価証券 | 152,006百万円 |

(注) 担保に供している資産に属するものは除いております。

(2) 受け入れた有価証券

| | |
|--------------------|--------------|
| 信用取引貸付金の本担保証券 | 44,005百万円 |
| 信用取引借証券 | 2,826百万円 |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 3,443,020百万円 |
| その他担保として受け入れた有価証券 | 254,905百万円 |

4. 1年内返済予定の長期借入金および長期借入金には、「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176条に定める劣後債務(劣後特約付借入金)176,300百万円が含まれております。

5. 保証債務

該当事項はありません。

a. 連結損益計算書に関する注記

該当事項はありません。

b. 連結包括利益計算書に関する注記

その他の包括利益に係る組替調整額及び税効果額

(単位：百万円)

| | 平成28年3月期 |
|---------------|----------|
| その他有価証券評価差額金： | |
| 当期発生額 | △147 |
| 組替調整額 | △1,061 |
| 税効果調整前 | △1,209 |
| 税効果額 | 415 |
| その他有価証券評価差額金 | △794 |
| 退職給付に係る調整額： | |
| 当期発生額 | △3,546 |
| 組替調整額 | △1,207 |
| 税効果調整前 | △4,753 |
| 税効果額 | 1,584 |
| 退職給付に係る調整額 | △3,169 |
| その他の包括利益合計 | △3,963 |

c. 連結株主資本等変動計算書に関する注記

1. 当連結会計年度の末日における発行済株式の種類および総数

| | |
|--------|----------|
| A種種類株式 | 40株 |
| B種種類株式 | 60株 |
| C種種類株式 | 26,765株 |
| D種種類株式 | 112,400株 |

2. 当連結会計年度中に行った剰余金の配当に関する事項

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり 配当額 | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|--------|-----------------|--------------|------------|-------------|
| 平成27年6月23日 定時株主総会 | A種種類株式 | 12 | 320,340円 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月23日 |
| | D種種類株式 | 36,006 | 320,340円 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月23日 |
| 平成27年10月28日 取締役会 | A種種類株式 | 5 | 144,910円 | 平成27年9月30日 | 平成27年11月13日 |
| | D種種類株式 | 16,287 | 144,910円 | 平成27年9月30日 | 平成27年11月13日 |

3. 当連結会計年度の末日後に行う剰余金の配当に関する事項
該当事項はありません。

②平成 29 年 3 月期

a. 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項に関する注記

1. 連結の範囲に関する事項

連結子会社数は 1 社であります。

連結子会社名

三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社

2. 持分法の適用に関する事項

該当事項はありません。

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社（1社）の決算日は3月末であります。

4. 会計処理基準に関する事項

(1) トレーディングに関する有価証券等の評価基準および評価方法

トレーディングに関する有価証券（売買目的有価証券）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) トレーディング関連以外の有価証券等の評価基準および評価方法

その他有価証券

ア. 時価のあるもの

当連結会計年度末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。

イ. 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

(3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法

① 有形固定資産の減価償却の方法

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 6～50年

器具備品 5～15年

② 無形固定資産の減価償却の方法

定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（主として5年）に基づく定額法によっております。

(4) 重要な引当金の計上基準

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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、所定の計算方法による支払見込額を計上しております。

③ 金融商品取引責任準備金

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の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」第175条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) 重要なヘッジ会計の方法

該当事項はありません。

(6) 退職給付に係る会計処理の方法

① 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当連結会計年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

② 数理計算上の差異および過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として12年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、各連結会計年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として12年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌連結会計年度から費用処理しております。

(7) のれんの償却方法及び償却期間

のれんの償却については、発生の都度、子会社の実態に基づいて償却期間を見積り、20年以内の年数で均等償却しております。

(8) その他連結財務諸表作成のための重要な事項

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き方式によっております。

b. 表示方法の変更に関する注記

1. 連結貸借対照表

前連結会計年度において、区分掲記しておりました「流動負債」の「資産除去債務」および「固定負債」の「役員退職慰労引当金」は金額的重要性が乏しいため、当連結会計年度より「その他」にそれぞれ含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前連結会計年度の連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前連結会計年度の連結貸借対照表において「流動負債」の「資産除去債務」に表示していた1,055百万円および「固定負債」の「役員退職慰労引当金」に表示していた19百万円は、「その他」としてそれぞれ組替えております。

2. 連結損益計算書

前連結会計年度において、「特別損失」の「その他」に含めておりました「本社移転費用」は、特別損失の総額に占める重要性が増したため、当連結会計年度より区分掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前連結会計年度については、連結財務諸表の組替えを行っております。

なお、前連結会計年度において「特別損失」の「その他」に計上されていた「本社移転費用」は2百万円です。

c. 連結貸借対照表に関する注記

1. 有形固定資産の減価償却累計額 20,596百万円

2. 担保に供している資産および担保に係る債務

担保に供している資産

トレーディング商品 229,080百万円

上記のほか、短期借入金（共通担保資金供給オペレーション）の担保として消費貸借契約により借り入れた有価証券146,675百万円及びその他担保として受け入れた有価証券10,137百万円を差し入れております。

担保に係る債務

短期借入金（共通担保資金供給オペレーション） 161,704百万円

3. 有価証券を担保とした金融取引および有価証券の消費貸借契約により差し入れた、または受け入れた有価証券の時価額は以下のとおりであります。

(1) 差し入れた有価証券

信用取引貸証券 44,850百万円

信用取引借入金の本担保証券 6,422百万円

消費貸借契約により貸し付けた有価証券 2,379,764百万円

現先取引で売却した有価証券 406,577百万円

その他担保として差し入れた有価証券 180,751百万円

（注）担保に供している資産に属するものは除いております。

(2) 受け入れた有価証券

信用取引貸付金の本担保証券 42,728百万円

信用取引借証券 2,911百万円

消費貸借契約により借り入れた有価証券 3,955,177百万円

現先取引で買い付けた有価証券 424,953百万円

その他担保として受け入れた有価証券 128,869百万円

4. 1年内返済予定の長期借入金および長期借入金には、「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176条に定める劣後債務（劣後特約付借入金）176,300百万円が含まれております。

5. 保証債務

該当事項はありません。

a. 連結損益計算書に関する注記

該当事項はありません。

b. 連結包括利益計算書に関する注記

その他の包括利益に係る組替調整額及び税効果額

(単位：百万円)

| | 平成29年3月期 |
|---------------|----------|
| その他有価証券評価差額金： | |
| 当期発生額 | 267 |
| 組替調整額 | △20 |
| 税効果調整前 | 246 |
| 税効果額 | △79 |
| その他有価証券評価差額金 | 166 |
| 退職給付に係る調整額： | |
| 当期発生額 | 525 |
| 組替調整額 | △776 |
| 税効果調整前 | △251 |
| 税効果額 | 76 |
| 退職給付に係る調整額 | △174 |
| その他の包括利益合計 | △7 |

c. 連結株主資本等変動計算書に関する注記

1. 当連結会計年度の末日における発行済株式の種類および総数

| | |
|--------|----------|
| A種種類株式 | 40株 |
| B種種類株式 | 60株 |
| C種種類株式 | 26,765株 |
| D種種類株式 | 112,400株 |

2. 当連結会計年度中に行った剰余金の配当に関する事項

該当事項はありません。

3. 当連結会計年度の末日後に行う剰余金の配当に関する事項

該当事項はありません。

2. 借入金の主要な借入先および借入金額

(1) 短期借入金

(単位：百万円)

| 種 類 ま た は 借 入 先 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| コ ー ル ・ マ ネ ー | 880,000 | 1,550,000 |
| 共 通 担 保 資 金 供 給 オ ペ レ ー シ ョ ン | 150,000 | 161,704 |
| 三 菱 U F J 証 券 ホ ー ル デ ィ ン グ ス | 400,000 | 462,945 |
| 合 計 | 1,430,000 | 2,174,649 |

(2) 1年内返済予定の長期借入金

(単位：百万円)

| 借 入 先 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 三 菱 U F J 証 券 ホ ー ル デ ィ ン グ ス | 30,000 | 57,000 |
| そ の 他 | 4,500 | 7,500 |
| 合 計 | 34,500 | 64,500 |

(3) 長期借入金

(単位：百万円)

| 借 入 先 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 三 菱 U F J 証 券 ホ ー ル デ ィ ン グ ス | 146,300 | 119,300 |
| そ の 他 | 223,100 | 249,000 |
| 合 計 | 369,400 | 368,300 |

(注) 「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 176 条に定める劣後特約付借入金が含まれております。

(4) 信用取引借入金

(単位：百万円)

| 借 入 先 | 平成 28 年 3 月 期 末 | 平成 29 年 3 月 期 末 |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 日 本 証 券 金 融 | 2,208 | 6,507 |
| 合 計 | 2,208 | 6,507 |

3. 保有する有価証券(トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く。)の取得価額、時価及び評価損益

- (1) 満期保有目的の債券で時価のあるもの
該当事項はありません。

(2) その他有価証券で時価のあるもの

(単位:百万円)

| 種類 | 平成28年3月期末 | | | 平成29年3月期末 | | | |
|------------------------------------|--------------------|-------|-------|--------------------|-------|-------|-------|
| | 連結貸借 対照表 計上額 | 取得原価 | 差 額 | 連結貸借 対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 | |
| 連結貸借対照 表計上額が取 得原価を超え るもの | (1)株式 | 3,082 | 1,276 | 1,805 | 3,295 | 1,243 | 2,052 |
| | (2)債券 | — | — | — | — | — | — |
| | (3)その他 | — | — | — | — | — | — |
| | 小計 | 3,082 | 1,276 | 1,805 | 3,295 | 1,243 | 2,052 |
| 連結貸借対照 表計上額が取 得原価を超え ないもの | (1)株式 | — | — | — | — | — | — |
| | (2)債券 | — | — | — | — | — | — |
| | (3)その他 | — | — | — | — | — | — |
| | 小計 | — | — | — | — | — | — |
| 合計 | 3,082 | 1,276 | 1,805 | 3,295 | 1,243 | 2,052 | |

(3) 時価を把握することが極めて困難と認められる主な有価証券の内容等

(単位:百万円)

| 種類 | 平成28年3月期末 | 平成29年3月期末 |
|------------------|------------|------------|
| | 連結貸借対照表計上額 | 連結貸借対照表計上額 |
| その他有価証券 非上場株式 | 1,552 | 1,548 |
| 合計 | 1,552 | 1,548 |

4. デリバティブ取引（トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。）の契約価額、時価及び評価損益

- (1) ヘッジ会計が適用されていないもの
該当事項はありません。
- (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。

5. 経営の健全性の状況

(単位:百万円)

| 区分 | | 平成 28 年 3 月 期末 | 平成 29 年 3 月 期末 |
|---------------------------------|-----|----------------|----------------|
| 基本的項目 | (A) | 389,760 | 424,341 |
| 補完的項目合計 | (B) | 181,377 | 181,404 |
| その他有価証券評価差額金(評価益)等 | | 3,199 | 3,188 |
| 金融商品取引責任準備金等 | | 1,878 | 1,916 |
| 一般貸倒引当金 | | 0 | 0 |
| 長期劣後債務 | | 18,000 | 17,000 |
| 短期劣後債務 | | 158,300 | 159,300 |
| 控除資産 | (C) | 130,036 | 154,459 |
| 固定化されていない自己資本の額 (A) + (B) - (C) | (D) | 441,101 | 451,285 |
| リスク相当額合計 | (E) | 157,910 | 138,955 |
| 市場リスク相当額 | | 67,330 | 54,660 |
| 取引先リスク相当額 | | 29,198 | 26,948 |
| 基礎的リスク相当額 | | 61,381 | 57,346 |
| 連結自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 | | 279.3% | 324.7% |

- (注) 1. 市場リスク相当額の算出に関しましては、主として内部管理モデル方式を用いております。
2. 劣後債務の明細は以下の通りです。

①平成 28 年 3 月 期末

(単位:百万円)

| 形態 | 金額 | 契約日 | 弁済期日 |
|----------|---------|-------------------|-------------------|
| 劣後特約付借入金 | 35,000 | 平成 25 年 3 月 29 日 | 平成 30 年 3 月 29 日 |
| | 1,600 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 28 年 9 月 30 日 |
| | 28,400 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 28 年 9 月 30 日 |
| | 22,000 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 29 年 9 月 29 日 |
| | 2,500 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 30 年 9 月 28 日 |
| | 13,000 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 30 年 9 月 28 日 |
| | 10,000 | 平成 25 年 12 月 17 日 | 平成 35 年 12 月 17 日 |
| | 26,800 | 平成 26 年 3 月 31 日 | 平成 31 年 3 月 29 日 |
| | 16,000 | 平成 26 年 9 月 30 日 | 平成 31 年 9 月 30 日 |
| | 13,000 | 平成 26 年 9 月 30 日 | 平成 31 年 9 月 30 日 |
| | 3,000 | 平成 27 年 9 月 30 日 | 平成 37 年 9 月 30 日 |
| | 5,000 | 平成 28 年 3 月 31 日 | 平成 33 年 7 月 30 日 |
| 計 | 176,300 | | |

②平成 29 年 3 月期末

(単位:百万円)

| 形態 | 金額 | 契約日 | 弁済期日 |
|----------|---------|-------------------|-------------------|
| 劣後特約付借入金 | 35,000 | 平成 25 年 3 月 29 日 | 平成 30 年 3 月 29 日 |
| | 22,000 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 29 年 9 月 29 日 |
| | 2,500 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 30 年 9 月 28 日 |
| | 13,000 | 平成 25 年 9 月 30 日 | 平成 30 年 9 月 28 日 |
| | 10,000 | 平成 25 年 12 月 17 日 | 平成 35 年 12 月 17 日 |
| | 26,800 | 平成 26 年 3 月 31 日 | 平成 31 年 3 月 29 日 |
| | 16,000 | 平成 26 年 9 月 30 日 | 平成 31 年 9 月 30 日 |
| | 13,000 | 平成 26 年 9 月 30 日 | 平成 31 年 9 月 30 日 |
| | 3,000 | 平成 27 年 9 月 30 日 | 平成 37 年 9 月 30 日 |
| | 5,000 | 平成 28 年 3 月 31 日 | 平成 33 年 7 月 30 日 |
| | 30,000 | 平成 28 年 9 月 30 日 | 平成 33 年 9 月 30 日 |
| 計 | 176,300 | | |

Mitsubishi UFJ Morgan Stanley