



平成23年3月期 決算短信〔日本基準〕（連結）

平成23年4月28日

会 社 名 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社

U R L <http://www.hd.sc.mufg.jp/>

代 表 者 （役職名）取締役社長 （氏名）秋 草 史 幸

問合せ先責任者 （役職名）財務企画部長 （氏名）圓 城 寺 貢

T E L (03) 6213-2550

定時株主総会開催予定日 平成23年6月28日

有価証券報告書提出予定日 平成23年6月28日

決算補足説明資料作成の有無 : 有・☒ 無

決算説明会開催の有無 : 有・☒ 無

（百万円未満切捨て）

1. 平成23年3月期の連結業績（平成22年4月1日～平成23年3月31日）

(1) 連結経営成績

（％表示は対前期増減率）

	営 業 収 益		純 営 業 収 益		営 業 利 益		経 常 利 益	
	百万円	％	百万円	％	百万円	％	百万円	％
23年3月期	202,262	△41.2	139,866	△51.3	△115,027	—	△95,859	—
22年3月期	343,824	△26.2	287,153	24.9	24,049	—	41,022	—

	当期純利益		1株当たり 当期純利益		潜在株式調整後 1株当たり当期純利益		自己資本 当期純利益率	
	百万円	％	円	銭	円	銭	％	
23年3月期	△50,440	—	△70	35	—	—	△8.4	
22年3月期	28,748	—	40	10	40	09	4.7	

（注）包括利益 23年3月期 △123,652百万円（－％） 22年3月期 62,778百万円（－％）

（参考）持分法投資損益 23年3月期 12,712百万円 22年3月期 228百万円

(2) 連結財政状態

	総 資 産	純 資 産	自己資本比率	1株当たり純資産
	百万円	百万円	％	円 銭
23年3月期	20,486,251	802,106	2.7	778 14
22年3月期	20,134,713	701,654	3.2	889 78

（参考）自己資本 23年3月期 557,913百万円 22年3月期 637,962百万円

（注）「自己資本比率」は、（期末純資産の部合計－期末新株予約権－期末少数株主持分）を期末資産の部合計で除して算出しております。

(3) 連結キャッシュ・フローの状況

	営 業 活 動 による キャッシュ・フロー	投 資 活 動 による キャッシュ・フロー	財 務 活 動 による キャッシュ・フロー	現金および現金同等物 期 末 残 高
	百万円	百万円	百万円	百万円
23年3月期	258,942	64,820	162,018	612,678
22年3月期	△605,490	△26,401	650,194	132,196

2. その他

(1) 期中における重要な子会社の異動（連結範囲の変更を伴う特定子会社の異動） : ☒ 有・無

新規 1 社（MMパートナーシップ）

(2) 会計処理の原則・手続、表示方法等の変更

① 会計基準等の改正に伴う変更 : ☒ 有・無

② ①以外の変更 : 有・☒ 無

(3) 発行済株式数（普通株式）

① 期末発行済株式数（自己株式を含む）

② 期末自己株式数

③ 期中平均株式数

23年3月期	716,985,496株	22年3月期	716,985,496株
23年3月期	—株	22年3月期	—株
23年3月期	716,985,496株	22年3月期	716,985,496株

※監査手続の実施状況に関する表示

この決算短信は、金融商品取引法に基づく財務諸表の監査手続の対象外であり、この決算短信の開示時点において、財務諸表に対する監査手続が実施中です。

※その他の特記事項

該当事項はありません。

○添付資料目次

1. 連結財務諸表

(1) 連結貸借対照表	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 1
(2) 連結損益計算書	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 4
(3) 連結包括利益計算書	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 5
(4) 連結株主資本等変動計算書	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 6
(5) 連結キャッシュ・フロー計算書	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 9
2. 継続企業の前提に関する注記	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 11
3. 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 11
4. 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更	・・・・・・・・	P. 13
5. 連結財務諸表に関する注記事項		
(連結包括利益計算書関係)	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 14
(セグメント情報)	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 14
(1株当たり情報)	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 16

(参考資料)

平成23年3月期 連結決算資料

1. 受入手数料収入

(1) 科目別内訳	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 17
(2) 商品別内訳	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 17
2. トレーディング損益	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 17
連結損益計算書の四半期推移	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 18

(参考資料)

平成23年3月期 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 決算資料

(1) 個別経営成績	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 19
(2) 個別財政状態	・・・・・・・・・・・・・・・・	P. 19

1. 連結財務諸表

(1) 連結貸借対照表

(単位：百万円)

	前連結会計年度末 (平成22年3月31日)	当連結会計年度末 (平成23年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	168,469	618,340
預託金	91,588	79,899
トレーディング商品	11,395,146	10,196,705
商品有価証券等	6,538,721	3,927,867
デリバティブ取引	4,856,424	6,268,837
約定見返勘定	109,281	23,400
営業投資有価証券等	67,650	65,901
営業貸付金	1,448	495
信用取引資産	59,020	53,577
信用取引貸付金	45,958	42,100
信用取引借証券担保金	13,062	11,477
有価証券担保貸付金	6,765,283	7,835,342
借入有価証券担保金	3,180,267	3,292,741
現先取引貸付金	3,585,015	4,542,601
立替金	4,962	8,302
短期差入保証金	435,248	500,844
短期貸付金	111	92
親会社株式	302	236
有価証券	327,962	182,384
未収還付法人税等	1,482	1,282
繰延税金資産	19,473	10,220
その他の流動資産	103,931	41,034
貸倒引当金	△ 967	△ 449
流動資産計	19,550,395	19,617,609
固定資産		
有形固定資産	23,441	23,843
建物	10,391	11,123
器具備品	7,626	6,673
土地	5,357	5,300
リース資産	5	2
建設仮勘定	60	743
無形固定資産	45,508	39,805
ソフトウェア	44,165	38,639
その他	1,343	1,165
投資その他の資産	515,368	804,992
投資有価証券	489,398	751,895
長期貸付金	3,395	3,336
繰延税金資産	5,546	4,258
その他	20,989	49,380
貸倒引当金	△ 3,962	△ 3,878
固定資産計	584,318	868,641
資産合計	20,134,713	20,486,251

(単位：百万円)

	前連結会計年度末 (平成22年3月31日)	当連結会計年度末 (平成23年3月31日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	7,540,898	8,908,654
商品有価証券等	2,932,436	2,847,019
デリバティブ取引	4,608,461	6,061,635
信用取引負債	23,908	11,220
信用取引借入金	18,254	7,948
信用取引貸証券受入金	5,653	3,272
有価証券担保借入金	8,307,900	6,782,909
有価証券貸借取引受入金	3,038,736	1,925,479
現先取引借入金	5,269,163	4,857,429
預り金	132,382	77,405
受入保証金	438,558	771,416
短期借入金	1,367,784	1,369,308
1年内返済予定の長期借入金	108,058	32,300
コマーシャル・ペーパー	374,700	438,800
1年内償還予定の社債	85,130	131,106
未払法人税等	5,901	4,716
賞与引当金	20,630	13,022
資産除去債務	—	895
その他の流動負債	59,648	68,610
流動負債計	18,465,501	18,610,367
固定負債		
社債	681,530	638,231
長期借入金	266,947	409,799
繰延税金負債	4,363	6,783
退職給付引当金	10,773	10,718
役員退職慰労引当金	415	487
資産除去債務	—	4,209
その他の固定負債	1,665	2,176
固定負債計	965,696	1,072,405
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	1,861	1,371
特別法上の準備金計	1,861	1,371
負債合計	19,433,059	19,684,144

(単位：百万円)

	前連結会計年度末 (平成22年3月31日)	当連結会計年度末 (平成23年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	65,518	65,518
資本剰余金	416,948	416,948
利益剰余金	184,580	126,812
株主資本合計	667,047	609,280
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	△ 5,382	△ 7,682
繰延ヘッジ損益	24	6
為替換算調整勘定	△ 23,726	△ 43,690
その他の包括利益累計額合計	△ 29,085	△ 51,366
新株予約権	0	4
少数株主持分	63,691	244,188
純資産合計	701,654	802,106
負債・純資産合計	20,134,713	20,486,251

(2) 連結損益計算書

(単位:百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
営業収益		
受入手数料	185,669	161,494
トレーディング損益	100,418	△ 27,195
営業投資有価証券等損益	△ 2,649	186
その他の商品売買損益	△ 9	4
金融収益	60,396	67,772
営業収益計	343,824	202,262
金融費用	56,671	62,395
純営業収益	287,153	139,866
販売費・一般管理費		
取引関係費	74,852	74,047
人件費	110,023	99,592
不動産関係費	25,728	26,082
事務費	21,729	24,311
減価償却費	21,859	21,652
租税公課	2,485	2,737
貸倒引当金繰入額	999	—
その他	5,425	6,470
販売費・一般管理費計	263,103	254,894
営業利益又は営業損失 (△)	24,049	△ 115,027
営業外収益		
受取利息	8,379	5,032
持分法による投資利益	228	12,712
投資有価証券評価益	8,053	—
その他	2,498	4,369
営業外収益計	19,160	22,114
営業外費用		
支払利息	713	663
固定資産除却損	443	655
為替差損	256	1,122
その他	773	504
営業外費用計	2,187	2,946
経常利益又は経常損失 (△)	41,022	△ 95,859
特別利益		
投資有価証券売却益	1,511	175
固定資産売却益	0	15
負ののれん発生益	—	943
金融商品取引責任準備金戻入	3	489
貸倒引当金戻入	—	71
持分変動利益	—	27,913
特別利益計	1,515	29,608
特別損失		
投資有価証券売却損	9	549
投資有価証券評価損	660	320
固定資産売却損	71	2
減損損失	1,082	3,525
損害賠償金等	726	—
M&A関連損失	469	—
統合関連費用	289	193
子会社整理損	129	—
本社移転費用	—	492
早期割増退職金	—	5,640
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	—	2,473
特別損失計	3,440	13,199
税金等調整前当期純利益又は税金等調整前当期純損失 (△)	39,097	△ 79,450
法人税、住民税及び事業税	12,838	7,744
法人税等調整額	△ 9,883	13,385
法人税等合計	2,954	21,130
少数株主損益調整前当期純損失 (△)	—	△ 100,580
少数株主利益又は少数株主損失 (△)	7,394	△ 50,140
当期純利益又は当期純損失 (△)	28,748	△ 50,440

(3) 連結包括利益計算書

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
少数株主損益調整前当期純損失 (△)	—	△ 100,580
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	—	△ 2,954
繰延ヘッジ損益	—	△ 17
為替換算調整勘定	—	△ 19,372
持分法適用会社に対する持分相当額	—	△ 727
その他の包括利益合計	—	※2 △ 23,071
包括利益	—	※1 △ 123,652
(内訳)		
親会社株主に係る包括利益	—	△ 72,721
少数株主に係る包括利益	—	△ 50,931

(4) 連結株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	65,518	65,518
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	65,518	65,518
資本剰余金		
前期末残高	416,948	416,948
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	416,948	416,948
利益剰余金		
前期末残高	170,580	184,580
当期変動額		
剰余金の配当	△ 14,748	△ 7,327
当期純利益又は当期純損失 (△)	28,748	△ 50,440
当期変動額合計	13,999	△ 57,767
当期末残高	184,580	126,812
株主資本合計		
前期末残高	653,047	667,047
当期変動額		
剰余金の配当	△ 14,748	△ 7,327
当期純利益又は当期純損失 (△)	28,748	△ 50,440
当期変動額合計	13,999	△ 57,767
当期末残高	667,047	609,280

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
その他の包括利益累計額		
その他の有価証券評価差額金		
前期末残高	△ 19,687	△ 5,382
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	14,304	△ 2,299
当期変動額合計	14,304	△ 2,299
当期末残高	△ 5,382	△ 7,682
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	—	24
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	24	△ 17
当期変動額合計	24	△ 17
当期末残高	24	6
為替換算調整勘定		
前期末残高	△ 35,680	△ 23,726
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	11,953	△ 19,963
当期変動額合計	11,953	△ 19,963
当期末残高	△ 23,726	△ 43,690
その他の包括利益累計額合計		
前期末残高	△ 55,368	△ 29,085
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	26,282	△ 22,281
当期変動額合計	26,282	△ 22,281
当期末残高	△ 29,085	△ 51,366
新株予約権		
前期末残高	0	0
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	—	4
当期変動額合計	—	4
当期末残高	0	4

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
少数株主持分		
前期末残高	59,758	63,691
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	3,933	180,496
当期変動額合計	3,933	180,496
当期末残高	63,691	244,188
純資産合計		
前期末残高	657,438	701,654
当期変動額		
剰余金の配当	△ 14,748	△ 7,327
当期純利益又は当期純損失（△）	28,748	△ 50,440
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	30,216	158,219
当期変動額合計	44,216	100,452
当期末残高	701,654	802,106

(5) 連結キャッシュ・フロー計算書

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前当期純利益又は 税金等調整前当期純損失 (△)	39,097	△ 79,450
減価償却費	21,859	21,652
のれん償却額	△ 233	589
負ののれん発生益	—	△ 943
退職給付引当金の増減額 (△は減少)	1,605	92
役員退職慰労引当金の増減額 (△は減少)	4	71
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	685	△ 600
金融商品取引責任準備金の増減額 (△は減少)	△ 3	△ 489
受取利息及び受取配当金	△ 69,664	△ 73,699
支払利息	57,385	63,058
持分法による投資損益 (△は益)	△ 228	△ 12,712
投資有価証券売却損益 (△は益)	△ 1,501	374
投資有価証券評価損益 (△は益)	△ 7,393	△ 1,058
固定資産売却損益 (△は益)	71	△ 12
持分変動損益 (△は益)	—	△ 27,913
減損損失	1,082	3,525
損害賠償金等	726	—
M&A関連損失	469	—
統合関連費用	289	193
子会社整理損	129	—
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	—	2,473
本社移転費用	—	492
早期割増退職金	—	5,640
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	△ 12,940	12,204
トレーディング商品の増減額	△ 854,795	2,335,451
約定見返勘定の増減額 (△は増加)	235,534	88,582
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	△ 16,244	△ 7,360
有価証券担保貸付金及び 有価証券担保借入金の増減額	19,959	△ 2,446,029
立替金及び預り金の増減額	52,122	△ 59,469
短期差入保証金の増減額 (△は増加)	77,543	△ 99,671
受入保証金の増減額 (△は減少)	△ 114,821	353,270
その他	△ 38,589	162,313
小計	△ 607,851	240,576
利息及び配当金の受取額	75,617	84,530
利息の支払額	△ 57,860	△ 56,286
損害賠償金等の支払額	△ 726	—
M&A関連損失の支払額	△ 469	—
統合関連費用の支払額	△ 260	△ 222
子会社整理損の支払額	△ 58	—
本社移転費用の支払額	—	△ 209
法人税等の支払額	△ 13,881	△ 9,446
営業活動によるキャッシュ・フロー	△ 605,490	258,942

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
投資活動によるキャッシュ・フロー		
定期預金の預入による支出	△ 3,558	△ 6,985
定期預金の払戻による収入	12,293	11,699
有価証券の取得による支出	△ 225,307	△ 542,273
有価証券の売却及び償還による収入	157,910	464,020
投資有価証券の取得による支出	△ 46,810	△ 66,939
投資有価証券の売却及び償還による収入	91,727	223,759
有形固定資産の取得による支出	△ 3,006	△ 6,467
有形固定資産の売却による収入	1,532	23
無形固定資産の取得による支出	△ 12,625	△ 11,847
貸付金の増減額 (△は増加)	1,453	78
連結の範囲の変更を伴う 子会社株式の売却による支出	△ 10	—
その他	—	△ 247
投資活動によるキャッシュ・フロー	△ 26,401	64,820
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入金の純増減額 (△は減少)	374,043	2,042
コマーシャル・ペーパーの増減額 (△は減少)	228,200	64,100
長期借入れによる収入	79,583	207,552
長期借入金の返済による支出	△ 108,110	△ 145,162
社債の発行による収入	255,167	206,965
社債の償還による支出	△ 162,850	△ 165,042
配当金の支払額	△ 14,748	△ 7,327
少数株主への分配金支払額	△ 1,208	△ 1,284
少数株主からの払込みによる収入	117	175
財務活動によるキャッシュ・フロー	650,194	162,018
現金及び現金同等物に係る換算差額	4,680	△ 5,299
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	22,982	480,482
現金及び現金同等物の期首残高	109,213	132,196
現金及び現金同等物の期末残高	132,196	612,678

2. 継続企業の前提に関する注記

該当事項はありません。

3. 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項

1. 連結の範囲に関する事項

(1) 連結子会社数 31 社（前年度 30 社）

主要な連結子会社名

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社(注1)

国際投信投資顧問株式会社

MUSプリンシパル・インベストメンツ株式会社

エム・ユー・ハンズオンキャピタル株式会社

エム・ユー・エス・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

エム・ユー・エス・ファシリティサービス株式会社

ビッグウィングインベストメント有限会社

三菱UFJセキュリティーズインターナショナル

三菱UFJウェルスマネジメント銀行（スイス）

三菱UFJセキュリティーズ（USA）

三菱UFJセキュリティーズ（香港）ホールディングス

三菱UFJセキュリティーズ（香港）（注2）

MUSHK Limited.（注3）

三菱UFJセキュリティーズ（シンガポール）

菱証投資咨詢（上海）有限公司

TMIノミニーズ

MFHKノミニーズ

MUS Roosevelt Capital Partners, Ltd.

MUS Roosevelt Capital Advisers (HK), Limited

MUS Roosevelt China Pacific Fund, L.P.

MMパートナーシップ

コーポレート・バリューアップ・ファンド投資事業有限責任組合

ティ・エイチ・シー・ミレニアム投資事業有限責任組合

ティ・エイチ・シー・フェニックス・ジャパン投資事業有限責任組合

投資事業有限責任組合ハンズオン1号

投資事業有限責任組合ハンズオン1・2号

NC Sホールディングス株式会社

株式会社福寅

(注1) 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社は、平成22年5月1日付で三菱UFJ証券株式会社（平成22年4月1日付で三菱UFJ証券分割準備株式会社から商号変更）から商号変更しております。

(注2) 三菱UFJセキュリティーズ(香港)は、平成22年12月31日付で三菱UFJセキュリティーズ(香港)キャピタルから商号変更しております。

(注3) MUSHK Limited. は、平成22年12月31日付で三菱UFJセキュリティーズ(香港)から商号変更しております。

(新規)

MMパートナーシップ

上記は新規設立に伴い、連結の範囲に含めております。

(2) 他の会社等の議決権（業務執行権）の過半数を自己の計算において所有しているにもかかわらず子会社としなかった当該他の会社等の名称

ティ・エイチ・シー・エー・ピー投資事業有限責任組合

投資事業有限責任組合しょうなん産学連携事業化支援ファンド

投資事業有限責任組合ぐんまチャレンジファンド

株式会社フーズネット

ヤマガタ食品株式会社

株式会社グリーン・ベル

株式会社パトライト

ドリームインフィニティ株式会社

日本コンピュータシステム株式会社

(子会社としなかった理由)

ベンチャーキャピタル事業を営む連結子会社が、主たる営業として組合の管理業務に準ずる業務を行うために無限責任組合員の地位を有するものであること、あるいは投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的等とする営業取引として株式等を所有しているのであって、傘下に入れる目的ではないことから、子会社として取り扱っておりません。

2. 持分法の適用に関する事項

(1) 持分法適用関連会社は17社(前年度17社)であります。

主要な持分法適用関連会社名

モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社

丸の内キャピタル株式会社

KE Capital Partners Pte. Ltd.

Kim Eng Holdings Limited

Sino Roosevelt Investment Partners Limited

(新規)

モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社

上記は議決権を取得したことに伴い、持分法適用関連会社の範囲に含めております。

(除外)

ワークス・キャピタル株式会社

上記は清算結了に伴い、持分法適用関連会社の範囲から除外しております。

(2) 他の会社等の議決権の百分の二十以上百分の五十以下を自己の計算において所有しているにもかかわらず関連会社としなかった当該他の会社等の名称

株式会社スーパーインデックス

Centillion II Venture Capital Corporation

株式会社レボ・トレーディング

(関連会社としなかった理由)

ベンチャーキャピタル事業を営む連結子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的等とする営業取引として株式等を所有しているのであって、傘下に入れる目的ではないことから、関連会社として取り扱っておりません。

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社の決算日は以下のとおりであります。

8月末日 1社

12月末日 22社

2月末日 1社

3月末日 7社

決算日が連結決算日と異なる連結子会社のうち、決算日の差異が3ヶ月を超えない23社については、各社の決算日現在の財務諸表を使用しております。ただし、各社の決算日から連結決算日までの期間に発生した重要な取引については、連結上必要な調整を行っております。また、決算日の差異が3ヶ月を超える1社については、連結決算日で実施した仮決算に基づく財務諸表を使用しております。

4. 会計処理基準に関する事項

(1) 重要なヘッジ会計の方法

①ヘッジ会計の方法

為替予約(為替スワップ取引)および金利スワップをヘッジ手段として指定した時価ヘッジおよび繰延ヘッジを適用しております。

②ヘッジ手段とヘッジ対象

ア. 為替変動リスク

ヘッジ手段 為替予約(為替スワップ取引)

ヘッジ対象 外貨建金融資産(その他有価証券、在外子会社等に対する投資への持分)

イ. 金利変動リスク

ヘッジ手段 金利スワップ

ヘッジ対象 投資有価証券(その他有価証券)

③ヘッジ方針

外貨建金融資産の一部について為替変動リスクを回避するため、為替予約(為替スワップ取引)を行っているほか、一部の投資有価証券(その他有価証券)の金利変動リスクを回避する目的で金利スワップ取引を行っており、ヘッジ対象の識別は個別契約ごとに行っております。

④ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の有効性の評価を定期的に行っております。

(2) のれんの償却方法および償却期間

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。なお、のれんの金額に重要性が乏しい場合には、発生年度に全額償却しております。

(3) 連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲

手許現金および当座預金、普通預金等の随時引き出し可能な預金からなっております。(預入期間が3ヶ月を越える定期預金は含んでおりません。)

なお、上記以外の事項は、最近の有価証券報告書(平成22年6月28日提出)における記載から重要な変更がないため開示を省略しております。

4. 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

1. 資産除去債務に関する会計基準の適用

当連結会計年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)および「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。

これにより、当連結会計年度の営業損失および経常損失はそれぞれ572百万円増加し、税金等調整前当期純損失は3,045百万円増加しております。また、当会計基準等の適用開始による資産除去債務の変動額は3,892百万円であります。

2. 企業結合に関する会計基準等の適用

当連結会計年度より、「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成20年12月26日)、「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20年12月26日)、『研究開発費等に係る会計基準』の一部改正(企業会計基準第23号 平成20年12月26日)、「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成20年12月26日)、「持分法に関する会計基準」(企業会計基準第16号 平成20年12月26日公表分)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20年12月26日)を適用しております。

5. 連結財務諸表に関する注記事項

(連結包括利益計算書関係)

当連結会計年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

※1 当連結会計年度の直前連結会計年度における包括利益

親会社株主に係る包括利益	55,031 百万円
少数株主に係る包括利益	7,747
計	62,778

※2 当連結会計年度の直前連結会計年度におけるその他の包括利益

その他有価証券評価差額金	14,381 百万円
繰延ヘッジ損益	24
為替換算調整勘定	11,588
持分法適用会社に対する持分相当額	642
計	26,636

(セグメント情報)

当連結会計年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 報告セグメントの概要

当社グループの報告セグメントは、当社グループの構成単位のうち分離された財務情報が入手可能であり、取締役会が、経営資源の配分の決定および業績を評価するために、定期的に検討を行う対象となっているものであります。

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、投資・金融サービスに係る事業を行っております。その中で当社は、証券持株会社として傘下の事業会社各社のグループ間連携を推進しつつ、業態毎に経営資源の配分や業績の検討を行っております。

したがって、当社グループは、業態・地域別のセグメントから構成されており、「証券業務(国内)」「証券業務(英国)」「証券業務(米国)」「投信投資顧問業」を報告セグメントとしております。

「証券業務」はお客さまに対し資金調達、資金運用の両面で幅広い投資・金融サービスを提供しており、「投信投資顧問業」は主に様々な資産を投資対象とした投資信託の設定・運用を行っております。

2. 報告セグメントごとの純営業収益、利益または損失、資産その他の項目の金額の算定方法

報告されている事業セグメントの会計処理の方法は、「連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項」における記載と同一であります。報告セグメントの利益または損失は、税金費用控除後の利益または損失をベースとした数値であります。セグメント間の内部純営業収益および振替高は市場実勢価格に基づいております。

3. 報告セグメントごとの純営業収益、利益または損失、資産その他の項目の金額に関する情報

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他 (注) 1	合計	調整額 (注) 2	連結財務諸 表計上額 (注) 3
	証券業務 (国内)	証券業務 (英国)	証券業務 (米国)	投信投資 顧問業	計				
純営業収益									
外部顧客からの純営業収益	56,783	21,959	8,625	53,203	140,570	△ 703	139,866	—	139,866
セグメント間の内部純営業収益 または振替高	4,659	3,618	2,734	—	11,013	21,284	32,298	△ 32,298	—
計	61,443	25,578	11,359	53,203	151,584	20,580	172,164	△ 32,298	139,866
セグメント利益または損失 (△)	△ 144,940	1,680	409	10,356	△ 132,494	△ 10,812	△ 143,307	92,867	△ 50,440
セグメント資産	11,669,461	7,406,548	1,702,969	111,829	20,890,808	1,796,863	22,687,672	△ 2,201,421	20,486,251
その他の項目									
減価償却費	18,902	1,989	302	642	21,838	375	22,213	△ 560	21,652
のれんの償却額	426	—	—	—	426	162	589	—	589
受取利息	7	4,116	—	854	4,978	179	5,158	△ 126	5,032
支払利息	—	—	—	—	—	668	668	△ 5	663
持分法投資利益または損失 (△)	—	—	—	—	—	—	—	12,712	12,712
特別利益	678	46	—	0	725	10,180	10,906	18,701	29,608
(うち、負ののれん発生益)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(943)	(943)
(うち、持分変動利益)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(27,913)	(27,913)
特別損失	12,302	254	—	14	12,572	910	13,482	△ 283	13,199
(うち、減損損失)	(3,265)	(—)	(—)	(—)	(3,265)	(260)	(3,525)	(0)	(3,525)
(うち、早期割増退職金)	(5,640)	(—)	(—)	(—)	(5,640)	(—)	(5,640)	(—)	(5,640)
(うち、資産除去債務会計基準の 適用に伴う影響額)	(2,417)	(—)	(—)	(—)	(2,417)	(56)	(2,473)	(—)	(2,473)
税金費用	6,606	1,564	239	7,149	15,561	18,725	34,286	△ 13,156	21,130
持分法適用会社への投資額	—	—	—	—	—	482,941	482,941	△ 158,912	324,029
有形固定資産および無形固定資産 の増加額	15,522	3,092	189	700	19,504	180	19,685	△ 713	18,972

(注) 1. 「その他」には、証券持株会社、有価証券投資業務等が含まれております。

2. 調整額は、以下のとおりであります。

(1) セグメント利益または損失の調整額 92,867 百万円には、セグメント間取引消去等△12,287 百万円、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社株式の現物出資に伴う持分変動利益 27,913 百万円、および各セグメントに配分していない持分法投資損益・税金費用・少数株主損益 75,767 百万円が含まれております。

(2) セグメント資産の調整額△2,201,421 百万円には、セグメント間の債権等の相殺消去△2,162,712 百万円、子会社として扱われる組合の個別財務諸表上の処理の戻入△27,397 百万円、持分法投資損益等の計上 13,188 百万円、未実現損益の調整額△12,074 百万円、および資産負債の相殺表示△12,626 百万円が含まれております。

(3) 税金費用の調整額△13,156 百万円には、資本連結上の投資原価としての消去△13,205 百万円が含まれております。

3. セグメント利益または損失は、連結財務諸表の当期純損失と調整を行っております。

(1株当たり情報)

当連結会計年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
1株当たり純資産額	778.14円
1株当たり当期純損失金額	△70.35円
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式は存在するものの1株当たり当期純損失であるため記載しておりません。	

(注) 1株当たり当期純損失金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	当連結会計年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) (百万円)
当期純損失 (△)	△50,440
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る当期純損失 (△)	△50,440
期中平均株式数 (千株)	716,985
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含めなかった潜在株式の概要	連結子会社の発行する新株予約権 エム・ユー・ハンズオンキャピタル株式会社 新株予約権の数 一個 ※平成22年12月1日で行使期限が終了しております。 株式会社福寅 (新株予約権 2種類) 新株予約権の数 12,370個 関連会社の発行する新株予約権 Kim Eng Holdings Limited 新株予約権の数 一個 ※平成22年2月22日で行使期限が終了しております。

(参考資料)

平成23年3月期 連結決算資料

1. 受入手数料収入

(1) 科目別内訳

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	対前年比増減
委託手数料	25,227	22,226	△ 3,001
(株券)	(24,843)	(21,699)	(△ 3,144)
(債券)	(253)	(281)	(27)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	39,373	20,048	△ 19,325
(株券)	(24,358)	(6,878)	(△ 17,480)
(債券)	(15,014)	(13,169)	(△ 1,844)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	26,663	31,415	4,752
(受益証券)	(26,468)	(31,306)	(4,837)
その他の受入手数料	94,404	87,804	△ 6,600
(受益証券)	(75,902)	(66,679)	(△ 9,223)
合計	185,669	161,494	△ 24,174

(2) 商品別内訳

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	対前年比増減
株券	49,935	31,725	△ 18,209
債券	16,415	15,180	△ 1,234
受益証券	102,501	98,230	△ 4,270
その他の	16,816	16,356	△ 459
合計	185,669	161,494	△ 24,174

2. トレーディング損益

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	対前年比増減
株券等	10,653	△ 6,953	△ 17,606
債券等	102,340	△ 46,027	△ 148,367
その他の	△ 12,575	25,784	38,360
合計	100,418	△ 27,195	△ 127,613

(参考資料)

連結損益計算書の四半期推移

(単位：百万円)

科 目	前第4四半期 連結会計期間 平成22年1月 1日 平成22年3月31日	当第1四半期 連結会計期間 平成22年4月 1日 平成22年6月30日	当第2四半期 連結会計期間 平成22年7月 1日 平成22年9月30日	当第3四半期 連結会計期間 平成22年10月 1日 平成22年12月31日	当第4四半期 連結会計期間 平成23年1月 1日 平成23年3月31日
営 業 収 益	77,838	83,840	74,661	80,976	△ 37,216
受 入 手 数 料	46,474	37,787	42,628	41,576	39,500
委 託 手 数 料	5,608	5,409	5,337	4,933	6,545
(株 券)	(5,562)	(5,288)	(5,222)	(4,777)	(6,409)
(債 券)	(11)	(50)	(57)	(107)	(65)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	8,369	2,990	6,605	5,553	4,898
(株 券)	(6,016)	(1,110)	(1,984)	(1,760)	(2,022)
(債 券)	(2,353)	(1,880)	(4,621)	(3,793)	(2,875)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	6,951	8,004	8,159	7,912	7,339
(受 益 証 券)	(6,932)	(7,971)	(8,133)	(7,887)	(7,314)
そ の 他 の 受 入 手 数 料	25,544	21,382	22,526	23,177	20,717
(受 益 証 券)	(18,204)	(17,837)	(17,219)	(16,395)	(15,226)
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	26,513	29,687	14,791	21,789	△ 93,463
株 券 等	3,336	△ 2,799	2,166	△ 1,645	△ 4,675
債 券 等	26,182	43,056	36,047	1,847	△ 126,978
そ の 他	△ 3,006	△ 10,569	△ 23,422	21,587	38,189
営 業 投 資 有 価 証 券 等 損 益	△ 2,068	823	7	52	△ 697
そ の 他 の 商 品 売 買 損 益	△ 0	△ 8	11	△ 0	1
金 融 収 益	6,920	15,550	17,221	17,557	17,442
金 融 費 用	9,782	17,438	13,772	18,040	13,143
純 営 業 収 益	68,055	66,402	60,888	62,936	△ 50,360
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	71,698	65,760	68,474	63,958	56,700
取 引 関 係 費	19,803	19,149	20,185	18,026	16,686
人 件 費	30,825	26,858	27,187	25,964	19,582
不 動 産 関 係 費	6,627	6,239	6,744	6,464	6,634
事 務 費	6,098	5,653	6,801	5,689	6,166
減 価 償 却 費	5,763	5,361	5,651	5,327	5,312
租 税 公 課	680	813	614	829	480
そ の 他	1,899	1,685	1,290	1,655	1,838
営 業 利 益 又 は 営 業 損 失 (△)	△ 3,642	641	△ 7,585	△ 1,022	△ 107,061
営 業 外 収 益	4,715	6,084	△ 11	3,093	12,948
営 業 外 費 用	279	250	1,151	527	1,017
経 常 利 益 又 は 経 常 損 失 (△)	794	6,475	△ 8,748	1,544	△ 95,130
特 別 利 益	474	24,618	3,897	538	554
特 別 損 失	1,137	2,772	1,901	624	7,900
税金等調整前当期純利益又は 税金等調整前当期純損失 (△)	130	28,321	△ 6,752	1,457	△ 102,476
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税	2,803	1,652	2,420	1,542	2,129
法 人 税 等 調 整 額	△ 7,901	2,699	△ 2,493	3,595	9,583
法 人 税 等 合 計	△ 5,098	4,352	△ 72	5,137	11,712
少数株主損益調整前当期純利益又は 少数株主損益調整前当期純損失 (△)	5,229	23,968	△ 6,680	△ 3,680	△ 114,189
少数株主利益又は少数株主損失 (△)	1,619	1,169	△ 3,311	△ 2,645	△ 45,353
当期純利益又は当期純損失 (△)	3,609	22,799	△ 3,368	△ 1,034	△ 68,835

(参考資料)

平成23年3月期
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 決算資料

(1) 個別経営成績

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	対前年比増減
営業収益	218,163	75,752	△ 142,411
（うち受入手数料）	109,342	97,394	△ 11,948
（うちトレーディング損益）	78,918	△ 48,643	△ 127,562
純営業収益	202,965	61,443	△ 141,522
営業利益又は営業損失（△）	9,327	△ 128,567	△ 137,894
経常利益又は経常損失（△）	11,094	△ 126,709	△ 137,804
当期純利益又は当期純損失（△）	11,008	△ 144,940	△ 155,949

(営業収益の内訳)

<受入手数料 科目別内訳>

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	対前年比増減
委託手数料	25,441	21,253	△ 4,187
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	25,042	8,901	△ 16,141
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	26,663	31,415	4,752
その他の受入手数料	32,195	35,823	3,628
合計	109,342	97,394	△ 11,948

<受入手数料 商品別内訳>

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	対前年比増減
株券	46,980	29,058	△ 17,922
債券	6,370	5,507	△ 863
受益証券	42,515	48,502	5,987
その他	13,475	14,326	851
合計	109,342	97,394	△ 11,948

<トレーディング損益>

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	対前年比増減
株券等	11,267	888	△ 10,378
債券等	82,149	△ 26,636	△ 108,786
その他	△ 14,497	△ 22,894	△ 8,397
合計	78,918	△ 48,643	△ 127,562

(2) 個別財政状態

(単位：百万円)

	前事業年度末 (平成22年3月31日)	当事業年度末 (平成23年3月31日)	対前年度末比増減
総資産	12,752,634	11,669,461	△ 1,083,172
純資産	626,646	168,791	△ 457,855

- (注1) 前事業年度、前事業年度末の業績は、三菱UFJ証券株式会社（現在の三菱UFJ証券ホールディングス株式会社）の業績を記載しております。
(注2) 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社は、平成22年4月1日付け会社分割により、現在の三菱UFJ証券ホールディングス株式会社から、国内の事業を承継しました。更に同年5月1日付でモルガン・スタンレー証券株式会社のインベストメントバンキング部門を統合しております。
(注3) 当事業年度末の自己資本規制比率は、219.4%であります。