

有 価 証 券 報 告 書

(金融商品取引法第24条第1項に基づく報告書)

事 業 年 度	自	平成21年4月1日
(第 5 期)	至	平成22年3月31日

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社

(E03771)

目 次

頁

表紙

第一部 企業情報	1
第1 企業の概況	1
1. 主要な経営指標等の推移	1
2. 沿革	3
3. 事業の内容	5
4. 関係会社の状況	7
5. 従業員の状況	10
第2 事業の状況	11
1. 業績等の概要	11
2. 対処すべき課題	16
3. 事業等のリスク	18
4. 経営上の重要な契約等	26
5. 研究開発活動	26
6. 財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析	27
第3 設備の状況	31
1. 設備投資等の概要	31
2. 主要な設備の状況	31
3. 設備の新設、除却等の計画	33
第4 提出会社の状況	34
1. 株式等の状況	34
2. 自己株式の取得等の状況	36
3. 配当政策	36
4. 株価の推移	36
5. 役員の状況	37
6. コーポレート・ガバナンスの状況等	44
7. 業務の状況	50
第5 経理の状況	58
1. 連結財務諸表等	59
2. 財務諸表等	134
第6 提出会社の株式事務の概要	176
第7 提出会社の参考情報	177
1. 提出会社の親会社等の情報	177
2. その他の参考情報	178
第二部 提出会社の保証会社等の情報	179

[監査報告書]

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条第1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年6月28日
【事業年度】	第5期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
【会社名】	三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 （旧会社名 三菱UFJ証券株式会社）
【英訳名】	Mitsubishi UFJ Securities Holdings Co.,Ltd. （旧英訳名 Mitsubishi UFJ Securities Co.,Ltd.）
【代表者の役職氏名】	取締役社長 秋草 史幸
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目4番1号
【電話番号】	03（6213）2550（代表）
【事務連絡者氏名】	財務企画部長 圓城寺 貢
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目4番1号
【電話番号】	03（6213）2550（代表）
【事務連絡者氏名】	財務企画部長 圓城寺 貢
【縦覧に供する場所】	本店のほかに該当ありません。

（注）当社は、平成22年4月1日付で三菱UFJ証券株式会社から三菱UFJ証券ホールディングス株式会社へ商号変更しております。

第一部【企業情報】

第1【企業の概況】

1【主要な経営指標等の推移】

(1)連結経営指標等

回 次	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期
決 算 年 月	平成18年3月	平成19年3月	平成20年3月	平成21年3月	平成22年3月
営業収益 (百万円)	309,621	435,508	534,093	465,850	343,824
純営業収益 (百万円)	256,439	291,333	243,612	229,972	287,153
経常損益 (△は損失) (百万円)	96,842	73,671	11,016	△22,788	41,022
当期純損益 (△は損失) (百万円)	61,188	44,433	8,137	△45,417	28,748
純資産額 (百万円)	698,763	742,377	771,582	657,438	701,654
総資産額 (百万円)	9,874,474	13,664,091	19,190,293	19,030,280	20,134,713
1株当たり純資産額 (円)	974.30	1,024.03	996.44	833.60	889.78
1株当たり当期純損益金額 (△は損失) (円)	103.22	61.96	11.35	△63.34	40.10
潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額 (円)	98.54	59.66	10.89	—	40.09
自己資本比率 (%)	7.1	5.4	3.7	3.1	3.2
自己資本利益率 (%)	11.2	6.2	1.1	△6.9	4.7
株価収益率 (倍)	18.30	21.72	—	—	—
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	20,906	△273,967	△621,137	346,907	△605,490
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	24,815	△15,878	16,615	△68,203	△26,401
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△28,876	246,370	687,999	△292,513	650,194
現金及び現金同等物の 期末残高 (百万円)	112,647	78,361	160,743	109,213	132,196
従業員数 (人) (外、平均臨時雇用者数)	7,011 (768)	7,210 (1,033)	8,132 (1,502)	8,394 (1,177)	8,520 (554)

(注) 1. 第4期の潜在株式調整後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。

2. 株価収益率は、当社株式が当社と株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループとの株式交換により平成19年9月25日付で上場廃止となっているため、第3期より記載しておりません。

3. 第1期の業績は、平成17年10月1日の合併に伴い、旧三菱証券の平成17年4月～平成17年9月連結実績に合併新会社（三菱UFJ証券）の平成17年10月～平成18年3月連結実績を加算しております。

4. 第2期より「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準第5号）および「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準適用指針第8号）を適用しております。

なお、消費税等の課税取引については、消費税等を含んでおりません。

(2) 提出会社の経営指標等

回 次	第 1 期	第 2 期	第 3 期	第 4 期	第 5 期
決 算 年 月	平成18年 3 月	平成19年 3 月	平成20年 3 月	平成21年 3 月	平成22年 3 月
営業収益 (うち受入手数料) (百万円)	239,686 (129,997)	276,444 (138,770)	255,024 (117,318)	190,503 (91,764)	218,163 (109,342)
純営業収益 (百万円)	233,366	257,546	212,690	149,087	202,965
経常損益 (△は損失) (百万円)	88,292	66,869	6,202	△40,581	11,094
当期純損益 (△は損失) (百万円)	53,555	39,017	△4,169	△57,385	11,008
資本金 (百万円)	65,518	65,518	65,518	65,518	65,518
発行済株式総数 (千株)	726,023	726,023	716,985	716,985	716,985
純資産額 (百万円)	702,762	719,988	690,418	628,084	626,646
総資産額 (百万円)	8,234,259	7,943,044	9,986,090	12,952,628	12,752,634
1株当たり純資産額 (円)	979.83	1,004.07	962.95	876.01	874.00
1株当たり配当額 (うち1株当たり 中間配当額) (円)	20.00 (－)	18.00 (－)	5.77 (－)	10.59 (－)	20.20 (9.98)
1株当たり当期純損益金額 (△は損失) (円)	90.30	54.41	△5.81	△80.04	15.35
潜在株式調整後1株当たり 当期純利益金額 (円)	86.21	52.39	－	－	－
自己資本比率 (%)	8.5	9.1	6.9	4.8	4.9
自己資本利益率 (%)	9.7	5.5	△0.6	△8.7	1.8
株価収益率 (倍)	20.93	24.74	－	－	－
配当性向 (%)	22.1	33.1	－	－	131.6
自己資本規制比率 (%)	462.6	371.1	299.4	353.7	342.9
従業員数 (外、平均臨時雇用者数) (人)	6,211 (498)	5,962 (898)	6,492 (1,322)	6,732 (998)	6,750 (349)

(注) 1. 第5期の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 第4期の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

3. 第3期の潜在株式調整後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。

4. 第3期および第4期の配当性向は、1株当たり当期純損失が計上されているため、記載しておりません。

5. 株価収益率は、当社株式が当社と株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループとの株式交換により平成19年9月25日付で上場廃止となっているため、第3期より記載しておりません。

6. 自己資本規制比率は第3期から金融商品取引法の規定に基づき、決算数値をもとに算出しております。なお、第2期以前は証券取引法の規定に基づき、決算数値をもとに算出しております。

7. 第1期の業績は、平成17年10月1日の合併に伴い、旧三菱証券の平成17年4月～平成17年9月実績に合併新会社（三菱UFJ証券）の平成17年10月～平成18年3月実績を加算しております。

なお、消費税等の課税取引については、消費税等を含んでおりません。

2【沿革】

年 月	沿 革
昭和23年3月	八千代證券株式会社を設立。
43年4月	改正証券取引法に基づく証券業の免許を受ける。
56年10月	光亜証券株式会社、野村證券投資信託販売株式会社と合併し、商号を国際証券株式会社に変更。
58年3月	国際投信委託株式会社を設立。
59年12月	国際投資顧問株式会社を設立。
62年5月	株式を東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所の各市場第二部に上場。
62年6月	弘陽産業株式会社（平成2年4月国際土地建物株式会社に商号変更）を設立。
62年12月	国際ビジネスサービス株式会社を設立。
平成元年3月	株式を東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所の各市場第一部に上場。
2年6月	国際コンピュータシステム株式会社を設立。
6年10月	〈三菱ダイヤモンド証券株式会社を設立（平成8年4月東京三菱証券株式会社に商号変更）。〉
9年7月	国際投信委託株式会社と国際投資顧問株式会社が合併（商号を国際投信投資顧問株式会社に變更）。
10年12月	改正証券取引法に基づく証券業の登録を受ける。
11年7月	国際コンピュータシステム株式会社と国際ビジネスサービス株式会社が合併（商号を国際ビジネス・アンド・システムサービス株式会社に變更）。
11年7月	〈東京三菱証券株式会社が三菱信託証券株式会社から営業の全部を譲り受け、同社と統合。〉
12年4月	〈ユニバーサル証券株式会社、太平洋証券株式会社、東和証券株式会社、第一証券株式会社が合併し、つばさ証券株式会社となる。〉
14年6月	〈つばさ証券株式会社とUFJキャピタルマーケット証券株式会社が合併し、UFJつばさ証券株式会社となる。〉
14年7月	三菱東京ウェルスマネジメント（スイス）の設立にあたり出資。（現商号は三菱UFJウェルスマネジメント銀行（スイス））。
14年9月	東京三菱証券株式会社、東京三菱パーソナル証券株式会社および一成証券株式会社と合併し、商号を三菱証券株式会社に変更。同時に、株式会社東京三菱銀行および株式会社三菱東京フィナンシャル・グループの子会社となる。
14年10月	東京三菱ティーディーウォーターハウス証券株式会社（平成14年11月Meネット証券株式会社に商号変更）を子会社化。
15年5月	東京三菱インターナショナル（シンガポール）を子会社化（現商号は三菱UFJセキュリティーズ（シンガポール））。
15年6月	東京三菱インターナショナル（ホンコン）を子会社化（現商号は三菱UFJセキュリティーズ（香港）キャピタル）。
15年7月	東京三菱セキュリティーズ（USA）を子会社化（現商号は三菱UFJセキュリティーズ（USA））。
16年7月	東京三菱インターナショナルを子会社化（現商号は三菱UFJセキュリティーズインターナショナル）。
17年7月	株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ（現商号は株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ）の直接出資子会社となる。
17年8月	Marunouchi & Co. Limited（現商号は三菱UFJセキュリティーズ（香港）ホールディングス）を子会社化。

年 月	沿 革
17年10月	UF Jつばさ証券株式会社と合併し、商号を三菱UF J証券株式会社に変更。 UF Jつばさ証券株式会社との合併により、UF Jつばさビジネスサービス株式会社、株式会社UF Jつばさ研究所、UF Jつばさハンズオンキャピタル株式会社（現商号はエム・ユー・ハンズオンキャピタル株式会社）、日聯飛翼証券亞洲有限公司（現商号は三菱UF Jセキュリティーズ（香港））が子会社となる。 三菱UF Jセキュリティーズ（香港）ホールディングスが、三菱UF Jセキュリティーズ（香港）キャピタル、三菱UF Jセキュリティーズ（香港）の持株会社となる。
18年 1 月	子会社であるMe ネット証券株式会社が、カブドットコム証券株式会社を存続会社として合併し、連結子会社でなくなる。
18年 7 月	子会社である株式会社UF Jつばさ研究所を吸収合併し、同研究所を解散。
18年 8 月	株式交換の方法により親会社である三菱UF Jフィナンシャル・グループの完全子会社となることについて、三菱UF Jフィナンシャル・グループと基本合意書を締結。
18年10月	子会社であるUF Jつばさビジネスサービス株式会社（商号をエム・ユー・エス・ビジネスサービス株式会社に変更）の不動産関連業務を会社分割の方法により、国際土地建物株式会社（商号をエム・ユー・エス・ファシリティサービス株式会社に変更）に集約。また、子会社である国際ビジネス・アンド・システムサービス株式会社の商号をエム・ユー・エス情報システム株式会社に変更。
19年 3 月	親会社である三菱UF Jフィナンシャル・グループと完全子会社化に関する株式交換契約書を締結。
19年 9 月	株式交換により三菱UF Jフィナンシャル・グループの完全子会社となる（これに伴い当社株式の上場を廃止）。
19年12月	三菱UF J ウェルスマネジメント銀行（スイス）を子会社化。 三菱UF J ウェルスマネジメント証券株式会社を子会社化。
20年 3 月	国際投信投資顧問株式会社を連結子会社とする。 三菱UF Jセキュリティーズ（インド）を設立。
20年 9 月	子会社である三菱UF J ウェルスマネジメント証券株式会社を吸収合併し、同社を解散。 MU S プリンシパル・インベストメンツ株式会社を設立。
21年12月	三菱UF J 証券分割準備株式会社を設立。
22年 2 月	三菱UF Jセキュリティーズ（インド）の全株式をKim Eng Securities India Private Limitedに譲渡。

（注）当社は、平成22年4月1日付会社分割により国内の事業を子会社の三菱UF J証券分割準備株式会社に承継して中間持株会社となり、商号を三菱UF J証券ホールディングス株式会社に変更いたしました。なお、当社の国内事業の承継会社は、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、商号を三菱UF Jモルガン・スタンレー証券株式会社に変更しております。

3 【事業の内容】

当社グループ（連結子会社30社、持分法適用関連会社17社）は、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等）を営んでおり、顧客に対し資金調達、資金運用の両面で幅広いサービスを提供しております。

また、同一の親会社をもつ会社である株式会社三菱東京UFJ銀行および三菱UFJ信託銀行株式会社と当社との間には、資金貸借取引または有価証券の売買等の取引において継続的で緊密な事業上の関係があります。

事業の系統図は、次のとおりであります。

なお、平成22年4月1日付で当社が証券持株会社となるに伴い、平成22年2月24日、同年3月31日をもって金融商品取引業者の登録を廃止することを決定し、同日付で金融商品取引業者の登録を廃止しております。

(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

(関連当事者)

三菱UFJ証券株式会社（注1）

株式会社三菱東京UFJ銀行
三菱UFJ信託銀行株式会社

(子会社)

三菱UFJ証券分割準備株式会社（注2）
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
NCSホールディングス株式会社
株式会社福寅
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）キャピタル
三菱UFJセキュリティーズ（香港）
三菱UFJセキュリティーズ（シンガポール）
菱証投資諮詢（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
コーポレート・バリュアアップ・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
MUS Roosevelt China Pacific Fund, L.P.

他

(関連会社)

ワークス・キャピタル株式会社
丸の内キャピタル株式会社
Sino Roosevelt Investment Partners Limited
KE Capital Partners Pte. Ltd.
Kim Eng Holdings Limited

他

(注1) 三菱UFJ証券株式会社は、平成22年4月1日付で三菱UFJ証券ホールディングス株式会社へ商号を変更しております。

(注2) 三菱UFJ証券分割準備株式会社は、平成22年4月1日付で三菱UFJ証券株式会社に商号変更し、さらに平成22年5月1日付で三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社へ商号を変更しております。

4【関係会社の状況】

① 議決権の所有（または被所有）割合によるもの

名 称	住 所	資 本 金	主要な事業の内容	議決権の所有（または被所有）割合（％）	関 係 内 容	摘 要
（親会社）						
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,136,582百万円	金融持株会社	100	経営管理、有価証券の引受および売買等の取引 役員の兼任等…３、転籍…０	(注) 1 (注) 2
（連結子会社）						
三菱ＵＦＪ証券分割準備株式会社	東京都千代田区	3,000百万円	三菱ＵＦＪ証券から会社分割により業務を承継するのに必要な準備業務	100	－ 役員の兼任等…７、転籍…０	(注) 8
国際投信投資顧問株式会社	東京都千代田区	2,680百万円	金融商品取引業	44.5 (11.0)	投資信託の募集の取扱い、投資信託の償還金・収益金の支払代行業務 役員の兼任等…１、転籍…３	(注) 3 (注) 7
MUSプリンシパル・インベストメント株式会社	東京都千代田区	100百万円	有価証券投資業	100	金銭貸借 役員の兼任等…１、転籍…０	
エム・ユー・ハンズオンキャピタル株式会社	東京都中央区	100百万円	ベンチャーキャピタル業	50.0	有価証券の売買等の取引 役員の兼任等…０、転籍…０	(注) 3
エム・ユー・エス・ビジネスサービス株式会社	東京都中央区	760百万円	証券バックオフィス事務の代行業務	100	事務処理の代行等 役員の兼任等…１、転籍…１	
エム・ユー・エス情報システム株式会社	東京都江東区	350百万円	システム開発・運用・保守業務	100	情報処理の事務委託等 役員の兼任等…１、転籍…０	
エム・ユー・エス・ファシリティサービス株式会社	東京都千代田区	50百万円	不動産賃貸・管理業および事務受託	100	店舗等の賃貸借管理等 役員の兼任等…０、転籍…１	
ビッグウィングインベストメント有限公司	東京都千代田区	3百万円	金銭債権買取業	－	債権買取の媒介 役員の兼任等…０、転籍…０	(注) 3
NCSホールディングス株式会社	東京都千代田区	566百万円	有価証券投資業	98.9 (98.9)	－ 役員の兼任等…０、転籍…０	
株式会社福寅	大阪市中央区	100百万円	有価証券投資業	62.0 (62.0)	－ 役員の兼任等…０、転籍…０	
三菱ＵＦＪセキュリティーズインターナショナル	英国 ロンドン市	760百万 英ポンド	証券業	100	有価証券の売買等の取引 役員の兼任等…１、転籍…０	(注) 1 (注) 4
三菱ＵＦＪウェルスマネジメント銀行（スイス）	スイス連邦 ジュネーブ市	65百万 スイスフラン	銀行業および証券業	60.0	－ 役員の兼任等…１、転籍…０	
三菱ＵＦＪセキュリティーズ（USA）	アメリカ合衆国 ニューヨーク市	69百万 米ドル	証券業	100	有価証券の売買等の取引 役員の兼任等…１、転籍…０	(注) 4
三菱ＵＦＪセキュリティーズ（香港）ホールディングス	中華人民共和国 香港	155百万 米ドル	証券持株会社	100	証券子会社の経営管理業務 役員の兼任等…１、転籍…０	(注) 4
三菱ＵＦＪセキュリティーズ（香港）キャピタル	中華人民共和国 香港	80百万 米ドル	証券業	100 (100)	キャピタルマーケット業務等 役員の兼任等…０、転籍…０	(注) 4
三菱ＵＦＪセキュリティーズ（香港）	中華人民共和国 香港	12,850百万円	証券業	100 (100)	有価証券の売買等の取引 役員の兼任等…０、転籍…０	(注) 4
三菱ＵＦＪセキュリティーズ（シンガポール）	シンガポール共和国 シンガポール	19百万 シンガポール ドル	証券業	100	M&A業務、コーポレートアドバイザー業務 役員の兼任等…１、転籍…０	
菱証投資諮詢（上海）有限公司	中華人民共和国 上海市	0百万 米ドル	コンサルティング業	100 (100)	－ 役員の兼任等…０、転籍…０	

名 称	住 所	資 本 金	主要な事業の内容	議決権の所有（または被所有）割合（％）	関 係 内 容	摘 要
TMI ノミニーズ	英国 ロンドン市	0百万 英ポンド	証券代理業	100 (100)	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	
MFHK ノミニーズ	中華人民共和国 香港	0百万 香港ドル	証券代理業	100 (100)	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	
MUS Roosevelt Capital Partners, Ltd.	英国領 ケイマン諸島	0百万 米ドル	投資顧問業	51.0 (51.0)	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	
MUS Roosevelt Capital Advisers (HK), Limited	中華人民共和国 香港	0百万 米ドル	投資顧問業	100 (100)	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	
その他2社						
(持分法適用関連会社)						
丸の内キャピタル株式会社	東京都千代田区	500百万円	投資事業組合運営 業務	50.0	－ 役員の兼任等…2、転籍…0	
ワークス・キャピタル 株式会社	東京都千代田区	170百万円	ベンチャーキャピ タル業	25.0	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	
Kim Eng Holdings Limited	シンガポール 共和国 シンガポール	244百万 シンガポール ドル	持株会社	29.2	戦略的業務提携契約 役員の兼任等…0、転籍…0	
KE Capital Partners Pte. Ltd.	シンガポール 共和国 シンガポール	5百万 シンガポール ドル	投資運用業務、投 資助言・代理業務	19.9	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	(注) 5
Sino Roosevelt Investment Partners Limited	英国領 バージン諸島	0百万 米ドル	ベンチャーキャピ タル業	－ [51.0]	－ 役員の兼任等…0、転籍…0	(注) 5
その他12社						

(注) 1. 有価証券報告書を提出しております。

2. 有価証券届出書を提出しております。

3. 持分は100分の50以下ですが、実質的に支配しているため子会社としたものであります。

4. 特定子会社に該当します。

5. 持分は100分の20未満ですが、実質的な影響力を持っているため関連会社としたものであります。

6. 議決権の所有（または被所有）割合の（ ）内は、間接所有割合で内数、[]内は、緊密な者または同意している者の所有割合で外数であります。

7. 国際投信投資顧問株式会社については、純営業収益（連結会社相互間の内部純営業収益を除く。）の連結純営業収益に占める割合が10%を超えております。

主要な損益情報等	(1) 純営業収益	63,090百万円
	(2) 経常利益	23,235百万円
	(3) 当期純利益	13,733百万円
	(4) 純資産額	96,906百万円
	(5) 総資産額	105,687百万円

8. 三菱UFJ証券分割準備株式会社は、平成22年4月1日付で三菱UFJ証券株式会社に商号変更し、さらに平成22年5月1日付で三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社へ商号を変更しております。

② 業務執行権および出資割合によるもの

名 称	住所	出 資 金	主要な 事業の 内 容	業務執行権 の所有割合 (%)	出資割合 (%)	関 係 内 容	摘 要
(連結子会社)							
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	東京都千代田区	21,039百万円	投資事業組合業務	— [100]	99.5 (99.5)	—	(注) 1
ティ・エイチ・シー・ ミレニアム投資事業有 限責任組合	東京都中央区	4,280百万円	投資事業組合業務	100 (100)	21.6 (1.4)	—	
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	東京都中央区	1,736百万円	投資事業組合業務	100 (100)	21.3 (12.8)	—	
投資事業有限責任組合 ハンズオン1号	東京都中央区	2,900百万円	投資事業組合業務	100 (100)	72.1 (4.9)	—	
投資事業有限責任組合 ハンズオン1・2号	東京都中央区	1,703百万円	投資事業組合業務	100 (100)	2.8 (2.8)	—	
MUS Roosevelt China Pacific Fund, L.P.	英国領 ケイマン諸島	58百万米ドル	有価証券投資業	100 (100)	35.5 (35.5)	—	

(注) 1. 特定子会社に該当します。

2. 業務執行権割合の()内は、間接所有割合で内数、[]内は、緊密な者または同意している者の所有割合で外数であります。

3. 出資割合の()内は、間接所有割合で内数であります。

5 【従業員の状況】

(1) 連結会社の状況

平成22年3月31日現在

	従業員数（人）
連 結 会 社 合 計	8,520 （554）

- （注） 1．従業員数は、就業人員数であり、臨時従業員数は（ ）内に年間の平均人員数を外数で記載しております。
 2．上記のほか、執行役員の平成22年3月末の人数は55人であります。
 3．当社および当社グループの事業は「投資・金融サービス業」という単一事業セグメントに属しており、全連結会社の従業員数の合計を記載しております。

(2) 提出会社の状況

平成22年3月31日現在

従業員数（人）	平均年齢	平均勤続年数	平均年間給与（円）
6,750 （349）	38歳9ヵ月	12年1ヵ月	7,859,386

- （注） 1．従業員数は、就業人員数であり、臨時従業員数は（ ）内に年間の平均人員数を外数で記載しております。
 2．上記のほか、執行役員の平成22年3月末の人数は32人であります。
 3．平均年間給与は、基準外賃金および賞与を含んでおります。

(3) 労働組合の状況

労使関係について特に記載すべき事項はありません。

第2【事業の状況】

1【業績等の概要】

(1) 業績

当年度の連結営業収益は3,438億24百万円（前年度比73.8%）となりました。受入手数料は1,856億69百万円（同110.4%）、トレーディング損益は1,004億18百万円（同122.9%）となりました。金融収益は603億96百万円（同28.0%）、金融費用は566億71百万円（同24.0%）となり、連結純営業収益は2,871億53百万円（同124.9%）となりました。また、販売費・一般管理費は2,631億3百万円（同101.8%）となったことから、連結営業利益は240億円49百万円（前年度は285億47百万円の損失）、連結経常利益は410億円22百万円（前年度は227億88百万円の損失）、連結当期純利益は287億円48百万円（前年度は454億17百万円の損失）となりました。

所在地別の業績は、前年度においては、北米で22億50百万円、アジアで5億70百万円の営業利益となり、日本で232億45百万円、欧州で86億76百万円の営業損失でありましたが、当年度においては、日本で285億3百万円、北米で49億83百万円の営業利益となり、欧州で87億12百万円、アジアで10億29百万円の営業損失となりました。

当年度の主要な連結の収益・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1,856億69百万円（前年度比110.4%）となりました。内訳は次のとおりです。

区 分	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) (百万円)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) (百万円)	前年度比 (%)
受入手数料	168,124	185,669	110.4
委託手数料	29,911	25,227	84.3
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	18,753	39,373	210.0
募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	18,428	26,663	144.7
その他の受入手数料	101,031	94,404	93.4

a. 委託手数料

当年度の委託手数料は合計で252億27百万円（前年度比84.3%）となりました。株式委託手数料は248億43百万円（同84.8%）となり、債券委託手数料は2億53百万円（同59.9%）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

当年度の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は合計で393億73百万円（前年度比210.0%）となりました。株式の引受・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は243億58百万円（同353.4%）となり、債券の引受・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は150億14百万円（同126.6%）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おります。当年度の投資信託の募集・売出し取扱高は4兆818億円（前年度比102.9%）となり、当年度の募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は266億63百万円（同144.7%）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他に、証券化・不動産ファイナンス業務、M&A業務および財務アドバイザー業務にかかる手数料、年金保険の販売手数料、連結子会社の国際投信投資顧問株式会社における投資信託の委託者報酬などが含まれます。当年度のその他の受入手数料は944億4百万円（前年度比93.4%）となりました。

② トレーディング損益

当年度のトレーディング損益は、株券等によるものが106億53百万円の利益（前年度は377億63百万円の損失）、債券等によるものが1,023億40百万円の利益（前年度比73.7%）、その他が125億75百万円の損失（前年度は193億60百万円の損失）、合計では1,004億18百万円の利益（前年度比122.9%）となりました。

区 分	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) (百万円)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) (百万円)	前年度比 (%)
トレーディング損益	81,718	100,418	122.9
株券等トレーディング損益	△37,763	10,653	—
債券等トレーディング損益	138,843	102,340	73.7
その他のトレーディング損益	△19,360	△12,575	—

③ 金融収支

当年度の金融収益603億96百万円（前年度比28.0%）から金融費用566億71百万円（同24.0%）を差し引いた金融収支は、37億25百万円の利益（前年度は202億77百万円の損失）となりました。

④ 販売費・一般管理費

厳しい収益環境が続く中で、当社グループ一体となってコスト・コントロールに努めております。取引関係費や事務費を中心に物件費が減少しましたが、一方で業績連動の人件費増加により、当期の販売費・一般管理費は2,631億3百万円（前年度比101.8%）となりました。

⑤ 特別損益

当年度の特別利益は15億15百万円（前年度比18.1%）、特別損失は34億40百万円（同20.5%）となりました。特別利益のうち主なものは投資有価証券売却益が15億11百万円であります。特別損失のうち主なものは、固定資産に関する減損損失10億82百万円、情報流出に関する損害賠償金等7億26百万円、投資有価証券評価損6億60百万円であります。

(2) キャッシュ・フロー

キャッシュ・フローの状況につきましては、営業活動によるキャッシュ・フローは、約定見返勘定の差引残高の減少による収入2,355億34百万円があったものの、トレーディング商品（資産・負債）の差引残高の増加による支出8,547億95百万円があったこと等により6,054億90百万円の資金の減少（前年度は3,469億7百万円の資金の増加）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローでは、有価証券の売却および償還による収入1,579億10百万円に加え投資有価証券の売却および償還による収入917億27百万円があったものの、有価証券の取得による支出2,253億7百万円および投資有価証券の取得による支出468億10百万円等により264億1百万円（前年度比38.7%）の資金の減少となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、長期借入金の返済による支出1,081億10百万円および社債の償還による支出1,628億50百万円があったものの、日銀オペ等による短期借入金の借入による増加3,740億43百万円、社債の発行による収入2,551億67百万円、およびコマーシャルペーパーの増加2,282億円があったこと等により6,501億94百万円の資金の増加（前年度は2,925億13百万円の資金の減少）となりました。これらの結果、現金及び現金同等物の期末残高は、前年度末比229億82百万円増加して1,321億96百万円（前年度比121.0%）となりました。

(3) トレーディング業務の概要

トレーディング商品：当年度の期末日時点のトレーディング商品の残高は以下のとおりです。

区 分	前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在) (百万円)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在) (百万円)
トレーディング商品（資産の部）	10,851,001	11,395,146
商品有価証券等	5,003,515	6,538,721
株式・ワラント	312,405	525,126
債券	4,490,227	5,639,405
受益証券	155,027	339,339
その他	45,855	34,850
デリバティブ取引	5,847,486	4,856,424
オプション取引	729,839	786,102
派生商品評価勘定	5,117,647	4,070,322
為替予約取引	30,750	20,870
先物取引	15,002	7,610
スワップ取引	5,071,894	4,041,841
トレーディング商品（負債の部）	7,881,704	7,540,898
商品有価証券等	2,213,678	2,932,436
株式・ワラント	16,797	40,559
債券	2,196,875	2,891,877
受益証券	6	—
デリバティブ取引	5,668,025	4,608,461
オプション取引	840,544	820,518
派生商品評価勘定	4,827,481	3,787,942
為替予約取引	41,662	43,039
先物取引	60,076	57,326
スワップ取引	4,725,742	3,687,576

(4) 特定金融会社等の開示に関する内閣府令（平成11年 5 月19日 大蔵省令第57号）に基づく営業貸付金の状況

(イ) 貸付金の種別残高内訳

平成22年 3 月31日現在

貸付種別	件数・残高	件数（件）		残高（百万円）		平均約定金利 （％）
		構成割合（％）		構成割合（％）		
消費者向	—	—	—	—	—	
無担保（住宅向を除く）	—	—	—	—	—	
有担保（住宅向を除く）	—	—	—	—	—	
住宅向	—	—	—	—	—	
計	—	—	—	—	—	
事業者向						
計	5	100	23, 104	100	2. 70	
合計	5	100	23, 104	100	2. 70	

(ロ) 資金調達内訳

平成22年 3 月31日現在

借入先等		残高（百万円）	平均調達金利（%）
金融機関等からの借入		323, 800	0. 99
その他		508, 898	0. 17
	社債・C P	508, 898	0. 17
合計		832, 698	0. 49
自己資本		645, 333	—
	資本金・出資額	65, 518	—

(注) 貸付債権譲渡額 110, 200百万円

(ハ) 業種別貸付金残高内訳

平成22年 3 月31日現在

業種別	先数・残高		先数（件）		残高（百万円）	
			構成割合（%）		構成割合（%）	
製造業			—	—	—	—
建設業			—	—	—	—
電気・ガス・熱供給・水道業			—	—	—	—
運輸・通信業			—	—	—	—
卸売・小売業、飲食店			—	—	—	—
金融・保険業			3	75. 0	17, 100	74. 0
不動産業			—	—	—	—
サービス業			—	—	—	—
個人			—	—	—	—
その他			1	25. 0	6, 004	26. 0
合計			4	100	23, 104	100

(二) 担保別貸付金残高内訳

平成22年3月31日現在

受入担保の種類		残高（百万円）	構成割合（％）
有価証券		16,354	70.8
	うち株式	—	—
債権		3,750	16.2
	うち預金	—	—
商品		—	—
不動産		—	—
財団		—	—
その他		—	—
計		20,104	87.0
保証		—	—
無担保		3,000	13.0
合計		23,104	100

(ホ) 期間別貸付金残高内訳

平成22年3月31日現在

期間別	件数・残高	件数（件）		残高（百万円）	
			構成割合（％）		構成割合（％）
1年以下		—	—	—	—
1年超 5年以下		3	60.0	9,754	42.2
5年超 10年以下		—	—	—	—
10年超 15年以下		1	20.0	10,350	44.8
15年超 20年以下		—	—	—	—
20年超 25年以下		—	—	—	—
25年超		1	20.0	3,000	13.0
合計		5	100	23,104	100
一件当たり平均期間				—	

(注) 「1件当たり平均期間」は永久劣後ローン契約を含んでおりますので算出しておりません。

2【対処すべき課題】

当社グループはMUFGグループの金融機能とネットワークを最大限活用し、引き続き法人取引の強化、海外業務の強化等に取り組んでまいります。加えて、積極的なアライアンス戦略を具体化させ、効率的で高い競争力を有する内外一体化した業務体制を構築し、お客さまの幅広いニーズに的確に応え得る、高度で先進的な商品・サービスを提供してまいります。

当社は、①お客さま情報の流出に対する対応、②モルガン・スタンレー証券との統合、③MUFG傘下の証券持株会社としてのガバナンス態勢確立に関する課題については、次のように対処しております。

① お客さま情報の流出に対する対応

当社は、お客さま情報の流出の事案により、平成21年6月25日に金融庁より金融商品取引法に基づく業務改善命令および個人情報の保護に関する法律に基づく勧告を受けております。この処分に基づき、7月2日、金融庁に業務改善報告書を提出、受理されております。業務改善報告書の主な概要は以下のとおりです。

i. 情報が流出したお客さま等の保護や被害拡大の防止に向けての必要な措置の実施

事態の判明を受け、直ちにお客さまからのお問い合わせ窓口、専用ホームページを開設すると共に、社長を本部長とする「お客さま情報流出対策本部」を設置し、お客さまの被害拡大防止を最優先に取り組みました。さらに、調査・評価のプロセスを明確化するために、対策本部内に外部専門家3名にて構成する「調査委員会」を設置いたしました。「調査委員会」は、事実関係を徹底的に調査し、第三者の視点から評価・提言を纏めた調査報告書を作成し、5月15日に対策本部長へその内容を報告しております。

名簿業者・勧誘業者への代理人弁護士による警告書の送付や、勧誘中止の要請などを実施し、名簿の回収を行うと共に、今後利用しないとの誓約を取り付ける対応を進めました。情報が流出した約5万名のお客さまへは、お詫びと当社の取り組み状況についてのお手紙を送付し、営業担当者から個別の電話や訪問により改めてご説明いたしました。また、6月下旬には、情報が流出したお客さまに対し、「お詫びのしるし」を送付いたしました。

会社分割後の三菱UFJモルガン・スタンレー証券においては、今後もお問い合わせ窓口を継続するとともに、当該名簿を利用した勧誘業者への勧誘中止の要請、警告文の送付、執拗な勧誘業者に対する法的手段も含めた対応等を実施し、今後ともお客さまへの対応を最優先課題として全社を挙げて取り組んでまいります。

ii. 経営陣を含む責任の所在の明確化

大量のお客さま情報等を流出させ、お客さまに多大なご迷惑をおかけした事案の重大性に鑑み、責任の所在を明確化するため、役員以下、関係者の社内処分を実施いたしました。

iii. 再発防止策

今回の事案を踏まえ、経営管理態勢の改善に取り組んでまいります。又、情報セキュリティ体制の充実・強化に向け、部門間の牽制機能の確保および外部委託先を含めた各種手続きの運用実態の検証と、その実効性を確保すると共に、システム開発・運用にかかる権限の分断および見直しを行いました。さらに、人事管理等の改善に向け、役職員に向けた倫理教育等の徹底、各種研修等を実施してまいります。

なお、施策の有効性検証のため外部監査法人を受け入れ、平成22年3月31日付の報告書を受領いたしました。これにより当社が進めてきたお客さま情報の漏洩防止策、今後の情報セキュリティ強化策について、重大な指摘事項はなく一定の評価を確認しております。

お客さま情報は当社グループにとってその基礎を成すものであり、今回の抜本的な再発防止策を実行に移していくことで、お客さまの信頼回復に向けて、役職員一同、徹底して取り組んでまいります。また、コンプライアンスのさらなる充実、内部統制システムの有効性確保のため、社内規程等の見直しを継続的に実施しております。

② モルガン・スタンレー証券との統合

当社の親会社であるMUFGと、Morgan Stanley（以下、「モルガン・スタンレー」といいます。）は、平成20年10月13日に行われたMUFGによるモルガン・スタンレーへの出資以降、グローバルな戦略的アライアンスの具体化について検討を進めてまいりました。

このような提携関係の第一歩として、両社及び両社のそれぞれの子会社である当社（現在の三菱UFJ証券ホールディングス）及びモルガン・スタンレー証券は、平成21年3月26日、当社とモルガン・スタンレー証券を統合することにつき、覚書を締結いたしました。その後四社間において協議を重ね、昨今のグローバルな金融規制環境の動向等を踏まえ、MUFGとモルガン・スタンレーの両社のネットワークと顧客基盤等を活用した統合効果を最大限発揮できる形態とするため、MUFGと、モルガン・スタンレーは、平成22年3月30日に、三菱UFJ証券とモルガン・スタンレー証券の統合に関する統合契約書を締結し、日本における証券事業の統合形態を、平成22年5月1日付で以下のように共同出資による証券会社2社（三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社（以下「MUMSS」といいます。）及びモルガン・スタンレーMUFG証券株式会社（以下「MSMS」といいます。））体制とすることに

いたしました。

i. 三菱UFJ証券の国内の事業とモルガン・スタンレー証券の事業のうち、インベストメントバンキング部門（以下「IB部門」といいます。）を統合することにより、MUFGとモルガン・スタンレーの共同出資会社（MUMSS）を設置いたしました。モルガン・スタンレー証券のIB部門は、会社分割（吸収分割）により平成22年5月1日付でMUMSSに承継されました。MUMSSにおける当社の議決権保有比率、経済的出資持分とも60%となりました。

ii. モルガン・スタンレー証券における、IB部門を除いたセールスアンドトレーディング部門と資本市場（株式・債券引受）部門の事業については、MUFGからも出資の上、モルガン・スタンレーとMUFGの共同出資会社（MSMS）といたしました。MSMSにおける当社の議決権保有比率は49%、経済的出資持分は60%となりました。

発足した両証券会社は、MUFGの本邦での総合金融ネットワークおよび広範な顧客基盤と、モルガン・スタンレーのグローバル・リーチおよび質の高い商品・サービスの両者を有機的に結び付け、専門性に国際性を加え、お客さまの高度化・多様化する金融ニーズに的確・迅速に対応することで、お客さまに最も支持される本邦証券業界のリーディングカンパニーを目指します。

③ MUFG傘下の証券持株会社としてのガバナンス態勢確立

当社は、モルガン・スタンレーとの戦略的提携の準備の一環として、当社傘下の証券事業全般に係る経営管理機能と業務統括機能を承継、集中することにより、迅速な意思決定を実現することを目的に、平成22年4月1日付にて証券持株会社となりました。

当社が証券持株会社化し、MUMSSならびにMSMSの証券会社2社を当社傘下におくストラクチャーが、ガバナンスや効率性の観点からも最適であると判断したうえで、他の内外の子会社・関連会社を含めて一元的に統括することにより、グループ全体での内部統制の強化につなげてまいります。このために、主要な連結対象の子会社とは経営管理契約を締結し、管理を実効性あるものとするに加え、当社が行う経営管理について、必要に応じてMUFGから指導、助言を求めることといたします。

また、MUFGと協働して、モルガン・スタンレーとの各種アライアンス推進等に向け、積極的に企画、立案に参画してまいります。

3【事業等のリスク】

当社は、事業の状況、経理の状況等に関する事項のうち、投資者の判断に重要な影響を及ぼす可能性のある事項として、以下を認識しております。また、必ずしもそのようなリスク要因に該当しない事項についても、投資者の投資判断上、重要であると考えられる事項については、投資者に対する積極的な情報開示の観点から以下に記載しております。なお、当社は、これらのリスク発生の可能性を認識した上で、発生の回避および発生した場合の対応に努める所存ですが、必ずしも確実にリスクの回避や十分な対応が実現される保証がないことに留意する必要があります。

なお、本稿における将来に関する事項は、有価証券報告書提出日（平成22年6月28日）現在において、当社が判断したものであります。

(1) 当社グループの事業について

当社の親会社は株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（MUFG）であり、当社議決権の100%を所有しております。当社グループは、MUFGグループの一員として、有価証券の売買および売買等の委託の媒介・取次ぎ・代理、有価証券の引受けおよび売出し、有価証券の募集・売出しの取扱いおよび私募の取扱い、各種デリバティブ取引、M&Aや資産の証券化等に係るアドバイス、投資信託委託業、投資顧問業、富裕層のお客さま向けの総合的な資産運用・管理業務（ウェルスマネジメント業務）を行っていますが、加えて金融機関等に対して金融商品仲介業および市場誘導業務の委託も行っています。なお、当社は平成22年4月1日付で、証券持株会社となり、傘下企業の事業全般に係る経営管理を行ってまいります。

海外では、子会社であるロンドンに本拠を有する三菱UFJセキュリティーズインターナショナルや、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（シンガポール）等を通じて証券業務等を行っております。

(2) 経営方針

① 経営の基本方針

当社グループは、MUFGグループの中核証券グループとして、以下の実現を目指し、事業基盤の拡大、株主価値の向上に努めてまいります。

- ・ 当社グループは、MUFGグループの金融機能とネットワークを最大限活用し、規制緩和に対応したビジネスモデルを確立し、金融業界の新しい動きを積極的にリードいたします。
- ・ 当社グループは、お客さまのニーズにお応えする営業体制を構築することにより営業基盤・営業力を拡充し、MUFGグループの中核証券グループたるプレゼンスを確立いたします。
- ・ 当社グループは、MUFGグループにおける中核証券グループとして、お客さまの幅広いニーズに適切な商品・サービスを供給できる機能を確立いたします。

この課題に対処するために、預り資産の増強、投資銀行業務を含めた法人取引の強化、海外業務の強化およびエクイティ業務の強化を推進すると同時にMUFGグループ内の協働体制の強化を進めております。また、当局の認可等を得られたことから、平成22年5月1日に証券子会社である三菱UFJ証券とモルガン・スタンレー証券のインベストメントバンキング部門を統合し、商号を三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社に変更しております。これらにつきましては、「2 対処すべき課題 ②モルガン・スタンレー証券との統合」をご参照下さい。

② コーポレート・ガバナンスについて

当社グループは、コーポレート・ガバナンス充実の一環として内部統制システムおよびリスク管理体制の整備・向上を経営の最重要課題の一つと位置付けております。当社は、社外取締役を選任することにより、取締役会の活性化を図るとともに経営の透明性を高め、また、監査機能につきましても、社外監査役を含めた体制により取締役の職務執行について監査しております。意思決定の迅速化を図るため、取締役会の下に「経営会議」を設置し、業務執行においては執行役員制を採用しております。経営会議には諮問機関として各種の委員会を設置しております。さらに、当社は、取締役会の委嘱を受けて、社外取締役および外部専門家を構成員に含む「監査委員会」を設置しております。当社が証券持株会社となったことによるガバナンス態勢については、「2 対処すべき課題 ③ MUFG傘下の証券持株会社としてのガバナンス態勢確立」をご参照ください。

(3) MUFGグループの中核証券会社としての位置付けについて

当社は、MUFGの連結子会社であり、MUFGの連結事業本部制度のもと、各連結事業本部と緊密な連携をとり、銀行・信託・証券すべての商品・サービスの中から、お客さまのニーズに対し適切なものを効率的かつ迅速に提供するという考え方でビジネスをグループ展開しております。

当社は、グループとしてのシナジー効果を最大限に発揮すべく、MUFGと経営管理契約を締結するとともに、当社の証券子会社である三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）は、株式会社三菱東京UFJ銀行（以下、「三菱東京UFJ銀行」といいます。）および三菱UFJ信託銀行株式会社（以下、「三菱UFJ信託銀行」といいます。）と各種業務に関する提携契約を締結しております。経営管理契約は、MUFGが当社に対して、必要に応じてリスク管理を含む助言・協議を行い、グループの健全かつ適切な業務運営を確保するとともに、当社グループの業務伸展を図ることを目的とする契約です。また各種業務に関する提携契約は、当該契約を通じて、グループのお客さまに対して、グループ銀行・信託銀行との協働による金融商品・サービスの提供およびそれぞれの分野にとらわれない総合的なアドバイスを行うことにより、当社グループおよびMUFGグループの連結ベースの収益力増強を目指す契約です。当社グループは、上記の各種契約に基づき、連結経営の観点から経営体制およびグループ内連携の強化を進めております。また、平成22年5月1日に証券子会社である三菱UFJ証券とモルガン・スタンレー証券のインベストメントバンキング部門を統合し、商号を三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社に変更しております。

当社グループは今後とも、MUFGグループとの連携の一層の強化につとめてまいります。万一、MUFGグループの政策が変更され、上記の経営管理契約、および、各種業務に関する提携契約の内容が大幅に改定、もしくは契約が終了された場合には、当社グループの業務および業績に影響を与える可能性があります。また、モルガン・スタンレー証券との統合についても、期待した統合効果を十分に発揮できない可能性も含めて、当社グループの業務および業績に影響を与える可能性があります。

(4) 当社グループの業績の推移について

① 最近3期の当社の連結業績および連結キャッシュ・フローの概要

当社の最近3期の連結損益計算書の主要な項目を次の表に示しております。

連結業績の推移

回 次	第3期	第4期	第5期
決 算 年 月	平成20年 3 月	平成21年 3 月	平成22年 3 月
区 分	(百万円)	(百万円)	(百万円)
営業収益	534,093	465,850	343,824
受入手数料	125,194	168,124	185,669
委託手数料	43,642	29,911	25,227
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	12,647	18,753	39,373
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	24,957	18,428	26,663
その他の受入手数料	43,946	101,031	94,404
トレーディング損益	125,508	81,718	100,418
金融収益	281,599	215,600	60,396
金融費用	290,480	235,878	56,671
純営業収益	243,612	229,972	287,153
経常利益	11,016	△22,788	41,022
当期純利益	8,137	△45,417	28,748

平成20年3月に終る第3期は、景気は緩やかな拡大を続けつつも、期末にかけて減速感が表れました。株式市場では第1四半期の上昇局面から転じて、米国サブプライム・ローン問題をきっかけに下落基調をたどり、債券市場では第1四半期は長期金利の上昇局面があったものの、追加利下げ観測が大幅に後退するとともに金利水準は低下傾向となりました。こうしたなか、受入手数料は1,251億94百万円（前年度比87.1%）、トレーディング損益は1,255億8百万円（同92.5%）となりました。連結営業収益は5,340億93百万円（同122.6%）、連結経常利益は110億16百万円（同15.0%）、連結当期純利益は81億37百万円（同18.3%）となりました。

平成21年3月に終る第4期は、米金融不安や世界景気の減速観測が強まるなか、株式市場では大幅な株価下落があり、債券市場では、第1四半期の一時的な長期金利の上昇局面があったものの、その後は「質への逃避」目的の債券投資もあり、基本的に低下傾向の中での一進一退を示しました。厳しい環境の下、受入手数料は1,681億24百万円（同134.3%）、トレーディング損益は817億18百万円（同65.1%）となり、連結営業収益は4,658億50百万円

(前年度比87.2%)、連結経常損失は227億88百万円(前年度は110億16百万円の利益)、連結当期純損失は454億17百万円(前年度は81億37百万円の利益)となりました。

平成22年3月に終る第5期は、景気は底打ちから緩やかな持ち直しに転じました。株式市場では景気底打ちと世界的な株高を背景に上昇基調となり、ギリシャ財政問題などを嫌気して弱含む場面があったものの、企業収益の回復期待を背景に上昇傾向をたどりました。債券市場では、長期金利が21年度補正予算に伴う過去最大の国債増発などを背景に上昇、日経平均株価の回復もあり、緩やかな金利上昇傾向となりました。こうしたなか、受入手数料は1,856億69百万円(同110.4%)、トレーディング損益は1,004億18百万円(同122.9%)となり、連結営業収益は3,438億24百万円(前年度比73.8%)、連結経常利益は410億22百万円(前年度は227億88百万円の損失)、連結当期純利益は287億48百万円(前年度は454億17百万円の損失)となりました。

当社の最近3期の連結キャッシュ・フロー計算書の主要な項目を次の表に示しております。

連結キャッシュ・フローの推移

回 次	第3期	第4期	第5期
決 算 年 月	平成20年3月	平成21年3月	平成22年3月
区 分	(百万円)	(百万円)	(百万円)
営業活動によるキャッシュ・フロー	△621,137	346,907	△605,490
投資活動によるキャッシュ・フロー	16,615	△68,203	△26,401
財務活動によるキャッシュ・フロー	687,999	△292,513	650,194
現金及び現金同等物に係る換算差額	△1,095	△37,484	4,680
現金及び現金同等物の増減額	82,382	△51,293	22,982
現金及び現金同等物の期首残高	78,361	160,743	109,213
連結の範囲の変更に伴う 現金及び現金同等物の増減額(△は減少)	—	△236	—
現金及び現金同等物の期末残高	160,743	109,213	132,196

キャッシュ・フロー計算書においては、一般的には、営業活動によるキャッシュ・フローは、企業が主たる営業活動から得られる資金を、投資活動によるキャッシュ・フローは、将来の利益獲得および資金運用のための資金の支出/回収を、財務活動によるキャッシュ・フローは、上記2つの活動を維持するために必要とする資金調達/返済を示すと想定されています。

しかし、証券会社のキャッシュ・フロー計算書には、以下のような固有の特徴があり注意を要します。まず、証券取引に関わる資産・負債は証券会社の貸借対照表における流動資産・負債の大部分と固定負債の一部(長期借入金等)を占めていますが、その残高はトレーディングやお客さまとの様々な証券取引により短期間に大きく変動する性質を有しています。その結果、キャッシュ・フロー計算書のうち、営業活動によるキャッシュ・フローおよび財務活動によるキャッシュ・フローの金額が、貸借対照表の証券取引に関わる項目の残高の増減に著しく影響を受けることとなります。また、キャッシュ・フロー計算書は、当該期初と期末の二時点間のみにおける貸借対照表の各項目の残高の変動を反映しておりますが、1年末満の短期間で大きく資金が流入、流出するという特徴を持つ証券会社の、当該期中のキャッシュ・フロー、特に営業によるキャッシュ・フローの状況を的確に示しているとは限りません。

証券会社のキャッシュ・フロー計算書における各項目のうち、証券取引に関わる資産・負債の増減に関連したものと思われる項目の主なものとして、営業活動によるキャッシュ・フローの中には、トレーディング商品(有価証券やデリバティブ取引の買付・売付)、信用取引資産・負債(貸付金・借証券担保金および借入金・貸証券受入金)、有価証券担保貸付金・借入金(レボ取引・現先取引に係る担保貸付金および借入金)等が含まれています。また、財務活動によるキャッシュ・フローの中には、短期借入金の増減額、コマーシャル・ペーパーの増減額といった証券取引に関わる負債の変動が含まれています。

② 連結業績の変動状況および要因

平成22年3月に終わる第5期の連結営業収益は3,438億24百万円(前年度比73.8%)となりました。受入手数料は1,856億69百万円(同110.4%)、トレーディング損益は1,004億18百万円(同122.9%)となりました。金融収益は603億96百万円(同28.0%)、金融費用は566億71百万円(同24.0%)となり、連結純営業収益は2,871億53百万円(同124.9%)となりました。また、販売費・一般管理費は2,631億3百万円(同101.8%)となったことから、連結営業利益は240億円49百万円(前年度は285億47百万円の損失)、連結経常利益は410億円22百万円(前年度は227億88百万円の損失)、連結当期純利益は287億円48百万円(前年度は454億17百万円の損失)となりました。

③ 連結キャッシュ・フローの状況

平成22年3月に終わる第5期の営業活動によるキャッシュ・フローは、約定見返勘定の差引残高の減少による収入2,355億34百万円があったものの、トレーディング商品（資産・負債）の差引残高の増加による支出8,547億95百万円があったこと等により6,054億90百万円の資金の減少（前年度は3,469億7百万円の資金の増加）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローでは、有価証券の売却および償還による収入1,579億10百万円に加え投資有価証券の売却および償還による収入917億27百万円があったものの、有価証券の取得による支出2,253億7百万円および投資有価証券の取得による支出468億10百万円等により264億1百万円（前年度比38.7%）の資金の減少となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、長期借入金返済による支出1,081億10百万円および社債の償還による支出1,628億50百万円があったものの、日銀オペ等による短期借入金の借入による増加3,740億43百万円、社債の発行による収入2,551億67百万円、およびコマーシャル・ペーパーの増加2,282億円があったこと等により6,501億94百万円の資金の増加（前年度は2,925億13百万円の資金の減少）となりました。これらの結果、現金及び現金同等物の期末残高は、前年度末比229億82百万円増加して1,321億96百万円（前年度比121.0%）となりました。

(5) 財政状態、経営成績等の変動とリスク管理およびコンプライアンス

① 財政状態、経営成績等の変動

当社グループの主な事業である証券・金融商品取引業は、国内外の経済情勢・市場動向の影響を受けて、受入手数料やトレーディング損益が変動し易い特性を持っております。当社グループは、法人・ホールセール事業ではエクイティ業務の強化と同時に、投資銀行業務、海外業務等の強化により、収益源の多様化に取り組んでおります。一方、リテール事業においては、預り資産の増強を図っており、その取組みにおいてはMUFGグループが構築を進める総合金融サービス提供体制の一翼を担っていくことで事業基盤を強化することを重要な課題と位置付け、グループにおける他のグループメンバーとの一層の連携を進めております。またリスク管理に関しましても、後記「② リスク管理」に記載のとおり、市場リスクをはじめとする各種リスクの管理により損失の回避に努めております。加えて徹底した経費削減の追求により、利益水準の向上にも努力しております。これらによりできる限り経済情勢・市場動向に左右されにくい収益体質の確立を当社グループは目指しております。しかしながら、かかる方策によっても当社グループの財政状態、経営成績等は、他の業種に比べ、その業務の性格上、経済情勢・市場動向により影響を受けることは避けられません。したがって、必ずしも受入手数料やトレーディング損益の変動の回避が保証されるものではなく、また収益源の多様化の順調な進展が保証されるものでもありません。

その他、法令諸規則等の変更や予測・管理困難なインフラストラクチャーの障害、災害ならびに戦争・テロ等も、当社グループの業績に直接的あるいは間接的に影響を及ぼす可能性があります。

② リスク管理

当社グループの事業運営におけるリスク管理につきましては、まず、当社の証券持株会社化によって、傘下子会社の経営管理機能を分離、集中させることで、当社が傘下企業の事業全般にかかる経営管理を行っていく体制を構築いたしました。次に、当社の証券子会社である三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）においては、取締役を構成員とする「リスク管理会議」を設置し、取締役会から委任されたリスク管理に関する重要事項の決議を行うとともに、各主要リスク管理関連部署から市場リスク・信用リスク・流動性リスク等の様々なリスクの状況の報告を受け、適切なリスク管理の運営を行うべく体制を構築しております。リスク管理会議には諮問機関として、リスク運営状況等の部門横断的な審議を行う「市場関連リスク管理委員会」、事務リスク管理および情報セキュリティ管理の総合的な運営のための「事務リスク・情報セキュリティ委員会」を設置しております。各主要リスク管理関連部署は、管理対象リスク毎に営業部門・商品部門から独立して設置され、牽制が働く管理体制をとるとともに、新しい商品の取扱いや業務を開始する場合には、各主要リスク管理関連部署によってリスク等の検討を経た上で、リスク管理会議で取扱いや業務の開始の可否を決議する体制となっております。また当社は、MUFGグループ全体のリスク管理の側面から、リスク管理に係る重要事項の決定にあたっては、MUFGと経営管理契約に基づく協議を実施しております。

なお、加えて当社の海外子会社である三菱UFJセキュリティーズインターナショナルおよびその他の海外子会社も当社の管理のもと、リスク管理体制の整備に努めております。このような方策により、以下の主要なリスクについて管理しておりますが、それによって当社グループとしてかかるリスクの影響を十分に回避できることを保証するものではありません。

a. トレーディング業務のリスク

当社グループは、証券市場を通じてお客さまの多様な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、種々のトレーディング・ポジションが発生いたします。トレーディングに伴って発生し、当社グループの財務状況について大きな影響を与えるリスクとして、保有する金融商品の市場価値（株式、金利、外国為替、コモディティ等の市場価格の水準または、これらのボラティリティ等）が変動することによ

り損失を被るリスク〔市場リスク〕および、借入人、有価証券の発行者、市場性取引等のカウンターパーティー等、契約の相手方その他関係者の財務状況の悪化または契約不履行等により損失を被るリスク〔信用リスク〕があります。

当社の証券子会社である三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）においては、市場リスクは、リスク管理会議が半期毎の許容する市場リスクの総量の上限、損失限度額を設定することにより管理しております。許容する市場リスク量は、バリュアットリスク方式※に基づく内部管理モデルにより捉えております。内部管理モデルの妥当性は、定期的にバックテスト※、ストレステスト※を実施し、確認しております。

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、管理方法を定めております。与信リスクは取引先毎に管理され、与信の供与はリスク管理会議が決定しております。発行体リスクについては、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、同社が保有する有価証券等に関して、格付別の残高上限等をリスク管理会議が設定することにより管理しております。カントリーリスクについては、当該国のカントリーリスクに晒されている発行体リスク額等に対し、リスク管理会議が対象国およびその上限額を設定することにより、当該国毎に管理しております。

上記の限度額等の遵守状況のモニターは、トレーディング業務を行う部署から独立したリスク統括部が行い、その結果を直接経営陣に日次で報告しております。また、限度額等のうち、許容する市場リスクの総量の上限、損失限度額および保有する有価証券等の格付け別残高上限の遵守状況は、トレーディング業務を行う本部内に設置されたリスク管理部署においてもモニターしております。

これらの管理により、トレーディング業務におけるリスクを特定し、コントロールしてリスクの回避に備えておりますが、それによって当社グループがトレーディング業務において多額の損失を被る可能性を十分に回避できるという保証はありません。

※バリュアットリスク方式	ポートフォリオ等の資産を一定期間保有すると仮定した場合に、ある一定の確率の範囲内で、マーケットの変動によりどの程度損失を被り得るかを、過去のマーケットのデータから計測する方法。
※バックテスト	実際に発生した損益またはポートフォリオを固定した場合に発生したと想定される損益とリスク計測モデルにより算出される損益との比較の結果に基づき、リスク計測モデルの正確性の検定を行うこと。
※ストレステスト	リスク計測モデルを用いて、想定される将来の価格変動を上回る価格変動が生じた場合に発生する損益に関する分析を行うこと。

また、証券持株会社化した当社において、当社グループの海外現地法人を含め、各種リスク総枠の設定や総合的なリスク管理をモニタリングする体制を整えております。

b. ブローカレッジ業務（有価証券等の売買の媒介、取次または代理業務）のリスク

ブローカレッジ業務では、市況の低迷などにより投資家の証券に対する投資需要が低調となる等の環境となった場合、収益が大きく低下する可能性があります。ブローカレッジ業務は、その業務の性質上、営業のためのインフラストラクチャー整備・維持のために多額の固定的経費（人件費、不動産費、減価償却費等）を必要とします。吸収分割実施前の当社では継続的にブローカレッジ業務における効率化策を実行してきており、今後も引き続き経費削減のための努力を推進してまいります。今後、市場環境の変化等の要因により、市況が低迷した場合には、ブローカレッジ業務の収益が大きく低下し、かかる経費削減のための努力にもかかわらず利益面において大幅な悪化を生じる可能性があります。

c. 投資銀行業務のリスク

投資銀行業務では、既公開企業の有価証券の引受けおよび募集・売出しの取扱い、未公開企業の新規公開業務、IRに関するアドバイス、各種資産の証券化に関するアドバイスならびに証券化商品の引受けおよび募集・売出しの取扱い、M&Aに対するアドバイスを主要な業務としております。これらの業務につきましても、経済情勢・市場動向の影響を受けて、手数料収入が変動し易い特性を持っております。また、引受業務には、引き受けた証券が市況の下落等で円滑に販売できない場合、損失を被るリスクがあります。その他、未公開企業、証券化関連商品等を対象とした、自己資金による中長期投資を行うことがあります。この場合、投資対象からの収益分配や投資対象の資産価値向上後の転売により投資収益を得ることを意図して投資を実行しますが、当該投資の流動性が低いこと、投資収益の不確実性などにより、投資の回収に長期間を要する、あるいは、当社グループが損失を被る可能性があります。

d. 流動性リスク

当社グループの主要事業である金融商品取引業は、その業務の性質上、大量の資金を必要とするため、資金を機動的かつ安定的に調達できることが必要となります。流動性リスクとは、市場の状況や当社の信用状態等の要因により、妥当な水準での取引ができなくなることにより損失を被るリスクをいい、取引や業務の遂行に必要な資金を適正な価格で調達することができないことにより、当社グループが損失を被るリスク〔資金流動性リスク（資金繰りリスク）〕と、保有ポジションを解消しようとする場合、必要とされる数量を妥当な水準で取引できないことにより、当社グループが損失を被るリスク〔商品流動性リスク〕に区分されます。

流動性リスクの中でも特に資金流動性リスクは、市場参加者にとって回避が困難なリスクであり、取引に際しては、キャッシュ・フローの確実性、時期その他の特性を分析した上、資金繰りを管理するとともに、危機時を想定した調達手段等に係る緊急時対応（コンティンジェンシー・プラン）として、有担保による調達、換金性の高い資産の売却などの代替資金調達手段を整備しております。また商品流動性リスクについては、三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）のリスク管理会議において、取引等の市場規模（厚み）を勘案し、必要な場合、商品流動性枠を設定して管理し、通常想定しうるリスクの極小化を図っております。しかしながら、資金流動性リスクが顕在化し、資金調達条件が著しく悪化した場合や、保有する金融商品の流動性が著しく悪化した場合には、事業の円滑な遂行に制約を受けることとなる可能性もあります。

また、当社は信用格付けの維持向上に取り組んでおりますが、当社の信用格付けが低下すると、当社の負債性資金の調達や借換えが円滑に行いにくくなり、事業に制約が生じるリスクがあります。これに対しましては、信用補完の方策として、当社がMUFGおよび三菱東京UFJ銀行とのキープウェル契約を締結していることに加えて、三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）は当社、MUFG、および三菱東京UFJ銀行とのキープウェル契約を締結していることによって、高い水準の格付けを維持し、当社グループとして機動的かつ安定的な資金調達基盤を構築しております。

e. 情報資産リスクおよびその他のオペレーショナルリスク

情報資産リスクとは、情報の喪失、改竄、不正使用および外部への漏洩、ならびに情報システムの破壊、停止、誤作動および不正使用等により、当社グループが損失を被るリスクをいいます。

三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）ではリスク管理会議の諮問機関として事務リスク・情報セキュリティ委員会を設置し、事務リスク管理および情報セキュリティ管理体制の整備・推進を図っておりますが、それによって当社グループが情報資産リスクの影響を十分に回避できることを保証するものではありません。なお、「対処すべき課題 ① お客さま情報の流出に対する対応」をあわせてご参照ください。

その他、コンピューターシステムに関する投資額は高水準なものとなっており、その結果、その償却コストおよび維持・運営コストも当社グループの財政状態、経営成績等に影響を及ぼす要因となり得ます。

また、その他のオペレーショナルリスクとして、

「事務リスク」 正確な事務を怠る、あるいは事務（取引処理）上の事故、不正により、当社グループが損失を被るリスク

「法務リスク」 取引および契約における法令等の検討・対応が不十分なことにより当社グループが損失を被るリスク（法令等の変更への対応が不十分であることにより、当社が損失を被るリスクを含みます）

「評判リスク」 諸リスクの顕在化、お客さまとのトラブル、もしくは不祥事件の発生等に起因した、当社グループの社会的な評判の低下により、当社グループが損失（もしくは得べかりし利益の逸失）を被るリスク（事実と異なるにもかかわらず、第三者による風評・情報の流布により、当社グループの評判が悪化し、当社グループが損失を被るリスクを含みます）

等が挙げられます。事務リスクにつきましては、オペレーションの正確性・信頼性確保、業務に関する手続きおよび権限体系の明確化、内部牽制機能の確保を基本として、その管理に取り組んでおります。法務リスクに関しては、社内外の法律専門家からの意見を必要に応じ十分聴取できるプロセスを確保するよう努めております。評判リスクに対しては、信用・信頼の重視を当社経営の根幹と認識し、種々の規程・手続き等により、お客さまとの取引における適正行動、不公正取引の防止等の徹底を図っております。しかし、これらの取組みによって当社グループがオペレーショナルリスクの影響を十分に回避できることを保証するものではありません。

③ コンプライアンス（法令遵守）

金融商品取引業者および金融商品取引業者の役職員は、金融商品取引業務を営む上で金融商品取引法をはじめとする各種の法令諸規則を遵守しなければなりません。法令違反等が発生した場合、その内容によっては、所轄官庁等より処分・命令を受ける可能性があり、また、当社グループの社会的な評判が低下する可能性もあります。また、お客さまとのトラブル、もしくは不祥事件等の発生に起因して、当社グループ各社に対して訴訟が提起され、多額の損害賠償支払いが生ずる可能性もあります。かかる事態の発生により、当社グループが損失（もしくは得べかりし利益の逸失）を被り、当社グループの財政状態、経営成績等が影響を受ける可能性があります。

これに対し当社グループは、コンプライアンス態勢の整備を経営の最重要課題の一つとして位置付け、その充実に取り組んでおります。特に三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）の業務執行については、経営の透明性を高めるために社外取締役、社外監査役を選任し、外部からの監視監督機能としております。また、取締役会および経営会議の諮問機関として、取締役に加え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、原則として四半期毎に内部管理体制の整備・強化のための討議および討議に基づく経営陣への諮問を行っております。さらに、当社においても別途コンプライアンス委員会を設置いたします。

また、MUFGグループでは、グループ全体のコンプライアンス態勢強化のため、MUFGのチーフ・コンプライアンス・オフィサー（CCO）を議長とし、MUFGの子会社である当社および三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）、三菱東京UFJ銀行および三菱UFJ信託銀行のCCOが参加する「グループCCO会議」を設置しております。グループCCO会議は、グループ会社のコンプライアンスに関する情報の共有化ならびに予兆管理を強化し、問題事象等への能動的な対応に繋げるとともに、グループ全体のコンプライアンス態勢の不断の改善を図ることを目的としております。しかし、上記の取組みによって当社グループがコンプライアンス上のリスクの影響を十分に回避できることを保証するものではありません。

さらに、個人情報の保護につきましては、個人情報の保護に関する法律により、三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）は同法に定める個人情報取扱事業者として、同法の規制を受けております。個人情報の保護に関する法律は、個人の権利利益保護の目的で、個人情報取扱事業者が個人情報の適切な取扱いを義務付けており、万一その取扱いに不備があった場合には、主務大臣からの勧告・命令等の行政処分がなされ、さらに主務大臣からの命令に違反した場合には罰則が科されることとなります。また、個人情報の保護に関する法律に基づき主務大臣は個人情報取扱事業者に対して報告を求めることができますが、かかる報告を行わなかった場合または虚偽の報告を行った場合にも罰則が科されることとなります。さらに、万一顧客等の個人情報の漏洩が生じた場合、当該顧客等から損害賠償を請求される可能性があります。かかる事態が発生した場合には当社グループの信用が失墜する可能性があります。

(6) 競争

本邦金融・証券市場におきましては、金融規制緩和の進展、オンライン証券取引の普及、外資系投資銀行による日本国内における業務拡大、異業種からの金融商品取引業参入等が進んでおります。規制緩和やオンライン取引の普及は、当社グループにとりましても新たな事業機会の拡大となり得ますが、反面、参入企業の増加により、競争が一層激化しております。具体的には、オンライン証券会社による委託取引サービスの急速な普及の結果として、手数料等の低下等が生じました。また、引受およびコーポレートアドバイザーサービスの分野においては日本市場に業務を拡大している外資系証券との競争が激しくなっています。加えて、日本の金融業界は大きな整理統合が進み、結果として各種金融サービスを総合的に提供しようとする金融機関が競合相手となっています。その中で、当社の証券子会社である三菱UFJ証券（現在の三菱UFJモルガン・スタンレー証券）とモルガン・スタンレー証券との統合により、従来のサービスに加え、モルガン・スタンレーの技術力や海外ネットワークを活用したグローバルな商品・サービスを、個人・法人両方のお客さまにご提案できるように努めていく体制が一層強化されることとなりますが、かかるより競争的で規制緩和が進んだ事業環境において十分に競争することができない場合、当社グループの財政状態、経営成績等に影響を及ぼす可能性があります。

(7) 法的規制

日本国内の金融商品取引業者には、金融商品取引法に基づき、自己資本規制比率が120%を下回ることがないようにならなければならないとの自己資本規制が設けられております。自己資本規制比率とは、「固定化されていない自己資本の額」の、保有する有価証券の価格の変動その他の理由により発生しうる危険に対応する額である「リスク相当額」に対する比率です。金融商品取引業者はその業務の性格上、保有有価証券等の価格変動などの各種リスクに備えるため、自己資本規制比率を一定水準以上に維持することが義務付けられています。この比率を維持できなかった場合、業務方法の変更等、種々の命令を受けることとなります。当社（吸収分割実施前の三菱UFJ証券）の自己資本規制比率は平成22年3月期末現在、342.9%となっています。

また、金融商品取引業者は、金融商品取引法に基づき、顧客資産の保護のため、金融商品取引業に係る顧客との取引に関して預託を受けた有価証券および金銭と、証券会社自身が保有する有価証券や金銭とを明確に区分して管理することを義務付けられています。分別管理の状況は、当社自身の内部監査に加え、金融商品取引業者を監督している金融庁の検査や日本証券業協会の監査により定期的に検証を受けています。さらに、監査法人または公認会計士による検証を毎年1回以上受けることが義務付けられています。

金融商品取引業者には、この他にも種々の規制の適用がありますが、規制を受ける法令諸規則の変更があった場合、また、新たな法的規制が導入された場合、業務が影響を受ける可能性があります。また当社グループは、当社の海外子会社を通じて海外でも証券業を行っており（後記「(8)海外事業」をご参照下さい。）、当該国における種々の法的規制に服しております。かかる法的規制が当該国の政府の方針等により変更された場合、当社の海外における業務は影響を受ける可能性があります。

(8) 海外事業

当社グループの主な海外拠点は現地法人7社および駐在員事務所1ヶ所（北京）があります。現地法人は英国に三菱UFJセキュリティーズインターナショナル、米国に三菱UFJセキュリティーズ（USA）、香港に三菱UFJセキュリティーズ（香港）ホールディングスおよびその子会社2社（三菱UFJセキュリティーズ（香港）キ

ャピタルおよび三菱ＵＦＪセキュリティーズ（香港）、シンガポールに三菱ＵＦＪセキュリティーズ（シンガポール）、上海に三菱ＵＦＪセキュリティーズ（香港）キャピタルの子会社である菱証投資諮詢（上海）有限公司があります。国内外での連携により、お客さまに対してより充実したサービス・商品を提供するためには、これら海外拠点において展開される業務等は重要な役割を果たしますが、内外における経済、市場等事業環境の変動が当該海外拠点における事業に影響を及ぼす可能性があります。また、現地法令諸規則の変更等により当該海外拠点の事業に影響が及ぶ場合があります。なお、海外拠点に関しましても、当社の証券子会社である三菱ＵＦＪ証券（現在の三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券）を取り巻くリスクと同様に、事業上、法令上のリスクの回避ならびにリスク管理等のための体制構築・向上に努めております。

(9) 会計上の見積りの不確実性

当社グループにおける重要な会計方針および見積りに関して、選択可能な見積り方法・手続きのうち最善かつ合理的な方法を選択し、合理的な前提条件および入手可能な情報の中で最も客観性のある情報に基づいて金額を算出し、計上しております。ただし、見積りは不確実なものであるため、見積りが確定するまでの間の環境等の変動により、見積り段階において設定した前提条件や利用した情報等に見積り誤差が生じ、結果として翌期以降の財政状態および経営成績に影響を与えることがあります。なお、決算期後に生じた事象（後発事象）について、その実質的な原因が決算日現在において既に存在しており、決算日現在の状況に関する会計上の判断ないし見積りをする上で、追加的ないしより客観的な証拠を提供するものである場合には、原則として当該決算期の財務諸表の修正を行っております。

なお、特に重要と考えられる項目は、次の項目であります。

- ① トレーディング商品
- ② トレーディング商品関連以外の有価証券等
- ③ 有形固定資産・無形固定資産
- ④ 貸倒引当金
- ⑤ 繰延税金資産・負債
- ⑥ 退職給付会計

4【経営上の重要な契約等】

(1) MUFGグループにおける契約

当社グループはMUFGグループの中核証券会社グループとして、MUFGグループにおける証券関連商品・サービスの提供機能を担っております。MUFGグループにおいては、お客さま一人ひとり、一社一社の金融ニーズにスピーディーかつ的確にお応えするために、お客さまのセグメント毎にグループ会社が緊密な連携のもと、一元的に戦略を策定し、グループ一体となって事業を推進する連結事業本部制度が導入されており、当社も各連結事業本部と緊密な連携をとりビジネスを展開して参ります。このような体制のもと、当社グループは、MUFGグループとしてのシナジー効果を最大限に発揮すべく、MUFGと経営管理契約を締結するとともに、株式会社三菱東京UFJ銀行および三菱UFJ信託銀行株式会社と各種業務に関する提携契約を締結しております。

各種契約の内容は以下のとおりです。

① 経営管理契約

当社グループは、MUFGと、当社グループの経営にかかる提携について、経営管理契約を締結しております。

この契約は、MUFGが当社グループに対して、必要に応じてリスク管理を含む助言・協議を行い、MUFGグループの健全かつ適切な業務運営を確保するとともに、当社グループの業務伸展を図ることを目的としたものであります。

また、当社が平成22年4月1日付で証券持株会社化したことを契機に、内外の子会社・関連会社を含めて一元的に統括することにより、グループ全体での内部統制の強化につなげていくため、同日付で主要な連結対象の子会社との間で経営管理契約を締結しております。

② 各種業務に関する提携契約について

当社は、株式会社三菱東京UFJ銀行および三菱UFJ信託銀行株式会社と各種業務に関して提携契約を締結しております。

これらの提携契約は、当該契約を通じて、MUFGグループのお客さまに対して、グループ銀行・信託銀行との協働による当社の金融商品・サービスの提供およびそれぞれの分野にとらわれない総合的なアドバイスを行うことにより、当社グループのみならずMUFGグループの連結ベースの収益力増強を目指すものであります。

(2) モルガン・スタンレー証券との統合に関する契約

当社の親会社であるMUFGと、Morgan Stanley（以下「モルガン・スタンレー」といいます。）は、平成20年10月13日に行われたMUFGによるモルガン・スタンレーへの出資以降、グローバルな戦略的アライアンスの具体化について検討を進めて参りました。このような提携関係の第一歩として、両社および両社のそれぞれの子会社である当社およびモルガン・スタンレー証券株式会社（以下「モルガン・スタンレー証券」といいます。）は、平成21年3月26日、当社とモルガン・スタンレー証券を統合することにつき、覚書を締結いたしました。その後四社間において協議を重ね、昨今のグローバルな金融規制環境の動向等を踏まえ、MUFGとモルガン・スタンレーの両社のネットワークと顧客基盤等を活用した統合効果を最大限発揮できる形態とするため、MUFGと、モルガン・スタンレーは、平成22年3月30日に、当社とモルガン・スタンレー証券の統合に関する統合契約書を締結し、日本における証券事業の統合形態を、平成22年5月1日付でMUFGとモルガン・スタンレーの共同出資による証券会社二社（三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社（以下「MUMSS」といいます。）およびモルガン・スタンレーMUFG証券株式会社（以下「MSMS」といいます。））体制とすることにいたしました。

統合に関し、当社は、平成21年11月18日開催の当社取締役会において、当社の営む事業を平成22年4月1日付で会社分割し、予め平成21年12月1日に当社が新設した100%子会社である三菱UFJ証券分割準備株式会社（平成22年4月1日付で「三菱UFJ証券株式会社」に商号変更）に承継させる内容の吸収分割を実施することを決議しました。

また、平成21年12月24日開催の取締役会において、吸収分割契約書を締結することを決議し、平成21年12月25日付で吸収分割契約書を締結いたしました。なお、当該吸収分割契約書に基づき、平成22年4月1日にこれを実行いたしました。

詳細につきましては、「第5 経理の状況 1 連結財務諸表等 (1) 連結財務諸表 2 財務諸表等 (1) 財務諸表 注記事項（重要な後発事象）」に記載のとおりであります。

5【研究開発活動】

該当事項はありません。

6【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

当年度の財政状態および経営成績の分析は、以下のとおりであります。

なお、文中における将来に関する事項は、有価証券報告書提出日（平成22年6月28日）現在において、当社グループが判断したものであります。

(1) 重要な会計方針および見積り

当社の連結財務諸表は、わが国において一般に公正妥当と認められている会計基準に基づき作成されております。この連結財務諸表の作成にあたり、トレーディング商品および投資についての評価、貸付等債権に対する貸倒引当金、繰延税金資産についての回収可能性、退職給付費用および債務、偶発事象や訴訟、その他資産・負債の報告数値や財務諸表の開示内容に影響を与える事項に対して、過去の実績や状況に応じ合理的と考えられる判断や見積りを行っております。従って、不確実性を内在しており、将来生じる実際の結果と大きく異なる可能性もありますので、ご留意下さい。なお、特に重要と考えられる項目は、次の項目であります。

① トレーディング商品

トレーディング商品（デリバティブを含む）は時価により評価され、評価損益はトレーディング損益に計上されております。時価については、市場で取引されているものについては、市場取引価格、業者間取引価格、またはこれらに準ずる価格等によっております。市場取引価格または業者間取引価格がない場合には、原金融資産の時間的価値とボラティリティ等を加味した時価評価モデルによって算出されております。

② トレーディング商品関連以外の有価証券等

有価証券については「金融商品に関する会計基準」に基づき、トレーディング商品、満期保有目的債券、子会社株式・関連会社株式のいずれにも属さないものについて、その他有価証券として分類しております。

その他有価証券のうち、時価のあるものについては時価法で、時価のないものについては移動平均法による原価法でそれぞれ評価されております。また、時価のあるものについては時価、時価のないものについてはその実質価額が取得原価より著しく下落し、かつ回復可能性がないと判断したものについては、社内の減損処理基準にしたがって時価または実質価額まで減損処理しております。

投資事業有限責任組合およびそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な直近の計算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

③ 有形固定資産・無形固定資産

主に建物、器具備品、土地、リース資産からなる有形固定資産および主にソフトウェアからなる無形固定資産は取得価額により計上し、リース資産を除く有形固定資産については個々の耐用年数に基づき定率法または定額法により、リース資産についてはリース期間を耐用年数とし残存価額を零とする定額法により、ソフトウェアについては利用可能期間に基づく定額法により、それぞれ減価償却しております。なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年3月31日以前のリース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。

また、収益性が低下した資産について、回収可能価額まで減損処理しております。

④ 貸倒引当金

信用取引貸付金等の一般債権については過去の貸倒実績率により、貸倒懸念債権および破産更生債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能と判断した金額を貸倒見積額として計上しております。

⑤ 繰延税金資産・負債

税務上の繰越欠損金や会計上の資産・負債と税務上の資産・負債との差額（一時差異の額）のうち、将来において税務上の損金となることで節税効果が見込まれると判断される金額（将来の減算一時差異等の解消見込額）について、翌期1年間における課税所得見積額の範囲内で繰延税金資産に計上しております。なお、その他有価証券の評価差益に対しては、将来の売却による課税の発生が確実であることから、繰延税金負債（固定負債）を計上しております。

⑥ 退職給付会計

従業員の退職給付引当金および退職給付費用については、割引率、退職率、年金資産の期待運用収益率等の合理的な見積りに基づく退職給付債務の数理計算上の見込額および年金資産の公正な評価額に基づいて計上しております。なお、当社の割引率につきましては、デリバティブの公正価値算定に用いるスワップレート等を使用しております。

(2)経営成績の分析

(当年度の経営成績)

当年度のわが国景気は、底打ちから緩やかな持ち直しに転じました。輸出は、アジア向けを中心に回復傾向をたどりました。公共投資は、対策効果により上期を中心に増加しました。また、個人消費は、厳しい雇用・所得環境にもかかわらず、対策効果に支えられ、耐久財を中心に底堅く推移しました。こうしたなか、鉱工業生産は前年の落ち込みの反動もあって高めの伸びとなりました。一方、設備投資は、企業収益の落ち込みと大幅な需給ギャップを反映し、弱含みの動きが続きました。

株式市場では、日経平均株価が8,173円でスタートし、11,089円で終了しました。景気底打ちと世界的な株高を背景に上昇基調となり、6月11日には8ヵ月ぶりに1万円の大台を回復しました。7月中旬には米株安から9,000円台割れ寸前まで反落したものの、米株が持ち直す反発しました。11月下旬には1ドル80円台半ばへの円高進行を受けて、再び9,000円台割れをうかがいましたが、12月1日の日銀の新型オペ導入をきっかけに為替が円安に向かうと、再び1万円台を回復しました。その後は、ギリシャ財政問題などを嫌気して弱含む場面があったものの、企業収益の回復期待を背景に上昇傾向をたどりました。

債券市場では、長期金利が1.330%で始まり、1.395%で終了しました。景気が底打ちするなか、09年度補正予算に伴う過去最大となる16.9兆円の国債増発などを背景に、6月11日には1.560%まで上昇しました。しかし、米長期金利が4%をつけた後ピークアウトに転じると、わが国景気の“二番底”への警戒感を背景に低下傾向に転じ、日銀が政府のデフレ宣言を受ける格好で追加金融緩和策を決めた12月1日には1.190%をつけました。その後は、平成22年度予算の一般会計総額が過去最大の92兆円に膨らんで一段の財政悪化懸念が強まるなか、日経平均株価の回復もあり、緩やかな金利上昇傾向となりました。

当年度の連結営業収益は3,438億24百万円（前年度比73.8%）、連結経常利益は410億22百万円（前年度は227億88百万円の損失）、連結当期純利益は287億48百万円（前年度は454億17百万円の損失）となりました。

当年度の主要な連結の収益・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1,856億69百万円で前年度比110.4%となりました。内訳は次のとおりです。

a. 委託手数料

当年度の東証の1日平均売買高（内国普通株合計）は、株数で23億22百万株（前年度比105.0%）、金額で1兆5,531億円（同76.5%）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248億43百万円（同84.8%）となりました。一方、債券委託手数料は2億53百万円（同59.9%）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

株式発行市場では、世界的な景気回復期待から自己資本充実を目的とした大型の資金調達が相次ぎ、当年度の国内公募増資はバブル経済崩壊後で最大規模に達しました。当社はこのような環境の下、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループの公募増資、株式会社三菱総合研究所の株式新規公開などの案件で代表引受会社および主幹事をつとめました。

債券発行市場では、金融不安の後退により世界的に債券市場を通じた資金調達の増加傾向が見られました。国内でも堅調な投資需要を背景に、高格付け銘柄の大型起債が相次ぐとともに個人向け社債の発行も旺盛となり、当年度の普通社債発行額は11年ぶりの高水準に達しました。当社はこのような環境の下、普通社債、財投機関債、地方債等で多数の主幹事をつとめました。欧米拠点においても、三菱UFJセキュリティーズインターナショナルや当年度より新たに引受業務を開始した三菱UFJセキュリティーズ（USA）が大型案件の主幹事をつとめるなど、好調な結果となりました。

以上の結果、当年度の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は合計で393億73百万円（前年度比210.0%）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。当年度は、主として通貨選択型の新興経済国の公社債等に実質的な投資を行う「三菱UFJ新興国債券ファンド通貨選択シリーズ」、「エマージング・ボンド・ファンド・カレンシー・セクション」、「新興国公社債オープン（通貨選択型）」、日本を除くアジア諸国の上場株式を主要投資対象とする「アジア・セクション」、当社のQFII（適格海外機関投資家）枠取得により、中国株を主要投資対象とする「中国株オープン」、ブ

ラジルの企業の株式を主要投資対象とする「ブラデスコ ブラジル株式オープン」等の新規募集を行ったほか、「ワールド・リート・オープン」、「HSBCブラジルオープン」等の継続募集に注力しました。また、日系発行体が世界で発行する外貨建ての債券等に投資を行う「東京海上Roggeニッポン海外債券ファンド（為替ヘッジあり）」など、法人向けの投資信託にも引き続き注力しました。投資信託の販売額は前年度を上回り、取扱手数料も前年度比で増加する結果となりました。当社の当年度の投資信託の募集・売買取扱高は4兆818億円（前年度比102.9%）となり、当年度末における投資信託の残存元本は、外国投資信託を含め4兆7,053億円（前年度比100.1%）となりました。

以上の結果、当年度の募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は266億63百万円（前年度比144.7%）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他に、証券化・不動産ファイナンス業務、M&A業務および財務アドバイザー業務にかかる手数料、年金保険の販売手数料、連結子会社の国際投信投資顧問株式会社における投資信託の委託者報酬などを含んでおります。投資信託については期末の純資産残高は前年度と比較し増加したものの、期中における純資産残高の平均は前年に及ばず、投資信託の代行手数料は、前年度比で減少する結果となりました。M&A業務では、国内外ネットワークの活用およびグループ企業との連携を通じ、お客さまの企業価値向上に資する多様なニーズにお応えして実績を積み重ねました。年金保険に関しては、投資型年金である第一フロンティア生命の「エレガントタイムⅡ」、定額年金であるマスマチュアル生命の「エムソリューションⅡ」等の販売に注力しました。一部販売商品の休止など外部環境の悪化はありましたが、相続・贈与ニーズは引き続き強く、前年度比では増加しました。

以上の結果、当年度のその他の受入手数料は944億4百万円（前年度比93.4%）となりました。

② トレーディング損益

国内株式市場は、期初に米国大手金融機関の信用不安後退や景気回復期待による回復をみせた後、エクイティファイナンスによる需給悪化懸念やドバイ・ショック等の信用不安の再燃もあり上値の重い状況も見られましたが、期末にかけて再び回復しました。このような市場動向の中、国内株式は全体的な上昇基調・信用不安後退に支えられ堅調なトレーディング環境となりました。外国株式では、一時的な信用悪化局面もあったものの米国の企業業績、ブラジル等の新興市場国の経済回復を反映し取引量が増加しました。

債券等では、4～9月は景況感を睨みながら大きく上下に推移する相場展開となりました。10月に入り、国債の需給悪化懸念や米国早期利上げ観測の台頭に債券価格は大幅下落しましたが、株安が進行すると相場は反転上昇し、年末にかけては一進一退の相場展開となりました。1月になると、内外株安や日銀の追加緩和観測報道も相俟って、相場の上昇余地を探る展開となりましたが、期末を控えて方向感に乏しい展開となりました。クレジット市場では、会社更生法適用申請や格付等の引き下げが相次ぎましたが、クレジットスプレッドは概ね縮小・安定推移となりました。このような相場環境下、当社はクレジット商品の売買、店頭取引のトレーディングで着実に収益を計上しました。

以上の結果、当年度のトレーディング損益は、株券等によるものが106億53百万円の利益（前年度は377億63百万円の損失）、債券等によるものが1,023億40百万円の利益（前年度比73.7%）、その他が125億75百万円の損失（前年度は193億60百万円の損失）、合計では1,004億18百万円の利益（前年度比122.9%）となりました。

③ 金融収支

当年度の金融収益603億96百万円（前年度比28.0%）から金融費用566億71百万円（同24.0%）を差し引いた金融収支は、37億25百万円の利益（前年度は202億77百万円の損失）となりました。

④ 販売費・一般管理費

厳しい収益環境が続く中で、当社グループ一体となってコスト・コントロールに努めております。取引関係費や事務費を中心に物件費が減少しましたが、一方で業績連動の人件費増加により、当年度の販売費・一般管理費は2,631億3百万円（前年度比101.8%）となりました。

⑤ 特別損益

当年度の特別利益は15億15百万円（前年度比18.1%）、特別損失は34億40百万円（同20.5%）となりました。特別利益のうち主なものは、投資有価証券売却益が15億11百万円であります。特別損失のうち主なものは、固定資産に関する減損損失10億82百万円、情報流出に関する損害賠償金等7億26百万円、投資有価証券評価損6億60百万円であります。

(3) 財政状態の分析

当年度末における総資産は20兆1,347億13百万円（前年度末比1兆1,044億33百万円増）となりました。内訳は流動資産が19兆5,503億95百万円（同1兆3,092億9百万円増）であり、このうちトレーディング商品が11兆3,951億46百万円（同5,441億44百万円増）、有価証券担保貸付金が6兆7,652億83百万円（同8,082億11百万円増）となっております。固定資産は5,843億18百万円（同2,047億76百万円減）となっております。

負債合計は、19兆4,330億59百万円（同1兆602億17百万円増）となりました。内訳は流動負債が18兆4,655億1百万円（同1兆1,045億99百万円増）であり、このうちトレーディング商品が7兆5,408億98百万円（同3,408億6百万円減）、有価証券担保借入金が8兆3,079億円（同8,647億62百万円増）となっております。固定負債は9,656億96百万円（同443億79百万円減）となっております。

純資産合計は7,016億54百万円（同442億16百万円増）となりました。うち、利益剰余金は純利益による287億48百万円の増加や剰余金の配当による147億48百万円の減少の結果、1,845億80百万円（同139億99百万円増）となっております。

(4) キャッシュ・フローの状況

（キャッシュ・フローの状況に関する分析）

当年度における現金および現金同等物（以下「資金」という。）は、トレーディング商品（資産・負債）の差引残高の増加、有価証券の取得、および社債の償還等による支出があったものの、共通担保資金供給オペレーション（日銀オペ）による短期借入金の増加や社債の発行等による収入により、前年度比229億82百万円の資金の増加となり、当年度末の資金残高は1,321億96百万円（前年度末比121.0%）となりました。

（営業活動によるキャッシュ・フロー）

当年度における営業活動による資金の減少は6,054億90百万円（前年度は3,469億7百万円の資金の増加）となりました。これは主に、約定見返勘定の差引残高の減少による収入2,355億34百万円があったものの、トレーディング商品（資産・負債）の差引残高の増加による支出8,547億95百万円があったこと等によるものであります。

（投資活動によるキャッシュ・フロー）

当年度における投資活動による資金の減少は264億1百万円（前年度比38.7%）となりました。これは主に、有価証券の売却および償還による収入1,579億10百万円に加え投資有価証券の売却および償還による収入917億27百万円があったものの、有価証券の取得による支出2,253億7百万円および投資有価証券の取得による支出468億10百万円等によるものであります。

（財務活動によるキャッシュ・フロー）

当年度における財務活動による資金の増加は、6,501億94百万円（前年度は2,925億13百万円の資金の減少）となりました。これは主に、長期借入金の返済による支出1,081億10百万円および社債の償還による支出1,628億50百万円があったものの、日銀オペ等による短期借入金の借入による増加3,740億43百万円、社債の発行による収入2,551億67百万円、およびコマーシャル・ペーパーの増加2,282億円があったこと等によるものであります。

第3【設備の状況】

1【設備投資等の概要】

当連結会計年度において実施した設備投資およびコンピューター関連投資の総額は、156億円であります。

設備投資については、営業店舗統廃合・移転関連投資、さらには店舗等の一般改修および長期修繕等の改修投資を行いました。

コンピューター関連投資については、お客さま情報流出の再発防止、情報セキュリティ強化、制度変更対応、老朽化基盤更改等、必要不可欠な案件を中心に、対応期限や投資効果を勘案し、緊急性および優先度の高い案件に限定した対応を行ってまいりました。また、モルガン・スタンレー証券株式会社との統合対応にも取り組んでおります。

なお、国内連結子会社（エム・ユー・エス・ファシリティサービス株式会社）所有の一部の土地（帳簿価額16億円）を売却しております。

2【主要な設備の状況】

当連結会計年度末における主要な設備の状況は、以下のとおりであります。

平成22年3月31日現在

会社名	店舗名 その他	所在地	設備の 内容	土地		建物	器具 備品	合計	従業員数 (人)
				面積（㎡）	帳簿価額（百万円）				
当社	本店ほか 26店	東京都	店舗・ 事務所	210	202	3,196	2,387	5,786	3,634
	大宮支店 ほか27店	東京都を 除く関東 地区	店舗	257	1	371	192	564	660
	札幌支店 ほか1店	北海道地 区	店舗	273	197	151	17	366	68
	仙台支店 ほか2店	東北地区	店舗	—	—	48	27	76	92
	名古屋支 店ほか8店	愛知県	店舗	146	23	239	100	363	337
	岐阜支店 ほか10店	愛知県を 除く中部 地区	店舗	—	—	104	73	178	346
	大阪支店 ほか7店	大阪府	店舗	993 (350)	583	1,322	118	2,024	483
	神戸支店 ほか9店	大阪府を 除く近畿 地区	店舗	—	—	233	90	323	361
	広島支店 ほか3店	中国地区	店舗	—	—	184	42	226	142
	高松支店 ほか3店	四国地区	店舗	—	—	35	30	65	95
	福岡支店 ほか5店	九州地区	店舗	—	—	114	56	171	156
	駐在員事 務所	アジア地 区	事務所	—	—	8	5	13	1

会社名		店舗名 その他	所在地	設備の 内容	土地		建物	器具 備品	合計	従業員数 (人)
					面積（㎡）	帳簿価額（百万円）				
当社		青葉台研 修センタ ー	横浜市青 葉区	研修所	4,218	657	296	10	964	－
		社宅・寮 計16ヵ所	東京都世 田谷区ほ か	厚生施 設	11,518 (203)	3,387	1,535	31	4,953	－
		その他の 施設	東京都江 東区ほか	その他	42,090	51	324	2,404	2,780	－
国内 連結子 会社	エム・ ユー・ エス・ ファシ リティ サービ ス株式 会社	本社	東京都	事務所	－	－	8	6	15	33
		大船ビル ほか	東京都を 除く関東 地区	賃貸ビ ル	563	139	210	0	350	－
		豊橋ビル ほか	愛知県	賃貸ビ ル	1,100	157	246	0	404	－
		甲府ビル ほか	愛知県を 除く中部 地区	賃貸ビ ル	1,312	265	141	－	407	－
	国際投 信投資 顧問株 式会社 ほか5社	本社ほか	東京都	事務所 ほか	486	186	384	279	850	671
海外 連結子 会社	三菱U F Jセ キュリ ティー ズイン ターナ シヨナ ル	本社ほか	英国ロンド ン市ほか	店舗ほ か	－	－	780	1,198	1,978	451
	三菱U F Jセ キュリ ティー ズ（U SA）	本社	アメリカ 合衆国ニ ューヨー ク市	店舗	－	－	452	354	806	152

- (注) 1. 土地の面積欄の()内は、借地の面積(うち書き)であり、三菱UFJ証券株式会社の賃借物件にかかる年間賃借料は11,819百万円であります。
2. 器具備品は、コンピューター関連および通信機器等3,986百万円、その他什器・備品等1,603百万円であります(三菱UFJ証券株式会社の国内記帳資産のみ)。
3. 上記のほか、ソフトウェア資産44,165百万円、リース資産5百万円を所有しています。
4. 従業員数には執行役員、嘱託および臨時従業員を含めておりません。

5. リース契約による主な賃借設備は以下のとおりであります。

会社名	店舗名 その他	所在地	設備の内容	従業員数 (人)	年間リース料 (百万円)
当社	本店ほか	東京都千代田区 ほか	コンピューター関 連機器およびソフ トウェアほか	—	3,362

3【設備の新設、除却等の計画】

当連結会計年度末において計画中である重要な設備の新設、除却等は、次のとおりであります。

(1) 新設、改修計画等

会社名	店舗名 その他	所在地	設備の内容	投資予定額 (百万円)		資金調達 方法	着手年月	完了予定 年月
				総額	既支払額			
当社	本社ほか	東京都千代田区ほか	アライア ンス関連 システム インフラ 構築	2,380	4	自己資金	平成22年1月	平成22年9月
当社	本社ほか	東京都千代田区ほか	新会計シ ステム構 築	1,650	0	自己資金	平成22年1月	平成23年8月
当社	本社ほか	東京都千代田区ほか	持株会管 理システ ム	1,600	514	自己資金	平成20年2月	平成23年9月
当社	寮・その他 施設	東京都文 京区	バックア ップサイ トおよび 独身寮	1,195	8	自己資金	平成23年1月	平成23年9月
当社	本社ほか	東京都渋谷区	本社オフ イス一部 移転	1,180	—	自己資金	平成22年5月	平成22年9月
三菱UF Jセキュ リティー ズインタ ーナショ ナル	本社	英国ロン ドン市	本社オフ イス移転	3,663	72	自己資金	平成21年5月	平成23年1月

(注) 上記設備計画の記載金額については、消費税および地方消費税を含んでおりません。

(2) 除却、売却計画等

重要な設備の除却、売却等の計画はありません。

第4【提出会社の状況】

1【株式等の状況】

(1)【株式の総数等】

①【株式の総数】

種 類	発行可能株式総数 (株)
普 通 株 式	1,800,000,000
計	1,800,000,000

②【発行済株式】

種 類	事業年度末現在発行数(株) (平成22年3月31日現在)	提出日現在発行数 (株) (平成22年6月28日現在)	上場金融商品取引所 名または登録認可金 融商品取引業協会名	内 容
普通株式	716,985,496	716,985,496	—	単元株式数1,000株
計	716,985,496	716,985,496	—	—

(2)【新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

(3)【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

(4)【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

(5)【発行済株式総数、資本金等の推移】

年 月 日	発行済株式 総数増減数 (株)	発行済株式 総数残高(株)	資本金増減額 (千円)	資本金残高 (千円)	資本準備金 増 減 額 (千円)	資本準備金 残高(千円)
平成17年10月1日 (注) 1	253,362,097	726,023,292	—	65,518,843	188,395,484	416,944,245
平成19年9月28日 (注) 2	△9,037,796	716,985,496	—	65,518,843	—	416,944,245

(注) 1. UFJつばさ証券株式会社との合併(合併比率 1:0.42)に伴うものであります。

2. 自己株式の消却による減少であります。

(6)【所有者別状況】

平成22年3月31日現在

区 分	株式の状況（１単元の株式数 1,000株）							単元未満株 式 の 状 況 (株)	
	政府および 地方公共団 体	金融機関	金融商品取 引業者	その他の 法 人	外国法人等		個人その他		計
					個人以外	個人			
株主数（人）		－	－	1	－	－	－	1	－
所有株式数 （単元）		－	－	716,985	－	－	－	716,985	496
所有株式数の 割合（％）		－	－	100.00	－	－	－	100.00	－

(7) 【大株主の状況】

平成22年3月31日現在

氏名または名称	住 所	所有株式数 (千株)	発行済株式総数に 対する所有株式数 の割合 (%)
株式会社三菱UFJ フィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内2-7-1	716,985	100.00
計	—	716,985	100.00

(8) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

平成22年3月31日現在

区 分	株式数 (株)	議決権の数 (個)	内 容
無議決権株式	—	—	—
議決権制限株式 (自己株式等)	—	—	—
議決権制限株式 (その他)	—	—	—
完全議決権株式 (自己株式等)	—	—	—
完全議決権株式 (その他)	普通株式 716,985,000	716,985	—
単元未満株式	普通株式 496	—	1 単元 (1,000株) 未満の株式
発行済株式総数	716,985,496	—	—
総株主の議決権	—	716,985	—

② 【自己株式等】

平成22年3月31日現在

所有者の氏名または名称	所有者の住所	自己名義所有 株式数 (株)	他人名義所有 株式数 (株)	所有株式数の 合計 (株)	発行済株式総数 に対する所有株 式数の割合 (%)
—	—	—	—	—	—
計	—	—	—	—	—

(9) 【ストックオプション制度の内容】

該当事項はありません。

2 【自己株式の取得等の状況】

【株式の種類等】 該当事項はありません。

(1) 【株主総会決議による取得の状況】

該当事項はありません。

(2) 【取締役会決議による取得の状況】

該当事項はありません。

(3) 【株主総会決議又は取締役会決議に基づかないものの内容】

該当事項はありません。

(4) 【取得自己株式の処理状況及び保有状況】

該当事項はありません。

3 【配当政策】

当社は、利益配分にあたり、市況変動に備えた収益基盤の強化ならびに将来の事業展開のための内部留保の充実に努めるとともに、適正な利益還元を継続的にを行うことを基本方針としております。当社は、経営基盤をより強固なものにしていくため、株主資本の有効活用に努め、株主価値最大化を目指してまいります。

毎事業年度における配当の回数については、株主への利益配分の機会を増やすため、中間配当および期末配当の年2回を基本的な方針としております。これらの配当の決定機関は、中間配当は取締役会、期末配当は株主総会であります。

当事業年度の配当については、上記方針に基づき中間配当を1株当たり9.98円、期末配当を1株当たり10.22円といたしました。

内部留保資金については、市況変動に備えた収益基盤の強化ならびに将来の事業展開のための自己資本の拡充に充てたいします。

なお、当社は会社法第454条第5項の規定に基づき、取締役会の決議により、毎年9月30日を基準日として中間配当を行うことができる旨を定款に定めております。

(注) 基準日が当事業年度に属する剰余金の配当は、以下のとおりであります。

決議年月日	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)
平成21年10月28日 取締役会決議	7,155	9.98
平成22年6月28日 定時株主総会決議	7,327	10.22

4 【株価の推移】

(1) 【最近5年間の事業年度別最高・最低株価】

回次	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期
決算年月	平成18年3月	平成19年3月	平成20年3月	平成21年3月	平成22年3月
最高(円)	1,930	1,918	1,447	—	—
最低(円)	840	1,235	1,005	—	—

(注) 1 最高・最低株価は東京証券取引所市場第一部におけるものであります。

2 当社株式は、当社と株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループとの株式交換により、平成19年9月25日付で上場廃止となったため、最終取引日である同年9月21日までの株価について記載しております。

(2) 【最近6月間の月別最高・最低株価】

該当事項はありません。

5 【役員の状況】

役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
取締役社長 (代表取締役)		秋 草 史 幸	昭和24年10月9日生	昭和47年4月 株式会社三菱銀行入行 平成12年6月 株式会社東京三菱銀行取締役営業審査部長 平成13年6月 同執行役員営業審査部長 平成15年5月 同常務執行役員融資部・審査第一部・審査第二部担当 平成16年5月 同常務執行役員投資銀行・資産運用部門長兼ストラクチャードファイナンス本部長兼金融商品開発本部長兼市場金融本部長兼市場金融部長 株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ常務執行役員 平成16年6月 株式会社東京三菱銀行常務取締役投資銀行・資産運用部門長兼ストラクチャードファイナンス本部長兼金融商品開発本部長兼シンジケーション本部長 平成17年6月 三菱証券株式会社専務取締役コーポレートセンター、リサーチ本部統括 平成17年10月 三菱ＵＦＪ証券株式会社取締役専務執行役員市場商品本部長 平成18年6月 同取締役副社長営業本部、市場商品本部、企画本部、事務・システム本部管掌、リスク統括部、引受審査部統括、地区担当役員共同統括兼リサーチグループ担当 株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ取締役（現任） 平成19年6月 三菱ＵＦＪ証券株式会社取締役副社長営業本部、市場商品本部、企画本部、事務・システム本部管掌、公共法人部、金融法人第一部・第二部、金融法人統括室、リサーチグループ、リスク管理グループ統括、地区担当役員共同統括兼リサーチグループ長 平成20年6月 同取締役社長 平成21年4月 同取締役社長兼最高経営責任者 平成21年12月 三菱ＵＦＪ証券分割準備株式会社取締役社長兼最高経営責任者 平成22年4月 当社取締役社長兼最高経営責任者（現任） 平成22年5月 三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社取締役社長兼最高経営責任者（現任） 〔他の法人等の代表状況〕 三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社取締役社長	(注)3	—

役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
取締役副社長 (代表取締役)		田 中 努	昭和24年 8 月31日生	昭和47年 4 月 株式会社三菱銀行入行 平成12年 6 月 株式会社東京三菱銀行取締役財務開発部長 平成13年 6 月 同執行役員財務開発部長 平成14年 9 月 三菱証券株式会社常務執行役員財務開発本部長兼財務開発第二部担当、財務開発第一部長 平成15年 6 月 同常務取締役リテール営業本部、法人営業本部、投資信託部統括、営業企画部副統括 平成17年 6 月 同常務取締役営業本部、投資信託部、地区担当役員統括、海外業務特命担当 平成17年 8 月 同常務取締役営業本部、投資信託部、地区担当役員統括兼国際業務部、海外業務特命担当 平成17年10月 三菱UFJ証券株式会社取締役専務執行役員地区担当役員統括兼国際業務部、海外業務特命担当 平成18年 2 月 同取締役専務執行役員地区担当役員統括兼投資顧問部、国際業務部、海外業務特命担当 平成18年 6 月 同専務取締役投資銀行本部、国際本部管掌、地区担当役員共同統括兼投資顧問部、クリーン・エネルギー・ファイナンス室担当、クリーン・エネルギー・ファイナンス室長 平成19年 6 月 同専務取締役投資銀行本部、国際本部管掌、投資顧問部、クリーン・エネルギー・ファイナンス室統括、地区担当役員共同統括兼国際本部長 平成19年10月 同専務取締役投資銀行本部、国際本部管掌、投資顧問部、クリーン・エネルギー・ファイナンス室統括、地区担当役員共同統括兼共同国際本部長 平成20年 6 月 同取締役副社長 平成21年12月 三菱UFJ証券分割準備株式会社取締役副社長 平成22年 4 月 当社取締役副社長（現任） 平成22年 5 月 モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社取締役（現任）	(注)3	—

役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
取締役副社長 (代表取締役)		竹 内 和 男	昭和25年 8 月15日生	昭和48年 4 月 株式会社東海銀行入行 平成11年 4 月 同執行役員企画部長 平成11年 6 月 同取締役企画部長 平成12年 4 月 同取締役戦略事業部長 平成12年10月 同取締役 平成13年 1 月 同取締役戦略事業部担当 平成13年 4 月 株式会社U F J ホールディングス執行役員統合推進部長 平成14年 1 月 株式会社U F J 銀行常務執行役員名古屋法人営業第 1 部～第 5 部担当 平成16年 9 月 同常務執行役員名古屋法人営業第 1 部～第 4 部担当、法人カンパニー長補佐（中部地区担当） 平成17年 6 月 U F J つばさ証券株式会社専務執行役員名古屋駐在 平成17年10月 三菱U F J 証券株式会社常務執行役員中部地区担当名古屋駐在 平成18年 6 月 同常務執行役員名古屋支店長 平成20年 4 月 同常務執行役員名古屋支店長兼名古屋支店プライベートバンキング部長 平成20年 6 月 同専務取締役企画管理本部長 株式会社三菱U F J フィナンシャル・グループ取締役（現任） 平成21年 6 月 カブドットコム証券株式会社取締役 平成21年12月 三菱U F J 証券分割準備株式会社専務取締役 平成22年 4 月 当社専務取締役経営企画部、財務企画部統括 平成22年 5 月 同取締役副社長（現任） 三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社専務取締役内部監査部統括（現任）	(注)3	—
取締役副社長		神 谷 明	昭和28年 9 月16日生	昭和52年 4 月 株式会社三菱銀行入行 平成17年 6 月 株式会社東京三菱銀行執行役員グローバル企画室長 株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ執行役員法人業務企画部部長（特命担当） 平成17年10月 同執行役員国際企画部長 平成18年 1 月 株式会社三菱東京U F J 銀行執行役員国際企画部長 平成20年 4 月 同常務執行役員国際部門副部門長 平成20年10月 株式会社三菱U F J フィナンシャル・グループ常務執行役員法人連結事業本部副本部長 平成22年 4 月 当社取締役副社長（現任） 株式会社三菱U F J フィナンシャル・グループ常務執行役員（現任） 平成22年 5 月 三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社取締役（現任）	(注)3	—

役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
常務取締役	リスク統括 部、業務管理 統括部統括	矢 野 文 規 (注)7	昭和29年6月9日生	昭和52年4月 株式会社東京銀行入行 平成8年4月 Tokyo-Mitsubishi International plc副社長 平成12年7月 東京三菱証券株式会社リスク管理部 長 平成14年9月 三菱証券株式会社執行役員リスク管 理部、引受審査部担当 平成17年10月 三菱ＵＦＪ証券株式会社執行役員リ スク統括部長 平成18年6月 同執行役員リスク統括部、引受審査 部担当兼リスク統括部長 平成19年6月 同執行役員リスク管理グループ長 平成20年6月 同執行役員企画管理本部副本部長 (リスク・法務担当) 平成21年1月 同常務執行役員企画管理本部副本部 長 (リスク・法務担当) 平成21年6月 同常務取締役企画管理本部副本部長 (リスク・法務担当) 平成21年9月 同常務取締役リスク管理本部長 平成21年10月 同常務取締役リスク管理本部長兼共 同リサーチ本部長 平成22年4月 当社常務取締役リスク統括部、業務 管理統括部統括 (現任) 株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャ ル・グループ常務執行役員 (現任) 平成22年5月 モルガン・スタンレーMUFG証券 株式会社取締役 (現任)	(注)3	—
取締役		渡 辺 捷 昭 (注)1	昭和17年2月13日生	昭和39年4月 トヨタ自動車工業株式会社入社 平成4年9月 トヨタ自動車株式会社取締役 平成9年6月 同常務取締役 平成11年6月 同専務取締役 平成13年6月 同取締役副社長 平成14年9月 三菱証券株式会社取締役 平成17年6月 トヨタ自動車株式会社取締役社長 平成17年10月 三菱ＵＦＪ証券株式会社取締役 平成21年6月 トヨタ自動車株式会社取締役副会長 (現任) 平成22年4月 当社取締役 (現任) 〔他の法人等の代表状況〕 トヨタ自動車株式会社取締役副会長	(注)3	—
取締役		宮 戸 直 輝 (注)1	昭和18年5月20日生	昭和42年4月 大同生命保険相互会社入社 平成6年7月 同取締役 平成8年3月 同常務取締役 平成11年3月 同専務取締役 平成11年7月 同代表取締役社長 平成14年4月 大同生命保険株式会社代表取締役社 長 平成16年4月 同取締役 株式会社T&Dホールディングス代 表取締役社長 (現任) 平成17年10月 三菱ＵＦＪ証券株式会社取締役 平成20年4月 太陽生命保険株式会社取締役 平成22年4月 当社取締役 (現任) 〔他の法人等の代表状況〕 株式会社T&Dホールディングス代表取締役社長	(注)3	—

役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
取締役		長谷川 理雄 (注)1	昭和30年4月20日生	昭和54年4月 株式会社東京銀行入行 平成16年4月 株式会社東京三菱銀行資産運用業務部長 株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ受託業務企画部付部長 平成17年5月 オランダ東京三菱銀行頭取 平成18年1月 オランダ三菱東京U F J 銀行頭取 平成20年4月 株式会社三菱東京U F J 銀行執行役員オランダ三菱東京U F J 銀行頭取 平成20年5月 同執行役員総合リスク管理部長 株式会社三菱U F J フィナンシャル・グループ執行役員リスク統括部長 平成22年5月 同常務執行役員リスク管理担当（現任） 平成22年6月 カブドットコム証券株式会社取締役（現任） 当社取締役（現任）	(注)3	—
常勤監査役		畠 中 博 巳	昭和27年3月2日生	昭和49年4月 野村證券株式会社入社 平成10年6月 国際証券株式会社執行役員コーポレート・ファイナンス部、名古屋コーポレート・ファイナンス部、大阪コーポレート・ファイナンス部、資本市場部、国際金融部担当 平成13年4月 同常務執行役員エクイティシンジケート部、エクイティ営業部、エクイティトレーディング部、エクイティ部、エクイティ調査部担当 平成13年6月 同常務取締役 平成13年10月 同常務取締役エクイティシンジケート部、エクイティ営業部、エクイティトレーディング部、エクイティ部、国際リサーチセンター担当 平成14年9月 三菱証券株式会社常務執行役員リテール営業本部長 平成15年6月 同常務執行役員内部管理統括部、(北海道・東北、関東第一～第五、東海・北陸、大阪、近畿、中国・四国、九州)内部管理室、ホールセール内部管理室、売買審査部、お客様相談室担当兼内部管理統括補助責任者 平成16年6月 同常務執行役員内部管理統括部、(東東京、西東京、東部、中部、近畿、西部)内部管理室、ホールセール内部管理室、売買審査部、お客様相談室、監査部、検査部担当兼内部管理統括補助責任者 平成17年6月 同常務取締役兼内部管理統括責任者 平成17年10月 三菱U F J 証券株式会社取締役常務執行役員コンプライアンスグループ長兼内部管理統括責任者 平成18年6月 同取締役常務執行役員コンプライアンス本部長兼内部管理統括責任者 同監査役 平成21年12月 三菱U F J 証券分割準備株式会社監査役 平成22年4月 当社常勤監査役（現任） 平成22年5月 三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社監査役（現任）	(注)4	—

役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
監査役		鈴木 崇正	昭和28年12月25日生	昭和51年4月 株式会社三和銀行入行 平成16年4月 U F J つばさ証券株式会社執行役員 エクイティ市場グループ長 平成16年7月 同執行役員エクイティ市場グループ 長兼エクイティソリューション部長 平成16年8月 同常務執行役員市場商品本部副本部 長兼金融市場グループ長兼エクイテ ィ市場グループ長兼エクイティソリ ューション部長 平成16年12月 同常務執行役員市場商品本部副本部 長兼金融市場グループ長兼エクイテ ィ市場グループ長 平成17年6月 同常務執行役員市場商品本部長兼金 融市場グループ長兼エクイティ市場 グループ長 平成17年10月 三菱U F J 証券株式会社常務執行役 員市場商品本部副本部長兼エクイテ ィグループ長 平成20年6月 同常務執行役員共同国際本部長 平成21年1月 同常務執行役員企画管理本部副本部 長（特命担当） 平成21年6月 同監査役 平成21年12月 三菱U F J 証券分割準備株式会社監 査役 平成22年4月 当社監査役（現任） 平成22年5月 三菱U F J モルガン・スタンレー証 券株式会社常勤監査役（現任）	(注)5	－
監査役		中 村 裕 一 (注)2	昭和29年12月21日生	昭和52年4月 三菱信託銀行株式会社入社 平成17年6月 同執行役員プライベートバンキング 営業部長 平成17年10月 三菱U F J 信託銀行株式会社ブライ ベートバンキング営業部長 平成21年6月 エム・ユートラスト・アップルブラ ンニング株式会社専務取締役 三菱U F J 信託銀行株式会社業務顧 問 三菱アルミニウム株式会社監査役 （現任） 株式会社寺岡製作所監査役（現任） 平成22年6月 三菱U F J モルガン・スタンレー証 券株式会社常勤監査役（現任） 当社監査役（現任）	(注)4	－
監査役		小 林 重 康 (注)2	昭和29年8月16日生	昭和54年4月 株式会社東京銀行入行 平成17年6月 株式会社東京三菱銀行執行役員 証券 投資部長 平成18年1月 株式会社三菱東京U F J 銀行執行役 員投資運用部長 平成19年5月 同執行役員外貨資金証券部長 平成20年5月 同執行役員コンプライアンス統括部 長 平成22年6月 三菱U F J モルガン・スタンレー証 券株式会社常勤監査役（現任） 当社監査役（現任）	(注)4	－

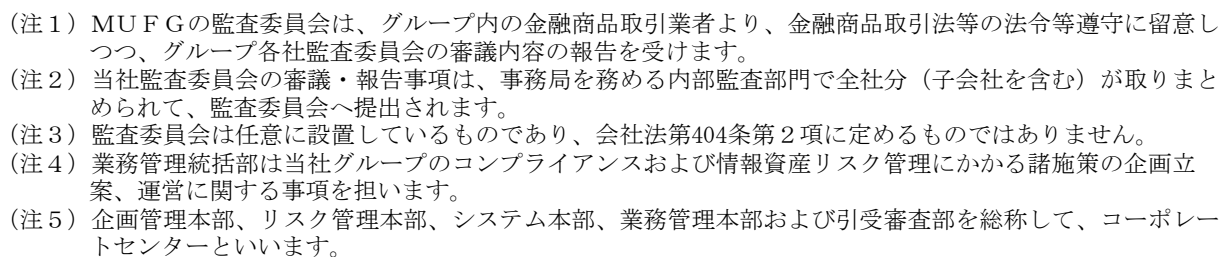
役 名	職 名	氏 名	生年月日	略 歴	任期	所 有 株式数 (千株)
監査役		江 尻 隆 (注)2	昭和17年5月16日生	昭和44年4月 東京弁護士会登録 孫田・高梨法律事務所入所 昭和44年9月 ハーバード大学ロー・スクール修士 課程入学（～昭和45年6月） 昭和45年7月 デューン・モリス・ヘックシャー法 律事務所入所 昭和46年1月 アンダーソン・マーチン法律事務所 入所 昭和46年2月 アンダーソン・毛利法律事務所入所 昭和52年11月 梶田江尻法律事務所設立（現西村あ さひ法律事務所）（現任） 平成16年6月 安藤建設株式会社監査役（現任） 平成18年6月 カゴメ株式会社監査役（現任） 平成22年5月 当社監査役（現任） 三菱UFJモルガン・スタンレー証券 株式会社監査役（現任） ディップ株式会社監査役（現任）	(注)6	—
計						—

- (注) 1. 取締役の渡辺捷昭、宮戸直輝および長谷川理雄は、会社法第2条第15号に定める社外取締役であります。
2. 監査役の中村裕一、小林重康および江尻隆は、会社法第2条第16号に定める社外監査役であります。
3. 平成22年6月28日開催の定時株主総会の終結の時から、1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時まで。
4. 平成22年6月28日開催の定時株主総会の終結の時から、4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時まで。
5. 平成21年6月25日開催の定時株主総会の終結の時から、4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時まで。
6. 平成22年5月1日開催の臨時株主総会の終結の時から、4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時まで。
7. 当社は、経営と執行の役割の明確化により、迅速な意思決定と業務執行における監督機能の強化を図るため、執行役員制度を導入しております。上記取締役のうち矢野文規は常務執行役員を兼務しております。

(1) 【コーポレート・ガバナンスの状況】

当社は、取締役8名のうち、3名を社外取締役（MUFGグループ外の現役経営者を含む）とすることにより、取締役会の活性化を図るとともに経営の透明性を高め、また、監査役会を設置し、監査役5名（うち社外監査役3名）が取締役の職務執行について監査しております。

監査委員会の構成員は、社外取締役2名、外部専門家2名および内部監査部門の担当役員ですが、MUF Gグループ外からの委員を半数以上とすることを要することとし、監査委員会委員長はMUF Gグループ外からの委員より選任することとしております。また、経営会議傘下に当社の重要事項を審議、および調査研究を組織横断的に実施する諮問機関として各種の委員会を設置しております。



- 44 -

当社は監査役および監査役会設置会社であります。監査役監査につきましては、各監査役は監査役会が定めた監査の方針、業務の分担等に従い、取締役会その他重要な会議に出席する他、取締役等からその業務の執行状況を聴取し、重要な決裁書類等を閲覧し、本社および各営業部店の業務および財産の状況を調査し、必要に応じて子会社から事業の報告を求めています。また、計算書類および附属明細書につき検討を加えるにあたり、会計監査人から報告および説明を受けているほか、定期的に会計監査人と情報交換を行い密接な連携を保つよう努めています。さらに、内部監査部門（104名、ただし三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社内部監査部門との兼務者を含む）から定期的に監査の状況および結果の説明を受け、内部監査部門と緊密な連携を保ち、効率的な監査を実施するよう努めています。なお、これらの監査役業務をサポートするため、専属のスタッフ組織として監査役室を設置しております。

なお、当社の社外取締役につきましては、渡辺捷昭氏はトヨタ自動車株式会社取締役副会長、宮戸直輝氏は株式会社T&Dホールディングス代表取締役社長、長谷川理雄氏はカブドットコム証券株式会社取締役および株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ常務執行役員であります。社外監査役につきましては、中村裕一氏は三菱アルミニウム株式会社監査役、株式会社寺岡製作所監査役および三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社常勤監査役、小林重康氏は三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社常勤監査役、江尻隆氏は安藤建設株式会社監査役、カゴメ株式会社監査役、ディップ株式会社監査役および三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社監査役を兼務しております。

(2) 内部統制システムおよびリスク管理体制の整備の状況

当社は、会社法第362条第4項第6号及び第5項並びに会社法施行規則第100条第1項及び同第3項の規定に基づき、当社の業務の適正を確保するための体制（内部統制システム）を以下のとおり整備しております。

① 法令等遵守体制

- a. 役職員の職務の執行が、法令及び定款に適合することを確保するため、役職員全員に共通した判断基準である「三菱UFJ証券ホールディングス行為規範」を定め、MUFGグループ共通の「グループ経営理念」、「倫理綱領」及び「行動規範」を採択し、当社のコンプライアンス基本方針と定める。
- b. 「グループ経営理念」、「倫理綱領」及び「行動規範」を踏まえて「お客さま本位の徹底」を実現するため社内規程の制定、管理・統括部署の設置、役職員への周知等を通じてお客さまへの説明やサポート体制、情報管理体制、利益相反管理体制等を整備する。
- c. 情報管理体制整備の一環として「個人情報保護方針」を策定し、個人情報適切に保護・管理される体制を整備する。
- d. 利益相反管理に関する基本方針として「利益相反管理方針」を策定し、お客さまの利益を不当に害することがないように、利益相反を管理する体制を整備する。
- e. 社内規程および「コンプライアンス・マニュアル」の整備を通じて、役職員が法令等を遵守するための体制を整備する。
- f. コンプライアンスを担当する役員を置くとともに、コンプライアンスに関する統括部署を設置する。
- g. コンプライアンス・プログラム（役職員を対象とする教育等、コンプライアンス体制を実効性あるものにするための組織的な取組み）を策定し、その進捗状況のフォローアップを実施する。
- h. コンプライアンス・ホットライン（広く社員等から不正行為に関する通報を社外を含む窓口で受け付ける内部通報制度）を設置する。

② 情報保存管理体制

- a. 取締役会及び経営会議等の会議の議事録のほか、取締役の職務執行にかかる重要な情報について、社内規程等の定めるところにより、保存・管理を行うものとする。
- b. 保存・管理されている情報について担当部署は、合理的な事情がある場合、いつでも閲覧または謄本に供することができる体制を整備する。

③ リスク管理体制

- a. 施策計画その他戦略目標に基づき、すべての主要なリスクを特定・計測・制御・継続監視するとともに、そのプロセスの有効性を監査を通じて検証することにより、リスクに見合った収益の安定的計上、適正な資本構成の達成、資源の適正配分等の基盤を提供し、株主価値の最大化に資することとする。
- b. リスクを次のように分類、定義したうえで社内規程においてリスク管理・運営の基本方針を定めるとともに個々のリスク管理及び運営体制においてはリスクの特定、計測、制御、継続監視の重要性を認識し、その把握と管理のための体制を整備する。
 - (a) 市場リスク
 - (b) 信用リスク
 - (c) 資金流動性リスク
 - (d) オペレーショナルリスク

- c. 取締役は、業務推進担当部署から独立した、リスク管理及び運営機能並びに内部監査機能を担う部署をそれぞれ設け、それぞれの機能遂行に必要な経営資源の配分を行うこととする。
 - d. 多岐に亘る当社グループの業務のリスクを可能な限り統一的な尺度で総合的に把握・運営を図るものとし、そのための体制を確立、維持、発展させ、リスク管理のベストプラクティスを目指すものとする。
 - e. 当社の連結対象子会社のリスク管理及び運営に際しては、当社グループにおけるリスク管理及び運営方針に則り業務実態に応じた態勢を目指すよう各社を指導するとともに、所在する各種リスクを把握・管理する態勢の整備に努めるものとする。
 - f. 危機事象の発生に対し、社内規程で定める以下の危機管理方針を遵守し危機事象の発生が業務に与える影響に基づき、危機事象に応じたレベルに区分し、各々のレベルに応じた危機管理体制の整備を行うものとする。
 - (a) 顧客、役職員及びその家族の生命に被害が及ぶ場合には、人命尊重を最優先とする。
 - (b) 正確に状況を把握し、当社に与える損失を極小化することに努める。
 - (c) 社会的責任を果たすための最低限必要な業務を早期に復旧し、継続することに努める。
- ④ 効率性確保のための体制
- a. 経営目標を定めるとともに経営計画を策定し、適切な手法に基づく経営管理を行う。
 - b. 取締役の職務執行の効率性を高めるために、取締役会の効率的な運営を図るとともに、経営会議を設置し、一定の事項の決定等を委任する。
 - c. 取締役会、経営会議の諮問機関として各種の委員会を設置し、取締役会、経営会議の協議・決議に資する事項の審議を組織横断的に行う。
 - d. 取締役会の決定に基づく職務の執行を効率的に行うため、社内規程に基づく業務分掌並びに職務権限、組織体制の整備を行い、職務執行を分担する。
- ⑤ グループ管理体制
- a. 当社グループにおける業務の適正を確保するため以下のような体制を整備する。
 - (a) 当社グループの経営目標の達成並びに業務の健全かつ適切な運営の確保とともに、子会社等を含めたグループ事業の発展を図るため、グループの連結戦略の策定・推進など、子会社等への指導・助言を含めた経営管理を行う。また、それに必要な体制を整備する。
 - (b) 子会社経営管理に関する基本方針を定める社内規程を制定する他、リスク管理、コンプライアンス、内部監査、財務報告に係る内部統制等の各社内規程において子会社管理に関する事項を定める。
 - b. MUFGグループ内企業との不適切な取引を防止し、当社グループの健全性を確保するため以下のような体制を整備する。
 - (a) MUFGグループ外の社外取締役を複数選任する。
 - (b) 社内規程の定めるところにより、内部監査及び法令遵守に関わる諸事項を審議する「監査委員会」の委員のうち半数以上をMUFGグループ外委員とし、委員長をグループ外取締役または外部専門家の中から取締役会が選任する。
- ⑥ 内部監査体制
- a. リスク管理、内部統制及びガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価する機能を担う高い専門性と独立性を備えた内部監査体制を構築し、当社及び当社グループの業務の健全性及び適切性を確保する。
 - b. 当社及び当社グループの内部監査の基本事項を定めた社内規程を制定する。
 - c. 取締役会の委嘱を受け、当社及び当社グループの内部監査及び法令遵守等に関わる諸事項を審議する「監査委員会」を、内部監査担当部署として内部監査部を設置する。
 - d. 内部監査担当部署の長は、監査役及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、内部監査の実効的な実施に努める。
- ⑦ 監査役の職務を補助する使用人に関する体制
- a. 監査役の職務を補助する組織の設置、使用人の配置については、監査役会の意向を尊重する。
 - b. 監査役の職務を補助し、かつ監査役会の運営事務に関する職務を行う組織として監査役室を設置する。
- ⑧ 監査役の職務を補助する使用人の独立性
- 監査役室の人事に関する事項等、監査役の補助者の独立性に関する事項は、監査役及び監査役会の意向を尊重する。

⑨ 監査役への報告体制

役職員等は社内規程の定めるところにより下記の事項を監査役に報告しなければならない。

- a. 取締役会及び経営会議で決議された事項
- b. 会社に著しい損害を及ぼすおそれのある事項
- c. 内部監査の実施状況及びその結果
- d. 定款及び重大な法令違反等
- e. コンプライアンス・ホットラインの通報状況及び事案内容
- f. その他監査役が報告を求める事項

⑩ その他監査役による監査の実効性確保のための体制

- a. 監査役による監査の実効性を確保するため、監査役会規則及び監査役監査基準に定めのある事項についてはその意向を尊重する。
- b. 監査役は、取締役会のほか、重要な意思決定の過程及び業務の執行状況を把握するため、経営会議その他の重要な委員会等に出席できる。
- c. 監査役は、監査の実効性をあげるため何時でも重要な役職員から業務の報告を求め、調査することができる。
- d. 監査役による監査の実効性を確保するため、監査役は代表取締役、内部監査部門と適時及び定期的に意見交換できる。
- e. 監査役による監査の実効性を確保するための基本事項を定めた社内規程を制定する。

(3) 会計監査の状況

業務を執行した公認会計士の氏名等	所属する監査法人名	継続監査年数
指定有限責任社員 業務執行社員 川本修司	有限責任監査法人トーマツ	－（注）
指定有限責任社員 業務執行社員 墨岡俊治	有限責任監査法人トーマツ	－（注）
指定有限責任社員 業務執行社員 青木裕晃	有限責任監査法人トーマツ	－（注）

（注） 7年以内であるため記載を省略しております。

監査業務に係る補助者	人数
公認会計士	12名
会計士補等	24名
その他	21名
合計	57名

内部監査、監査役監査および会計監査の相互連携につきましては、内部監査、監査役監査ともに、定期的に会計監査人と情報交換を行い密接な連携を保つよう努めております。

(4) 役員報酬の内容

① 役員報酬の内容

	報酬等の総額	報酬等の種類別の総額（百万円）				対象となる役員の員数（人）
		年額報酬額	ストックオプションとしての新株予約権に関する報酬	役員賞与	退職慰労金	
社内取締役	470	185	76	168	41	11
社外取締役	44	33	11	－	－	4
社内監査役	89	44	17	－	28	3
社外監査役	73	52	21	－	－	3

② 役員の報酬等の額またはその算定方法に係る決定に関する方針等

当社では、役員の報酬等の額またはその算定方法に係る決定に関する方針は定めておりませんが、役員報酬体系の内容は以下の通りです。

- a. 当社の取締役の報酬等は、株主総会において、年額報酬、ストックオプションとしての新株予約権に関する報酬等および役員賞与のそれぞれの総額を決定し、その範囲内において、M U F G の指名・報酬委員会の審議内容を踏まえて、取締役会が個人別の報酬等の額を決定することとしております。
- (a) 当社の取締役が受ける報酬等は、年額報酬、ストックオプションとしての新株予約権に関する報酬等および役員賞与の3種類に分けて支払うこととしております。
- (b) 年額報酬は、固定報酬として、役位毎に業務執行の状況・貢献度等に応じて支払うこととしております。年額報酬は、毎月現金で支払っております。
- (c) スtockオプションとしての新株予約権に関する報酬等は、三菱U F J フィナンシャル・グループ株価の上昇および長期的な業績向上への貢献意欲を高めることを目的とし、役位毎に業務執行の状況・貢献度等に応じて支払うこととしております。また、ストックオプションとしての新株予約権に関する報酬等は、株式会社三菱U F J フィナンシャル・グループが発行する新株予約権を年に1回付与することで支払い、その新株予約権は取締役の地位を喪失した日の翌日以降権利行使できる制度となっております。
- (d) 役員賞与は、業績向上への貢献意欲を高めることを目的とし、業績連動報酬として、業績および取締役個人の職務遂行状況に応じて支払うこととしております。
- (e) なお、親会社であるM U F G において、M U F G の社外取締役等を構成員とする指名・報酬委員会が設けられており、M U F G および当社等の役員の報酬等に関する制度の設置・改廃ならびに当該各社の会長、副会長、社長および頭取の報酬等を審議しております。
- b. 当社監査役の報酬等は、株主総会において、年額報酬、ストックオプションとしての新株予約権に関する報酬等のそれぞれの総額を決定し、その範囲内において、監査役の協議により個人別の報酬等の額を決定することとしております。

(5) 責任限定契約の内容

当社は、現行定款において、社外取締役および常勤の監査役以外の社外監査役の責任限定契約に関する規定を設けております。当該定款に基づき当社が社外取締役および常勤の監査役以外の社外監査役の全員と締結している責任限定契約の内容は次のとおりであります。

(責任限定契約の概要)

① 社外取締役の責任限定契約

社外取締役は、本契約締結後、会社法第423条第1項の責任について、その職務を行うにつき善意でありかつ重大な過失がなかったときは、金1千万円または会社法第425条第1項に定める最低責任限度額のいずれか高い額を限度として損害賠償責任を負担するものとする。

② 社外監査役の責任限定契約

社外監査役は、本契約締結後、会社法第423条第1項の責任について、その職務を行うにつき善意でありかつ重大な過失がなかったときは、金1千万円または会社法第425条第1項に定める最低責任限度額のいずれか高い額を限度として損害賠償責任を負担するものとする。

(6) 定款で取締役の定数または取締役の資格制限について定め、また、取締役の選解任の決議要件につき、会社法と異なる別段の定めをした場合の内容

当社の定款には、取締役の定数および選任決議について、以下のとおり定めております。なお、解任決議につきましては別段の定めはございません。

(取締役の員数および選任)

第15条 当会社の取締役は15名以内とし、株主総会において選任する。

2. 前項の選任決議には、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主の出席を要する。
3. 取締役の選任決議は、累積投票によらないものとする。

(7) 剰余金の配当の決定機関

当社は、株主への利益配分の機会を増やすため、会社法第454条第5項の規定により、毎年9月30日を基準日として、取締役会の決議により中間配当を行うことができます。

(2) 【監査報酬の内容等】

① 【監査公認会計士等に対する報酬の内容】

区分	前連結会計年度		当連結会計年度	
	監査証明業務に基づく報酬（百万円）	非監査業務に基づく報酬（百万円）	監査証明業務に基づく報酬（百万円）	非監査業務に基づく報酬（百万円）
提出会社	424	32	478	28
連結子会社	26	9	20	8
計	451	42	499	37

② 【その他重要な報酬の内容】

（前連結会計年度）

該当事項はありません。

（当連結会計年度）

該当事項はありません。

③ 【監査公認会計士等の提出会社に対する非監査業務の内容】

（前連結会計年度）

当社が監査公認会計士等に対して報酬を支払っている非監査業務の内容としましては、「顧客資産の分別管理に対する検証業務」、「内部管理モデルの外部監査」等があります。

（当連結会計年度）

当社が監査公認会計士等に対して報酬を支払っている非監査業務の内容としましては、「顧客資産の分別管理に対する検証業務」、「内部管理モデルの外部監査」等があります。

④ 【監査報酬の決定方針】

（前連結会計年度）

該当事項はありません。

（当連結会計年度）

監査報酬については、会計監査人より監査の体制・手続き・日程等の監査計画、監査見積時間等の提示を受け、その妥当性を検証の上、監査役会の同意を得て決定しております。

7 【業務の状況】

(1) 受入手数料の内訳

期 別	区 分	株券 (百万円)	債券 (百万円)	受益証券 (百万円)	その他 (百万円)	計 (百万円)
第4期 (自 平成20年4月 至 平成21年3月)	委託手数料	28,120	81	205	—	28,407
	引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	6,893	6,253	—	—	13,146
	募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	—	490	17,930	—	18,420
	その他の受入手数料	530	610	17,612	13,035	31,789
	計	35,544	7,436	35,748	13,035	91,764
第5期 (自 平成21年4月 至 平成22年3月)	委託手数料	25,195	105	140	—	25,441
	引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	19,897	5,145	—	—	25,042
	募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	—	194	26,468	—	26,663
	その他の受入手数料	1,888	925	15,906	13,475	32,195
	計	46,980	6,370	42,515	13,475	109,342

(2) トレーディング損益の内訳

区 分	第4期 (自 平成20年4月 至 平成21年3月)			第5期 (自 平成21年4月 至 平成22年3月)		
	実現損益 (百万円)	評価損益 (百万円)	計 (百万円)	実現損益 (百万円)	評価損益 (百万円)	計 (百万円)
株券等トレーディング損益	△22,641	16,611	△6,030	32,837	△21,570	11,267
債券等トレーディング損益	24,183	79,208	103,391	99,892	△17,742	82,149
その他のトレーディング損益	△37,035	△14,764	△51,799	9,176	△23,674	△14,497
計	△35,493	81,055	45,561	141,906	△62,987	78,918

(3) 自己資本規制比率

区 分		第 4 期末 (平成21年 3 月31日現在) (百万円)	第 5 期末 (平成22年 3 月31日現在) (百万円)
基本的項目 (A)		619,807	616,333
補完的項目	その他有価証券評価差額金 (評価益)等	684	2,985
	金融商品取引責任準備金等	1,864	1,861
	一般貸倒引当金	71	187
	短期劣後債務	228,300	228,300
計 (B)		230,919	233,334
控除資産 (C)		347,903	343,974
固定化されていない自己資本 (A) + (B) - (C) (D)		502,823	505,693
リスク相当額	市場リスク相当額	63,375	75,871
	取引先リスク相当額	25,153	25,168
	基礎的リスク相当額	53,603	46,405
	計 (E)	142,131	147,445
自己資本規制比率 (%) (D) / (E) × 100		353.7	342.9

(注) 上記は金融商品取引法の規定に基づき、それぞれ決算数値をもとに算出したものであります。

なお、当期の市場リスク相当額の月末平均額は73,169百万円、月末最大額は82,708百万円、取引先リスク相当額の月末平均額は25,942百万円、月末最大額は28,630百万円であります。

(4) 有価証券の売買等業務

① 有価証券の売買の状況（証券先物取引等を除く）

最近 2 事業年度における有価証券の売買の状況（証券先物取引等を除く）は、次のとおりであります。

イ. 株券

区 分	受託 (百万円)	自己 (百万円)	合計 (百万円)
第 4 期 (自 平成20年 4 月 至 平成21年 3 月)	15,450,390	10,911,959	26,362,349
第 5 期 (自 平成21年 4 月 至 平成22年 3 月)	11,116,722	8,536,217	19,652,940

ロ. 債券

区 分	受託（百万円）	自己（百万円）	合計（百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	25,460	578,901,039	578,926,500
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	69,985	533,582,086	533,652,072

ハ. 受益証券

区 分	受託（百万円）	自己（百万円）	合計（百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	692,496	1,674,032	2,366,529
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	535,054	1,146,250	1,681,304

ニ. その他

区 分	新株引受権証書（新株予約権証券を含む） （百万円）	外国新株予約権証券 （百万円）	コマーシャル・ペーパー （百万円）	外国証書 （百万円）	その他 （百万円）	合計 （百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	—	—	—	—	—	—
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	—	—	—	—	—	—

（受託取引の状況）上記のうち、受託取引の状況は次のとおりであります。

区 分	新株引受権証書（新株予約権証券を含む） （百万円）	外国新株予約権証券 （百万円）	コマーシャル・ペーパー （百万円）	外国証書 （百万円）	その他 （百万円）	合計 （百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	—	—	—	—	—	—
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	—	—	—	—	—	—

② 証券先物取引等の状況

最近２事業年度における証券先物取引等の状況は次のとおりであります。

イ. 株式に係る取引

区 分	先物取引		オプション取引		合計（百万円）
	受託（百万円）	自己（百万円）	受託（百万円）	自己（百万円）	
第４期 （自 平成20年４月 至 平成21年３月）	4,461,966	21,537,334	388,467	2,039,977	28,427,746
第５期 （自 平成21年４月 至 平成22年３月）	2,288,966	18,239,710	695,904	3,414,080	24,638,661

ロ. 債券に係る取引

区 分	先物取引		オプション取引		合計（百万円）
	受託（百万円）	自己（百万円）	受託（百万円）	自己（百万円）	
第４期 （自 平成20年４月 至 平成21年３月）	2,351,394	92,188,572	1,180,801	25,818,808	121,539,575
第５期 （自 平成21年４月 至 平成22年３月）	904,075	89,972,923	966,762	41,191,371	133,035,131

- (5) 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

最近２事業年度における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は次のとおりであります。

① 株券

区 分	引受高 （百万円）	売出高 （百万円）	特定投資 家向け売 付け勧誘 等の総額 （百万円）	募集の 取扱高 （百万円）	売出しの 取扱高 （百万円）	私募の 取扱高 （百万円）	特定投資 家向け売 付け勧誘 等の取扱 高 （百万円）
第４期 （自 平成20年４月 至 平成21年３月）	451,584	19,357	—	59,536	64,455	392,013	—
第５期 （自 平成21年４月 至 平成22年３月）	780,583	239,768	—	215,894	826	392,609	—

② 債券

期 別	種 類	引受高 (百万円)	売出高 (百万円)	特定投資 家向け売 付け勧誘 等の総額 (百万円)	募集の 取扱高 (百万円)	売出しの 取扱高 (百万円)	私募の 取扱高 (百万円)	特定投資 家向け売 付け勧誘 等の取扱 高 (百万円)
第 4 期 (自 平成20年 4 月 至 平成21年 3 月)	国債	—	—	—	115,607	—	—	—
	地方債	655,211	—	—	12,881	—	—	—
	特殊債	1,343,070	—	—	44,333	—	—	—
	社債	3,148,515	—	—	604,728	—	17,446	—
	外国債券	145,700	302,363	—	5,400	—	—	—
	合 計	5,292,496	302,363	—	782,950	—	17,446	—
第 5 期 (自 平成21年 4 月 至 平成22年 3 月)	国債	—	—	—	55,764	—	—	—
	地方債	759,187	—	—	9,924	—	—	—
	特殊債	1,623,200	—	—	151,957	—	—	—
	社債	2,525,925	—	—	353,780	—	380	—
	外国債券	328,000	536,871	—	2,100	—	—	—
	合 計	5,236,312	536,871	—	573,526	—	380	—

③ 受益証券

期 別	種 類	募集の取扱高 (百万円)	売出しの取扱高 (百万円)	私募の取扱高 (百万円)	特定投資家向け 売付け勧誘等の 取扱高 (百万円)
第 4 期 (自 平成20年 4 月 至 平成21年 3 月)	株式投信	390,807	—	489,018	—
	公社債投信	2,449,641	—	21,764	—
	外国投信	608,951	—	8,061	—
	合 計	3,449,400	—	518,845	—
第 5 期 (自 平成21年 4 月 至 平成22年 3 月)	株式投信	903,653	—	152,330	—
	公社債投信	2,581,989	—	4,092	—
	外国投信	426,841	—	12,924	—
	合 計	3,912,484	—	169,346	—

④ その他

期 別	種 類	引受高 (百万円)	売出高 (百万円)	募集の取扱高 (百万円)	売出しの取扱 高 (百万円)	私募の取扱高 (百万円)
第4期 (自 平成20年4月 至 平成21年3月)	コマーシャル・ペーパー	—	—	—	—	—
	外国証券	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—
第5期 (自 平成21年4月 至 平成22年3月)	コマーシャル・ペーパー	—	—	—	—	—
	外国証券	—	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—	—

(6) その他業務

最近2事業年度におけるその他業務の状況は、次のとおりであります。

① 保護預り業務

期 別	区 分	国内有価証券 (百万円)	外国有価証券 (百万円)
第4期末 (平成21年3月末)	株券(千株)	16,452,971	513,940
	債券	6,781,859	3,707,407
	受益証券		
	単位型	75,861	
	追加型		1,077,782
	株式	1,787,571	
第5期末 (平成22年3月末)	債券	696,657	
	コマーシャル・ペーパー および外国証券等	—	0
	株券(千株)	17,867,050	580,629
	債券	8,549,557	3,901,816
	受益証券		
	単位型	55,541	
第5期末 (平成22年3月末)	追加型		1,049,419
	株式	2,416,267	
	債券	676,714	
	コマーシャル・ペーパー および外国証券等	—	—

② 信用取引にかかる融資および貸証券

区 分	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（千株）	金額（百万円）	株数（千株）	金額（百万円）
第4期末（平成21年3月末）	56,086	33,310	8,406	6,922
第5期末（平成22年3月末）	71,368	44,948	8,621	5,653

③ 公社債元利金支払の代理業務

区 分	元金支払取扱額(百万円)	利金支払取扱額(百万円)	合計（百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	840,955	94,483	935,438
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	847,534	112,538	960,072

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

区 分	収益分配金・償還金および一部解約金支払の取扱額（百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	3,045,658
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	3,481,160

⑤ その他の商品の売買の状況

区 分	譲渡性預金（百万円）	金地金（百万円）	その他（百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	—	3	90
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	—	11	66

⑥ 金融先物取引の状況

区 分	金利先物		通貨先物	
	受託（百万円）	自己（百万円）	受託（百万円）	自己（百万円）
第4期 （自 平成20年4月 至 平成21年3月）	—	12,428,275	—	—
第5期 （自 平成21年4月 至 平成22年3月）	—	10,181,183	—	—

⑦ 金銭の相互支払に関する取引業務（金利先渡取引業務を含む）

区 分	想定元本（期末残高）（百万円）
第 4 期末（平成21年 3 月31日現在）	379, 222, 893
第 5 期末（平成22年 3 月31日現在）	126, 427, 380

第5【経理の状況】

1. 連結財務諸表および財務諸表の作成方法について

(1) 当社の連結財務諸表は、「連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和51年大蔵省令第28号。以下「連結財務諸表規則」という。）ならびに同規則第46条および第68条の規定に基づき、「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、前連結会計年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）は、改正前の連結財務諸表規則に基づき、当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）は、改正後の連結財務諸表規則に基づいて作成しております。

(2) 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「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）、「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）および「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」（平成11年総理府・大蔵省令第32号）に準拠して作成しております。

なお、前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前連結会計年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）の連結財務諸表および前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）の財務諸表については、監査法人トーマツにより監査を受け、当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）の連結財務諸表および当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）の財務諸表については、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

なお、監査法人トーマツは、監査法人の種類の変更により、平成21年7月1日をもって有限責任監査法人トーマツとなっております。

また、当社の監査人は次のとおり異動しております。

前々連結会計年度および前々事業年度 新日本監査法人

前連結会計年度および前事業年度 監査法人トーマツ

臨時報告書に記載した事項は次のとおりであります。

(1) 異動に係る監査公認会計士等

就任監査公認会計士等の名称

監査法人トーマツ

(2) 異動の年月日

平成20年6月26日

3. 連結財務諸表等の適正性を確保するための特段の取組みについて

当社は、連結財務諸表等の適正性を確保するための特段の取組みを行っております。具体的には、会計基準等の内容を適切に把握し、又は会計基準等の変更等についての的確に対応することができる体制を整備するため、公益財団法人財務会計基準機構へ加入し、研修に参加しております。

1 【連結財務諸表等】
(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 (平成21年 3 月31日)	当連結会計年度 (平成22年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	※2 154,772	※2 168,469
預託金	77,545	91,588
トレーディング商品	※2 10,851,001	※2 11,395,146
商品有価証券等	5,003,515	6,538,721
デリバティブ取引	5,847,486	4,856,424
約定見返勘定	350,229	109,281
営業投資有価証券等	※2 71,432	※2 67,650
営業貸付金	1,640	1,448
信用取引資産	43,264	59,020
信用取引貸付金	34,371	45,958
信用取引借証券担保金	8,893	13,062
有価証券担保貸付金	5,957,071	6,765,283
借入有価証券担保金	2,798,359	3,180,267
現先取引貸付金	3,158,712	3,585,015
立替金	1,991	4,962
短期差入保証金	483,408	435,248
短期貸付金	1,469	111
親会社株式	293	302
有価証券	89,827	327,962
未収還付法人税等	1,722	1,482
繰延税金資産	11,049	19,473
その他の流動資産	144,602	103,931
貸倒引当金	△138	△967
流動資産計	18,241,186	19,550,395
固定資産		
有形固定資産	※1 28,280	※1 23,441
建物	11,719	10,391
器具備品	9,428	7,626
土地	6,995	5,357
リース資産	3	5
建設仮勘定	133	60
無形固定資産	50,128	45,508
ソフトウェア	48,574	44,165
その他	1,554	1,343
投資その他の資産	710,685	515,368
投資有価証券	※2, ※4 687,310	※2, ※4 489,398
長期貸付金	3,474	3,395
長期差入保証金	17,733	—

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成21年 3 月 31 日)	当連結会計年度 (平成22年 3 月 31 日)
繰延税金資産	813	5,546
その他	5,460	20,989
貸倒引当金	△4,106	△3,962
固定資産計	789,094	584,318
資産合計	19,030,280	20,134,713
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	7,881,704	7,540,898
商品有価証券等	2,213,678	2,932,436
デリバティブ取引	5,668,025	4,608,461
信用取引負債	24,409	23,908
信用取引借入金	※2 17,487	※2 18,254
信用取引貸証券受入金	6,922	5,653
有価証券担保借入金	7,443,137	8,307,900
有価証券貸借取引受入金	3,237,182	3,038,736
現先取引借入金	4,205,954	5,269,163
預り金	76,310	132,382
受入保証金	524,360	438,558
短期借入金	※2 996,304	※2 1,367,784
1年内返済予定の長期借入金	※2, ※6 58,653	※2, ※6 108,058
コマーシャル・ペーパー	146,500	374,700
1年内償還予定の社債	53,453	※2 85,130
未払金	9,729	—
未払法人税等	6,931	5,901
繰延税金負債	13	—
賞与引当金	9,194	20,630
その他の流動負債	130,198	59,648
流動負債計	17,360,901	18,465,501
固定負債		
社債	※2 650,370	※2 681,530
長期借入金	※2, ※6 346,185	※2, ※6 266,947
繰延税金負債	2,055	4,363
退職給付引当金	9,168	10,773
役員退職慰労引当金	411	415
その他の固定負債	1,883	1,665
固定負債計	1,010,076	965,696
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	※7 1,864	※7 1,861
特別法上の準備金計	1,864	1,861
負債合計	18,372,842	19,433,059

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成21年3月31日)	当連結会計年度 (平成22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	170,580	184,580
株主資本合計	653,047	667,047
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△19,687	△5,382
繰延ヘッジ損益	—	24
為替換算調整勘定	△35,680	△23,726
評価・換算差額等合計	△55,368	△29,085
新株予約権	0	0
少数株主持分	59,758	63,691
純資産合計	657,438	701,654
負債・純資産合計	19,030,280	20,134,713

②【連結損益計算書】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業収益		
受入手数料	168,124	185,669
委託手数料	29,911	25,227
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	18,753	39,373
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	18,428	26,663
その他の受入手数料	101,031	94,404
トレーディング損益	81,718	100,418
営業投資有価証券等損益	402	△2,649
その他の商品売買損益	4	△9
金融収益	215,600	60,396
営業収益計	465,850	343,824
金融費用	235,878	56,671
純営業収益	229,972	287,153
販売費・一般管理費		
取引関係費	86,392	74,852
人件費	※1 90,538	※1 110,023
不動産関係費	26,008	25,728
事務費	24,206	21,729
減価償却費	20,035	21,859
租税公課	2,485	2,485
貸倒引当金繰入額	2,288	999
その他	6,565	5,425
販売費・一般管理費計	258,520	263,103
営業利益又は営業損失（△）	△28,547	24,049
営業外収益		
受取利息	14,704	8,379
持分法による投資利益	—	228
投資有価証券評価益	—	※2 8,053
その他	3,136	2,498
営業外収益計	17,841	19,160
営業外費用		
支払利息	—	713
投資有価証券評価損	※3 2,053	—
持分法による投資損失	4,697	—
固定資産除却損	—	443
為替差損	—	256
その他	5,330	773
営業外費用計	12,081	2,187
経常利益又は経常損失（△）	△22,788	41,022

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
特別利益		
投資有価証券売却益	70	1,511
固定資産売却益	※4 7,446	0
金融商品取引責任準備金戻入	874	3
特別利益計	8,391	1,515
特別損失		
投資有価証券売却損	24	9
投資有価証券評価損	※5 12,056	※5 660
固定資産売却損	※6 23	※6 71
減損損失	※7 4,695	※7 1,082
損害賠償金等	—	726
M&A関連損失	—	469
統合関連費用	—	※8 289
子会社整理損	—	129
特別損失計	16,799	3,440
税金等調整前当期純利益又は税金等調整前当期純損失(△)	△31,196	39,097
法人税、住民税及び事業税	11,777	12,838
過年度法人税等	991	—
法人税等調整額	△6,580	△9,883
法人税等合計	6,189	2,954
少数株主利益	8,032	7,394
当期純利益又は当期純損失(△)	△45,417	28,748

③【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20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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	219,721	170,580
在外子会社の会計処理の変更に伴う増減	240	—
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失(△)	△45,417	28,748
連結範囲の変動	172	—
当期変動額合計	△49,381	13,999
当期末残高	170,580	184,580
株主資本合計		
前期末残高	702,188	653,047
在外子会社の会計処理の変更に伴う増減	240	—
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失(△)	△45,417	28,748
連結範囲の変動	172	—
当期変動額合計	△49,381	13,999
当期末残高	653,047	667,047
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	1,533	△19,687
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△21,221	14,304
当期変動額合計	△21,221	14,304
当期末残高	△19,687	△5,382
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	—	—
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	—	24

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期変動額合計	—	24
当期末残高	—	24
為替換算調整勘定		
前期末残高	10,712	△35,680
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△46,392	11,953
当期変動額合計	△46,392	11,953
当期末残高	△35,680	△23,726
評価・換算差額等合計		
前期末残高	12,246	△55,368
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△67,614	26,282
当期変動額合計	△67,614	26,282
当期末残高	△55,368	△29,085
新株予約権		
前期末残高	100	0
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△100	—
当期変動額合計	△100	—
当期末残高	0	0
少数株主持分		
前期末残高	57,046	59,758
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	2,711	3,933
当期変動額合計	2,711	3,933
当期末残高	59,758	63,691
純資産合計		
前期末残高	771,582	657,438
在外子会社の会計処理の変更に伴う増減	240	—
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失（△）	△45,417	28,748
連結範囲の変動	172	—
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△65,003	30,216
当期変動額合計	△114,384	44,216
当期末残高	657,438	701,654

④ 【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20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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(△)	△31,196	39,097
減価償却費	20,035	21,859
のれん償却額	△86	△233
退職給付引当金の増減額(△は減少)	△2,146	1,605
役員退職慰労引当金の増減額(△は減少)	△288	4
貸倒引当金の増減額(△は減少)	2,174	685
金融商品取引責任準備金の増減額(△は減少)	△874	△3
受取利息及び受取配当金	△231,870	△69,664
支払利息	236,557	57,385
持分法による投資損益(△は益)	4,697	△228
投資有価証券売却損益(△は益)	△46	△1,501
固定資産売却損益(△は益)	△7,423	71
投資有価証券評価損	12,056	—
投資有価証券評価損益(△は益)	—	△7,393
減損損失	4,695	1,082
損害賠償金等	—	726
M&A関連損失	—	469
統合関連費用	—	289
子会社整理損	—	129
顧客分別金信託の増減額(△は増加)	33,179	△12,940
トレーディング商品の増減額	△1,534,310	△854,795
約定見返勘定の増減額(△は増加)	△331,498	235,534
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	45,826	△16,244
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	2,254,534	19,959
立替金及び預り金の増減額	△12,758	52,122
短期差入保証金の増減額(△は増加)	△348,345	77,543
受入保証金の増減額(△は減少)	220,279	△114,821
その他	42,159	△38,589
小計	375,349	△607,851
利息及び配当金の受取額	233,141	75,617
利息の支払額	△253,838	△57,860
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
子会社整理損の支払額	—	△58
法人税等の支払額	△7,744	△13,881
営業活動によるキャッシュ・フロー	346,907	△605,490

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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	△2,667	△3,558
定期預金の払戻による収入	24,214	12,293
有価証券の取得による支出	△6,897	△225,307
有価証券の売却及び償還による収入	18,999	157,910
投資有価証券の取得による支出	△101,367	△46,810
投資有価証券の売却及び償還による収入	19,574	91,727
有形固定資産の取得による支出	△5,556	△3,006
有形固定資産の売却による収入	8,530	1,532
無形固定資産の取得による支出	△23,818	△12,625
貸付金の増減額 (△は増加)	△372	1,453
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	1,156	—
投資活動によるキャッシュ・フロー	△68,203	△26,401
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)	△485,167	374,043
コマーシャル・ペーパーの増減額 (△は減少)	5,200	228,200
長期借入れによる収入	60,850	79,583
長期借入金の返済による支出	△44,155	△108,110
社債の発行による収入	239,568	255,167
社債の償還による支出	△64,269	△162,850
配当金の支払額	△4,137	△14,748
少数株主への分配金支払額	△969	△1,208
少数株主からの払込みによる収入	566	117
財務活動によるキャッシュ・フロー	△292,513	650,194
現金及び現金同等物に係る換算差額	△37,484	4,680
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	△51,293	22,982
現金及び現金同等物の期首残高	160,743	109,213
連結の範囲の変更に伴う現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	△236	—
現金及び現金同等物の期末残高	109,213	132,196

【連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項】

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1. 連結の範囲に関する事項 (1) 連結子会社数 30社 連結子会社名 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)キャピタル 三菱UFJセキュリティーズ(香港) 三菱UFJセキュリティーズ(シンガポール) 三菱UFJセキュリティーズ(インド) Asset Finance Corporation Limited TROR Corporation Limited 菱証投資諮詢(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. コーポレート・バリュアアップ・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 パレス・キャピタル・パートナーズ株式会社 株式会社福寅	1. 連結の範囲に関する事項 (1) 連結子会社数 30社 連結子会社名 三菱UFJ証券分割準備株式会社 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)キャピタル 三菱UFJセキュリティーズ(香港) 三菱UFJセキュリティーズ(シンガポール) Asset Finance Corporation Limited TROR Corporation Limited 菱証投資諮詢(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. コーポレート・バリュアアップ・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 NCSホールディングス株式会社 株式会社福寅 (注)平成21年5月1日付でパレス・キャピタル・ パートナーズ株式会社は、NCSホールディングス 株式会社へ商号を変更しております。

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(新規) MUSプリンシパル・インベストメンツ株式会社 上記は新規設立に伴い、連結の範囲に含めております。 パレス・キャピタル・パートナーズ株式会社 上記は株式を取得したことに伴い、連結の範囲に含めております。 (除外) 三菱UFJウェルスマネジメント証券株式会社 上記は当社への吸収合併に伴い、連結の範囲から除外しております。 パレス・キャピタル・パートナーズA株式会社 上記はパレス・キャピタル・パートナーズA株式会社がその営業投資先である株式会社フーズネットを吸収合併したことに伴い、連結の範囲から除外しております。これは、ベンチャーキャピタル事業を営む連結子会社の投資育成目的等による株式の所有であって、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わないことによるものです。 なお、平成21年1月1日付でパレス・キャピタル・パートナーズA株式会社は、株式会社フーズネットへ商号を変更しております。 (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(旧パレス・キャピタル・パートナーズA株式会社) 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 ベスタ・フーズ株式会社 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	(新規) 三菱UFJ証券分割準備株式会社 上記は新規設立に伴い、連結の範囲に含めております。 (除外) 三菱UFJセキュリティーズ（インド） 上記は保有株式を売却したことに伴い、連結の範囲から除外しております。 (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 ベスタ・フーズ株式会社 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

前連結会計年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)																
(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、あるいは投資育成目的等による株式の所有であって、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) 関連会社17社について持分法を適用しております。 主要な持分法適用関連会社名 ワークス・キャピタル株式会社 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) 丸の内キャピタル株式会社 上記は新規設立に伴い、持分法適用関連会社の範囲に含めております。 KE Capital Partners Pte. Ltd. 上記は株式を追加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。 Kim Eng Holdings Limitedほか12社 上記13社は、Kim Eng Holdings Limitedの株式を追加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。 (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 株式会社ストリートデザイン マーズ株式会社 株式会社シフラ Centillion II Venture Capital Corporation (関連会社としなかった理由) いずれも、ベンチャーキャピタル事業を営む連結子会社による投資育成目的等による株式の所有であって、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。 <table> <tr> <td>8月末日</td><td>1社</td></tr> <tr> <td>12月末日</td><td>22社</td></tr> <tr> <td>2月末日</td><td>1社</td></tr> <tr> <td>3月末日</td><td>6社</td></tr> </table>	8月末日	1社	12月末日	22社	2月末日	1社	3月末日	6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) 関連会社17社について持分法を適用しております。 主要な持分法適用関連会社名 ワークス・キャピタル株式会社 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 (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 株式会社ストリートデザイン マーズ株式会社 株式会社シフラ 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。 <table> <tr> <td>8月末日</td><td>1社</td></tr> <tr> <td>12月末日</td><td>21社</td></tr> <tr> <td>2月末日</td><td>1社</td></tr> <tr> <td>3月末日</td><td>7社</td></tr> </table>	8月末日	1社	12月末日	21社	2月末日	1社	3月末日	7社
8月末日	1社																
12月末日	22社																
2月末日	1社																
3月末日	6社																
8月末日	1社																
12月末日	21社																
2月末日	1社																
3月末日	7社																

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
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。	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22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	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	(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
当社および連結子会社の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、原則として時価法を採用しております。	同左
(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	(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
① 満期保有目的債券	① 満期保有目的債券
償却原価法(定額法)によっております。	償却原価法によっております。
② その他有価証券	② その他有価証券
ア. 時価のあるもの	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。	同左
イ. 時価のないもの	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。	同左
③ 投資事業有限責任組合等出資	③ 投資事業有限責任組合等出資
投資事業有限責任組合およびそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な直近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取込む方法によっております。	同左
(3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法	(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(リース資産を除く)	① 有形固定資産の減価償却の方法(リース資産を除く)
当社は、定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く。)については、定額法を採用しております。	当社および国内連結子会社は、主として定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く。)については、定額法を採用しております。
連結子会社は、主として定率法を採用しております。	在外連結子会社は、主として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。	なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。
建物 5～50年	建物 5～50年
器具備品 4～15年	器具備品 4～15年

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
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（5年）に基づく定額法によっております。 ③ リース資産の減価償却の方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。 なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年3月31日以前のリース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 (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等により、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、所定の計算法による支払見込額を計上しております。 ③ 役員賞与引当金 役員賞与の支払いに備えるため、支給見込額に基づき計上しております。	② 無形固定資産の減価償却の方法 同左 ③ リース資産の減価償却の方法 同左 (4) 重要な引当金の計上基準 ① 貸倒引当金 同左 ② 賞与引当金 同左 ③ 役員賞与引当金 同左

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
④ 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当連結会計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いて計上しております。 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することとしております。 ⑤ 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、一部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。 （追加情報） 当社は、従来、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく連結会計年度末要支給額を計上しておりましたが、平成20年6月26日開催の定時株主総会において、役員退職慰労金制度を廃止し、廃止時の要支給額を取締役および監査役の退任時に支給することといたしました。これにより、廃止時における役員退職慰労引当金相当額381百万円を固定負債の「その他の固定負債」に振替えております。	④ 退職給付引当金 同左 （会計方針の変更） 当連結会計年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その3）（企業会計基準第19号平成20年7月31日）を適用しております。 数理計算上の差異を翌期から償却するため、これによる営業利益、経常利益および税金等調整前当期純利益に与える影響はありません。 また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額の未処理残高は576百万円であります。 ⑤ 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、一部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。

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(5) 重要なヘッジ会計の方法 ① ヘッジ会計の方法 通貨スワップ取引、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を適用しています。なお、特例処理の要件を満たしている金利スワップについては、特例処理を採用しております。 ② ヘッジ手段とヘッジ対象 ア. 為替変動リスク (a)ヘッジ手段 通貨スワップ取引および為替予約（為替スワップ取引） (b)ヘッジ対象 外貨建金融資産（その他有価証券） イ. 金利変動リスク (a)ヘッジ手段 金利スワップ (b)ヘッジ対象 投資有価証券（その他有価証券）、借入金 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、同一通貨の通貨スワップ取引および為替予約（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）および借入金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。 なお、金利スワップの特例処理の要件を満たしているものについては、有効性の判定を省略しております。 (6) 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 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。	(5) 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います。なお、特例処理の要件を満たしている金利スワップについては、特例処理を採用しております。 ② ヘッジ手段とヘッジ対象 ア. 為替変動リスク (a)ヘッジ手段 為替予約（為替スワップ取引） (b)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 (a)ヘッジ手段 同左 (b)ヘッジ対象 同左 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）および借入金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 同左 (6) 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 同左

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
5. 連結子会社の資産および負債の評価に関する事項 連結子会社の資産および負債の評価については、全面時価評価法を採用しております。 6. のれんおよび負ののれんの償却方法に関する事項 のれんおよび負ののれんの償却については、発生他都度、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、のれんおよび負の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。 7. 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ヵ月を超える定期預金は含んでおりません。)	5. 連結子会社の資産および負債の評価に関する事項 同左 6. のれんおよび負ののれんの償却方法に関する事項 同左 7. 連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲 同左

【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】

前連結会計年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
(リース取引に関する会計基準) 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当連結会計年度より「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号(平成5年6月17日(企業会計審議会第一部会)、平成19年3月30日改正))および「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号(平成6年1月18日(日本公認会計士協会 会計制度委員会)、平成19年3月30日改正))が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。 なお、これに伴う損益への影響は軽微であります。 また、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。 (連結財務諸表作成における在外子会社の会計処理に関する当面の取扱い) 当連結会計年度より、「連結財務諸表作成における在外子会社の会計処理に関する当面の取扱い」(実務対応報告第18号 平成18年5月17日)を適用し、連結決算上必要な修正を行っております。 なお、これに伴い当連結会計年度の営業損失、経常損失及び税金等調整前当期純損失は、それぞれ、329百万円増加しております。 また、期首時点における改正後の会計基準の適用による過年度利益の影響額については、利益剰余金に加算して処理しておりますが、影響は軽微であります。 (デリバティブ取引の相殺表示) 従来、法的に有効なマスターネットティング契約を有する同一取引先とのデリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債については相殺表示しておりました。親会社においては当連結会計年度よりこれらの金融資産および金融負債を総額で表示する方法に変更しております。当社においても親会社との会計方針の統一を図るため信用リスクを適切に表示する観点から検討した結果、デリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債のみを相殺表示する合理性が薄れていると判断し、原則通りこれらの金融資産および金融負債を総額で表示する方法に変更しております。 この結果、従来の表示方法に比して、デリバティブ取引(資産)およびデリバティブ取引(負債)がそれぞれ4,349,791百万円増加しております。	

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(国際会計基準第39号「金融商品：認識と測定」) 当連結会計年度より、一部の在外子会社において、 「金融商品：認識と測定」(国際会計基準 (IAS) 第39号 平成20年10月13日改正)を適用し、一部の売買目的 有価証券をその他有価証券および満期保有目的の債券へ 振替えております。 なお、これに伴い当連結会計年度の営業損失は、 17,263百万円減少し、経常損失および税金等調整前当期 純損失は、それぞれ29,093百万円減少しております。	

【表示方法の変更】

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(連結貸借対照表) 従来、在外子会社の売戻条件付買入契約および買戻条件付売却契約は、「借入有価証券担保金」および「有価証券貸借取引受入金」として表示しておりましたが、親会社との会計方針の統一を図るため検討した結果、契約形態に合わせて表示することが、より明瞭であると判断し、当連結会計年度末より「現先取引貸付金」および「現先取引借入金」として表示する方法に変更しております。 なお、前連結会計年度末の「借入有価証券担保金」および「有価証券貸借取引受入金」に含まれる在外子会社における売戻条件付買入契約および買戻条件付売却契約は、それぞれ6,821,297百万円および5,781,848百万円であります。 (連結損益計算書) 1. 従来、営業外収益の「その他」に含めて表示しておりました「受取利息」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当連結会計年度より区分掲記しております。 なお、前連結会計年度の営業外収益の「その他」に含まれる「受取利息」は、66百万円であります。 2. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「受取配当金」(当連結会計年度は1,565百万円)は、営業外収益の総額の100分の10以下となったため、営業外収益の「その他」に含めて表示しております。 3. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「固定資産除却損」(当連結会計年度は704百万円)は、営業外費用の総額の100分の10以下となったため、営業外費用の「その他」に含めて表示しております。 4. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「投資事業有限責任組合等出資損失」(当連結会計年度は289百万円)は、営業外費用の総額の100分の10以下となったため、営業外費用の「その他」に含めて表示しております。	(連結貸借対照表) 1. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「長期差入保証金」(当連結会計年度末の残高は、15,797百万円)は、当連結会計年度において、資産の総額に占める重要性が低下したため、投資その他の資産の「その他」に含めて表示しております。 2. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「未払金」(当連結会計年度末の残高は、11,045百万円)は、当連結会計年度において、負債および純資産の合計額に占める重要性が低下したため、流動負債の「その他の流動負債」に含めて表示しております。 (連結損益計算書) 1. 従来、営業外費用の「その他」に含めて表示しておりました「支払利息」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当連結会計年度より区分掲記しております。 なお、前連結会計年度の営業外費用の「その他」に含まれる「支払利息」は、678百万円であります。 2. 従来、営業外費用の「その他」に含めておりました「固定資産除却損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当連結会計年度より区分掲記しております。 なお、前連結会計年度の営業外費用の「その他」に含まれる「固定資産除却損」は、704百万円であります。 3. 従来、営業外費用の「その他」に含めておりました「為替差損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当連結会計年度より区分掲記しております。 なお、前連結会計年度の営業外費用の「その他」に含まれる「為替差損」は、975百万円であります。

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(連結キャッシュ・フロー計算書) 1. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「営業外損益項目にかかる調整」の「その他」(当連結会計年度は956百万円)は、E D I N E TへのX B R L導入に伴い連結財務諸表の比較可能性を向上するため、当連結会計年度より「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」として表示しております。 2. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「特別損益項目にかかる調整」の「投資有価証券売却益」(当連結会計年度は△70百万円)および「投資有価証券売却損」(当連結会計年度は24百万円)は、E D I N E TへのX B R L導入に伴い連結財務諸表の比較可能性を向上するため、当連結会計年度より「投資有価証券売却損益(△は益)」として表示しております。 3. 前連結会計年度まで区分掲記しておりました「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「特別損益項目にかかる調整」の「固定資産売却益」(当連結会計年度は△7,446百万円)および「固定資産売却損」(当連結会計年度は23百万円)は、E D I N E TへのX B R L導入に伴い連結財務諸表の比較可能性を向上するため、当連結会計年度より「固定資産売却損益(△は益)」として表示しております。 4. 従来、「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「定期預金の増減額」に含めて表示しておりました「定期預金の預入による支出」および「定期預金の払戻による収入」は、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。 なお、前連結会計年度における「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「定期預金の増減額」に含まれる「定期預金の預入による支出」および「定期預金の払戻による収入」は、それぞれ46,085百万円および75,344百万円であります。 5. 従来、「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「有価証券の増減額」に含めて表示しておりました「有価証券の取得による支出」および「有価証券の売却及び償還による収入」は、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。 なお、前連結会計年度における「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「有価証券の増減額」に含まれる「有価証券の取得による支出」および「有価証券の売却及び償還による収入」は、それぞれ△4,247百万円および3,428百万円であります。 6. 従来、「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「投資有価証券の売却による収入」として掲記されていたものは、明瞭表示のため、当連結会計年度から「投資有価証券の売却及び償還による収入」と表示しております。	(連結キャッシュ・フロー計算書) 従来、「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に含めて表示しておりました営業外損益項目にかかる「投資有価証券評価損益」は、連結財務諸表の比較可能性を向上するため、当連結会計年度より「投資有価証券評価損益(△は益)」に含めて表示しております。 なお、前連結会計年度における「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に含まれる営業外損益項目にかかる「投資有価証券評価損益」は、2,053百万円であります。

【追加情報】

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(金融商品取引責任準備金) 従来、証券事故による損失に備えるため、旧証券取引法第51条の規定に基づき、旧「証券会社に関する内閣府令」第35条に定めるところにより算出した額を証券取引責任準備金として計上していましたが、金融商品取引法が施行されたことに伴い、当連結会計年度より金融商品取引法第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金融商品取引責任準備金として計上しております。 なお、従来と同一の基準によった場合と比較して、特別利益が365百万円増加し、税金等調整前当期純損失が365百万円減少しております。	—

【注記事項】

(連結貸借対照表関係)

前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在)
※1. 有形固定資産から控除した減価償却累計額 27,370百万円	※1. 有形固定資産から控除した減価償却累計額 32,043百万円
※2. 担保に供している資産 前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	※2. 担保に供している資産

前連結会計年度末 平成21年3月31日現在	被担保債務		担保に供している資産			
	科 目	期末残高 (百万円)	現金・預金 (百万円)	トレーディング商品 (百万円)	営業投資有価証券等 (百万円)	計 (百万円)
	短期借入金	697,350	27	719,759	553	720,340
	共通担保資金供給オペレーション	697,000	—	719,759	—	719,759
	1年内返済予定の長期借入金	4,153	4,014	—	237	4,251
	信用取引借入金	17,487	—	10,396	—	10,396
	社債	25,823	—	26,949	—	26,949
	長期借入金	33,985	32,080	822	1,739	34,641
	計	778,799	36,122	757,926	2,529	796,578

(注) 1. 担保に供している資産は期末帳簿価額によるものであります。

2. 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303,831百万円、短期借入金（コール・マネー）の担保として短期借入有価証券15,599百万円、営業投資先の長期借入金の担保として営業投資有価証券等33,472百万円および連結子会社株式（消去前金額6,356百万円）を差し入れております。また、先物取引証拠金等の代用として短期借入有価証券48,119百万円、トレーディング商品11,669百万円、投資有価証券9,883百万円を、DVP決済等の担保として短期借入有価証券12,270百万円を差し入れております。

当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在)

当連結会計年度末 平成22年3月31日現在	被担保債務		担保に供している資産			
	科 目	期末残高 (百万円)	現金・預金 (百万円)	トレーディング商品 (百万円)	営業投資有価証券等 (百万円)	計 (百万円)
	短期借入金	850,200	—	861,431	—	861,431
	共通担保資金供給オペレーション	850,200	—	861,431	—	861,431
	1年内返済予定の長期借入金	6,058	5,106	824	369	6,300
	信用取引借入金	18,254	—	12,285	—	12,285
	1年内償還予定の社債	10,684	—	10,743	—	10,743
	社債	53,020	—	53,769	—	53,769
	長期借入金	26,664	25,728	—	2,160	27,889
	計	964,882	30,835	939,053	2,529	972,419

(注) 1. 担保に供している資産は期末帳簿価額によるものであります。

2. 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242,948百万円、営業投資先の長期借入金の担保として営業投資有価証券等33,469百万円および連結子会社株式（消去前金額6,338百万円）を差し入れております。また、先物取引証拠金等の代用としてトレーディング商品24,112百万円、投資有価証券11,725百万円、短期借入有価証券10,323百万円を、DVP決済等の担保としてトレーディング商品11,993百万円を差し入れております。

前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在)																																																																				
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。 <table> <tr> <th>種 類</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>差し入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸証券</td><td>7,502</td></tr> <tr> <td>信用取引借入金の本担保証券</td><td>17,487</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td><td>3,403,091</td></tr> <tr> <td>現先取引で売却した有価証券</td><td>6,863,997</td></tr> <tr> <td>その他担保として差し入れた有価証券</td><td>1,539</td></tr> <tr> <td>受け入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸付金の本担保証券</td><td>33,919</td></tr> <tr> <td>信用取引借証券</td><td>8,893</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により借り入れた有価証券</td><td>3,420,110</td></tr> <tr> <td>現先取引で買い付けた有価証券</td><td>4,654,112</td></tr> <tr> <td>その他担保として受け入れた有価証券</td><td>94,133</td></tr> </table> ※4. 関連会社に対するものは、次のとおりであります。 投資有価証券(株式) 12,188百万円 5. 保証債務 (1) 従業員の金融機関からの住宅融資に対する保証債務が44百万円あります。 (2) 関係会社等において営業投資先の金融機関からの借入等に対する保証債務があります。 <table> <tr> <th>保証先</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>株式会社パトライト</td><td>12,730</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>108</td></tr> <tr> <td>(1), (2) 計</td><td>12,838</td></tr> </table> ※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)228,300百万円が含まれております。	種 類	金額 (百万円)	差し入れた有価証券		信用取引貸証券	7,502	信用取引借入金の本担保証券	17,487	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,403,091	現先取引で売却した有価証券	6,863,997	その他担保として差し入れた有価証券	1,539	受け入れた有価証券		信用取引貸付金の本担保証券	33,919	信用取引借証券	8,893	消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,420,110	現先取引で買い付けた有価証券	4,654,112	その他担保として受け入れた有価証券	94,133	保証先	金額 (百万円)	株式会社パトライト	12,730	その他	108	(1), (2) 計	12,838	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。 <table> <tr> <th>種 類</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>差し入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸証券</td><td>6,228</td></tr> <tr> <td>信用取引借入金の本担保証券</td><td>18,254</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td><td>3,250,693</td></tr> <tr> <td>現先取引で売却した有価証券</td><td>6,535,838</td></tr> <tr> <td>その他担保として差し入れた有価証券</td><td>221</td></tr> <tr> <td>受け入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸付金の本担保証券</td><td>49,431</td></tr> <tr> <td>信用取引借証券</td><td>13,062</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により借り入れた有価証券</td><td>3,662,221</td></tr> <tr> <td>現先取引で買い付けた有価証券</td><td>5,559,999</td></tr> <tr> <td>その他担保として受け入れた有価証券</td><td>93,070</td></tr> </table> ※4. 関連会社に対するものは、次のとおりであります。 投資有価証券(株式) 19,242百万円 5. 保証債務 (1) 従業員の金融機関からの住宅融資に対する保証債務が40百万円あります。 (2) 関係会社等において営業投資先の金融機関からの借入等に対する保証債務があります。 <table> <tr> <th>保証先</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>株式会社パトライト</td><td>11,607</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>131</td></tr> <tr> <td>計</td><td>11,738</td></tr> </table> ※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)228,300百万円が含まれております。	種 類	金額 (百万円)	差し入れた有価証券		信用取引貸証券	6,228	信用取引借入金の本担保証券	18,254	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,250,693	現先取引で売却した有価証券	6,535,838	その他担保として差し入れた有価証券	221	受け入れた有価証券		信用取引貸付金の本担保証券	49,431	信用取引借証券	13,062	消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,662,221	現先取引で買い付けた有価証券	5,559,999	その他担保として受け入れた有価証券	93,070	保証先	金額 (百万円)	株式会社パトライト	11,607	その他	131	計	11,738
種 類	金額 (百万円)																																																																				
差し入れた有価証券																																																																					
信用取引貸証券	7,502																																																																				
信用取引借入金の本担保証券	17,487																																																																				
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,403,091																																																																				
現先取引で売却した有価証券	6,863,997																																																																				
その他担保として差し入れた有価証券	1,539																																																																				
受け入れた有価証券																																																																					
信用取引貸付金の本担保証券	33,919																																																																				
信用取引借証券	8,893																																																																				
消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,420,110																																																																				
現先取引で買い付けた有価証券	4,654,112																																																																				
その他担保として受け入れた有価証券	94,133																																																																				
保証先	金額 (百万円)																																																																				
株式会社パトライト	12,730																																																																				
その他	108																																																																				
(1), (2) 計	12,838																																																																				
種 類	金額 (百万円)																																																																				
差し入れた有価証券																																																																					
信用取引貸証券	6,228																																																																				
信用取引借入金の本担保証券	18,254																																																																				
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,250,693																																																																				
現先取引で売却した有価証券	6,535,838																																																																				
その他担保として差し入れた有価証券	221																																																																				
受け入れた有価証券																																																																					
信用取引貸付金の本担保証券	49,431																																																																				
信用取引借証券	13,062																																																																				
消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,662,221																																																																				
現先取引で買い付けた有価証券	5,559,999																																																																				
その他担保として受け入れた有価証券	93,070																																																																				
保証先	金額 (百万円)																																																																				
株式会社パトライト	11,607																																																																				
その他	131																																																																				
計	11,738																																																																				

前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在)																								
※7. 特別法上の準備金 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は以下のとおりであります。 金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5 8. 当座貸越契約および貸出コミットメント (貸手側) 連結子会社の三菱UFJセキュリティーズインターナショナルは貸出コミットメント契約等を締結しております。この契約に基づく当連結会計年度末の貸出未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>貸出コミットメントの総額</td><td>52,683 百万円</td></tr> <tr> <td>貸出実行残高</td><td>43,610</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>9,073</td></tr> </table> (借手側) 当社および連結子会社においては、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行9行と当座貸越契約等を締結しております。これら契約に基づく当連結会計年度末の借入未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>当座貸越極度額</td><td>221,801 百万円</td></tr> <tr> <td>借入実行残高</td><td>—</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>221,801</td></tr> </table>	貸出コミットメントの総額	52,683 百万円	貸出実行残高	43,610	差引額	9,073	当座貸越極度額	221,801 百万円	借入実行残高	—	差引額	221,801	※7. 特別法上の準備金 同左 8. 当座貸越契約および貸出コミットメント (貸手側) 連結子会社の三菱UFJセキュリティーズインターナショナルは貸出コミットメント契約等を締結しております。この契約に基づく当連結会計年度末の貸出未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>貸出コミットメントの総額</td><td>55,681 百万円</td></tr> <tr> <td>貸出実行残高</td><td>48,170</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>7,511</td></tr> </table> (借手側) 当社および連結子会社においては、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行8行と当座貸越契約等を締結しております。これら契約に基づく当連結会計年度末の借入未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>当座貸越極度額</td><td>207,830 百万円</td></tr> <tr> <td>借入実行残高</td><td>—</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>207,830</td></tr> </table>	貸出コミットメントの総額	55,681 百万円	貸出実行残高	48,170	差引額	7,511	当座貸越極度額	207,830 百万円	借入実行残高	—	差引額	207,830
貸出コミットメントの総額	52,683 百万円																								
貸出実行残高	43,610																								
差引額	9,073																								
当座貸越極度額	221,801 百万円																								
借入実行残高	—																								
差引額	221,801																								
貸出コミットメントの総額	55,681 百万円																								
貸出実行残高	48,170																								
差引額	7,511																								
当座貸越極度額	207,830 百万円																								
借入実行残高	—																								
差引額	207,830																								

(連結損益計算書関係)

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																																																															
※1. 人件費には、賞与引当金繰入額6,577百万円および退職給付費用4,759百万円が含まれております。	※1. 人件費には、賞与引当金繰入額 21,170百万円および退職給付費用6,750百万円が含まれております。																																																															
※3. 投資有価証券評価損 時価ヘッジに係る評価損であります。	※2. 投資有価証券評価益 時価ヘッジに係る評価益であります。																																																															
※4. 固定資産売却益の内訳 土地 7,427百万円 その他（借地権） 283百万円 建物 △262百万円 器具備品 △1百万円	※5. 投資有価証券評価損 同左																																																															
※5. 投資有価証券評価損 上場および非上場の投資有価証券について、金融商品に係る会計基準に基づき減損処理を行ったものであります。	※6. 固定資産売却損の内訳 建物 72百万円 土地 △2百万円 投資その他の資産 その他 2百万円																																																															
※6. 固定資産売却損の内訳 建物 12百万円 土地 10百万円 器具備品 0百万円	※7. 減損損失 当連結会計年度において、当社グループは以下の資産グループについて減損損失を計上しております。																																																															
※7. 減損損失 当連結会計年度において、当社グループは以下の資産グループについて減損損失を計上しております。	※7. 減損損失 当連結会計年度において、当社グループは以下の資産グループについて減損損失を計上しております。																																																															
<table><tr><th>場所</th><th>用途</th><th>種類</th><th>減 損 損失額 (百万円)</th></tr><tr><td rowspan="6">川崎市幸区 他</td><td rowspan="2">業務システム</td><td>リース資産</td><td>78</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>862</td></tr><tr><td rowspan="4">本社オフィス等</td><td>建物</td><td>2,736</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>105</td></tr><tr><td>土地</td><td>62</td></tr><tr><td>電話加入権</td><td>14</td></tr><tr><td rowspan="3">大阪市中央区他12箇所</td><td rowspan="3">店舗設備</td><td>土地</td><td>101</td></tr><tr><td>建物</td><td>705</td></tr><tr><td>電話加入権</td><td>0</td></tr><tr><td rowspan="2">その他</td><td>遊休資産</td><td>土地</td><td>25</td></tr><tr><td>その他</td><td>その他</td><td>1</td></tr></table>	場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)	川崎市幸区 他	業務システム	リース資産	78	ソフトウェア	862	本社オフィス等	建物	2,736	器具備品	105	土地	62	電話加入権	14	大阪市中央区他12箇所	店舗設備	土地	101	建物	705	電話加入権	0	その他	遊休資産	土地	25	その他	その他	1	<table><tr><th>場所</th><th>用途</th><th>種類</th><th>減 損 損失額 (百万円)</th></tr><tr><td>東京都江東区</td><td>業務システム</td><td>ソフトウェア</td><td>489</td></tr><tr><td rowspan="3">大阪府高槻市 他16箇所</td><td rowspan="3">店舗設備</td><td>建物</td><td>316</td></tr><tr><td>土地</td><td>27</td></tr><tr><td>長期前払費用</td><td>8</td></tr><tr><td rowspan="2">愛知県刈谷市 他119箇所</td><td rowspan="2">社名入り看板・サイン</td><td>建物</td><td>157</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>67</td></tr><tr><td rowspan="2">その他</td><td>遊休資産</td><td>土地</td><td>10</td></tr><tr><td>その他</td><td>その他</td><td>5</td></tr></table>	場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)	東京都江東区	業務システム	ソフトウェア	489	大阪府高槻市 他16箇所	店舗設備	建物	316	土地	27	長期前払費用	8	愛知県刈谷市 他119箇所	社名入り看板・サイン	建物	157	器具備品	67	その他	遊休資産	土地	10	その他	その他	5
場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)																																																													
川崎市幸区 他	業務システム	リース資産	78																																																													
		ソフトウェア	862																																																													
	本社オフィス等	建物	2,736																																																													
		器具備品	105																																																													
		土地	62																																																													
		電話加入権	14																																																													
大阪市中央区他12箇所	店舗設備	土地	101																																																													
		建物	705																																																													
		電話加入権	0																																																													
その他	遊休資産	土地	25																																																													
	その他	その他	1																																																													
場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)																																																													
東京都江東区	業務システム	ソフトウェア	489																																																													
大阪府高槻市 他16箇所	店舗設備	建物	316																																																													
		土地	27																																																													
		長期前払費用	8																																																													
愛知県刈谷市 他119箇所	社名入り看板・サイン	建物	157																																																													
		器具備品	67																																																													
その他	遊休資産	土地	10																																																													
	その他	その他	5																																																													

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当社は、管理会計制度における管理単位をキャッシュ・フロー生成単位としてホールセールとリテールに分け、それぞれの本部および支店についてグルーピングし、また連結子会社のうち、賃貸用不動産を有する会社についてはそれぞれの物件毎に、それ以外の会社については事業全体を1つの資産グループとしてそれぞれグルーピングして減損の兆候を判断しております。 当連結会計年度において、業務システムの一部更改による廃止に伴うリース資産・ソフトウェア、本社オフィス集約による保有不動産および退去フロアや店舗網見直しによる廃止予定店舗などの廃棄資産の建物・器具備品・電話加入権について、帳簿価額または未経過リース料を回収可能価額まで減額し、減損損失(3,951百万円)として特別損失に計上しております。 また、世界的な金融市場の混乱を受けた株式相場下落が経営環境の著しい悪化に該当し減損の兆候があると判断したため、一部の店舗設備のうち保有不動産については回収可能額まで減額し、減損損失(715百万円)として特別損失に計上しております。 当資産グループの回収可能価額のうち、土地・建物・器具備品・電話加入権・その他については正味売却価額により測定しており、土地・建物については不動産鑑定評価額または合理的な見積もりにより、器具備品・電話加入権・その他については合理的な見積もりにより評価しております。 また、主たるリース資産・ソフトウェアについては使用価値により測定しており、将来キャッシュ・フローを3.5%で割り引いて算定しております。	当社は、管理会計制度における管理単位をキャッシュ・フロー生成単位としてホールセールとリテールに分け、それぞれの本部および支店についてグルーピングし、また連結子会社のうち、賃貸用不動産を有する会社についてはそれぞれの物件毎に、それ以外の会社については事業全体を1つの資産グループとしてそれぞれグルーピングして減損の兆候を判断しております。 当連結会計年度において、業務システムの一部更改による廃止に伴うソフトウェア、店舗網見直しによる廃止予定店舗などの廃棄資産の建物・長期前払費用について、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、減損損失(842百万円)として特別損失に計上しております。 また、モルガン・スタンレー証券株式会社との統合に伴う商号変更により、店舗等の看板・サインの取替えを実施するため、既存の建物・器具備品について帳簿価額を回収可能価額まで減損し、減損損失(224百万円)として特別損失に計上しております。 当資産グループの回収可能価額のうち、建物・器具備品・長期前払費用・その他については正味売却価額により測定しており、合理的な見積もりにより評価しております。 また、ソフトウェアについては使用価値により測定しており、将来キャッシュ・フローを2.5%で割り引いて算定しております。 ※8. 統合関連費用 当社とモルガン・スタンレー証券株式会社の統合に係る費用であります。

(連結株主資本等変動計算書関係)

前連結会計年度(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	前連結会計年度末 株式数(千株)	当連結会計年度増 加株式数(千株)	当連結会計年度減 少株式数(千株)	当連結会計年度末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	716,985	—	—	716,985
合計	716,985	—	—	716,985

(注) 自己株式については、該当事項はありません。

2. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	当連結会計年 度末残高 (百万円)
連結子会社	0

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生日
平成20年6月26日 定時株主総会	普通株式	4,137	5.77	平成20年3月31日	平成20年6月27日

(2) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	配当の原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月25日 定時株主総会	普通株式	7,592	利益剰余金	10.59	平成21年3月31日	平成21年6月26日

当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	前連結会計年度末 株式数（千株）	当連結会計年度増 加株式数（千株）	当連結会計年度減 少株式数（千株）	当連結会計年度末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	716,985	—	—	716,985
合計	716,985	—	—	716,985

（注）自己株式については、該当事項はありません。

2. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	当連結会計年 度末残高 （百万円）
連結子会社	0

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （百万円）	1株当たり配当 額（円）	基準日	効力発生日
平成21年6月25日 定時株主総会	普通株式	7,592	10.59	平成21年3月31日	平成21年6月26日
平成21年10月28日 取締役会	普通株式	7,155	9.98	平成21年9月30日	平成21年11月25日

(2) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （百万円）	配当の原資	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成22年6月28日 定時株主総会	普通株式	7,327	利益剰余金	10.22	平成22年3月31日	平成22年6月29日

(連結キャッシュ・フロー計算書関係)

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1. 現金及び現金同等物の期末残高と連結貸借対照表に掲 記する科目の金額との関係	1. 現金及び現金同等物の期末残高と連結貸借対照表に掲 記する科目の金額との関係
現金・預金 154,772 百万円	現金・預金 168,469 百万円
預入期間が3ヵ月を超える $\Delta 45,558$	預入期間が3ヵ月を超える $\Delta 36,273$
定期預金	定期預金
現金及び現金同等物の期末 残高 109,213	現金及び現金同等物の期末 残高 132,196

(リース取引関係)

前連結会計年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																																
1. ファイナンス・リース取引 (借主側) 所有権移転外ファイナンス・リース取引 ①リース資産の内容 有形固定資産 複合機 (器具備品) であります。 ②リース資産の減価償却の方法 連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項 「4. 会計処理基準に関する事項 (3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。 なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が、平成20年 3 月31日以前のリース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっており、その内容は次のとおりであります。 (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額および期末残高相当額	1. ファイナンス・リース取引 (借主側) 所有権移転外ファイナンス・リース取引 ①リース資産の内容 同左 ②リース資産の減価償却の方法 同左 同左 (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額および期末残高相当額																																
<table><tr><th></th><th>取得価額相当額 (百万円)</th><th>減価償却累計額相当額 (百万円)</th><th>期末残高相当額 (百万円)</th></tr><tr><td>器具備品</td><td>5,387</td><td>4,197</td><td>1,190</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>15,081</td><td>8,384</td><td>6,696</td></tr><tr><td>合 計</td><td>20,469</td><td>12,581</td><td>7,887</td></tr></table> (2) 未経過リース料期末残高相当額等 未経過リース料期末残高相当額 1 年内 3,197 百万円 1 年超 5,322 合計 8,519 (3) 支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額および減損損失 支払リース料 3,815百万円 リース資産減損勘定の取崩額 844 減価償却費相当額 3,415 支払利息相当額 291 減損損失 78 (4) 減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 (5) 利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額の差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。		取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)	器具備品	5,387	4,197	1,190	ソフトウェア	15,081	8,384	6,696	合 計	20,469	12,581	7,887	<table><tr><th></th><th>取得価額相当額 (百万円)</th><th>減価償却累計額相当額 (百万円)</th><th>期末残高相当額 (百万円)</th></tr><tr><td>器具備品</td><td>3,764</td><td>3,368</td><td>396</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>15,081</td><td>10,527</td><td>4,553</td></tr><tr><td>合 計</td><td>18,846</td><td>13,896</td><td>4,949</td></tr></table> (2) 未経過リース料期末残高相当額等 未経過リース料期末残高相当額 1 年内 2,662 百万円 1 年超 2,623 合計 5,285 (3) 支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額および減損損失 支払リース料 3,369百万円 減価償却費相当額 3,075 支払利息相当額 193 (4) 減価償却費相当額の算定方法 同左 (5) 利息相当額の算定方法 同左		取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)	器具備品	3,764	3,368	396	ソフトウェア	15,081	10,527	4,553	合 計	18,846	13,896	4,949
	取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)																														
器具備品	5,387	4,197	1,190																														
ソフトウェア	15,081	8,384	6,696																														
合 計	20,469	12,581	7,887																														
	取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)																														
器具備品	3,764	3,368	396																														
ソフトウェア	15,081	10,527	4,553																														
合 計	18,846	13,896	4,949																														

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)												
2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のもの に係る未経過リース料 <table> <tr> <td>1年内</td><td>5,827 百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>10,352</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>16,179</td></tr> </table>	1年内	5,827 百万円	1年超	10,352	合計	16,179	2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のもの に係る未経過リース料 <table> <tr> <td>1年内</td><td>5,551 百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>8,439</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>13,991</td></tr> </table>	1年内	5,551 百万円	1年超	8,439	合計	13,991
1年内	5,827 百万円												
1年超	10,352												
合計	16,179												
1年内	5,551 百万円												
1年超	8,439												
合計	13,991												

(金融商品関係)

当連結会計年度(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社グループは、証券市場を通じてお客様の多様なニーズに応じた最良のサービスや商品を提供すること、市場機能を補完すること、更にこれらの結果として生じるポジションのリスクコントロール等を目的としてトレーディングを行っており、種々の金融商品を保有しています。また、有価証券や証券化商品の引受業務も行っており、一時的にそれらの金融商品を保有することがあります。その他に、株式や債券、その他の有価証券等を対象に、自己資金による中長期投資を行うことがあります。また、資金調達的手段として種々の金融商品を利用しています。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社グループが保有する金融商品は、(a)株式や債券に代表される有価証券の現物取引、(b)株価指数の先物取引やオプション取引、国債証券の先物取引や先物オプション取引といった取引所上場の金融派生商品[市場デリバティブ取引、外国市場デリバティブ取引]、(c)スワップ取引、外国為替先物取引、通貨オプション取引、選択権付債券売買、有価証券店頭デリバティブ取引等の取引所以外の金融派生商品[店頭デリバティブ取引]、(d)証券化商品、その他の有価証券等、の4種類に大別されます。また、資金調達や運用の手段として、レポ取引や有価証券貸借取引、長期借入金、デリバティブを内包したMTNや仕組みローン、等を利用しています。デリバティブ内包型の資金調達を行った場合、内部取引によるデリバティブの分離、或いはヘッジ処理を行い資金調達取引からの分別管理をおこなっています。

なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジの方針、ヘッジの有効性の評価方法等については、前述の「連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項」の「重要なヘッジ会計の方法」を参照ください。

当社グループが保有する金融商品に伴って発生し、当社グループの財務状況に大きな影響を与えるリスクは、主として市場リスクと信用リスクがあげられます。市場リスクとは、金利、有価証券の価格、為替等の様々な指標(市場リスクファクター)の変動により、保有する資産・負債(オフバランスの資産・負債を含む)の価値が変動し、損失を被るリスク(市場変動リスク)、および市場の混乱や取引の厚み不足等により、必要とされる数量を妥当な水準で取引できないことにより損失を被るリスク(商品流動性リスク)をいいます。信用リスクとは借入人、有価証券の発行者、市場性取引等のカウンターパーティ等、契約に係る相手先もしくは参照先の財務状況の悪化、契約不履行等により損失を被るリスクをいいます。また、その他に、財務内容の悪化等により必要な資金が確保できなくなることで、または資金の確保に通常より著しく高い金利での資金調達を余儀なくされることにより損失を被る可能性がある資金流動性リスクがあります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社グループのリスク管理体制につきましては、取締役会より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・信用リスク管理の基本的手続を定めた「市場リスク管理規程」「信用リスク管理規程」を制定し、当該規程に則った管理体制としております。

市場リスクについては、リスク管理会議において半期毎に、当社グループ全体およびトレーディング業務に従事する各本部に、市場リスク量の上限および損失限度額を設定することにより管理しております。また、主要業務における当社グループ全体の商品流動性に係る枠を設定することにより商品流動性リスクを管理しております。日々の市場リスク量は、バリュアットリスク方式に基づく内部管理モデルにより捉えております。内部管理モデルの妥当性やイベントに対するリスクは、定期的にバックテスト、ストレステストを実施し、確認しております。

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、管理方法を定めております。与信リスクは取引先毎に管理され、与信の供与は、リスク管理会議が決定しております。ただし、リスク管理会議は、限度を定め、信用審査部役員等へ、与信を決定する権限を委譲しております。発行体リスクについては、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、当社グループが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、格付け別の上限額等をリスク管理会議が設定することにより管理しております。カントリーリスクについては、当該国のリスクに晒されているカントリーリスク額に対しリスク管理会議が対象国及びその上限額を設定することにより、当該国毎に管理しております。

また付随するものとして、資金流動性リスクがありますが、上記のリスクと同様に「リスク管理会

議」において、資金流動性リスク管理の基本的手続を定めた「資金流動性リスク管理規程」を制定し、同規程に則った管理体制としております。商品在庫を当社調達力の範囲内に抑える管理として、当社全体の非国債残高に対して、リスク管理会議にて限度枠を設定しております。また資金調達が一時点に集中することを抑える管理として、当社全体の要調達額に対して、リスク管理会議にて限度枠を設定しております。

上記の限度額等の遵守状況は、トレーディング業務に従事する各本部内に所属する、ポジション操作および顧客サービスに直接従事しないフロント管理部署、およびトレーディング業務を行う本部から独立したリスク統括部の双方がモニタリングしております。また、モニタリングの結果は、リスク統括部が直接経営陣に日次で報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価格のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価格が含まれています。当該価格の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価格が異なることもあります。また、「2. 金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における連結貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。((注2)参照)

	連 結 貸 借 対 照 表 計 上 額 (百万円)	時 価 (百万円)	差 額 (百万円)
(1) 現金・預金	168,469	168,469	—
(2) 預託金	91,588	91,588	—
(3) 商品有価証券等	6,538,721	6,538,721	—
(4) 約定見返勘定	109,281	109,281	—
(5) 営業貸付金(*1) 貸倒引当金	1,448 △642		
(6) 信用取引資産	805	805	—
①信用取引貸付金(*1) 貸倒引当金	58,865 45,958 △154	58,865	—
②信用取引借証券担保金	45,803 13,062	45,803 13,062	—
(7) 有価証券担保貸付金	6,765,283	6,765,283	—
①借入有価証券担保金	3,180,267	3,180,267	—
②現先取引貸付金	3,585,015	3,585,015	—
(8) 立替金	4,962	4,962	—
(9) 短期差入保証金	435,248	435,248	—
(10) 短期貸付金(*1) 貸倒引当金	111 △0		
(11) 有価証券、営業投資有価証券等、親会社株式 および投資有価証券	111 823,868	111 828,397	— 4,529
(12) 長期貸付金(*1) 貸倒引当金	3,395 △11		
	3,384	3,505	121
資 産 計	15,000,590	15,005,241	4,650
(1) 商品有価証券等	2,932,436	2,932,436	—
(2) 信用取引負債	23,908	23,908	—
①信用取引借入金	18,254	18,254	—
②信用取引貸証券受入金	5,653	5,653	—
(3) 有価証券担保借入金	8,307,900	8,307,900	—
①有価証券貸借取引受入金	3,038,736	3,038,736	—
②現先取引借入金	5,269,163	5,269,163	—
(4) 預り金	132,382	132,382	—
(5) 受入保証金	438,558	438,558	—
(6) 短期借入金	1,367,784	1,367,784	—
(7) 1年内返済予定の長期借入金	108,058	107,819	△239
(8) コマーシャル・ペーパー	374,700	374,700	—
(9) 1年内償還予定の社債	85,130	85,130	—
(10) 社債	681,530	681,456	△74
(11) 長期借入金	266,947	266,923	△24
負 債 計	14,719,338	14,719,000	△338
デリバティブ取引(*2)			
①ヘッジ会計が適用されていないもの	243,983	243,983	—
②ヘッジ会計が適用されているもの	3,979	3,979	—
デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計	247,963	247,963	—

(*1) 該当科目は、対応する一般貸倒引当金および個別貸倒引当金を控除しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

(注1)．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券およびデリバティブ取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金ならびに(2) 預託金

これらについては、主として約定期間が短期間のもの、あるいは満期のないものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。なお、一部の在外子会社においては、預金に公正価値オプションを適用しており、時価は理論価格によっております。

なお、理論価格を算出する際には、最も適切と考えられるモデルを採用しております。

(3) 商品有価証券等

商品有価証券等については、市場で取引されているものについては、市場取引価格、業者間取引価格、またはこれらに準ずる価格等を時価としております。市場取引価格または業者間取引価格がない場合には理論価格をそれぞれ時価として使用しております。理論価格を算出する際には対象となる商品や取引について最も適切と考えられるモデルを採用しております。

また、当連結会計年度の損益に含まれた評価差額については、「有価証券関係およびデリバティブ取引関係」注記をご参照ください。

(4) 約定見返勘定

当該取引期間は主に短期間であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(5) 営業貸付金

貸倒見積高は、見積将来キャッシュ・フローの現在価値および担保・保証による回収見込額等に基づいて算定しているため、時価は連結決算日における連結貸借対照表計上額から現在の貸倒見積高を控除した金額に近似しており、当該価額を時価としております。

(6) 信用取引資産

信用取引貸付金については、当該取引期間は主に短期間であり、時価は貸倒引当金控除後の帳簿価額と近似していることから、当該価額を時価としております。

信用取引借証券担保金については、当該取引期間は主に短期間であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(7) 有価証券担保貸付金

これらについては当該取引期間は短期間であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。また在外子会社の一部の時価は、対象残高のイールドカーブに基づき算出した現在価値により算出しております。

(8) 立替金、(9) 短期差入保証金ならびに(10) 短期貸付金

これらについては当該取引期間は短期間であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(11) 有価証券、営業投資有価証券等、親会社株式および投資有価証券

これらの時価については、株式は取引所の価格によっており、債券は取引所の価格または取引金融機関から提示された価格によっております。投資信託については、公表されている基準価格によっております。組合出資金については、組合財産を時価評価できるものには時価評価を行ったうえ、当該時価に対する持分相当額を組合出資金の時価とみなして計上しております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係およびデリバティブ取引関係」注記をご参照ください。

(12) 長期貸付金

主に短期間で市場金利を反映する変動金利での貸付であり、主として時価は貸倒引当金控除後の帳簿価額と近似していることから、当該価額を時価としております。

負債

(1) 商品有価証券等

商品有価証券等については、市場で取引されているものについては、市場取引価格、業者間取引価格、またはこれらに準ずる価格等を時価としております。市場取引価格または業者間取引価格がない場合には理論価格をそれぞれ時価として使用しております。理論価格を算出する際には対象となる商品や取引について最も適切と考えられるモデルを採用しております。

また、当連結会計年度の損益に含まれた評価差額については、「有価証券関係およびデリバティブ取引関係」注記をご参照ください。

(2) 信用取引負債

これらは主に短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券担保借入金

これらについては当該取引期間は短期間であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。また在外子会社の一部の時価は、対象残高のイールドカーブに基づき算出した現在価値により算出しております。

(4) 預り金、(5) 受入保証金ならびに(6) 短期借入金

これらは主に短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7) 1年内返済予定の長期借入金ならびに(11)長期借入金

長期借入金のうち、変動金利によるものは、短期間（1年以内）で市場金利を反映し、当社の信用状態が実行後大きく異なっていないかぎり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。なお、一部の長期借入金は、組込デリバティブを区分処理しており、現物負債部分を、変動利率の長期借入金とみなしており、変動金利によるものは、短期間（1年以内）で市場金利を反映し、また、当社の信用状態は借入後大きく異なっていないことから、時価は帳簿価額と近似していると考えられるため、当該帳簿価額によっております。また、変動金利で当社の信用状態が実行時と乖離しているものは、一定の期間ごとに区分した当該長期借入金の元利金の合計額を同様の借入において想定される利率で割引いたものを用いて時価としております。一方、固定金利によるものは、一定期間ごとに区分した当該長期借入金の元利金の合計額を同様の借入において想定される利率で割り引いて現在価値を算定しております。

(8) コマーシャル・ペーパー

コマーシャル・ペーパーは約定期間が短期間（1年以内）であり、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(9) 1年内償還予定の社債ならびに(10) 社債

当社の発行する社債は、組込デリバティブを区分処理しており、現物負債部分を、変動利率の社債とみなしてしております。変動金利によるものは、短期間（1年以内）で市場金利を反映し、また、当社の信用状態は社債発行後大きく異なっていないことから、時価は帳簿価額と近似していると考えられるため、当該帳簿価額によっております。

在外子会社において発行する仕組債の時価は公正価値オプションを適用しており、理論価格によっております。また一部の劣後特約付社債については、理論価格を時価としております。なお、理論価格を算出する際には、最も適切と考えられるモデルを採用しております。

デリバティブ取引

「有価証券関係およびデリバティブ取引関係」注記をご参照ください。

(注2)．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、金融商品の時価情報の「資産(11)有価証券、営業投資有価証券等、親会社株式および投資有価証券」には含まれておりません。

区 分	連結貸借対照表計上額（百万円）
①非上場株式等(*1)	50,603
②組合出資金等(*2)	10,842

(*1) 非上場株式等については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、時価開示の対象としておりません。

(*2) 組合出資金等のうち、組合財産が非上場株式など時価を把握することが極めて困難と認められるもので構成されているものについては、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の連結決算日後の償還予定額

	1年以内 (百万円)	1年超 2年以内 (百万円)	2年超 3年以内 (百万円)	3年超 4年以内 (百万円)	4年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
現金・預金	142,725	—	25,744	—	—	—	—
預託金(*2)	90,381	5	—	—	—	—	—
営業貸付金(*1)	—	—	51	196	46	26	—
信用取引資産	59,020	—	—	—	—	—	—
①信用取引貸付金	45,958	—	—	—	—	—	—
②信用取引借証券担保金	13,062	—	—	—	—	—	—
有価証券担保貸付金	6,786,374	—	31,129	—	—	—	—
①借入有価証券担保金	3,180,267	—	—	—	—	—	—
②現先取引貸付金	3,606,107	—	31,129	—	—	—	—
立替金	4,870	—	—	—	—	—	—
短期差入保証金	435,248	—	—	—	—	—	—
短期貸付金	111	—	—	—	—	—	—
有価証券、営業投資有価証券等 および投資有価証券	317,938	20,860	152,511	7,630	157,655	93,382	—
①満期保有目的の債券	189,940	14,656	139,100	1,100	107,302	—	—
(1)国債・地方債	—	—	—	—	—	—	—
(2)特殊債	9,590	3,156	1,100	—	—	—	—
(3)社債	13,700	11,500	6,000	1,100	—	—	—
(4)外国債券	166,650	—	132,000	—	107,302	—	—
(5)その他	—	—	—	—	—	—	—
②その他有価証券のうち満期 があるもの	127,998	6,204	13,411	6,530	50,352	93,382	—
(1)債券	126,798	6,204	13,411	6,530	50,352	93,382	—
(2)その他	1,200	—	—	—	—	—	—
長期貸付金(*2)	51	31	45	49	79	244	84
合 計	7,836,721	20,896	209,481	7,875	157,781	93,653	84

(*1) 営業貸付金のうち、破産更生債権等、償還予定額が見込めないものについては上表に含めておりません。

(*2) 預託金および長期貸付金のうち、期間の定めのないものについては上表に含めておりません。

(注4) 社債、長期借入金及びその他の有利子負債の連結決算日後の返済予定額

	1年以内 (百万円)	1年超 2年以内 (百万円)	2年超 3年以内 (百万円)	3年超 4年以内 (百万円)	4年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
信用取引負債							
信用取引借入金	18,254	—	—	—	—	—	—
短期借入金	1,367,784	—	—	—	—	—	—
1年以内返済予定の長期借入金	108,058	—	—	—	—	—	—
コマーシャル・ペーパー	374,700	—	—	—	—	—	—
1年以内償還予定の社債	85,130	—	—	—	—	—	—
社債	—	120,799	53,372	57,291	14,985	112,280	322,801
長期借入金	—	31,450	129,419	9,378	34,800	34,000	27,900
合計	1,953,928	152,249	182,791	66,669	49,785	146,280	350,701

(追加情報)

当連結会計年度より「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

(有価証券関係およびデリバティブ取引関係)
前連結会計年度(平成21年3月31日現在)

1. トレーディングに係るもの

(1) トレーディングの状況に関する事項

前連結会計年度
(自 平成20年4月1日
至 平成21年3月31日)

① トレーディングの内容

当社のトレーディング対象商品は、(a)株式や債券に代表される有価証券の現物取引、(b)株価指数の先物取引やオプション取引、国債証券の先物取引や先物オプション取引といった取引所上場の金融派生商品[市場デリバティブ取引、外国市場デリバティブ取引]、(c)スワップ取引、外国為替先物取引、通貨オプション取引、選択権付債券売買、有価証券店頭デリバティブ取引等の取引所上場以外の金融派生商品[店頭デリバティブ取引]の3種類に大別されます。また、その形態はマーケットメイク、バスケット取引、各種裁定取引等多岐にわたります。

② トレーディングに対する取組方針および取引の利用目的

当社は、証券市場を通じ、お客さまの多様なニーズに応じた最良のサービスや商品を提供すること、市場機能を補完すること、更にこれらの結果として生じるポジションのリスクコントロール等を目的としてトレーディングを行っています。

③ トレーディングに係るリスクの内容

トレーディングに伴って発生し、当社の財務状況に大きな影響を与えるリスクは、主として市場リスクと信用リスクがあげられます。市場リスクとは、金利、有価証券の価格、為替等の様々な指標(市場のリスクファクター)の変動により、保有する資産・負債(オフバランス資産・負債を含む)の価値が変動し損失を被るリスク(市場変動リスク)、および市場の混乱や取引の厚み不足等により、必要とされる数量を妥当な水準で取引できないことにより損失を被るリスク(商品流動性リスク)をいいます。信用リスクとは、借入人、有価証券の発行者、市場性取引等のカウンターパーティー等、契約に係る相手先もしくは参照先の財務状況の悪化または契約不履行等により損失を被るリスクをいいます。

④ トレーディングに係るリスク管理体制

トレーディングに係るリスク管理体制につきましては、取締役会より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・信用リスク管理の基本的手続を定めた「市場リスク管理規程」「信用リスク管理規程」を制定し、当該規程に則った管理体制としております。

市場リスクについては、リスク管理会議において半期毎に、当社全体およびトレーディング業務に従事する各本部毎に、市場リスク量の上限および損失限度額を設定することにより管理しております。また、主要業務における当社全体の商品流動性に係る枠を設定することにより管理しております。日々の市場リスク量は、バリュアットリスク方式に基づく内部管理モデルにより捉えております。内部管理モデルの妥当性やイベントに対するリスクは、定期的にバックテスト、ストレステストを実施し、確認しております。

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、管理方法を定めております。与信リスクは取引先毎に管理され、与信の供与は、リスク管理会議が決定しております。ただし、リスク管理会議は、限度を定め、リスク統括部統括役員等へ、与信を決定する権限を委譲しております。発行体リスクについては、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、格付け別の上限額等をリスク管理会議が設定することにより管理しております。カントリーリスクについては、当該国のリスクに晒されているカントリーリスク額に対しリスク管理会議が対象国およびその上限額を設定することにより、当該国毎に管理しております。

上記の限度額等の遵守状況は、トレーディング業務に従事する各本部内に所属する、ポジション操作および顧客サービスに直接従事しないフロント管理部署、およびトレーディング業務を行う本部から独立したリスク統括部の双方がモニタリングしております。また、モニタリングの結果は、リスク統括部が直接経営陣に日次で報告しております。

(2) 有価証券の時価等

種 類	前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	
	資産 (百万円)	負債 (百万円)
株式・ワラント	312,405	16,797
債券	4,490,227	2,196,875
受益証券	155,027	6
その他	45,855	—

(注) 損益に含まれた評価差額は、前連結会計年度△90,730百万円であります。

(3) デリバティブ取引

種 類	前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)			
	資産 (百万円)		負債 (百万円)	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	36,022,386	729,839	47,915,837	840,544
為替予約取引	785,050	30,750	922,272	41,662
先物取引	7,989,822	15,002	5,782,944	60,076
スワップ取引	186,616,173	5,071,894	180,468,988	4,725,742

(注) 1. 時価ならびにみなし決済損益を連結貸借対照表に計上しておりますので、評価損益欄を設けておりません。

2. [先物取引]の項目には、先渡取引も含んでおります。

3. 時価の主な算定方法は以下のとおりです。

前連結会計年度末（平成21年3月31日現在）

時価の主な算定方法は以下のとおりです。

① 株券等

株価指数先物取引	主たる証券取引所が定める清算指数
株券オプション取引、 株価指数オプション取引	主たる証券取引所が定める証拠金算定基準値段
有価証券店頭デリバティブ 取引	金利、配当利回り、ボラティリティ、原証券価額、取引期間等を基に 価格算定モデルにより算出した現在価値

② 債券等

債券先物取引	主たる証券取引所が定める清算値段
金利先物取引	T I F F E が定める清算価格
債券オプション取引	主たる証券取引所が定める証拠金算定基準値段
選択権付債券売買取引	原則として原証券の時価、ボラティリティ、金利を基準として業者間 気配を参考に算出した価格
金利スワップ取引	原則、L I B O R、スワップレート、ボラティリティ、コリレーショ ン等を参考に受取または支払金額の将来価値を算出し、各通貨の金利 で現在価値に割引き、スポットの為替レートで円貨換算して算出した 受取現在価値から支払現在価値を控除した額 ただし、一定の条件下で金銭の相互支払が発生または消滅するような 取引は、受払ネットの金額の確率分布を勘案する

③ その他（通貨）

通貨オプション取引	スワップレート、ボラティリティ、コリレーション等を参考に受取ま たは支払金額の将来価値を算出し、各通貨の金利で現在価値に割引 き、スポットの為替レートで円貨換算して算出した受取現在価値から 支払現在価値を控除した額
為替予約取引	受取金額、支払金額をそれぞれの当該スポットの為替レートまたは、 それに為替直先スプレッドを加算したレートで円貨換算して算出した 受取現在価値から支払現在価値を控除した額
通貨スワップ取引	原則、L I B O R、スワップレート、ボラティリティ、コリレーショ ン等を参考に受取または支払金額の将来価値を算出し、各通貨の金利 で現在価値に割引き、スポットの為替レートで円貨換算して算出した 受取現在価値から支払現在価値を控除した額 ただし、一定の条件下で金銭の相互支払が発生または消滅するような 取引は、受払ネットの金額の確率分布を勘案する

２．トレーディングに係るもの以外
前連結会計年度末（平成21年３月31日現在）
（１）満期保有目的債券で時価のあるもの

種 類	連結貸借対照表計上額 (百万円)	時価（百万円）	差額（百万円）
流動資産に属するもの	16,554	16,579	24
時価が連結貸借対照表計上額を超えるもの	14,752	14,777	25
国債・地方債	—	—	—
特殊債	9,742	9,763	20
社債	5,009	5,014	4
外国債券	—	—	—
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額を超えないもの	1,802	1,801	△0
国債・地方債	—	—	—
特殊債	—	—	—
社債	1,802	1,801	△0
外国債券	—	—	—
その他	—	—	—
固定資産に属するもの	443,065	437,100	△5,965
時価が連結貸借対照表計上額を超えるもの	130,379	131,782	1,402
国債・地方債	—	—	—
特殊債	13,981	14,087	105
社債	28,846	28,996	150
外国債券	87,552	88,698	1,146
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額を超えないもの	312,685	305,317	△7,367
国債・地方債	—	—	—
特殊債	—	—	—
社債	3,636	3,629	△6
外国債券	309,048	301,687	△7,361
その他	—	—	—

(2) その他有価証券で時価のあるもの

種 類	取得原価（百万円）	連結貸借対照表計上額 （百万円）	差額（百万円）
流動資産に属するもの	76,815	76,638	△176
連結貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	21,750	22,083	332
株式	—	—	—
債券	21,750	22,083	332
その他	—	—	—
連結貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	55,065	54,555	△509
株式	1,224	1,127	△96
債券	53,840	53,427	△413
その他	—	—	—
固定資産に属するもの	240,412	220,802	△19,609
連結貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	8,040	11,906	3,866
株式	3,637	7,499	3,861
債券	4,342	4,347	4
その他	60	60	0
連結貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	232,371	208,895	△23,475
株式	21,088	18,297	△2,790
債券	210,495	189,832	△20,662
その他	787	765	△22

(注) 時価のあるその他有価証券のうち、減損処理を行った金額は12,227百万円であり、取得原価には減損処理後の金額を記載しております。なお、時価のある株式については、原則として、連結決算日の時価が取得原価に比べて50%以上下落した全銘柄および30%以上50%未満下落した銘柄のうち回復可能性があると認められるものを除き、減損処理を行っております。

(3) 当連結会計年度中に売却したその他有価証券

売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
16,896	3,095	86

(4) 時価評価されていない主な有価証券の内容および連結貸借対照表計上額

種 類	連結貸借対照表計上額（百万円）
その他有価証券	53,822
流動資産に属するもの	48,948
株式（非上場株式）	45,061
債券（国内債券）	14
その他（受益証券）	934
その他（金銭債権の信託受益権）	2,937
固定資産に属するもの	4,874
株式（非上場株式）	4,874
投資事業有限責任組合等出資	25,791
流動資産に属するもの	19,411
匿名組合出資等	19,411
固定資産に属するもの	6,379
その他	6,379

(5) その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的債券の今後の償還予定額

種 類	1 年以内 （百万円）	1 年超 5 年以内 （百万円）	5 年超 10 年以内 （百万円）	10 年超 （百万円）
債券	83,336	397,246	234,469	—
国債・地方債等	5,740	2,500	119,072	—
特殊債	9,724	15,390	—	—
社債	6,800	44,332	—	—
外国債券	61,072	335,024	115,397	—
その他	—	—	—	—
その他	—	—	—	—

(6) デリバティブ取引の契約額等および時価に関する事項
該当事項はありません。

(7) 流動性が乏しいことその他の事由により金融商品市場において時価で有価証券を売却することが相当期間困難である場合であって、当連結会計年度中に保有目的区分を変更した有価証券

① 売買目的有価証券から満期保有目的の債券への変更

イ. 概要

有価証券の内容	振替時の時価（百万円）
外国債券（物価連動国債）	516,336

ロ. 保有目的区分を変更した日および変更の理由

一部の在外子会社において、「金融商品：認識と測定」（国際会計基準（IAS）第39号 平成20年10月13日改正）を適用し、平成20年7月1日に遡り、一部の売買目的有価証券を満期保有目的の債券へ区分して振替えております。この変更は、世界的な金融市場の混乱を背景に一部の債券の流動性が極端に低下し、極めて稀な状況に至ったため、時価の変動による利益を得ることを目的としなくなったことによるものです。

ハ. 当連結会計年度における損益

有価証券の内容	当連結会計年度の時価評価損益の額（百万円）
外国債券（物価連動国債）	10,647

ニ. 連結決算日における時価および連結貸借対照表計上額

有価証券の内容	時価（百万円）	連結貸借対照表計上額（百万円）
外国債券（物価連動国債）	390,386	396,601

ホ. 保有目的の変更が連結財務諸表に及ぼす影響額

有価証券の内容	当連結会計年度の損益への影響額（百万円）
外国債券（物価連動国債）	△10,449

② 売買目的有価証券からその他有価証券への変更

イ. 概要

有価証券の内容	振替時の時価（百万円）
債券（物価連動国債、米連邦住宅貸付銀行債）	297,911

ロ. 保有目的区分を変更した日および変更の理由

一部の在外子会社において、「金融商品：認識と測定」（国際会計基準（IAS）第39号 平成20年10月13日改正）を適用し、平成20年7月1日に遡り、一部の売買目的有価証券をその他有価証券へ振替えております。この変更は、世界的な金融市場の混乱を背景に一部の債券の流動性が極端に低下し、極めて稀な状況に至ったため、時価の変動による利益を得ることを目的としなくなったことによるものです。

ハ. 当連結会計年度における損益

有価証券の内容	当連結会計年度の時価評価損益の額（百万円）
債券（物価連動国債、米連邦住宅貸付銀行債）	2,755

ニ. 連結決算日における連結貸借対照表計上額

有価証券の内容	連結貸借対照表計上額（百万円）
債券（物価連動国債、米連邦住宅貸付銀行債）	247,762

ホ. 保有目的の変更が連結財務諸表に及ぼす影響額

有価証券の内容	当連結会計年度の損益への影響額（百万円）	当連結会計年度の評価・換算差額等への影響額（百万円）
債券（物価連動国債、米連邦住宅貸付銀行債）	△18,644	18,644

当連結会計年度（平成22年3月31日現在）

（有価証券関係）

1. 商品有価証券等

当連結会計年度の損益に含まれた評価差額 103,199百万円

2. 満期保有目的の債券

	種類	連結貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
時価が連結貸借対照表 計上額を超えるもの	(1) 国債・地方債	—	—	—
	(2) 特殊債	13,895	13,986	91
	(3) 社債	32,410	32,755	344
	(4) 外国債券	165,488	165,493	5
	(5) その他	—	—	—
	小計	211,795	212,235	440
時価が連結貸借対照表 計上額を超えないもの	(1) 国債・地方債	—	—	—
	(2) 特殊債	—	—	—
	(3) 社債	—	—	—
	(4) 外国債券	236,522	234,972	△1,549
	(5) その他	—	—	—
	小計	236,522	234,972	△1,549
合計		448,317	447,208	△1,108

3. その他有価証券

	種類	連結貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
連結貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	12,245	5,944	6,300
	(2) 債券	174,193	173,688	505
	(3) その他	4,152	3,681	470
	小計	190,591	183,315	7,276
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	15,488	17,063	△1,575
	(2) 債券	132,474	136,066	△3,592
	(3) その他	18,557	18,784	△226
	小計	166,520	171,914	△5,394
合計		357,111	355,230	1,881

（注）非上場株式等（連結貸借対照表計上額 49,799百万円）および組合出資金等のうち組合財産が非上場株式等で構成されているもの（連結貸借対照表計上額 10,842百万円）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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

4. 当連結会計年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	4,674	1,662	64
(2) 債券	—	—	—
(3) その他	65	5	—
合計	4,740	1,668	64

5. 減損処理を行った有価証券

当連結会計年度において、有価証券について1,709百万円（その他有価証券の株式1,569百万円、その他有価証券のその他140百万円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、原則として、時価のある有価証券については連結決算日の時価が取得原価と比べて、また時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券については実質価額が取得原価と比べて、50%以上下落した全銘柄および30%以上50%未満下落した銘柄のうち回復可能性があるものと認められるものを除き、減損処理を行っております。

6. 当連結会計年度前に保有目的を変更した有価証券

一部の在外子会社において、平成20年7月1日に遡り、保有目的を変更した一部の売買目的有価証券のうち、当連結会計年度末において「満期保有目的の債券」および「その他有価証券」の区分に計上しているものは、下記のとおりであります。

①売買目的有価証券から満期保有目的の債券への変更

イ. 連結決算日における時価および連結貸借対照表計上額

有価証券の内容	時価（百万円）	連結貸借対照表計上額（百万円）
外国債券（物価連動国債）	400,466	402,010

ロ. 保有目的の変更が連結財務諸表に及ぼす影響額

有価証券の内容	当連結会計年度の損益への影響額 （百万円）	当連結会計年度の評価・換算 差額等への影響額（百万円）
外国債券（物価連動国債）	10,069	△1,165

②売買目的有価証券からその他有価証券への変更

イ. 連結決算日における連結貸借対照表計上額

有価証券の内容	連結貸借対照表計上額（百万円）
債券（物価連動国債）	186,487

ロ. 保有目的の変更が連結財務諸表に及ぼす影響額

有価証券の内容	当連結会計年度の損益への影響額 （百万円）	当連結会計年度の評価・換算 差額等への影響額（百万円）
債券（物価連動国債）	11,363	4,659

(デリバティブ取引関係)

① ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの連結決算日における契約額または契約において定められた元本相当額、時価および評価損益ならびに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

(a) 金利関連取引

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	金利先物	売建	2,682,994	1,426,809	3,701	3,701
		買建	3,533,809	3,288,028	△11,519	△11,519
	金利オプション	売建	56,617	—	△49	31
		買建	56,175	2,059	285	△276
市場取引以外の取引	金利先渡契約	売建	10,262,056	58,612	1,564	1,564
		買建	12,092,539	58,612	△1,303	△1,303
	金利スワップ	受取固定・ 支払変動	158,764,748	115,459,585	2,723,684	2,723,684
		受取変動・ 支払固定	163,505,894	115,682,776	△2,583,705	△2,583,705
		受取変動・ 支払変動	14,398,301	9,280,479	34,400	34,400
		受取固定・ 支払固定	468,048	454,652	△5,526	△5,526
	金利スワップション	売建	57,065,344	40,586,262	△538,424	△38,387
		買建	39,582,073	20,874,473	541,597	59,751
	その他	売建	3,990,036	3,509,764	△24,241	△836
		買建	2,449,216	2,078,385	23,839	5,446
合計			—	—	164,302	187,024

(注) 時価の算定方法

市場取引については、東京金融取引所等が定める清算価格によっております。

市場取引以外の取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(b) 通貨関連取引

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	通貨スワップ		13,028,643	11,133,920	122,913	122,913
	為替予約	売建	1,038,959	156,549	△20,154	△20,154
		買建	579,356	156,355	△5,120	△5,120
	通貨オプション	売建	2,122,093	1,372,723	△174,915	△88,608
		買建	1,986,923	1,476,817	152,124	80,830
合計			—	—	74,847	89,861

(注) 時価の算定方法

割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(c) 株式関連取引

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1 年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株式指数先物	売建	589,812	—	△47,820	△47,820
		買建	58,913	—	841	841
	株式指数 オプション	売建	187,032	49,371	△12,491	1,221
		買建	225,035	42,955	11,853	△2,523
市場取引以外の 取引	有価証券 店頭オプション	売建	394,373	220,888	△43,660	△3,052
		買建	249,702	129,634	29,835	1,812
	有価証券店頭 指数等スワップ	株価指数変化率 受取・金利支払	124,539	123,337	△7,165	△7,165
		金利受取・株価 指数変化率支払	212,753	207,864	25,936	25,936
	有価証券店頭 指数等先渡取引	売建	3,931	—	△289	△289
		買建	3,809	—	283	283
合計			—	—	△42,677	△30,756

(注) 時価の算定方法

市場取引については、東京証券取引所等が定める清算指数によっております。

市場取引以外の取引については、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(d) 債券関連取引

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1 年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	債券先物	売建	414,910	147,298	2,821	2,821
		買建	343,082	63,767	△669	△669
	債券先物 オプション	売建	164,753	12,501	△458	203
		買建	69,179	67,779	3	△35
市場取引以外 の取引	債券店頭 オプション	売建	378,429	327,849	△720	1,730
		買建	197,338	151,699	354	89
	債券店頭 スワップ	受取変動・ 支払固定	3,000	3,000	△55	△55
		受取変動・ 支払変動	132,000	132,000	△2,781	△2,781
合計			—	—	△1,505	1,305

(注) 時価の算定方法

市場取引については、東京証券取引所等が定める清算値段によっております。

市場取引以外の取引については、オプション価格計算モデル等により算定しております。

(e) 商品関連取引

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1 年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	商品先物	売建	40,278	18,626	△3,401	△3,401
		買建	82,247	32,618	6,076	6,076
	商品オプション	売建	58,297	23,057	△2,295	1,242
		買建	36,540	16,161	3,950	31
市場取引以外の取引	商品スワップ	商品指数変化率 受取・金利支払	241,818	135,564	△39,201	△39,201
		金利受取・商品 指数変化率支払	161,834	99,936	90,405	90,405
	商品オプション	売建	207,606	92,272	△23,352	△21,439
		買建	240,807	119,359	22,617	19,491
合計			—	—	54,799	53,206

(注) 1 時価の算定方法

市場取引については、国際石油取引所等における最終の価格によっております。

市場取引以外の取引については、取引対象物の価格、契約期間、その他当該取引に係る契約を構成する要素に基づき算定しております。

2 商品は主に石油に係るものであります。

(f) クレジットデリバティブ取引

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1 年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	クレジット・デ フォルト・オブ ション	売建	3,086,633	2,326,508	6,946	6,946
		買建	2,769,281	1,947,245	△3,027	△3,027
	トータル・レート ・オブ・リターン スワップ	売建	—	—	—	—
		買建	25,701	—	△8,799	△8,799
合計			—	—	△4,880	△4,880

(注) 1 時価の算定方法

割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

2 「売建」は信用リスクの引受取引、「買建」は信用リスクの引渡取引であります。

(g) その他

区分	種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超のもの (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	ウェザー・ デリバティブ	売建	14	—	1	1
		買建	—	—	—	—
	地震 デリバティブ	売建	8,694	8,694	△923	△923
		買建	8,694	8,694	21	21
合計			—	—	△900	△900

(注) 時価の算定方法

割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

②ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの連結決算日における契約額または契約において定められた元本相当額、時価ならびに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

(a) 金利関連取引

ヘッジ会計の方法	種類		主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超のもの (百万円)	時価 (百万円)
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	金利スワップ	受取固定・支払変動	その他有価証券	6,863	6,863	407
		受取変動・支払固定		193,160	43,558	△5,787
		受取固定・支払固定		101,836	29,152	6,254
金利スワップの特例処理	金利スワップ	受取固定・支払変動	借入金	22,000	—	—
合計				—	—	874

(注) 時価の算定方法
割引現在価値等により算定しております。

(b) 通貨関連取引

ヘッジ会計の方法	種類		主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超のもの (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約 (為替スワップ取引)	売建	その他有価証券	427	—	24
ヘッジ対象に係る損益を認識する方法	為替予約 (為替スワップ取引)	売建	在外子会社等に対する投資への持分	53,815	—	3,080
合計				—	—	3,104

(注) 時価の算定方法
割引現在価値等により算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社および一部の国内連結子会社は、キャッシュバランス型の確定給付企業年金制度および確定拠出年金制度を採用しております。

また、一部の海外子会社でも確定給付型および確定拠出型の制度を設けております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在) (百万円)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在) (百万円)
イ. 退職給付債務	△51,350	△57,629
ロ. 年金資産	38,540	47,212
ハ. 未積立退職給付債務 (イ+ロ)	△12,809	△10,416
ニ. 未認識数理計算上の差異	6,740	2,229
ホ. 未認識過去勤務債務 (債務の減額)	△3,015	△2,586
ヘ. 連結貸借対照表計上額純額 (ハ+ニ+ホ)	△9,084	△10,773
ト. 前払年金費用	84	—
チ. 退職給付引当金 (ヘ+ト)	△9,168	△10,773

(注) 一部の連結子会社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

3. 退職給付費用に関する事項

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) (百万円)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) (百万円)
イ. 勤務費用	3,499	3,217
ロ. 利息費用	1,338	1,398
ハ. 期待運用収益	△1,291	△742
ニ. 数理計算上の差異の費用処理額	704	2,272
ホ. 過去勤務債務の費用処理額	△430	△428
ヘ. 退職給付費用 (イ+ロ+ハ+ニ+ホ)	3,820	5,716
ト. その他	939	1,034
チ. 計	4,759	6,750

(注) 1. 「ト. その他」は主として確定拠出型年金への掛金拠出額であります。

2. 簡便法を採用している連結子会社の退職給付費用は、「イ. 勤務費用」に計上しております。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在)
イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	期間定額基準
ロ. 割引率 (%)	主として1.8	主として1.7
ハ. 期待運用収益率 (%)	主として1.8	主として0.5
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	12年（発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法によります。）	12年（発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法によります。）
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	主として12年（発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数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 of 翌連結会計年度から費用処理することとしております。）	主として12年（発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数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 of 翌連結会計年度から費用処理することとしております。）

(ストック・オプション等関係)

前連結会計年度(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1. スtock・オプションに係る当連結会計年度における費用計上額及び科目名
販売費・一般管理費(人件費) 16百万円

2. スtock・オプションの内容、規模及びその変動状況
連結子会社(エム・ユー・ハンズオンキャピタル株式会社)

(1) スtock・オプションの内容

	平成12年② ストック・オプション	平成14年 ストック・オプション
付与対象者の区分 および人数	取締役 4名	取締役 3名
	従業員 1名	従業員 14名
株式の種類別の ストック・オプション数 (注)	普通株式 1,200株	普通株式 585株
付与日	平成12年12月18日	平成15年5月20日
権利確定条件	付与日に在籍していること。	付与日に在籍していること。
対象勤務期間	期間の定めはありません。	期間の定めはありません。
権利行使期間	平成14年12月2日から 平成22年12月1日まで	平成16年6月27日から 平成22年12月1日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) スtock・オプションの規模及びその変動状況

当連結会計年度において存在したストック・オプションを対象とし、ストック・オプションの数については、株式数に換算して記載しております。

① スtock・オプションの数

	平成12年② ストック・オプション	平成14年 ストック・オプション
権利確定前 (株)		
前連結会計年度末	—	—
付与	—	—
失効	—	—
権利確定	—	—
未確定残	—	—
権利確定後 (株)		
前連結会計年度末	375	245
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
未行使残	375	245

② 単価情報

	平成12年② ストック・オプション	平成14年 ストック・オプション
権利行使価格 (円)	65,000	120,000
行使時平均株価 (円)	—	—

なお、前連結会計年度において連結子会社として開示していました、パレス・キャピタル・パートナーズA株式会社につきましては、当連結会計年度において、その営業投資先である株式会社フーズネットを吸収合併したことに伴い連結の範囲から除外したことから、当連結会計年度の記載を省略しております。

当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. ストック・オプションに係る当連結会計年度における費用計上額及び科目名
該当事項はありません。

2. ストック・オプションの内容、規模及びその変動状況
連結子会社（エム・ユー・ハンズオンキャピタル株式会社）

(1) ストック・オプションの内容

	平成12年② ストック・オプション	平成14年 ストック・オプション
付与対象者の区分 および人数	取締役 4名	取締役 3名
	従業員 1名	従業員 14名
株式の種類別の ストック・オプション数 (注)	普通株式 1,200株	普通株式 585株
付与日	平成12年12月18日	平成15年5月20日
権利確定条件	付与日に在籍していること。	付与日に在籍していること。
対象勤務期間	期間の定めはありません。	期間の定めはありません。
権利行使期間	平成14年12月2日から 平成22年12月1日まで	平成16年6月27日から 平成22年12月1日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストック・オプションの規模及びその変動状況

当連結会計年度において存在したストック・オプションを対象とし、ストック・オプションの数については、株式数に換算して記載しております。

① ストック・オプションの数

	平成12年② ストック・オプション	平成14年 ストック・オプション
権利確定前 (株)		
前連結会計年度末	—	—
付与	—	—
失効	—	—
権利確定	—	—
未確定残	—	—
権利確定後 (株)		
前連結会計年度末	375	245
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
未行使残	375	245

② 単価情報

	平成12年② ストック・オプション	平成14年 ストック・オプション
権利行使価格 (円)	65,000	120,000
行使時平均株価 (円)	—	—

(税効果会計関係)

前連結会計年度末 (平成21年3月31日現在)	当連結会計年度末 (平成22年3月31日現在)																																																																																																																
1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr> <td>繰越欠損金</td><td>23,344 百万円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>3,739</td></tr> <tr> <td>減価償却費</td><td>4,249</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金</td><td>1,100</td></tr> <tr> <td>賞与引当金</td><td>1,681</td></tr> <tr> <td>減損損失</td><td>3,728</td></tr> <tr> <td>デリバティブプロビジョン</td><td>10,988</td></tr> <tr> <td>有価証券評価損</td><td>4,881</td></tr> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td><td>5,854</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>488</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>6,967</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>67,024</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△51,619</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>15,405</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td><td>△4,069</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△1,542</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△5,611</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td><td>9,794</td></tr> </table> (注) 平成21年3月31日現在の繰延税金資産の純額は連結貸借対照表の以下の項目に含まれております。 <table> <tr> <td>流動資産－繰延税金資産</td><td>11,049 百万円</td></tr> <tr> <td>固定資産－繰延税金資産</td><td>813</td></tr> <tr> <td>流動負債－繰延税金負債</td><td>△13</td></tr> <tr> <td>固定負債－繰延税金負債</td><td>△2,055</td></tr> </table> 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳 税金等調整前当期純損失を計上しているため、該当の記載は行っておりません。	繰延税金資産		繰越欠損金	23,344 百万円	退職給付引当金	3,739	減価償却費	4,249	貸倒引当金	1,100	賞与引当金	1,681	減損損失	3,728	デリバティブプロビジョン	10,988	有価証券評価損	4,881	その他有価証券評価差額金	5,854	未払事業税	488	その他	6,967	繰延税金資産小計	67,024	評価性引当額	△51,619	繰延税金資産合計	15,405	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	△4,069	その他	△1,542	繰延税金負債合計	△5,611	繰延税金資産の純額	9,794	流動資産－繰延税金資産	11,049 百万円	固定資産－繰延税金資産	813	流動負債－繰延税金負債	△13	固定負債－繰延税金負債	△2,055	1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr> <td>繰越欠損金</td><td>23,922 百万円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>4,276</td></tr> <tr> <td>減価償却費</td><td>2,580</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金</td><td>1,116</td></tr> <tr> <td>賞与引当金</td><td>6,199</td></tr> <tr> <td>減損損失</td><td>3,980</td></tr> <tr> <td>デリバティブプロビジョン</td><td>8,771</td></tr> <tr> <td>有価証券評価損</td><td>2,710</td></tr> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td><td>3,465</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>597</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>7,040</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>64,659</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△36,048</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>28,611</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td><td>△5,628</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△2,325</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△7,954</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td><td>20,657</td></tr> </table> (注) 平成22年3月31日現在の繰延税金資産の純額は連結貸借対照表の以下の項目に含まれております。 <table> <tr> <td>流動資産－繰延税金資産</td><td>19,473 百万円</td></tr> <tr> <td>固定資産－繰延税金資産</td><td>5,546</td></tr> <tr> <td>流動負債－繰延税金負債</td><td>－</td></tr> <tr> <td>固定負債－繰延税金負債</td><td>△4,363</td></tr> </table> 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳 <table> <tr> <td></td><td>(%)</td></tr> <tr> <td>法定実効税率</td><td>40.7</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>2.4</td></tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>△4.2</td></tr> <tr> <td>評価性引当額の増減</td><td>△27.1</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△4.2</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>7.6</td></tr> </table>	繰延税金資産		繰越欠損金	23,922 百万円	退職給付引当金	4,276	減価償却費	2,580	貸倒引当金	1,116	賞与引当金	6,199	減損損失	3,980	デリバティブプロビジョン	8,771	有価証券評価損	2,710	その他有価証券評価差額金	3,465	未払事業税	597	その他	7,040	繰延税金資産小計	64,659	評価性引当額	△36,048	繰延税金資産合計	28,611	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	△5,628	その他	△2,325	繰延税金負債合計	△7,954	繰延税金資産の純額	20,657	流動資産－繰延税金資産	19,473 百万円	固定資産－繰延税金資産	5,546	流動負債－繰延税金負債	－	固定負債－繰延税金負債	△4,363		(%)	法定実効税率	40.7	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	2.4	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△4.2	評価性引当額の増減	△27.1	その他	△4.2	税効果会計適用後の法人税等の負担率	7.6
繰延税金資産																																																																																																																	
繰越欠損金	23,344 百万円																																																																																																																
退職給付引当金	3,739																																																																																																																
減価償却費	4,249																																																																																																																
貸倒引当金	1,100																																																																																																																
賞与引当金	1,681																																																																																																																
減損損失	3,728																																																																																																																
デリバティブプロビジョン	10,988																																																																																																																
有価証券評価損	4,881																																																																																																																
その他有価証券評価差額金	5,854																																																																																																																
未払事業税	488																																																																																																																
その他	6,967																																																																																																																
繰延税金資産小計	67,024																																																																																																																
評価性引当額	△51,619																																																																																																																
繰延税金資産合計	15,405																																																																																																																
繰延税金負債																																																																																																																	
その他有価証券評価差額金	△4,069																																																																																																																
その他	△1,542																																																																																																																
繰延税金負債合計	△5,611																																																																																																																
繰延税金資産の純額	9,794																																																																																																																
流動資産－繰延税金資産	11,049 百万円																																																																																																																
固定資産－繰延税金資産	813																																																																																																																
流動負債－繰延税金負債	△13																																																																																																																
固定負債－繰延税金負債	△2,055																																																																																																																
繰延税金資産																																																																																																																	
繰越欠損金	23,922 百万円																																																																																																																
退職給付引当金	4,276																																																																																																																
減価償却費	2,580																																																																																																																
貸倒引当金	1,116																																																																																																																
賞与引当金	6,199																																																																																																																
減損損失	3,980																																																																																																																
デリバティブプロビジョン	8,771																																																																																																																
有価証券評価損	2,710																																																																																																																
その他有価証券評価差額金	3,465																																																																																																																
未払事業税	597																																																																																																																
その他	7,040																																																																																																																
繰延税金資産小計	64,659																																																																																																																
評価性引当額	△36,048																																																																																																																
繰延税金資産合計	28,611																																																																																																																
繰延税金負債																																																																																																																	
その他有価証券評価差額金	△5,628																																																																																																																
その他	△2,325																																																																																																																
繰延税金負債合計	△7,954																																																																																																																
繰延税金資産の純額	20,657																																																																																																																
流動資産－繰延税金資産	19,473 百万円																																																																																																																
固定資産－繰延税金資産	5,546																																																																																																																
流動負債－繰延税金負債	－																																																																																																																
固定負債－繰延税金負債	△4,363																																																																																																																
	(%)																																																																																																																
法定実効税率	40.7																																																																																																																
(調整)																																																																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.4																																																																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△4.2																																																																																																																
評価性引当額の増減	△27.1																																																																																																																
その他	△4.2																																																																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	7.6																																																																																																																

(企業結合等関係)

前連結会計年度(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

共通支配下の取引等

1. 対象となった事業の名称およびその事業の内容、企業結合の法的形式、結合後企業の名称ならびに取引の目的を含む取引の概要

- (1) 対象となった事業の名称およびその事業の内容

事業の名称 当社のプリンシパルインベストメント事業

事業の内容 有価証券その他の金融商品の取得、保有および運用ならびにこれらに対する投資等。

- (2) 企業結合の法的形式

当社を分割会社とし、当社の完全子会社であるMUSプリンシパル・インベストメンツ株式会社(当社の連結子会社)を承継会社とする分社型吸収分割。

- (3) 結合後企業の名称

MUSプリンシパル・インベストメンツ株式会社(当社の連結子会社)

- (4) 取引の目的を含む取引の概要

当社内の複数部署にて実施しているプリンシパルインベストメント事業を集約することにより、業務効率の改善を図るとともに、投資判断の適正性向上等を目的として、当社のプリンシパルインベストメント事業を会社分割(簡易吸収分割)の方法により、当社の連結子会社であるMUSプリンシパル・インベストメンツ株式会社に承継させております。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に係る会計基準」(企業会計審議会 平成15年10月31日)および「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 最終改正平成19年11月15日公表分)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

3. 子会社株式の追加取得に関する事項

取得原価およびその内容

MUSプリンシパル・インベストメンツ株式会社の普通株式 54,379百万円

当連結会計年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

(セグメント情報)

【事業の種類別セグメント情報】

前連結会計年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）および当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社および当社グループは、①有価証券の売買等、②有価証券の売買等の委託の媒介、③有価証券の引受けおよび売出し、④有価証券の募集および売出しの取扱い、⑤有価証券の私募の取扱いなどの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。従って、当社および当社グループの事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しております。

【所在地別セグメント情報】

前連結会計年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

所在地別の純営業収益、販売費・一般管理費、営業利益および資産は次のとおりであります。

	日本 (百万円)	欧州 (百万円)	アジア (百万円)	北米 (百万円)	計 (百万円)	消去または 全社 (百万円)	連結 (百万円)
I 純営業収益および営業損益							
純営業収益							
外部顧客からの 純営業収益	203,745	21,652	2,413	2,161	229,972	—	229,972
セグメント間の 内部純営業収益	8,871	1,493	383	5,820	16,568	(16,568)	—
計	212,616	23,145	2,797	7,981	246,541	(16,568)	229,972
販売費・一般管理 費	235,862	31,821	2,226	5,731	275,641	(17,121)	258,520
営業利益（または 営業損失）	(23,245)	(8,676)	570	2,250	(29,100)	553	(28,547)
II 資産	12,351,276	6,719,992	26,928	595,036	19,693,234	(662,953)	19,030,280

(注) 国または地域の区分の方法および各区分に属する主な国または地域

(1) 国または地域の区分の方法・・・・・・地理的接近度によっております。

(2) 各区分に属する主な国または地域

欧州・・・・・・イギリス、スイス、ドイツ

アジア・・・・・・中国（香港、上海）、シンガポール、インド

北米・・・・・・アメリカ

(3) デリバティブ取引の相殺表示

「連結財務諸表作成のための基本となる事項の変更」に記載のとおり、従来、法的に有効なマスターネットティング契約を有する同一取引先とのデリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債については相殺表示しておりましたが、当社においても親会社との会計方針の統一を図るため信用リスクを適切に表示する観点から検討した結果、デリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債のみを相殺表示する合理性が薄れていると判断し、原則通りこれらの金融資産および金融負債を総額で表示する方法に変更しております。

この結果、従来の表示方法に比して、資産は「日本」で2,618,455百万円、「欧州」で1,731,335百万円それぞれ増加しております。

(4) 国際会計基準第39号「金融商品：認識と測定」

「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」に記載のとおり、当連結会計年度より、一部の在外子会社において、「金融商品：認識と測定」（国際会計基準（IAS）第39号 平成20年10月13日改正）を適用し、一部の売買目的有価証券をその他有価証券および満期保有目的の債券へ振替えております。

なお、これに伴い、当連結会計年度の純営業収益は17,263百万円増加し、営業損失は同額減少しておりますが、この影響は「欧州」におけるものであります。

当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

所在地別の純営業収益、販売費・一般管理費、営業利益および資産は次のとおりであります。

	日本 (百万円)	欧州 (百万円)	アジア (百万円)	北米 (百万円)	計 (百万円)	消去または 全社 (百万円)	連結 (百万円)
I 純営業収益および営業損益							
純営業収益							
外部顧客からの 純営業収益	254,602	20,795	1,009	10,745	287,153	—	287,153
セグメント間の 内部純営業収益	6,296	4,593	395	5,199	16,484	(16,484)	—
計	260,898	25,389	1,404	15,945	303,637	(16,484)	287,153
販売費・一般管理 費	232,395	34,101	2,433	10,962	279,892	(16,788)	263,103
営業利益（または 営業損失）	28,503	(8,712)	(1,029)	4,983	23,745	304	24,049
II 資産	12,878,616	6,817,596	21,394	1,637,066	21,354,673	(1,219,959)	20,134,713

（注）国または地域の区分の方法および各区分に属する主な国または地域

（１）国または地域の区分の方法・・・・・・地理的接近度によっております。

（２）各区分に属する主な国または地域

欧州・・・・・・イギリス、スイス、ドイツ

アジア・・・・・・中国（香港、上海）、シンガポール、インド

北米・・・・・・アメリカ

【海外売上高】

前連結会計年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

当社および連結子会社の本邦以外の国または地域からの純営業収益（連結会社間の内部収益を除く）は次のとおりであります。

	欧州 (百万円)	その他の地域 (百万円)	計 (百万円)
I 海外売上高（純営業収益）	20,209	4,170	24,380
II 連結純営業収益			229,972
III 連結純営業収益に占める 海外売上高の割合	8.8%	1.8%	10.6%

（注）国または地域の区分の方法および各区分に属する主な国または地域

（1）国または地域の区分の方法・・・・・・地理的接近度によっております。

（2）各区分に属する主な国または地域

欧州・・・・・・イギリス、スイス、ドイツ

その他の地域・・・・・・アメリカ、中国（香港、上海）、シンガポール

当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社および連結子会社の本邦以外の国または地域からの純営業収益（連結会社間の内部収益を除く）は次のとおりであります。

	欧州 (百万円)	その他の地域 (百万円)	計 (百万円)
I 海外売上高（純営業収益）	18,941	12,023	30,964
II 連結純営業収益			287,153
III 連結純営業収益に占める 海外売上高の割合	6.6%	4.2%	10.8%

（注）国または地域の区分の方法および各区分に属する主な国または地域

（1）国または地域の区分の方法・・・・・・地理的接近度によっております。

（2）各区分に属する主な国または地域

欧州・・・・・・イギリス、スイス、ドイツ

その他の地域・・・・・・アメリカ、中国（香港、上海）、シンガポール

【関連当事者情報】

前連結会計年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

（追加情報）

当連結会計年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に加えて、連結財務諸表提出会社の子会社と関連当事者との取引が開示対象に追加されております。

1. 関連当事者との取引

（1）連結財務諸表提出会社と関連当事者との取引

連結財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び連結財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有） 割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,196,295	銀行業	—	資金貸借取引および有価証券の売買等の取引	コール・マネー	391,000	短期借入金	—
							有価証券貸借取引	— (注1)	有価証券貸借取引受入金	599,454
							コマーシャル・ペーパー	477,500	コマーシャル・ペーパー	52,000
							デリバティブ取引（金利スワップ・クレジットデフォルトスワップ）	— (注1)	デリバティブ取引（資産）	1,806,098
							デリバティブ取引（金利スワップ）	— (注1)	デリバティブ取引（負債）	1,377,223
							劣後特約付借入	—	長期借入金	52,000
	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279	信託業 銀行業	—	資金貸借取引	コール・マネー	400,000	短期借入金	—
							有価証券貸借取引	— (注1)	有価証券貸借取引受入金	49,974

（注）1. 反復的かつ多額な市場性取引であるため、取引金額については期末残高のみを開示しております。

2. 取引条件および取引条件の決定方針等

取引条件は、市場実勢等を勘案して決定しております。

（2）連結財務諸表提出会社の連結子会社と関連当事者との取引

連結財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び連結財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有） 割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,196,295	銀行業	—	有価証券の売買等の取引	債券現先取引	— (注1)	現先取引貸付金	836,280

（注）1. 反復的かつ多額な市場性取引であるため、取引金額については期末残高のみを開示しております。

2. 取引条件および取引条件の決定方針等

取引条件は、市場実勢等を勘案して決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

㈱三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ

(東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所およびニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

当連結会計年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 連結財務諸表提出会社と関連当事者との取引

連結財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び連結財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有） 割合（％）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958	銀行業	－	資金貸借取引および有価証券の売買等の取引	コール・マネー	180,000	短期借入金	－
							有価証券貸借取引	－ (注１)	借入有価証券担保金	852,591
							有価証券貸借取引	－ (注１)	有価証券貸借取引受入金	1,430,451
							コマーシャル・ペーパー	554,000	コマーシャル・ペーパー	154,000
							デリバティブ取引（金利スワップ・通貨スワップ）	－ (注１)	デリバティブ取引（資産）	1,226,629
							デリバティブ取引（金利スワップ）	－ (注１)	デリバティブ取引（負債）	898,648
							デリバティブ取引（金利スワップ）	－ (注１)	その他の受入保証金	245,940
							劣後特約付借入	－	長期借入金	52,000
		三菱UFJ信託銀行（株）	東京都千代田区	324,279	信託業 銀行業	－	資金貸借取引	コール・マネー	60,000	短期借入金

(注) 1. 反復的かつ多額な市場性取引であるため、取引金額については期末残高のみを開示しております。

2. 取引条件および取引条件の決定方針等

取引条件は、市場実勢等を勘案して決定しております。

(2) 連結財務諸表提出会社の連結子会社と関連当事者との取引

連結財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び連結財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有） 割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958	銀行業	—	有価証券の売買等の取引	債券現先取引	— (注1)	現先取引貸付金	141,801

(注) 1. 反復的かつ多額な市場性取引であるため、取引金額については期末残高のみを開示しております。

2. 取引条件および取引条件の決定方針等

取引条件は、市場実勢等を勘案して決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

㈱三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ

(東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所およびニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
1株当たり純資産額	833.60 円	1株当たり純資産額	889.78 円
1株当たり当期純損失金額	63.34 円	1株当たり当期純利益金額	40.10 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。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額	40.09 円

(注) 1株当たり当期純利益金額または当期純損失金額および潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) (百万円)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) (百万円)
1株当たり当期純利益金額または当期純損失金額		
当期純利益または当期純損失 (△)	△45,417	28,748
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益または当期純損失 (△)	△45,417	28,748
期中平均株式数 (千株)	716,985	716,985
潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額		
当期純利益調整額	—	△1
(うち関連会社の発行する潜在株式による調整額)	(—)	(△1)
普通株式増加数 (千株)	—	—

	前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) (百万円)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) (百万円)
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 ①新株引受権（成功報酬型ワラント） ・付与日 平成12年12月18日 ・行使期限 平成22年12月1日 ・権利行使価格 65,000円 ・当初付与個数 1,200個 ・21年3月末現在個数 375個 ②新株予約権（ストックオプション） ・付与日 平成15年5月20日 ・行使期限 平成22年12月1日 ・権利行使価格 120,000円 ・当初付与個数 585個 ・21年3月末現在個数 245個 パレス・キャピタル・パートナーズA株式会社 平成21年1月1日付で連結の範囲から除外しているため新株予約権の種類および数は記載しておりません。なお、同日付で株式会社フーズネットへ商号を変更しております。 関連会社の発行する新株予約権 Kim Eng Securities (Thailand) Public Company Limited 新株予約権（ストックオプション） ・付与日 平成18年2月22日 ・行使期限 平成22年2月22日 ・権利行使価格 7 パーツ ・当初付与個数 27,250,000個 ・20年12月末 現在個数 5,457,200個	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 ①新株引受権（成功報酬型ワラント） ・付与日 平成12年12月18日 ・行使期限 平成22年12月1日 ・権利行使価格 65,000円 ・当初付与個数 1,200個 ・22年3月末現在個数 375個 ②新株予約権（ストックオプション） ・付与日 平成15年5月20日 ・行使期限 平成22年12月1日 ・権利行使価格 120,000円 ・当初付与個数 585個 ・22年3月末現在個数 245個

(重要な後発事象)

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
	(モルガン・スタンレー証券との統合) 当社の親会社である株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(以下「MUFG」といいます。)と、Morgan Stanley(以下「モルガン・スタンレー」といいます。)は、平成20年10月13日に行われたMUFGによるモルガン・スタンレーへの出資以降、グローバルな戦略的アライアンスの具体化について検討を進めて参りました。このような提携関係の第一歩として、両社および両社のそれぞれの子会社である当社およびモルガン・スタンレー証券株式会社(以下「モルガン・スタンレー証券」といいます。)は、平成21年3月26日、当社とモルガン・スタンレー証券を統合することにつき、覚書を締結いたしました。その後四社間において協議を重ね、昨今のグローバルな金融規制環境の動向等を踏まえ、MUFGとモルガン・スタンレーの両社のネットワークと顧客基盤等を活用した統合効果を最大限発揮できる形態とするため、MUFGと、モルガン・スタンレーは、平成22年3月30日に、当社とモルガン・スタンレー証券の統合に関する統合契約書を締結し、日本における証券事業の統合形態を、平成22年5月1日付で以下のように共同出資による証券会社二社(三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社(以下「MUMSS」といいます。)およびモルガン・スタンレーMUFG証券株式会社(以下「MSMS」といいます。))体制とすることにいたしました。 (1) 当該事象の内容 ア. 統合により発足する証券会社 (ア) 当社の国内の事業とモルガン・スタンレー証券の事業のうち、インベストメントバンキング部門(以下「IB部門」といいます。)を統合することにより、MUFGとモルガン・スタンレーの共同出資会社を設置いたしました。モルガン・スタンレー証券のIB部門は、会社分割(吸収分割)により平成22年5月1日付で共同出資会社に承継されました。 ①会社名(商号)： (和文) 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 (英文) Mitsubishi UFJ Morgan Stanley Securities Co., Ltd. ②本社所在地： 東京都千代田区丸の内二丁目5番2号 ③株主： 当社(議決権保有比率、経済的出資持分とも60%) モルガン・スタンレー・ホールディングス株式会社 (議決権保有比率、経済的出資持分とも40%)

前連結会計年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																					
	④主要役員： <table><tr><th>役 職 名</th><th>英 文 呼 称</th><th>氏 名</th></tr><tr><td>社長</td><td>President & CEO</td><td>秋草 史幸</td></tr><tr><td>副社長 (業務本部、営業本部、法人本部総括)</td><td>Deputy President and CEO of Retail and Middle Market</td><td>中島 秀之</td></tr><tr><td>副社長 (投資銀行本部総括)</td><td>Deputy President and CEO of Investment Banking</td><td>中村 春雄</td></tr><tr><td>副社長 (市場商品本部総括)</td><td>Deputy President and CEO of Sales and Trading</td><td>幡鎌 俊行</td></tr></table> (イ) モルガン・スタンレー証券における、I B部門を除いたセールスアンドトレーディング部門と資本市場（株式・債券引受）部門の事業については、MUF Gからも出資の上、モルガン・スタンレーとMUF Gの共同出資会社といたしました。 ①会社名（商号）： （和文）モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社 （英文）Morgan Stanley MUF G Securities Co., Ltd. ②本社所在地： 東京都渋谷区恵比寿四丁目20番3号 ③株主： モルガン・スタンレー・ホールディングス株式会社 （議決権保有比率：51%） 当社（議決権保有比率：49%） なお、経済的出資持分は、当社とモルガン・スタンレー・ホールディングス株式会社（以下「MS JHD」といいます。）で60％：40％といたしました。 ④主要役員： <table><tr><th>役 職 名</th><th>英 文 呼 称</th><th>氏 名</th></tr><tr><td>社長</td><td>President & CEO</td><td>ジョナサン B. キンドレッド</td></tr></table>	役 職 名	英 文 呼 称	氏 名	社長	President & CEO	秋草 史幸	副社長 (業務本部、営業本部、法人本部総括)	Deputy President and CEO of Retail and Middle Market	中島 秀之	副社長 (投資銀行本部総括)	Deputy President and CEO of Investment Banking	中村 春雄	副社長 (市場商品本部総括)	Deputy President and CEO of Sales and Trading	幡鎌 俊行	役 職 名	英 文 呼 称	氏 名	社長	President & CEO	ジョナサン B. キンドレッド
役 職 名	英 文 呼 称	氏 名																				
社長	President & CEO	秋草 史幸																				
副社長 (業務本部、営業本部、法人本部総括)	Deputy President and CEO of Retail and Middle Market	中島 秀之																				
副社長 (投資銀行本部総括)	Deputy President and CEO of Investment Banking	中村 春雄																				
副社長 (市場商品本部総括)	Deputy President and CEO of Sales and Trading	幡鎌 俊行																				
役 職 名	英 文 呼 称	氏 名																				
社長	President & CEO	ジョナサン B. キンドレッド																				

前連結会計年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
	イ. 統合のスケジュール 平成21年12月1日 「三菱UFJ証券分割準備株式会社」(当社100%出資)設立 平成22年4月1日 当社が会社分割(吸収分割)により中間持株会社制へ移行 ・当社が「三菱UFJ証券ホールディングス株式会社」に商号変更 ・三菱UFJ証券分割準備株式会社が「三菱UFJ証券株式会社」に商号変更 平成22年5月1日 MUF Gとモルガン・スタンレーの共同出資による証券会社2社の発足 ・モルガン・スタンレー証券の会社分割(吸収分割)により、IB部門を三菱UFJ証券株式会社に承継 ・三菱UFJ証券株式会社が「三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社」に商号変更 ・モルガン・スタンレー証券が「モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社」に商号変更 (なお、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社とモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社の最初の営業日は、平成22年5月6日となりました。) ウ. 統合ストラクチャーの概要 本件統合において以下のスキームを採用し、発足する証券会社2社に係る経済的出資持分を、原則として当社とMSJHDで60:40といたしました。 ① 当社とMSJHDは、それぞれMUMSSおよびMSMSの過半数の議決権が付与された株式(当社はMUMSSの議決権総数の60%、MSJHDはMSMSの議決権総数の51%)の直接保有を継続しつつ、MUMSSおよびMSMSが発行するその他の株式をいずれも別途設立する民法上の任意組合(MMパートナーシップ)に現物出資いたしました。本組合に対する組合出資持分については、当社が60%、MSJHDが40%を取得することにより、MUMSSおよびMSMSに係る経済的出資持分比率を当社とMSJHDで60:40といたしました。本組合は当該目的のために組成するもので、本組合はMUF Gおよび当社の子会社となりました。 ② また、本組合が保有するMUMSS株式およびMSMS株式に係る議決権行使に関する組合契約上の取り決めに基づき、本組合を通じて、当社は、MUMSS/MSMSに対する配当請求権の60%に加えてMSMSの議決権の49%を実質的に取得し、MSJHDは、MUMSS/MSMSに対する配当請求権の40%に加えてMUMSSの議決権の40%を実質的に取得いたしました。

前連結会計年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																																						
	③ モルガン・スタンレー証券の I B 部門は、会社分割（吸収割）により平成22年 5 月 1 日付でMUMS S に承継されました。 <table><tr><td>(1) 名 称</td><td>(和文) MM パートナーシップ (英文) MM Partnership</td></tr><tr><td>(2) 根拠法</td><td>民法</td></tr><tr><td>(3) 所在地</td><td>東京都千代田区丸の内二丁目 4 番 1 号</td></tr><tr><td>(4) 事業内容</td><td>MUMS S およびMSMS 株式の保有</td></tr><tr><td>(5) 組合契約の効力 発生日</td><td>平成22年 5 月 1 日</td></tr><tr><td>(6) 持分比率</td><td>当社 60% MS JHD 40%</td></tr><tr><td>(7) 当社と当該会社 との間の関係</td><td>資本関係 当社は本組合の持分の60%を 保有し、本組合はMUFG お よび当社の子会社に該当しま す。 人的関係 記載すべき人的関係はありま せん。 取引関係 記載すべき取引関係はありま せん。</td></tr></table> エ. 発足する証券会社 2 社の概要 <table><tr><td>商号</td><td>三菱UFJモルガ ン・スタンレー証券 株式会社</td><td>モルガン・スタンレ ーMUFG証券株式 会社</td></tr><tr><td>代表者</td><td>取締役社長 秋草 史幸</td><td>代表取締役社長 ジョナサン B. キ ンドレッド</td></tr><tr><td>本社所在地</td><td>東京都千代田区丸の 内二丁目 5 番 2 号</td><td>東京都渋谷区恵比寿 四丁目20番 3 号</td></tr><tr><td>創業年月日</td><td>昭和23年 3 月 4 日</td><td>昭和59年 3 月 6 日</td></tr><tr><td>主な事業内容</td><td>金融商品取引業</td><td>金融商品取引業</td></tr><tr><td>資本金</td><td>30億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td><td>1,261億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td></tr><tr><td>従業員数</td><td>約6,880名 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td><td>約810名 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td></tr><tr><td>決算期</td><td>3 月</td><td>3 月</td></tr></table> なお、統合の相手会社であるモルガン・スタンレー証券の概要 は以下のとおりです。ただし、当社およびモルガン・スタンレー 証券の現在の子会社・関連会社は、原則として統合対象には含ま れません。	(1) 名 称	(和文) MM パートナーシップ (英文) MM Partnership	(2) 根拠法	民法	(3) 所在地	東京都千代田区丸の内二丁目 4 番 1 号	(4) 事業内容	MUMS S およびMSMS 株式の保有	(5) 組合契約の効力 発生日	平成22年 5 月 1 日	(6) 持分比率	当社 60% MS JHD 40%	(7) 当社と当該会社 との間の関係	資本関係 当社は本組合の持分の60%を 保有し、本組合はMUFG お よび当社の子会社に該当しま す。 人的関係 記載すべき人的関係はありま せん。 取引関係 記載すべき取引関係はありま せん。	商号	三菱UFJモルガ ン・スタンレー証券 株式会社	モルガン・スタンレ ーMUFG証券株式 会社	代表者	取締役社長 秋草 史幸	代表取締役社長 ジョナサン B. キ ンドレッド	本社所在地	東京都千代田区丸の 内二丁目 5 番 2 号	東京都渋谷区恵比寿 四丁目20番 3 号	創業年月日	昭和23年 3 月 4 日	昭和59年 3 月 6 日	主な事業内容	金融商品取引業	金融商品取引業	資本金	30億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)	1,261億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)	従業員数	約6,880名 (平成22年 5 月 1 日 現在)	約810名 (平成22年 5 月 1 日 現在)	決算期	3 月	3 月
(1) 名 称	(和文) MM パートナーシップ (英文) MM Partnership																																						
(2) 根拠法	民法																																						
(3) 所在地	東京都千代田区丸の内二丁目 4 番 1 号																																						
(4) 事業内容	MUMS S およびMSMS 株式の保有																																						
(5) 組合契約の効力 発生日	平成22年 5 月 1 日																																						
(6) 持分比率	当社 60% MS JHD 40%																																						
(7) 当社と当該会社 との間の関係	資本関係 当社は本組合の持分の60%を 保有し、本組合はMUFG お よび当社の子会社に該当しま す。 人的関係 記載すべき人的関係はありま せん。 取引関係 記載すべき取引関係はありま せん。																																						
商号	三菱UFJモルガ ン・スタンレー証券 株式会社	モルガン・スタンレ ーMUFG証券株式 会社																																					
代表者	取締役社長 秋草 史幸	代表取締役社長 ジョナサン B. キ ンドレッド																																					
本社所在地	東京都千代田区丸の 内二丁目 5 番 2 号	東京都渋谷区恵比寿 四丁目20番 3 号																																					
創業年月日	昭和23年 3 月 4 日	昭和59年 3 月 6 日																																					
主な事業内容	金融商品取引業	金融商品取引業																																					
資本金	30億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)	1,261億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)																																					
従業員数	約6,880名 (平成22年 5 月 1 日 現在)	約810名 (平成22年 5 月 1 日 現在)																																					
決算期	3 月	3 月																																					

前連結会計年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																		
	<table> <tr> <td>商号</td><td>モルガン・スタンレー証券株式会社</td></tr> <tr> <td>代表者</td><td>代表取締役社長 ジョナサン B. キンドレッド</td></tr> <tr> <td>本社所在地</td><td>東京都渋谷区恵比寿四丁目 20番 3 号</td></tr> <tr> <td>設立年月日</td><td>昭和59年 3 月 6 日</td></tr> <tr> <td>主な事業内容</td><td>金融商品取引業</td></tr> <tr> <td>資本金</td><td>126, 149, 525, 296円 (平成22年 3 月31日現在)</td></tr> <tr> <td>従業員数</td><td>1, 089名 (平成22年 3 月31日現在)</td></tr> <tr> <td>発行済株式総数</td><td>657, 529株</td></tr> <tr> <td>決算期</td><td>3 月</td></tr> </table> (2) 当該注記に関する未確定事項につきましては記載しておりません。	商号	モルガン・スタンレー証券株式会社	代表者	代表取締役社長 ジョナサン B. キンドレッド	本社所在地	東京都渋谷区恵比寿四丁目 20番 3 号	設立年月日	昭和59年 3 月 6 日	主な事業内容	金融商品取引業	資本金	126, 149, 525, 296円 (平成22年 3 月31日現在)	従業員数	1, 089名 (平成22年 3 月31日現在)	発行済株式総数	657, 529株	決算期	3 月
商号	モルガン・スタンレー証券株式会社																		
代表者	代表取締役社長 ジョナサン B. キンドレッド																		
本社所在地	東京都渋谷区恵比寿四丁目 20番 3 号																		
設立年月日	昭和59年 3 月 6 日																		
主な事業内容	金融商品取引業																		
資本金	126, 149, 525, 296円 (平成22年 3 月31日現在)																		
従業員数	1, 089名 (平成22年 3 月31日現在)																		
発行済株式総数	657, 529株																		
決算期	3 月																		

⑤【連結附属明細表】

【社債明細表】

会 社 名	銘 柄	発行年月日	前期末残高 (百万円)	当期末残高 (百万円)	利率 (%)	担 保	償還期限
三菱UFJ証券 株式会社	普通社債 (注) 1	平成20年3月 ～ 平成22年3月	147,807 [26,989]	129,298 [9,139]	0.00～ 1.13	なし	平成21年4月 ～ 平成52年3月
三菱UFJセキュリ ティーズインターナ ショナル	普通社債 (注) 1	平成18年4月 ～ 平成21年12月	25,823 [－]	63,704 [15,126]	0.00～ 4.05	あり	平成22年4月 ～ 平成31年9月
三菱UFJセキュリ ティーズインターナ ショナル	普通社債 (注) 1、2	平成13年7月 ～ 平成21年12月	520,216 (USD214,750千) (EUR3,000千) (AUD34,200千) [21,499]	558,816 (USD253,050千) (EUR4,000千) (AUD54,400千) [55,938]	0.00～ 27.70	なし	平成21年1月 ～ 平成51年7月
三菱UFJセキュリ ティーズインターナ ショナル	劣後社債 (注) 1、2	平成16年12月 ～ 平成21年10月	9,977 (USD15,000千) [4,964]	14,841 (USD5,000千) [4,926]	0.59～ 1.78	なし	平成21年12月 ～ 平成24年11月
合 計	－	－	703,824 [53,453]	766,661 [85,130]	－	－	－

(注) 1. 「当期末残高」欄の〔 〕書きは、1年以内に償還が予定されている金額であります。

2. 「当期末残高」欄の()書きは外貨建社債の金額であります。

3. 連結決算日後5年以内における償還予定額は以下のとおりであります。

1年以内 (百万円)	1年超2年以内 (百万円)	2年超3年以内 (百万円)	3年超4年以内 (百万円)	4年超5年以内 (百万円)
85,130	120,799	53,372	57,291	14,985

【借入金等明細表】

区 分	前期末残高 (百万円)	当期末残高 (百万円)	平均利率 (%)	返済期限
短期借入金	299,304	517,584	0.13	—
1年以内に返済予定の長期借入金	58,653	108,058	0.97	—
1年以内に返済予定のリース債務	1	3	—	—
長期借入金（1年以内に返済予定のものを除く。）	346,185	266,947	1.14	平成23年～ 平成50年
リース債務（1年以内に返済予定のものを除く。）	2	3	—	平成23年～ 平成24年
その他有利子負債				
コマーシャル・ペーパー（1年以内返済）	146,500	374,700	0.14	—
共通担保資金供給オペレーション（1年以内返済）	697,000	850,200	0.11	—
信用取引借入金（1年以内返済）	17,487	18,254	0.97	—
合 計	1,565,134	2,135,751	—	—

（注） 1. 平均利率については、期末借入金残高に対する加重平均利率を記載しております。

2. リース債務の平均利率については、リース料総額に含まれる利息相当額を控除する前の金額でリース債務を連結貸借対照表に計上しているため、記載しておりません。

3. 長期借入金及びリース債務（1年以内に返済予定のものを除く。）の連結決算日後5年以内における返済予定額は以下のとおりであります。

	1年超2年以内 (百万円)	2年超3年以内 (百万円)	3年超4年以内 (百万円)	4年超5年以内 (百万円)
長期借入金	31,450	129,419	9,378	34,800
リース債務	2	0	—	—

（2）【その他】

該当事項はありません。

2 【財務諸表等】
(1) 【財務諸表】
① 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成21年 3 月31日)	当事業年度 (平成22年 3 月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	37,297	71,049
預託金	75,522	90,154
トレーディング商品	※3 8,325,497	※3 8,715,339
商品有価証券等	※1 4,275,764	※1 5,139,303
貸付債権	※11 43,137	※11 31,665
デリバティブ取引	4,006,594	3,544,370
約定見返勘定	446,594	126,350
営業投資有価証券等	3,285	3,252
信用取引資産	42,203	58,010
信用取引貸付金	33,310	44,948
信用取引借証券担保金	8,893	13,062
有価証券担保貸付金	3,362,154	3,037,310
借入有価証券担保金	2,729,917	2,891,146
現先取引貸付金	※5 632,237	※5 146,163
立替金	480	355
顧客への立替金	452	280
その他の立替金	28	75
短期差入保証金	215,764	185,929
支払差金勘定	31,057	48,441
短期貸付金	112	131
親会社株式	293	302
前払金	204	98
前払費用	1,873	1,265
未収入金	※6 1,686	73
未収還付法人税等	1,687	775
未収収益	17,905	20,980
繰延税金資産	10,191	13,719
その他の流動資産	55	23
貸倒引当金	△91	△313
流動資産計	12,573,775	12,373,250
固定資産		
有形固定資産	※2 21,857	※2 18,917
建物	9,138	8,164
器具備品	7,604	5,590
土地	5,114	5,104
建設仮勘定	—	57
無形固定資産	46,334	41,798
ソフトウェア	45,797	41,282

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成21年3月31日)	当事業年度 (平成22年3月31日)
借家権	147	131
借地権	39	39
電話加入権	346	343
その他	3	1
投資その他の資産	310,659	318,668
投資有価証券	※3 30,605	※3 32,791
関係会社株式	249,388	260,999
その他の関係会社有価証券	1,806	1,474
出資金	27	27
長期貸付金	※12 3,293	※12 3,242
関係会社長期貸付金	7,187	3,892
長期差入保証金	17,074	15,103
長期立替金	689	549
長期前払費用	95	61
その他	4,540	4,432
貸倒引当金	△4,048	△3,905
固定資産計	378,852	379,383
資産合計	12,952,628	12,752,634
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	5,859,821	6,057,866
商品有価証券等	※1 2,122,695	※1 2,719,538
デリバティブ取引	3,737,125	3,338,328
信用取引負債	24,409	23,908
信用取引借入金	※3 17,487	※3 18,254
信用取引貸証券受入金	6,922	5,653
有価証券担保借入金	4,288,798	3,363,677
有価証券貸借取引受入金	3,175,697	2,786,452
現先取引借入金	1,113,101	577,224
預り金	74,609	131,315
顧客からの預り金	56,720	64,464
募集等受入金	11,397	57,858
その他の預り金	6,490	8,992
受入保証金	※5 406,443	305,532
短期借入金	※3 986,200	※3 1,362,700
1年内返済予定の長期借入金	※7 54,500	※7 102,000
コマーシャル・ペーパー	146,500	374,700
1年内償還予定の社債	26,989	9,139
未払金	1,834	※6 5,326
未払費用	16,900	16,204

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成21年3月31日)	当事業年度 (平成22年3月31日)
未払法人税等	1,544	725
賞与引当金	3,445	11,279
その他の流動負債	366	585
流動負債計	11,892,364	11,764,960
固定負債		
社債	125,717	125,058
長期借入金	※7 294,200	※7 221,800
繰延税金負債	809	3,084
退職給付引当金	8,161	8,655
その他の固定負債	1,424	567
固定負債計	430,314	359,166
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	※8 1,864	※8 1,861
特別法上の準備金計	1,864	1,861
負債合計	12,324,543	12,125,987
純資産の部		
株主資本		
資本金	65,518	65,518
資本剰余金		
資本準備金	416,944	416,944
資本剰余金合計	416,944	416,944
利益剰余金		
利益準備金	12,208	12,208
その他利益剰余金		
別途積立金	74,553	74,553
繰越利益剰余金	58,175	54,436
利益剰余金合計	144,937	141,198
株主資本合計	627,400	623,661
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	684	2,985
評価・換算差額等合計	684	2,985
純資産合計	628,084	626,646
負債・純資産合計	12,952,628	12,752,634

②【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業収益		
受入手数料	91,764	109,342
委託手数料	28,407	25,441
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	13,146	25,042
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	18,420	26,663
その他の受入手数料	31,789	32,195
トレーディング損益	※1 45,561	※1 78,918
営業投資有価証券等損益	4,516	378
その他の商品売買損益	4	△9
金融収益	※2 48,656	※2 29,533
営業収益計	190,503	218,163
金融費用	※9 41,415	※9 15,197
純営業収益	149,087	202,965
販売費・一般管理費		
取引関係費	※3 47,811	※3 47,016
人件費	※4 67,541	※4 75,916
不動産関係費	※5 23,141	※5 21,699
事務費	※6 25,365	※6 23,653
減価償却費	18,479	19,462
租税公課	※7 1,998	※7 2,151
貸倒引当金繰入額	2,272	393
その他	※8 4,831	※8 3,345
販売費・一般管理費計	191,442	193,638
営業利益又は営業損失（△）	△42,354	9,327
営業外収益		
受取配当金	3,493	1,907
その他	1,802	1,280
営業外収益計	※14 5,296	※14 3,187
営業外費用		
固定資産除却損	650	412
投資事業有限責任組合等出資損失	735	274
移転関連費用	837	—
その他	1,299	733
営業外費用計	※14 3,522	1,420
経常利益又は経常損失（△）	△40,581	11,094
特別利益		
投資有価証券売却益	70	1,080
固定資産売却益	※10 197	0
金融商品取引責任準備金戻入	874	3
特別利益計	1,142	1,083

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
特別損失		
投資有価証券売却損	24	5
投資有価証券評価損	※11 11,448	※11 619
関係会社株式評価損	9,032	309
固定資産売却損	※12 23	※12 2
減損損失	※13 2,672	※13 956
抱合せ株式消滅差損	※15 320	—
損害賠償金等	—	726
M&A関連損失	—	※14 469
統合関連費用	—	※14, ※16 351
子会社整理損	—	273
特別損失計	23,521	3,714
税引前当期純利益又は税引前当期純損失 (△)	△62,960	8,463
法人税、住民税及び事業税	134	117
過年度法人税等	991	—
法人税等調整額	△6,700	△2,662
法人税等合計	△5,574	△2,545
当期純利益又は当期純損失 (△)	△57,385	11,008

③【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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		
資本準備金		
前期末残高	416,944	416,944
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	416,944	416,944
資本剰余金合計		
前期末残高	416,944	416,944
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	416,944	416,944
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	12,208	12,208
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	12,208	12,208
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	74,553	74,553
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	74,553	74,553
繰越利益剰余金		
前期末残高	119,698	58,175
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失(△)	△57,385	11,008
当期変動額合計	△61,522	△3,739
当期末残高	58,175	54,436
利益剰余金合計		
前期末残高	206,459	144,937
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失(△)	△57,385	11,008
当期変動額合計	△61,522	△3,739
当期末残高	144,937	141,198

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	688,922	627,400
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失 (△)	△57,385	11,008
当期変動額合計	△61,522	△3,739
当期末残高	627,400	623,661
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	1,495	684
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	△810	2,301
当期変動額合計	△810	2,301
当期末残高	684	2,985
評価・換算差額等合計		
前期末残高	1,495	684
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	△810	2,301
当期変動額合計	△810	2,301
当期末残高	684	2,985
純資産合計		
前期末残高	690,418	628,084
当期変動額		
剰余金の配当	△4,137	△14,748
当期純利益又は当期純損失 (△)	△57,385	11,008
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	△810	2,301
当期変動額合計	△62,333	△1,437
当期末残高	628,084	626,646

【重要な会計方針】

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)				
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) 満期保有目的債券 償却原価法（定額法）によっております。 (2) 子会社株式および関連会社株式 移動平均法による原価法によっております。 (3) その他有価証券 ① 時価のあるもの 当期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。 (4) 投資事業有限責任組合等出資 投資事業有限責任組合およびそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な直近の計算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。 3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く。）については、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。 <table data-bbox="244 1496 558 1561"> <tr> <td>建物</td> <td>8～50年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>5～15年</td> </tr> </table>	建物	8～50年	器具備品	5～15年	1. トレーディング商品の評価基準および評価方法 同左 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) 満期保有目的債券 同左 (2) 子会社株式および関連会社株式 同左 (3) その他有価証券 ① 時価のあるもの 同左 ② 時価のないもの 同左 (4) 投資事業有限責任組合等出資 同左 3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 同左
建物	8～50年				
器具備品	5～15年				

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(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（5年）に基づく定額法によっております。 4. 引当金および準備金の計上基準 (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) 役員賞与引当金 役員賞与の支払いに備えるため、支給見込額に基づき計上しております。 (4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当期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。 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の翌事業年度から費用処理することとしております。	(2) 無形固定資産および投資その他の資産 同左 4. 引当金および準備金の計上基準 (1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左 (3) 役員賞与引当金 同左 (4) 退職給付引当金 同左 (会計方針の変更) 当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その3）（企業会計基準第19号 平成20年7月31日）を適用しております。 数理計算上の差異を翌期から償却するため、これによる営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響はありません。 また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額の未処理残高は576百万円であります。

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(5) 役員退職慰労引当金 ————— (追加情報) 従来、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく当事業年度末要支給額を計上していましたが、平成20年6月26日開催の定時株主総会において、役員退職慰労金制度を廃止し、廃止時の要支給額を取締役および監査役の退任時に支給することといたしました。これにより、廃止時における役員退職慰労引当金相当額381百万円を固定負債の「その他の固定負債」に振替えております。 (6) 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。 (追加情報) 従来、証券事故による損失に備えるため、旧証券取引法第51条の規定に基づき、旧「証券会社に関する内閣府令」第35条に定めるところにより算出した額を証券取引責任準備金として計上していましたが、金融商品取引法が施行されたことに伴い、当事業年度より金融商品取引法第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金融商品取引責任準備金として計上しております。 なお、従来と同一の基準によった場合と比較して、当事業年度の特別利益（同責任準備金戻入）が365百万円増加し、税引前当期純損失が365百万円減少しております。	————— (6) 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。

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
5. ヘッジ会計の方法 (1) ヘッジ会計の方法 通貨スワップ取引および為替予約（為替スワップ取引）をヘッジ手段として指定した時価ヘッジを適用しているほか、特例処理の要件を満たしている金利スワップについては、特例処理を採用しております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ア. 為替変動リスク ① ヘッジ手段 通貨スワップ取引および為替予約（為替スワップ取引） ② ヘッジ対象 外貨建金融資産（其他有価証券） イ. 金利変動リスク ① ヘッジ手段 金利スワップ ② ヘッジ対象 借入金 (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、同一通貨の通貨スワップ取引および為替予約（為替スワップ取引）を行っているほか、一部の借入金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 為替変動リスクに対するヘッジについては、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。 なお、金利スワップの特例処理の要件を満たしているものについては、有効性の判定を省略しております。 6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 消費税等の会計処理 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。	5. ヘッジ会計の方法 (1) ヘッジ会計の方法 特例処理の要件を満たしている金利スワップについては、特例処理を採用しております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 金利変動リスク ① ヘッジ手段 金利スワップ取引 ② ヘッジ対象 借入金 (3) ヘッジ方針 一部の借入金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 特例処理によっている金利スワップについては、有効性の判定を省略しております。 6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 消費税等の会計処理 同左

【重要な会計方針の変更】

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(リース取引に関する会計基準) 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当事業年度より「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号(平成5年6月17日(企業会計審議会第一部会)、平成19年3月30日改正))及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号(平成6年1月18日(日本公認会計士協会 会計制度委員会)、平成19年3月30日改正))が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 また、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。 なお、これに伴う損益への影響はありません。 (デリバティブ取引の相殺表示) 従来、法的に有効なマスターネットティング契約を有する同一相手先とのデリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債については相殺表示しておりました。親会社においては当事業年度よりこれらの金融資産および金融負債を総額で表示する方法に変更しております。当社においても親会社との会計方針の統一を図るため信用リスクを適切に表示する観点から検討した結果、デリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債のみを相殺表示する合理性が薄れていると判断し、原則どおりこれらの金融資産および金融負債を総額で表示する方法に変更しております。 この結果、従来の表示方法に比して、デリバティブ取引(資産)およびデリバティブ取引(負債)がそれぞれ2,916,224百万円増加しております。	—————

【表示方法の変更】

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
(貸借対照表) 前事業年度まで流動資産のトレーディング商品の「商品有価証券等」に含めて表示しておりました「貸付債権は、当事業年度より「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」(平成11年総理府・大蔵省令第32号)を適用したことに伴い、区分掲記しております。 なお、前事業年度における「貸付債権」は、37,837百万円であります。 (損益計算書) 前事業年度まで区分掲記しておりました「社債償還益」(当事業年度は0百万円)は、営業外収益の総額の100分の10以下となったため、営業外収益の「その他」に含めて表示しております。	(損益計算書) 前事業年度まで区分掲記しておりました「移転関連費用」(当事業年度は15百万円)は、営業外費用の総額の100分の10以下となったため、営業外費用の「その他」に含めて表示しております。

【注記事項】

(貸借対照表関係)

第4期末 (平成21年3月31日現在)				第5期末 (平成22年3月31日現在)					
※1. トレーディング商品に含まれる商品有価証券等の内訳				※1. トレーディング商品に含まれる商品有価証券等の内訳					
種 類		資産 (百万円)	負債 (百万円)	種 類		資産 (百万円)	負債 (百万円)		
株式		275,579	14,003	株式		457,015	29,654		
債券		3,842,440	2,108,685	債券		4,339,839	2,689,883		
受益証券		155,027	6	受益証券		339,339	—		
その他		2,717	—	その他		3,109	—		
合 計		4,275,764	2,122,695	合 計		5,139,303	2,719,538		
※2. 有形固定資産から控除した減価償却累計額				※2. 有形固定資産から控除した減価償却累計額					
建物		10,421 百万円		建物		11,405 百万円			
器具備品		13,254		器具備品		15,612			
計		23,676		計		27,018			
※3. 担保に供している資産				※3. 担保に供している資産					
科 目		被担保債務期末残高 (百万円)	担保に供している資産		科 目		被担保債務期末残高 (百万円)	担保に供している資産	
			トレーディング商品 (百万円)	計 (百万円)				トレーディング商品 (百万円)	計 (百万円)
短期借入金		697,000	719,759	719,759	短期借入金		850,200	861,431	861,431
共通担保資金供給オペレーション		697,000	719,759	719,759	共通担保資金供給オペレーション		850,200	861,431	861,431
信用取引借入金		17,487	10,396	10,396	信用取引借入金		18,254	12,285	12,285
計		714,487	730,155	730,155	計		868,454	873,716	873,716
注1. 担保に供している資産は期末帳簿価額によるものです。				注1. 担保に供している資産は期末帳簿価額によるものです。					
2. 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303,831百万円を、短期借入金（コール・マネー）の担保として短期借入有価証券15,599百万円を差し入れております。また、先物取引証拠金等の代用として短期借入有価証券48,119百万円、トレーディング商品11,669百万円、投資有価証券9,883百万円、DVP決済等の担保として短期借入有価証券12,270百万円を差し入れております。				2. 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242,948百万円を差し入れております。また、先物取引証拠金等の代用としてトレーディング商品24,112百万円、投資有価証券11,725百万円、短期借入有価証券10,323百万円を、DVP決済等の担保としてトレーディング商品11,993百万円を差し入れております。					

第4期末 (平成21年3月31日現在)	第5期末 (平成22年3月31日現在)																																																				
4. 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。 <table> <tr> <th>種 類</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>差し入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸証券</td><td>7,502</td></tr> <tr> <td>信用取引借入金の本担保証券</td><td>17,487</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td><td>3,170,039</td></tr> <tr> <td>現先取引で売却した有価証券</td><td>1,113,101</td></tr> <tr> <td>その他担保として差し入れた有価証券</td><td>3,539</td></tr> <tr> <td>受け入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸付金の本担保証券</td><td>31,625</td></tr> <tr> <td>信用取引借証券</td><td>8,893</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により借り入れた有価証券</td><td>3,155,627</td></tr> <tr> <td>現先取引で買い付けた有価証券</td><td>632,237</td></tr> <tr> <td>その他担保として受け入れた有価証券</td><td>94,133</td></tr> </table> ※5. 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは以下のとおりであります。 現先取引貸付金 632,237百万円 受入保証金 142,329百万円 ※6. 未収消費税等は「未収入金」に含めて表示しております。 ※7. 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)228,300百万円が含まれております。 ※8. 特別法上の準備金 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は以下のとおりであります。 金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5	種 類	金額 (百万円)	差し入れた有価証券		信用取引貸証券	7,502	信用取引借入金の本担保証券	17,487	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,170,039	現先取引で売却した有価証券	1,113,101	その他担保として差し入れた有価証券	3,539	受け入れた有価証券		信用取引貸付金の本担保証券	31,625	信用取引借証券	8,893	消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,155,627	現先取引で買い付けた有価証券	632,237	その他担保として受け入れた有価証券	94,133	4. 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。 <table> <tr> <th>種 類</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>差し入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸証券</td><td>6,228</td></tr> <tr> <td>信用取引借入金の本担保証券</td><td>18,254</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td><td>2,793,117</td></tr> <tr> <td>現先取引で売却した有価証券</td><td>577,078</td></tr> <tr> <td>その他担保として差し入れた有価証券</td><td>18,234</td></tr> <tr> <td>受け入れた有価証券</td><td></td></tr> <tr> <td>信用取引貸付金の本担保証券</td><td>47,425</td></tr> <tr> <td>信用取引借証券</td><td>13,062</td></tr> <tr> <td>消費貸借契約により借り入れた有価証券</td><td>3,262,225</td></tr> <tr> <td>現先取引で買い付けた有価証券</td><td>145,779</td></tr> <tr> <td>その他担保として受け入れた有価証券</td><td>93,070</td></tr> </table> ※5. 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは以下のとおりであります。 現先取引貸付金 146,163百万円 ※6. 未払消費税等は「未払金」に含めて表示しております。 ※7. 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)228,300百万円が含まれております。 ※8. 特別法上の準備金 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は以下のとおりであります。 同左	種 類	金額 (百万円)	差し入れた有価証券		信用取引貸証券	6,228	信用取引借入金の本担保証券	18,254	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	2,793,117	現先取引で売却した有価証券	577,078	その他担保として差し入れた有価証券	18,234	受け入れた有価証券		信用取引貸付金の本担保証券	47,425	信用取引借証券	13,062	消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,262,225	現先取引で買い付けた有価証券	145,779	その他担保として受け入れた有価証券	93,070
種 類	金額 (百万円)																																																				
差し入れた有価証券																																																					
信用取引貸証券	7,502																																																				
信用取引借入金の本担保証券	17,487																																																				
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,170,039																																																				
現先取引で売却した有価証券	1,113,101																																																				
その他担保として差し入れた有価証券	3,539																																																				
受け入れた有価証券																																																					
信用取引貸付金の本担保証券	31,625																																																				
信用取引借証券	8,893																																																				
消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,155,627																																																				
現先取引で買い付けた有価証券	632,237																																																				
その他担保として受け入れた有価証券	94,133																																																				
種 類	金額 (百万円)																																																				
差し入れた有価証券																																																					
信用取引貸証券	6,228																																																				
信用取引借入金の本担保証券	18,254																																																				
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	2,793,117																																																				
現先取引で売却した有価証券	577,078																																																				
その他担保として差し入れた有価証券	18,234																																																				
受け入れた有価証券																																																					
信用取引貸付金の本担保証券	47,425																																																				
信用取引借証券	13,062																																																				
消費貸借契約により借り入れた有価証券	3,262,225																																																				
現先取引で買い付けた有価証券	145,779																																																				
その他担保として受け入れた有価証券	93,070																																																				

第4期末 (平成21年3月31日現在)	第5期末 (平成22年3月31日現在)																								
9. 当座貸越契約および貸出コミットメント (貸手側) 当社は、連結子会社の三菱UFJセキュリティーズ(香港)と貸出コミットメント契約を締結しております。この契約に基づく当事業年度末の貸出未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>貸出コミットメントの総額</td><td>5,000 百万円</td></tr> <tr> <td>貸出実行残高</td><td>—</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>5,000</td></tr> </table> (借手側) 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行6行と当座貸越契約を締結しております。この契約に基づく当事業年度末の借入未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>当座貸越極度額の総額</td><td>164,350 百万円</td></tr> <tr> <td>借入実行残高</td><td>—</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>164,350</td></tr> </table> 10. 保証債務 (1) 従業員の金融機関からの住宅融資に対する保証債務が11百万円あります。 (2) 三菱UFJセキュリティーズインターナショナルの一部のデリバティブ取引および社債の銀行保証に対して保証を行っております。なお、当事業年度末において当該残高は、それぞれ86,837百万円および5,900百万円であります。 (3) 三菱UFJセキュリティーズインターナショナルの一部の有価証券貸借取引から生じる債務に対して保証を行っております。 なお、当事業年度末において当該残高はございません。 ※11. 貸付債権 貸金業の規制等に関する法律(昭和58年法律第32号)上の貸付債権残高は、22,632百万円であり内容は、証書貸付であります。 ※12. 長期貸付金 貸金業の規制等に関する法律(昭和58年法律第32号)上の長期貸付金残高は、3,000百万円であり内容は、証書貸付であります。	貸出コミットメントの総額	5,000 百万円	貸出実行残高	—	差引額	5,000	当座貸越極度額の総額	164,350 百万円	借入実行残高	—	差引額	164,350	9. 当座貸越契約および貸出コミットメント (貸手側) 当社は、連結子会社の三菱UFJセキュリティーズ(香港)と貸出コミットメント契約を締結しております。この契約に基づく当事業年度末の貸出未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>貸出コミットメントの総額</td><td>5,000 百万円</td></tr> <tr> <td>貸出実行残高</td><td>—</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>5,000</td></tr> </table> (借手側) 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行5行と当座貸越契約を締結しております。この契約に基づく当事業年度末の借入未実行残高は以下のとおりであります。 <table> <tr> <td>当座貸越極度額の総額</td><td>154,350 百万円</td></tr> <tr> <td>借入実行残高</td><td>—</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>154,350</td></tr> </table> 10. 保証債務 (1) 従業員の金融機関からの住宅融資に対する保証債務が8百万円あります。 (2) 三菱UFJセキュリティーズインターナショナルの一部のデリバティブ取引および社債の銀行保証に対して保証を行っております。なお、当事業年度末において当該残高は、それぞれ63,804百万円および1,600百万円であります。 (3) 三菱UFJセキュリティーズインターナショナルの一部の有価証券貸借取引から生じる債務に対して保証を行っております。 なお、当事業年度末において当該残高はございません。 ※11. 貸付債権 貸金業の規制等に関する法律(昭和58年法律第32号)上の貸付債権残高は、20,104百万円であり内容は、証書貸付であります。 ※12. 長期貸付金 貸金業の規制等に関する法律(昭和58年法律第32号)上の長期貸付金残高は、3,000百万円であり内容は、証書貸付であります。	貸出コミットメントの総額	5,000 百万円	貸出実行残高	—	差引額	5,000	当座貸越極度額の総額	154,350 百万円	借入実行残高	—	差引額	154,350
貸出コミットメントの総額	5,000 百万円																								
貸出実行残高	—																								
差引額	5,000																								
当座貸越極度額の総額	164,350 百万円																								
借入実行残高	—																								
差引額	164,350																								
貸出コミットメントの総額	5,000 百万円																								
貸出実行残高	—																								
差引額	5,000																								
当座貸越極度額の総額	154,350 百万円																								
借入実行残高	—																								
差引額	154,350																								

(損益計算書関係)

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)				第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)			
※1. トレーディング損益の内訳				※1. トレーディング損益の内訳			
	実現損益 (百万円)	評価損益 (百万円)	計 (百万円)		実現損益 (百万円)	評価損益 (百万円)	計 (百万円)
株券等トレーディング損益	△22,641	16,611	△6,030	株券等トレーディング損益	32,837	△21,570	11,267
債券等トレーディング損益	24,183	79,208	103,391	債券等トレーディング損益	99,892	△17,742	82,149
その他の トレーディング 損益	△37,035	△14,764	△51,799	その他の トレーディング 損益	9,176	△23,674	△14,497
計	△35,493	81,055	45,561	計	141,906	△62,987	78,918
※2. 金融収益の内訳				※2. 金融収益の内訳			
			(百万円)				(百万円)
信用取引収益			1,915	信用取引収益			1,479
現先取引収益			3,169	現先取引収益			427
有価証券貸借取引収益			18,022	有価証券貸借取引収益			4,930
受取配当金			7,805	受取配当金			8,134
受取債券利子			14,903	受取債券利子			11,381
収益分配金			1,259	収益分配金			2,052
貸付金利息 (注)			587	貸付金利息 (注)			484
その他の受取利息 (注)			511	その他の受取利息			134
その他			480	その他			507
計			48,656	計			29,533
(注) 「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」(平成11年総理府・大蔵省令第32号)の適用に伴い、前事業年度まで「受取利息」に含めて記載しておりました「貸付金利息」および「その他の受取利息」を区分して記載しております。なお、前事業年度の「受取利息」に含まれる「貸付金利息」および「その他の受取利息」は、それぞれ569百万円および705百万円であります。なお、「貸付金利息」に含まれる貸金業の規制等に関する法律(昭和58年法律第32号)上の貸付金利息は、254百万円であります。				(注) 「貸付金利息」に含まれる貸金業の規制等に関する法律(昭和58年法律第32号)上の貸付金利息は、292百万円であります。			
※3. 取引関係費の内訳				※3. 取引関係費の内訳			
			(百万円)				(百万円)
支払手数料			29,512	支払手数料			30,511
取引所・協会費			1,539	取引所・協会費			1,381
通信・運送費			12,218	通信・運送費			11,647
旅費・交通費			2,162	旅費・交通費			1,735
広告宣伝費			1,969	広告宣伝費			1,408
交際費			408	交際費			331
計			47,811	計			47,016

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
※4. 人件費の内訳 (百万円) 報酬・給料 53,055 福利厚生費 7,531 賞与引当金繰入 3,395 退職給付費用 3,432 役員退職慰労引当金繰入 126 計 67,541	※4. 人件費の内訳 (百万円) 報酬・給料 52,223 福利厚生費 8,031 賞与引当金繰入 11,464 退職給付費用 4,196 計 75,916
※5. 不動産関係費の内訳 (百万円) 不動産費 15,031 器具備品費 8,109 計 23,141	※5. 不動産関係費の内訳 (百万円) 不動産費 13,973 器具備品費 7,725 計 21,699
※6. 事務費の内訳 (百万円) 事務委託費 23,491 事務用品費 1,873 計 25,365	※6. 事務費の内訳 (百万円) 事務委託費 22,044 事務用品費 1,609 計 23,653
※7. 租税公課の内訳 (百万円) 源泉所得税 122 印紙税 31 事業所税・事業税 943 その他 899 計 1,998	※7. 租税公課の内訳 (百万円) 源泉所得税 133 印紙税 19 事業所税・事業税 1,103 その他 894 計 2,151
※8. 販売費・一般管理費の「その他」の内訳 (百万円) 教育研修費 316 動力水道光熱費 889 新聞図書費 370 会議費・諸会費 241 寄付金 32 その他 2,981 計 4,831	※8. 販売費・一般管理費の「その他」の内訳 (百万円) 教育研修費 291 動力水道光熱費 818 新聞図書費 277 会議費・諸会費 192 寄付金 78 その他 1,688 計 3,345

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																																																								
※9. 金融費用の内訳 (百万円) <table> <tr><td>信用取引費用</td><td>975</td></tr> <tr><td>現先取引費用</td><td>3,701</td></tr> <tr><td>有価証券貸借取引費用</td><td>21,789</td></tr> <tr><td>借入金利息(注)</td><td>11,666</td></tr> <tr><td>社債利息(注)</td><td>816</td></tr> <tr><td>コマーシャル・ペーパー利息</td><td>729</td></tr> <tr><td>(注)</td><td></td></tr> <tr><td>その他の支払利息(注)</td><td>0</td></tr> <tr><td>その他</td><td>1,736</td></tr> <tr><td>計</td><td>41,415</td></tr> </table> (注)「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」(平成11年総理府・大蔵省令第32号)の適用に伴い、前事業年度まで「支払利息」に含めて記載しておりました「借入金利息」、「社債利息」、「コマーシャルペーパー利息」および「その他の支払利息」を区分して記載しております。なお、前事業年度の「支払利息」に含まれる「借入金利息」、「社債利息」、「コマーシャルペーパー利息」および「その他の支払利息」は、それぞれ11,337百万円、1百万円、1,094百万円および9百万円であります。 ※10. 固定資産売却益の内訳 <table> <tr><td>その他(借地権)</td><td>283百万円</td></tr> <tr><td>建物</td><td>△177百万円</td></tr> <tr><td>土地</td><td>90百万円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>0百万円</td></tr> </table> ※11. 投資有価証券評価損 上場および非上場の投資有価証券について、金融商品に係る会計基準に基づき減損処理を行ったものであります。 ※12. 固定資産売却損の内訳 <table> <tr><td>建物</td><td>12百万円</td></tr> <tr><td>土地</td><td>10百万円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>0百万円</td></tr> </table>	信用取引費用	975	現先取引費用	3,701	有価証券貸借取引費用	21,789	借入金利息(注)	11,666	社債利息(注)	816	コマーシャル・ペーパー利息	729	(注)		その他の支払利息(注)	0	その他	1,736	計	41,415	その他(借地権)	283百万円	建物	△177百万円	土地	90百万円	器具備品	0百万円	建物	12百万円	土地	10百万円	器具備品	0百万円	※9. 金融費用の内訳 (百万円) <table> <tr><td>信用取引費用</td><td>755</td></tr> <tr><td>現先取引費用</td><td>839</td></tr> <tr><td>有価証券貸借取引費用</td><td>7,044</td></tr> <tr><td>借入金利息</td><td>5,149</td></tr> <tr><td>社債利息</td><td>574</td></tr> <tr><td>コマーシャル・ペーパー利息</td><td>336</td></tr> <tr><td>その他の支払利息</td><td>0</td></tr> <tr><td>その他</td><td>498</td></tr> <tr><td>計</td><td>15,197</td></tr> </table> ※11. 投資有価証券評価損 同左 ※12. 固定資産売却損の内訳 <table> <tr><td>投資その他の資産</td><td>2百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td></td></tr> </table>	信用取引費用	755	現先取引費用	839	有価証券貸借取引費用	7,044	借入金利息	5,149	社債利息	574	コマーシャル・ペーパー利息	336	その他の支払利息	0	その他	498	計	15,197	投資その他の資産	2百万円	その他	
信用取引費用	975																																																								
現先取引費用	3,701																																																								
有価証券貸借取引費用	21,789																																																								
借入金利息(注)	11,666																																																								
社債利息(注)	816																																																								
コマーシャル・ペーパー利息	729																																																								
(注)																																																									
その他の支払利息(注)	0																																																								
その他	1,736																																																								
計	41,415																																																								
その他(借地権)	283百万円																																																								
建物	△177百万円																																																								
土地	90百万円																																																								
器具備品	0百万円																																																								
建物	12百万円																																																								
土地	10百万円																																																								
器具備品	0百万円																																																								
信用取引費用	755																																																								
現先取引費用	839																																																								
有価証券貸借取引費用	7,044																																																								
借入金利息	5,149																																																								
社債利息	574																																																								
コマーシャル・ペーパー利息	336																																																								
その他の支払利息	0																																																								
その他	498																																																								
計	15,197																																																								
投資その他の資産	2百万円																																																								
その他																																																									

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																																																					
※13. 減損損失 当期において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しております。	※13. 減損損失 当期において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しております。																																																					
<table><tr><th>場所</th><th>用途</th><th>種類</th><th>減 損 損失額 (百万円)</th></tr><tr><td rowspan="5">東京都 千代田区 他</td><td rowspan="2">業務シス テム</td><td>リース 資産</td><td>78</td></tr><tr><td>ソフト ウェア</td><td>873</td></tr><tr><td rowspan="3">本社オフ イス</td><td>建物</td><td>772</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>99</td></tr><tr><td>電話 加入権</td><td>14</td></tr><tr><td rowspan="3">大阪市中央 区他12箇所</td><td rowspan="3">店舗設備</td><td>土地</td><td>101</td></tr><tr><td>建物</td><td>705</td></tr><tr><td>電話 加入権</td><td>0</td></tr><tr><td>その他</td><td>遊休資産</td><td>土地</td><td>25</td></tr></table>	場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)	東京都 千代田区 他	業務シス テム	リース 資産	78	ソフト ウェア	873	本社オフ イス	建物	772	器具備品	99	電話 加入権	14	大阪市中央 区他12箇所	店舗設備	土地	101	建物	705	電話 加入権	0	その他	遊休資産	土地	25	<table><tr><th>場所</th><th>用途</th><th>種類</th><th>減 損 損失額 (百万円)</th></tr><tr><td>東京都 江東区</td><td>業務シス テム</td><td>ソフト ウェア</td><td>489</td></tr><tr><td rowspan="2">大阪府 高槻市 他14箇所</td><td rowspan="2">店舗設備</td><td>建物</td><td>223</td></tr><tr><td>長期前 払費用</td><td>8</td></tr><tr><td rowspan="2">愛知県 刈谷市 他119箇所</td><td rowspan="2">社名入り 看板・ サイン</td><td>建物</td><td>157</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>67</td></tr><tr><td>その他</td><td>遊休資産</td><td>土地</td><td>10</td></tr></table>	場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)	東京都 江東区	業務シス テム	ソフト ウェア	489	大阪府 高槻市 他14箇所	店舗設備	建物	223	長期前 払費用	8	愛知県 刈谷市 他119箇所	社名入り 看板・ サイン	建物	157	器具備品	67	その他	遊休資産	土地	10
場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)																																																			
東京都 千代田区 他	業務シス テム	リース 資産	78																																																			
		ソフト ウェア	873																																																			
	本社オフ イス	建物	772																																																			
		器具備品	99																																																			
		電話 加入権	14																																																			
大阪市中央 区他12箇所	店舗設備	土地	101																																																			
		建物	705																																																			
		電話 加入権	0																																																			
その他	遊休資産	土地	25																																																			
場所	用途	種類	減 損 損失額 (百万円)																																																			
東京都 江東区	業務シス テム	ソフト ウェア	489																																																			
大阪府 高槻市 他14箇所	店舗設備	建物	223																																																			
		長期前 払費用	8																																																			
愛知県 刈谷市 他119箇所	社名入り 看板・ サイン	建物	157																																																			
		器具備品	67																																																			
その他	遊休資産	土地	10																																																			

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)														
当社は、管理会計制度における管理単位をキャッシュ・フロー生成単位としてホールセールとリテールに分け、それぞれの本部および支店についてグルーピングし、減損の兆候を判断しております。 当事業年度において、業務システムの一部更改による廃止に伴うリース資産・ソフトウェア、本社オフィス集約による退去フロアや店舗網見直しによる廃止予定店舗などの廃棄資産の建物・器具備品・電話加入権について、帳簿価額または未経過リース料を回収可能価額まで減額し、減損損失（1,930百万円）として特別損失に計上しております。 また、世界的な金融市場の混乱を受けた株式相場の下落が経営環境の著しい悪化に該当し減損の兆候があると判断したため、一部の店舗設備のうち保有不動産については回収可能額まで減額し、減損損失（715百万円）として特別損失に計上しております。 当資産グループの回収可能価額のうち、土地・建物・器具備品・電話加入権については正味売却価額により測定しており、土地・建物については不動産鑑定評価額または合理的な見積りにより、器具備品・電話加入権については合理的な見積りにより評価しております。 また、リース資産・ソフトウェアについては使用価値により測定しており、将来キャッシュ・フローを3.5%で割引いて算定しております。 ※14. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 <table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 60%;">関係会社よりの受取配当金</td><td style="text-align: right;">2,469百万円</td></tr> <tr> <td>上記以外の関係会社に係る営業外収益の合計額</td><td style="text-align: right;">588百万円</td></tr> <tr> <td>関係会社に対する営業外費用の合計額</td><td style="text-align: right;">560百万円</td></tr> </table> ※15. 抱合せ株式消滅差損 当社の100%子会社である三菱UFJウェルスマネジメント証券（株）を当社へ吸収合併したことに伴う差損であります。	関係会社よりの受取配当金	2,469百万円	上記以外の関係会社に係る営業外収益の合計額	588百万円	関係会社に対する営業外費用の合計額	560百万円	当社は、管理会計制度における管理単位をキャッシュ・フロー生成単位としてホールセールとリテールに分け、それぞれの本部および支店についてグルーピングし、減損の兆候を判断しております。 当事業年度において、業務システムの一部更改による廃止に伴うソフトウェア、店舗網見直しによる廃止予定店舗の廃棄資産の建物・長期前払費用について、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、減損損失（721百万円）として特別損失に計上しております。 また、モルガン・スタンレー証券株式会社との統合に伴う商号変更により、店舗等の看板・サインの取替えを実施するため、既存の建物・器具備品について帳簿価額を回収可能価額まで減損し、減損損失（224百万円）として特別損失に計上しております。 当資産グループの回収可能価額のうち、建物・器具備品・長期前払費用については正味売却価額により測定しており、合理的な見積りにより評価しております。 また、ソフトウェアについては使用価値により測定しており、将来キャッシュ・フローを2.5%で割引いて算定しております。 ※14. 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 <table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 60%;">関係会社よりの受取配当金</td><td style="text-align: right;">485百万円</td></tr> <tr> <td>上記以外の関係会社に係る営業外収益の合計額</td><td style="text-align: right;">408百万円</td></tr> <tr> <td>M&A関連損失のうち関係会社に対するもの</td><td style="text-align: right;">469百万円</td></tr> <tr> <td>統合関連費用のうち関係会社に対するもの</td><td style="text-align: right;">84百万円</td></tr> </table> ※16. 統合関連費用 当社とモルガン・スタンレー証券株式会社の統合にかかる費用であります。	関係会社よりの受取配当金	485百万円	上記以外の関係会社に係る営業外収益の合計額	408百万円	M&A関連損失のうち関係会社に対するもの	469百万円	統合関連費用のうち関係会社に対するもの	84百万円
関係会社よりの受取配当金	2,469百万円														
上記以外の関係会社に係る営業外収益の合計額	588百万円														
関係会社に対する営業外費用の合計額	560百万円														
関係会社よりの受取配当金	485百万円														
上記以外の関係会社に係る営業外収益の合計額	408百万円														
M&A関連損失のうち関係会社に対するもの	469百万円														
統合関連費用のうち関係会社に対するもの	84百万円														

(株主資本等変動計算書関係)

第4期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

第5期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																																
1. ファイナンス・リース取引 (借主側) 所有権移転外ファイナンス・リース取引 リース取引開始日が、平成20年3月31日以前のリース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっており、その内容は次のとおりであります。 (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額および期末残高相当額	1. ファイナンス・リース取引 (借主側) 所有権移転外ファイナンス・リース取引 同左 (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額および期末残高相当額																																
<table><tr><th></th><th>取得価額相当額 (百万円)</th><th>減価償却累計額相当額 (百万円)</th><th>期末残高相当額 (百万円)</th></tr><tr><td>器具備品</td><td>5,359</td><td>4,182</td><td>1,177</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>15,081</td><td>8,384</td><td>6,696</td></tr><tr><td>合 計</td><td>20,441</td><td>12,567</td><td>7,873</td></tr></table>		取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)	器具備品	5,359	4,182	1,177	ソフトウェア	15,081	8,384	6,696	合 計	20,441	12,567	7,873	<table><tr><th></th><th>取得価額相当額 (百万円)</th><th>減価償却累計額相当額 (百万円)</th><th>期末残高相当額 (百万円)</th></tr><tr><td>器具備品</td><td>3,750</td><td>3,362</td><td>388</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>15,081</td><td>10,527</td><td>4,553</td></tr><tr><td>合 計</td><td>18,831</td><td>13,889</td><td>4,941</td></tr></table>		取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)	器具備品	3,750	3,362	388	ソフトウェア	15,081	10,527	4,553	合 計	18,831	13,889	4,941
	取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)																														
器具備品	5,359	4,182	1,177																														
ソフトウェア	15,081	8,384	6,696																														
合 計	20,441	12,567	7,873																														
	取得価額相当額 (百万円)	減価償却累計額相当額 (百万円)	期末残高相当額 (百万円)																														
器具備品	3,750	3,362	388																														
ソフトウェア	15,081	10,527	4,553																														
合 計	18,831	13,889	4,941																														
(2) 未経過リース料期末残高相当額等 未経過リース料期末残高相当額 1 年内 3,191 百万円 1 年超 5,314 合計 8,505	(2) 未経過リース料期末残高相当額等 未経過リース料期末残高相当額 1 年内 2,659 百万円 1 年超 2,618 合計 5,277																																
(3) 支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額および減損損失 支払リース料 3,806 百万円 リース資産減損勘定の取崩額 844 減価償却費相当額 3,407 支払利息相当額 290 減損損失 78	(3) 支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額および減損損失 支払リース料 3,362 百万円 減価償却費相当額 3,069 支払利息相当額 193																																
(4) 減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	(4) 減価償却費相当額の算定方法 同左																																
(5) 利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額の差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	(5) 利息相当額の算定方法 同左																																
2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 1 年内 4,898 百万円 1 年超 7,650 合計 12,549	2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 1 年内 4,099 百万円 1 年超 4,479 合計 8,579																																

(有価証券関係)

前事業年度 (平成21年 3 月31日)

子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	9,726	9,726	—

(注) 関連会社株式について減損処理を行っております。

当事業年度 (平成22年 3 月31日)

子会社株式および関連会社株式

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	16,541	22,607	6,066

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式および関連会社株式

区分	貸借対照表計上額 (百万円)
子会社株式	243,829
関連会社株式	628

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式および関連会社株式」には含めておりません。

なお、「その他の関係会社有価証券」に計上しているみなし有価証券 (貸借対照表計上額 1,474百万円) は、上表の「時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式および関連会社株式」には含めておりません。

(税効果会計関係)

第4期末 (平成21年3月31日現在)	第5期末 (平成22年3月31日現在)																																																																								
1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 <table> <tr><td>退職給付引当金</td><td>3,321 百万円</td></tr> <tr><td>減価償却費</td><td>1,047</td></tr> <tr><td>貸倒引当金</td><td>1,054</td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td>1,402</td></tr> <tr><td>減損損失</td><td>3,728</td></tr> <tr><td>デリバティブプロビジョン</td><td>10,075</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>4,198</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価損</td><td>4,118</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td>112</td></tr> <tr><td>繰越欠損金</td><td>16,644</td></tr> <tr><td>その他</td><td>5,686</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>51,389</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td>△37,786</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td>13,602</td></tr> </table> 繰延税金負債 <table> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td>△2,807</td></tr> <tr><td>その他</td><td>△1,414</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td>△4,221</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>9,381</td></tr> </table>	退職給付引当金	3,321 百万円	減価償却費	1,047	貸倒引当金	1,054	賞与引当金	1,402	減損損失	3,728	デリバティブプロビジョン	10,075	投資有価証券評価損	4,198	関係会社株式評価損	4,118	未払事業税	112	繰越欠損金	16,644	その他	5,686	繰延税金資産小計	51,389	評価性引当額	△37,786	繰延税金資産合計	13,602	その他有価証券評価差額金	△2,807	その他	△1,414	繰延税金負債合計	△4,221	繰延税金資産の純額	9,381	1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 <table> <tr><td>退職給付引当金</td><td>3,521 百万円</td></tr> <tr><td>減価償却費</td><td>849</td></tr> <tr><td>貸倒引当金</td><td>900</td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td>4,521</td></tr> <tr><td>減損損失</td><td>3,595</td></tr> <tr><td>デリバティブプロビジョン</td><td>7,901</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>1,965</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価損</td><td>4,244</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td>219</td></tr> <tr><td>繰越欠損金</td><td>15,888</td></tr> <tr><td>その他</td><td>6,208</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>49,816</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td>△32,798</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td>17,017</td></tr> </table> 繰延税金負債 <table> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td>△4,180</td></tr> <tr><td>その他</td><td>△2,201</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td>△6,382</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>10,634</td></tr> </table>	退職給付引当金	3,521 百万円	減価償却費	849	貸倒引当金	900	賞与引当金	4,521	減損損失	3,595	デリバティブプロビジョン	7,901	投資有価証券評価損	1,965	関係会社株式評価損	4,244	未払事業税	219	繰越欠損金	15,888	その他	6,208	繰延税金資産小計	49,816	評価性引当額	△32,798	繰延税金資産合計	17,017	その他有価証券評価差額金	△4,180	その他	△2,201	繰延税金負債合計	△6,382	繰延税金資産の純額	10,634
退職給付引当金	3,321 百万円																																																																								
減価償却費	1,047																																																																								
貸倒引当金	1,054																																																																								
賞与引当金	1,402																																																																								
減損損失	3,728																																																																								
デリバティブプロビジョン	10,075																																																																								
投資有価証券評価損	4,198																																																																								
関係会社株式評価損	4,118																																																																								
未払事業税	112																																																																								
繰越欠損金	16,644																																																																								
その他	5,686																																																																								
繰延税金資産小計	51,389																																																																								
評価性引当額	△37,786																																																																								
繰延税金資産合計	13,602																																																																								
その他有価証券評価差額金	△2,807																																																																								
その他	△1,414																																																																								
繰延税金負債合計	△4,221																																																																								
繰延税金資産の純額	9,381																																																																								
退職給付引当金	3,521 百万円																																																																								
減価償却費	849																																																																								
貸倒引当金	900																																																																								
賞与引当金	4,521																																																																								
減損損失	3,595																																																																								
デリバティブプロビジョン	7,901																																																																								
投資有価証券評価損	1,965																																																																								
関係会社株式評価損	4,244																																																																								
未払事業税	219																																																																								
繰越欠損金	15,888																																																																								
その他	6,208																																																																								
繰延税金資産小計	49,816																																																																								
評価性引当額	△32,798																																																																								
繰延税金資産合計	17,017																																																																								
その他有価証券評価差額金	△4,180																																																																								
その他	△2,201																																																																								
繰延税金負債合計	△6,382																																																																								
繰延税金資産の純額	10,634																																																																								
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳 当社は税引前当期純損失を計上しているため、該当の記載は行っておりません。	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳 (%) <table> <tr><td>法定実効税率</td><td>40.7</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>2.7</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>△18.5</td></tr> <tr><td>法人住民税均等割</td><td>1.4</td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td>△58.9</td></tr> <tr><td>その他</td><td>2.5</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>△30.1</td></tr> </table>	法定実効税率	40.7	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	2.7	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△18.5	法人住民税均等割	1.4	評価性引当額の増減	△58.9	その他	2.5	税効果会計適用後の法人税等の負担率	△30.1																																																								
法定実効税率	40.7																																																																								
(調整)																																																																									
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.7																																																																								
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△18.5																																																																								
法人住民税均等割	1.4																																																																								
評価性引当額の増減	△58.9																																																																								
その他	2.5																																																																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	△30.1																																																																								

(企業結合等関係)

前事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

共通支配下の取引等

連結財務諸表「注記事項 (企業結合等関係)」に記載しているため、注記を省略しております。

当事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
1株当たり純資産額	876.01円	1株当たり純資産額	874.00円
1株当たり当期純損失金額	80.04円	1株当たり当期純利益金額	15.35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、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		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、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり当期純利益金額または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。

	第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) (百万円)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) (百万円)
1株当たり当期純利益金額または当期純損失金額		
当期純利益または当期純損失 (△)	△57,385	11,008
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益または当期純損失 (△)	△57,385	11,008
期中平均株式数 (千株)	716,985	716,985

(重要な後発事象)

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
	(モルガン・スタンレー証券との統合) 当社の親会社である株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(以下「MUFG」といいます。)と、Morgan Stanley(以下「モルガン・スタンレー」といいます。)は、平成20年10月13日に行われたMUFGによるモルガン・スタンレーへの出資以降、グローバルな戦略的アライアンスの具体化について検討を進めて参りました。このような提携関係の第一歩として、両社および両社のそれぞれの子会社である当社およびモルガン・スタンレー証券株式会社(以下「モルガン・スタンレー証券」といいます。)は、平成21年3月26日、当社とモルガン・スタンレー証券を統合することにつき、覚書を締結いたしました。その後四社間において協議を重ね、昨今のグローバルな金融規制環境の動向等を踏まえ、MUFGとモルガン・スタンレーの両社のネットワークと顧客基盤等を活用した統合効果を最大限発揮できる形態とするため、MUFGと、モルガン・スタンレーは、平成22年3月30日に、当社とモルガン・スタンレー証券の統合に関する統合契約書を締結し、日本における証券事業の統合形態を、平成22年5月1日付で以下のように共同出資による証券会社二社(三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社(以下「MUMSS」といいます。)およびモルガン・スタンレーMUFG証券株式会社(以下「MSMS」といいます。))体制とすることにいたしました。 (1) 当該事象の内容 ア. 統合により発足する証券会社 (ア) 当社の国内の事業とモルガン・スタンレー証券の事業のうち、インベストメントバンキング部門(以下「IB部門」といいます。)を統合することにより、MUFGとモルガン・スタンレーの共同出資会社を設置いたしました。モルガン・スタンレー証券のIB部門は、会社分割(吸収分割)により平成22年5月1日付で共同出資会社に承継されました。 ①会社名(商号)： (和文) 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 (英文) Mitsubishi UFJ Morgan Stanley Securities Co., Ltd. ②本社所在地： 東京都千代田区丸の内二丁目5番2号 ③株主： 当社(議決権保有比率、経済的出資持分とも60%) モルガン・スタンレー・ホールディングス株式会社 (議決権保有比率、経済的出資持分とも40%)

第4期 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	第5期 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																					
	④主要役員： <table><tr><th>役 職 名</th><th>英 文 呼 称</th><th>氏 名</th></tr><tr><td>社長</td><td>President & CEO</td><td>秋草 史幸</td></tr><tr><td>副社長 (業務本部、営業本部、法人本部総括)</td><td>Deputy President and CEO of Retail and Middle Market</td><td>中島 秀之</td></tr><tr><td>副社長 (投資銀行本部総括)</td><td>Deputy President and CEO of Investment Banking</td><td>中村 春雄</td></tr><tr><td>副社長 (市場商品本部総括)</td><td>Deputy President and CEO of Sales and Trading</td><td>幡鎌 俊行</td></tr></table> (イ) モルガン・スタンレー証券における、I B部門を除いたセールスアンドトレーディング部門と資本市場（株式・債券引受）部門の事業については、MUFGからも出資の上、モルガン・スタンレーとMUFGの共同出資会社といたしました。 ①会社名（商号）： (和文) モルガン・スタンレーMUFG証券株式会社 (英文) Morgan Stanley MUFG Securities Co., Ltd. ②本社所在地： 東京都渋谷区恵比寿四丁目20番3号 ③株主： モルガン・スタンレー・ホールディングス株式会社 (議決権保有比率：51%) 当社（議決権保有比率：49%） なお、経済的出資持分は、当社とモルガン・スタンレー・ホールディングス株式会社（以下「MSJHD」といいます。）で60％：40％といたしました。 ④主要役員： <table><tr><th>役 職 名</th><th>英 文 呼 称</th><th>氏 名</th></tr><tr><td>社長</td><td>President & CEO</td><td>ジョナサン B. キンドレッド</td></tr></table>	役 職 名	英 文 呼 称	氏 名	社長	President & CEO	秋草 史幸	副社長 (業務本部、営業本部、法人本部総括)	Deputy President and CEO of Retail and Middle Market	中島 秀之	副社長 (投資銀行本部総括)	Deputy President and CEO of Investment Banking	中村 春雄	副社長 (市場商品本部総括)	Deputy President and CEO of Sales and Trading	幡鎌 俊行	役 職 名	英 文 呼 称	氏 名	社長	President & CEO	ジョナサン B. キンドレッド
役 職 名	英 文 呼 称	氏 名																				
社長	President & CEO	秋草 史幸																				
副社長 (業務本部、営業本部、法人本部総括)	Deputy President and CEO of Retail and Middle Market	中島 秀之																				
副社長 (投資銀行本部総括)	Deputy President and CEO of Investment Banking	中村 春雄																				
副社長 (市場商品本部総括)	Deputy President and CEO of Sales and Trading	幡鎌 俊行																				
役 職 名	英 文 呼 称	氏 名																				
社長	President & CEO	ジョナサン B. キンドレッド																				

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
	イ. 統合のスケジュール 平成21年12月1日 「三菱UFJ証券分割準備株式会社」(当社100%出資)設立 平成22年4月1日 当社が会社分割(吸収分割)により中間持株会社制へ移行 ・当社が「三菱UFJ証券ホールディングス株式会社」に商号変更 ・三菱UFJ証券分割準備株式会社が「三菱UFJ証券株式会社」に商号変更 平成22年5月1日 MUF Gとモルガン・スタンレーの共同出資による証券会社2社の発足 ・モルガン・スタンレー証券の会社分割(吸収分割)により、IB部門を三菱UFJ証券株式会社に承継 ・三菱UFJ証券株式会社が「三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社」に商号変更 ・モルガン・スタンレー証券が「モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社」に商号変更 (なお、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社とモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社の最初の営業日は、平成22年5月6日となりました。) ウ. 統合ストラクチャーの概要 本件統合において以下のスキームを採用し、発足する証券会社2社に係る経済的出資持分を、原則として当社とMSJHDで60:40といたしました。 ① 当社とMSJHDは、それぞれMUMSSおよびMSMSの過半数の議決権が付与された株式(当社はMUMSSの議決権総数の60%、MSJHDはMSMSの議決権総数の51%)の直接保有を継続しつつ、MUMSSおよびMSMSが発行するその他の株式をいずれも別途設立する民法上の任意組合(MMパートナーシップ)に現物出資いたしました。本組合に対する組合出資持分については、当社が60%、MSJHDが40%を取得することにより、MUMSSおよびMSMSに係る経済的出資持分比率を当社とMSJHDで60:40といたしました。本組合は当該目的のために組成するもので、本組合はMUF Gおよび当社の子会社となりました。 ② また、本組合が保有するMUMSS株式およびMSMS株式に係る議決権行使に関する組合契約上の取り決めに基づき、本組合を通じて、当社は、MUMSS/MSMSに対する配当請求権の60%に加えてMSMSの議決権の49%を実質的に取得し、MSJHDは、MUMSS/MSMSに対する配当請求権の40%に加えてMUMSSの議決権の40%を実質的に取得いたしました。

第 4 期 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	第 5 期 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																																						
	③ モルガン・スタンレー証券の I B 部門は、会社分割（吸収分割）により平成22年 5 月 1 日付でMUMS S に承継されました。 <table><tr><td>(1) 名 称</td><td>(和文) MM パートナークシップ (英文) MM Partnership</td></tr><tr><td>(2) 根拠法</td><td>民法</td></tr><tr><td>(3) 所在地</td><td>東京都千代田区丸の内二丁目 4 番 1 号</td></tr><tr><td>(4) 事業内容</td><td>MUMS S およびMSMS 株式の保有</td></tr><tr><td>(5) 組合契約の効力 発生日</td><td>平成22年 5 月 1 日</td></tr><tr><td>(6) 持分比率</td><td>当社 60% MS JHD 40%</td></tr><tr><td>(7) 当社と当該会社 との間の関係</td><td>資本関係 当社は本組合の持分の60%を 保有し、本組合はMUFG お よび当社の子会社に該当しま す。 人的関係 記載すべき人的関係はありま せん。 取引関係 記載すべき取引関係はありま せん。</td></tr></table> エ. 発足する証券会社 2 社の概要 <table><tr><td>商号</td><td>三菱UFJ モルガ ン・スタンレー証券 株式会社</td><td>モルガン・スタンレ ーMUFG 証券株式 会社</td></tr><tr><td>代表者</td><td>取締役社長 秋草 史幸</td><td>代表取締役社長 ジョナサン B. キ ンドレッド</td></tr><tr><td>本社所在地</td><td>東京都千代田区丸の 内二丁目 5 番 2 号</td><td>東京都渋谷区恵比寿 四丁目 20 番 3 号</td></tr><tr><td>創業年月日</td><td>昭和23年 3 月 4 日</td><td>昭和59年 3 月 6 日</td></tr><tr><td>主な事業内容</td><td>金融商品取引業</td><td>金融商品取引業</td></tr><tr><td>資本金</td><td>30億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td><td>1,261億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td></tr><tr><td>従業員数</td><td>約6,880名 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td><td>約810名 (平成22年 5 月 1 日 現在)</td></tr><tr><td>決算期</td><td>3 月</td><td>3 月</td></tr></table> なお、統合の相手会社であるモルガン・スタンレー証券の概要 は以下のとおりです。ただし、当社およびモルガン・スタンレー 証券の現在の子会社・関連会社は、原則として統合対象には含ま れません。	(1) 名 称	(和文) MM パートナークシップ (英文) MM Partnership	(2) 根拠法	民法	(3) 所在地	東京都千代田区丸の内二丁目 4 番 1 号	(4) 事業内容	MUMS S およびMSMS 株式の保有	(5) 組合契約の効力 発生日	平成22年 5 月 1 日	(6) 持分比率	当社 60% MS JHD 40%	(7) 当社と当該会社 との間の関係	資本関係 当社は本組合の持分の60%を 保有し、本組合はMUFG お よび当社の子会社に該当しま す。 人的関係 記載すべき人的関係はありま せん。 取引関係 記載すべき取引関係はありま せん。	商号	三菱UFJ モルガ ン・スタンレー証券 株式会社	モルガン・スタンレ ーMUFG 証券株式 会社	代表者	取締役社長 秋草 史幸	代表取締役社長 ジョナサン B. キ ンドレッド	本社所在地	東京都千代田区丸の 内二丁目 5 番 2 号	東京都渋谷区恵比寿 四丁目 20 番 3 号	創業年月日	昭和23年 3 月 4 日	昭和59年 3 月 6 日	主な事業内容	金融商品取引業	金融商品取引業	資本金	30億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)	1,261億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)	従業員数	約6,880名 (平成22年 5 月 1 日 現在)	約810名 (平成22年 5 月 1 日 現在)	決算期	3 月	3 月
(1) 名 称	(和文) MM パートナークシップ (英文) MM Partnership																																						
(2) 根拠法	民法																																						
(3) 所在地	東京都千代田区丸の内二丁目 4 番 1 号																																						
(4) 事業内容	MUMS S およびMSMS 株式の保有																																						
(5) 組合契約の効力 発生日	平成22年 5 月 1 日																																						
(6) 持分比率	当社 60% MS JHD 40%																																						
(7) 当社と当該会社 との間の関係	資本関係 当社は本組合の持分の60%を 保有し、本組合はMUFG お よび当社の子会社に該当しま す。 人的関係 記載すべき人的関係はありま せん。 取引関係 記載すべき取引関係はありま せん。																																						
商号	三菱UFJ モルガ ン・スタンレー証券 株式会社	モルガン・スタンレ ーMUFG 証券株式 会社																																					
代表者	取締役社長 秋草 史幸	代表取締役社長 ジョナサン B. キ ンドレッド																																					
本社所在地	東京都千代田区丸の 内二丁目 5 番 2 号	東京都渋谷区恵比寿 四丁目 20 番 3 号																																					
創業年月日	昭和23年 3 月 4 日	昭和59年 3 月 6 日																																					
主な事業内容	金融商品取引業	金融商品取引業																																					
資本金	30億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)	1,261億円 (平成22年 5 月 1 日 現在)																																					
従業員数	約6,880名 (平成22年 5 月 1 日 現在)	約810名 (平成22年 5 月 1 日 現在)																																					
決算期	3 月	3 月																																					

第4期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第5期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																		
	<table border="1"> <tr> <td>商号</td><td>モルガン・スタンレー証券株式会社</td></tr> <tr> <td>代表者</td><td>代表取締役社長 ジョナサン B. キンドレッド</td></tr> <tr> <td>本社所在地</td><td>東京都渋谷区恵比寿四丁目 20番3号</td></tr> <tr> <td>設立年月日</td><td>昭和59年3月6日</td></tr> <tr> <td>主な事業内容</td><td>金融商品取引業</td></tr> <tr> <td>資本金</td><td>126,149,525,296円 (平成22年3月31日現在)</td></tr> <tr> <td>従業員数</td><td>1,089名 (平成22年3月31日現在)</td></tr> <tr> <td>発行済株式総数</td><td>657,529株</td></tr> <tr> <td>決算期</td><td>3月</td></tr> </table> (2) 当該注記に関する未確定事項につきましては記載しておりません。 (会社分割) 当社は、平成21年11月18日開催の当社取締役会において、平成22年4月1日に、当社で行っている事業を会社分割し、予め平成21年12月1日に当社が新設した100%子会社である三菱UFJ証券分割準備株式会社（平成22年4月1日付で「三菱UFJ証券株式会社」に商号変更）以下「新会社」といいます。）に承継させる内容の吸収分割を実施することを決議しました。 また、平成21年12月24日開催の取締役会において、吸収分割契約書を締結することを決議し、平成21年12月25日付で吸収分割契約書を締結いたしました。なお、当該吸収分割契約書に基づき、平成22年4月1日にこれを実行いたしました。 (1) 結合当事企業又は対象となった事業の名称およびその事業の内容 当社の金融商品取引業その他の当社が営む事業（但し、子会社の経営管理事業（子会社間における連携の推進事業、当社の子会社が営む事業に関連する企画管理事業、および当社の親会社との間における子会社の経営管理に関する事項の調整事業を含む。）、当社による子会社への出資事業ならびに当社の子会社が運営その他関与するファンドに係る事業は除く）。	商号	モルガン・スタンレー証券株式会社	代表者	代表取締役社長 ジョナサン B. キンドレッド	本社所在地	東京都渋谷区恵比寿四丁目 20番3号	設立年月日	昭和59年3月6日	主な事業内容	金融商品取引業	資本金	126,149,525,296円 (平成22年3月31日現在)	従業員数	1,089名 (平成22年3月31日現在)	発行済株式総数	657,529株	決算期	3月
商号	モルガン・スタンレー証券株式会社																		
代表者	代表取締役社長 ジョナサン B. キンドレッド																		
本社所在地	東京都渋谷区恵比寿四丁目 20番3号																		
設立年月日	昭和59年3月6日																		
主な事業内容	金融商品取引業																		
資本金	126,149,525,296円 (平成22年3月31日現在)																		
従業員数	1,089名 (平成22年3月31日現在)																		
発行済株式総数	657,529株																		
決算期	3月																		

第 4 期 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	第 5 期 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)
	(2) 企業結合の法的形式 当社を吸収分割会社とし、新会社を吸収分割承継会社とする吸収分割です。 (3) 結合後企業の名称 三菱ＵＦＪ証券株式会社（平成22年 4 月 1 日に、三菱ＵＦＪ証券分割準備株式会社より商号変更、同年 5 月 1 日付で、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社に商号変更） (4) 取引の目的を含む取引の概要 ①吸収分割の目的 モルガン・スタンレーとの戦略的提携準備の一環として当社傘下の証券事業全般に係る経営管理機能と業務執行機能とを分離・集中することにより、迅速な意思決定を実現するため、当社の100%出資により新会社を設立し、現在当社で行っている事業を会社分割（吸収分割）することにより新会社に承継させることを目的として、吸収分割を実施いたしました。 ②吸収分割日 平成22年 4 月 1 日 (5) 実施した会計処理の概要 本吸収分割は、「企業結合に係る会計基準」（企業会計基準21号 平成20年12月26日）および「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 最終改正 平成20年12月26日）に基づき共通支配下の取引として会計処理を行っています。 (6) 子会社株式の追加取得に関する事項 取得原価およびその内容 三菱ＵＦＪ証券株式会社（平成22年 4 月 1 日に、三菱ＵＦＪ証券分割準備株式会社より商号変更、同年 5 月 1 日付で、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社に商号変更）の普通株式 294,629百万円。

④【附属明細表】

【有価証券明細表】

【株式】

銘 柄	株式数 (千株)	貸借対照表計上額 (百万円)
(営業投資有価証券等)		
(その他有価証券)		
5 銘柄	400	122
小 計	400	122
(投資有価証券)		
(その他有価証券)		
カブドットコム証券(株)	20,637	10,401
(株)大阪証券取引所	4	2,347
(株)T & Dホールディングス	1,054	2,334
(株)ニトリ	261	1,855
(株)ワコールホールディングス	788	920
日本証券金融(株)	1,262	867
(株)千葉銀行	1,400	782
三菱UFJメリルリンチPB証券(株)	6	600
出光興産(株)	71	505
亀田製菓(株)	262	437
その他 (206銘柄)	11,415	9,532
小 計	37,164	30,584
合 計	37,564	30,707

【その他】

種類 及び 銘柄	投資口数等 (口)	貸借対照表計上額 (百万円)
(営業投資有価証券等)		
(その他有価証券)		
(投資事業有限責任組合等出資)		
2 銘柄	—	279
(金銭債権の信託受益権)		
農林年金ローン債権信託 劣後受益権	—	2, 224
その他 (5 銘柄)	—	624
小 計	—	3, 129
(投資有価証券)		
(その他有価証券)		
(投資事業有限責任組合等出資)		
MMパートナーシップ (注)	—	2, 018
その他 (1 銘柄)	49	14
(その他)		
2 銘柄	1, 115, 550	174
小 計	—	2, 206
合 計	—	5, 336

(注) 平成22年5月1日に設立した組合の取得に要した支出額を計上しております。

【有形固定資産等明細表】

資産の種類	前期末残高 (百万円)	当期増加額 (百万円)	当期減少額 (百万円)	当期末残高 (百万円)	当期末減価償却累計額または償却累計額 (百万円)	当期償却額 (百万円)	差引当期末残高 (百万円)
有形固定資産							
建物	19,560	744	733 (380)	19,570	11,405	1,322	8,164
器具備品	20,859	949	606 (67)	21,202	15,612	2,818	5,590
土地	5,114	—	10 (10)	5,104	—	—	5,104
建設仮勘定	—	57	—	57	—	—	57
有形固定資産計	45,533	1,751	1,350 (458)	45,935	27,018	4,140	18,917
無形固定資産							
ソフトウェア	85,699	11,507	2,118 (489)	95,089	53,806	15,241	41,282
借家権	224	46	41	229	98	43	131
借地権	39	—	—	39	—	—	39
電話加入権	401	—	12	389	46	3	343
その他	11	—	—	11	10	2	1
無形固定資産計	86,376	11,554	2,171 (489)	95,759	53,961	15,290	41,798
長期前払費用	173	13	60 (8)	125	63	31	61
繰延資産							
—	—	—	—	—	—	—	—
繰延資産計	—	—	—	—	—	—	—

(注) 「当期減少額」欄の()内は内書きで、減損損失の計上額であります。

【引当金明細表】

区 分	前期末残高 (百万円)	当期増加額 (百万円)	当期減少額 (目的使用) (百万円)	当期減少額 (その他) (百万円)	当期末残高 (百万円)
貸倒引当金（注１）	4,140	484	314	90	4,218
賞与引当金（注２）	3,445	11,279	3,439	6	11,279
金融商品取引責任準備金	1,864	56	59	－	1,861

（注１）「当期減少額（その他）」は、洗い替えによるものであります。

（注２）「当期減少額（その他）」は、前事業年度末引当額と実際支給額との差額を戻入れたものであります。

(2) 【主な資産および負債の内容】

平成22年3月31日現在における主な資産および負債の内容は次のとおりであります。

なお、附属明細表において記載した項目については省略いたしました。

① 資産の部

イ. 現金・預金

種 類	金 額 (百万円)
現金	0
預金	
当座預金	43,705
普通預金	12
定期預金	1,864
外貨預金	24,911
その他の預金	556
計	71,049
合 計	71,049

ロ．トレーディング商品
(商品有価証券等)

種 類	数 量	取得価額 (百万円)	貸借対照表計上額 (百万円)
株券			
内国株券	474,043千株	432,920	452,027
外国株券	18,441	4,801	4,988
計	492,484	437,721	457,015
債券			
内国債券			
国債	3,831,844 百万円	3,888,249	3,886,510
地方債	86,954	87,232	86,955
特殊債	132,347	134,923	134,603
社債	72,383	73,945	66,770
外国債券	249,121千US \$ 147,280百万円 110,543千AUD \$ その他	164,349	164,999
計	—	4,348,700	4,339,839
受益証券			
受益証券	1,311,870千口	328,099	339,339
計	1,311,870	328,099	339,339
その他			
信託受益権証書	3,254 百万円	3,257	3,109
計	3,254	3,257	3,109
合 計	—	5,117,778	5,139,303

(貸付債権)

種 類	数 量	取得価額 (百万円)	貸借対照表計上額 (百万円)
金銭債権	31,750百万円	31,763	31,665
合 計	31,750	31,763	31,665

(デリバティブ取引)

種 類	貸借対照表計上額（百万円）
株式オプション取引	35,034
債券オプション取引	355
金利オプション取引	515,148
通貨オプション取引	88,752
株式先物取引	362
債券先物取引	58
金利先物取引	158
金利先渡取引	148
スワップ取引	2,893,638
為替予約取引	10,711
合 計	3,544,370

ハ．信用取引資産

種 類	金額（百万円）
信用取引貸付金（注） 1	44,948
信用取引借証券担保金（注） 2	13,062
合 計	58,010

（注） 1．顧客の信用取引にかかる株式の買付代金相当額であります。

2．貸借取引により証券金融会社に差し入れる借証券担保金であります。

ニ．有価証券担保貸付金

種 類	金額（百万円）
借入有価証券担保金（注） 1	2,891,146
現先取引貸付金（注） 2	146,163
合 計	3,037,310

（注） 1．債券貸借取引等の消費貸借契約に基づき借り入れた有価証券の担保として、相手方に差し入れている担保金であります。

2．売戻条件付債券等売買取引に係る受渡代金相当額であります。

② 負債の部

イ. トレーディング商品

(商品有価証券等)

種 類	数 量	取得価額 (百万円)	貸借対照表計上額 (百万円)
株券			
信用売証券	22,616千株	10,901	11,288
内国株券	26,644	15,639	16,245
外国株券	5,017	2,001	2,120
計	54,278	28,543	29,654
債券			
内国債券			
国債	2,640,163百万円	2,694,716	2,689,843
外国債券	40百万円	40	40
計	2,640,203	2,694,756	2,689,883
合 計	—	2,723,299	2,719,538

(デリバティブ取引)

種 類	貸借対照表計上額（百万円）
株式オプション取引	50,093
債券オプション取引	842
金利オプション取引	507,199
通貨オプション取引	91,025
その他オプション取引	1
株式先物取引	48,100
債券先物取引	7
金利先物取引	174
金利先渡取引	176
スワップ取引	2,626,172
為替予約取引	14,534
合 計	3,338,328

ロ．信用取引負債

種 類	金額（百万円）
信用取引借入金（注） 1	18,254
信用取引貸証券受入金（注） 2	5,653
合 計	23,908

- （注） 1． 貸借取引にかかる証券金融会社からの借入金であります。
 2． 顧客の信用取引にかかる証券の売付代金相当額であります。

ハ．有価証券担保借入金

種 類	金額（百万円）
有価証券貸借取引受入金（注） 1	2,786,452
現先取引借入金（注） 2	577,224
合 計	3,363,677

- （注） 1． 債券貸借取引等の消費貸借契約に基づき貸し付けた有価証券の担保として相手方から受け入れている担保金
 であります。
 2． 買戻条件付債券等売買取引に係る受渡代金相当額であります。

ニ．受入保証金

種 類	金額（百万円）
信用取引受入保証金（注） 1	7, 166
先物取引受入証拠金（注） 2	3, 250
その他の受入保証金（注） 3	295, 115
合 計	305, 532

（注） 1． 顧客から信用取引の委託保証金として受け入れている現金であります。

2． 顧客から先物取引等の委託証拠金として受け入れている現金であります。

3． 顧客から有価証券店頭デリバティブ取引等の委託証拠金として受け入れている現金であります。

ホ．短期借入金

種 類	金額（百万円）
コール・マネー	512, 500
共通担保資金供給オペレーション	850, 200
合 計	1, 362, 700

（3）【その他】

該当事項はありません。

第6【提出会社の株式事務の概要】

事業年度	4月1日から3月31日まで
定時株主総会	6月中
基準日	—
株券の種類	当社は株券を発行していません。
剰余金の配当の基準日	9月30日 3月31日
1単元の株式数	1,000株
株式の名義書換え 取扱場所 株主名簿管理人 取次所 名義書換手数料 新券交付手数料	東京都千代田区丸の内二丁目4番1号 当社本店 法務部 — — — —
単元未満株式の買取り 取扱場所 株主名簿管理人 取次所 買取手数料	東京都千代田区丸の内二丁目4番1号 当社本店 法務部 — — —
公告掲載方法	日本経済新聞
株主に対する特典	なし

(注1) 当社の株主は、その有する単元未満株式について、次に掲げる権利以外の権利を行使することができません。

会社法第189条第2項各号に掲げる権利

会社法第166条第1項の規定による請求をする権利

株主の有する株式数に応じて募集株式の割当ておよび募集新株予約権の割当てを受ける権利

(注2) 平成22年4月1日から株式の名義書換えの取扱場所および単元未満株式の買取りの取扱場所を次の場所に変更しております。

東京都千代田区丸の内二丁目4番1号

当社本店 経営企画部

第 7 【提出会社の参考情報】

1 【提出会社の親会社等の情報】

当社は上場会社ではありませんので、金融商品取引法第24条の 7 第 1 項の適用がありません。

2 【その他の参考情報】

当事業年度の開始日から有価証券報告書提出日までの間に、次の書類を提出しております。

- | | |
|---|---|
| (1) 有価証券報告書およびその添付書類並びに確認書
事業年度（第4期）（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 平成21年6月26日
関東財務局長に提出 |
| (2) 半期報告書および確認書
（第5期中）（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日） | 平成21年12月16日
関東財務局長に提出 |
| (3) 臨時報告書
金融商品取引法第24条の5第4項および企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第7号（吸収分割）に基づく臨時報告書であります。
金融商品取引法第24条の5第4項並びに企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第12号および第19号（財政状態及び経営成績に著しい影響を与える事象）に基づく臨時報告書であります。
金融商品取引法第24条の5第4項および企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第3号（特定子会社の異動）に基づく臨時報告書であります。 | 平成21年11月19日
関東財務局長に提出
平成22年3月31日
関東財務局長に提出
平成22年5月6日
関東財務局長に提出 |
| (4) 臨時報告書の訂正報告書
平成21年11月19日提出の臨時報告書（吸収分割）に係る訂正報告書であります。 | 平成21年12月25日
関東財務局長に提出 |

第二部【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成21年 6 月25日

三菱UFJ証券株式会社

取締役会 御中

監査法人トーマツ

指定社員 業務執行社員	公認会計士	川本 修司	印
----------------	-------	-------	---

指定社員 業務執行社員	公認会計士	田中 素子	印
----------------	-------	-------	---

指定社員 業務執行社員	公認会計士	墨岡 俊治	印
----------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「経理の状況」に掲げられている三菱UFJ証券株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの連結会計年度の連結財務諸表、すなわち、連結貸借対照表、連結損益計算書、連結株主資本等変動計算書、連結キャッシュ・フロー計算書及び連結附属明細表について監査を行った。この連結財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から連結財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に連結財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての連結財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ証券株式会社及び連結子会社の平成21年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する連結会計年度の経営成績及びキャッシュ・フローの状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

追記情報

1. 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に記載されているとおり、会社はデリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債について、従来相殺表示していたが、当連結会計年度より総額で表示する方法に変更した。
2. 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に記載されているとおり、会社は一部の在外子会社が保有する一部の債券の保有区分について、従来売買目的有価証券としていたが、当連結会計年度よりその他有価証券及び満期保有目的の債券に変更した。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 連結財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成22年 6 月25日

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社
(旧商号：三菱UFJ証券株式会社)

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	川本 修司	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	墨岡 俊治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木 裕晃	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「経理の状況」に掲げられている三菱UFJ証券ホールディングス株式会社（旧商号：三菱UFJ証券株式会社）の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの連結会計年度の連結財務諸表、すなわち、連結貸借対照表、連結損益計算書、連結株主資本等変動計算書、連結キャッシュ・フロー計算書及び連結附属明細表について監査を行った。この連結財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から連結財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に連結財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての連結財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ証券ホールディングス株式会社（旧商号：三菱UFJ証券株式会社）及び連結子会社の平成22年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する連結会計年度の経営成績及びキャッシュ・フローの状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

追記情報

重要な後発事象にモルガン・スタンレー証券との統合に関する事項が記載されている。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 連結財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成21年 6 月25日

三菱UFJ証券株式会社

取締役会 御中

監査法人トーマツ

指定社員 業務執行社員	公認会計士	川本 修司	印
----------------	-------	-------	---

指定社員 業務執行社員	公認会計士	田中 素子	印
----------------	-------	-------	---

指定社員 業務執行社員	公認会計士	墨岡 俊治	印
----------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「経理の状況」に掲げられている三菱UFJ証券株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第4期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書及び附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ証券株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

追記情報

重要な会計方針の変更に記載されているとおり、会社はデリバティブ取引の時価評価による金融資産と金融負債について、従来相殺表示していたが、当事業年度より総額で表示する方法に変更した。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成22年 6 月25日

三菱ＵＦＪ証券ホールディングス株式会社
(旧商号：三菱ＵＦＪ証券株式会社)

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	川本 修司	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	墨岡 俊治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木 裕晃	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「経理の状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ証券ホールディングス株式会社（旧商号：三菱ＵＦＪ証券株式会社）の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第5期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書及び附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ証券ホールディングス株式会社（旧商号：三菱ＵＦＪ証券株式会社）の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

追記情報

1. 重要な後発事象にモルガン・スタンレー証券との統合に関する事項が記載されている。
2. 重要な後発事象に会社分割に関する事項が記載されている。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。