

半 期 報 告 書

(第8期中) 自 平成24年4月1日
至 平成24年9月30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. 事業の内容	3
3. 関係会社の状況	3
4. 従業員の状況	3
第2 事業の状況	4
1. 業績等の概要	4
2. 対処すべき課題	9
3. 事業等のリスク	9
4. 経営上の重要な契約等	9
5. 研究開発活動	9
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	10
第3 設備の状況	14
1. 主要な設備の状況	14
2. 設備の新設、除却等の計画	15
第4 提出会社の状況	16
1. 株式等の状況	16
2. 株価の推移	17
3. 役員の状況	17
第5 経理の状況	18
1. 中間連結財務諸表等	19
2. 中間財務諸表等	65
第6 提出会社の参考情報	75
第二部 提出会社の保証会社等の情報	76

[中間監査報告書]

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年11月29日
【中間会計期間】	第8期中（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
【会社名】	三菱UFJ証券ホールディングス株式会社
【英訳名】	Mitsubishi UFJ Securities Holdings Co.,Ltd.
【代表者の役職氏名】	取締役社長 豊泉 俊郎
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内二丁目5番2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】	東京都文京区目白台三丁目29番20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】	本店のほかには該当ありません。

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6期中	第7期中	第8期中	第6期	第7期
会計期間	自 平成22年 4月1日 至 平成22年 9月30日	自 平成23年 4月1日 至 平成23年 9月30日	自 平成24年 4月1日 至 平成24年 9月30日	自 平成22年 4月1日 至 平成23年 3月31日	自 平成23年 4月1日 至 平成24年 3月31日
営業収益 (百万円)	158,502	152,800	155,285	202,262	306,926
純営業収益 (百万円)	127,291	114,079	129,119	139,866	238,585
経常損益(△は損失) (百万円)	△2,273	17,743	30,502	△95,859	38,177
中間(当期)純損益(△は損失) (百万円)	19,430	16,353	18,017	△50,440	16,583
中間包括利益又は包括利益 (百万円)	△1,059	30,989	33,106	△123,652	20,734
純資産額 (百万円)	935,702	813,341	843,405	802,106	819,651
総資産額 (百万円)	24,730,764	24,363,668	24,929,725	20,486,251	22,436,260
1株当たり純資産額 (円)	882.43	812.62	835.08	778.14	808.05
1株当たり 中間(当期)純損益金額(△は損失) (円)	27.10	22.81	24.45	△70.35	22.86
潜在株式調整後1株当たり 中間(当期)純利益金額 (円)	27.10	—	—	—	—
自己資本比率 (%)	2.6	2.4	2.5	2.7	2.7
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△457,649	△151,485	△237,999	258,942	296,032
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△6,513	26,462	△72,236	64,820	60,833
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	456,418	△48,571	217,242	162,018	△543,014
現金及び現金同等物の 中間期末(期末)残高 (百万円)	121,056	441,073	330,698	612,678	422,521
従業員数 (人) (外、平均臨時雇用人員)	8,649 (468)	8,392 (283)	6,762 (408)	8,610 (455)	6,818 (304)

- (注) 1. 第6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. 第7期中および第7期の潜在株式調整後1株当たり中間(当期)純利益金額については、希薄化効果を有している潜在株式が存在しないため記載しておりません。
3. 第8期中の潜在株式調整後1株当たり中間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。
4. 第6期中の中間包括利益の算定にあたり、「包括利益の表示に関する会計基準」(企業会計基準第25号平成22年6月30日)を適用し、遡及処理しております。

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6期中	第7期中	第8期中	第6期	第7期
会 計 期 間	自 平成22年 4月1日 至 平成22年 9月30日	自 平成23年 4月1日 至 平成23年 9月30日	自 平成24年 4月1日 至 平成24年 9月30日	自 平成22年 4月1日 至 平成23年 3月31日	自 平成23年 4月1日 至 平成24年 3月31日
営業収益 (百万円)	6,794	41,615	19,897	11,964	47,593
経常損益 (△は損失) (百万円)	△216	37,261	12,011	341	36,605
中間(当期)純損益 (△は損失) (百万円)	△14,925	49,190	11,141	△14,517	59,927
資本金 (百万円)	65,518	65,518	75,518	65,518	75,518
発行済株式総数 (千株)	716,985	716,985	736,985	716,985	736,985
純資産額 (百万円)	629,244	681,080	717,866	629,182	708,440
総資産額 (百万円)	1,056,556	1,142,763	1,315,493	1,078,943	1,225,356
1株当たり純資産額 (円)	877.63	949.92	974.06	877.54	961.27
1株当たり 中間(当期)純損益金額 (△は損失) (円)	△20.82	68.61	15.12	△20.25	82.62
潜在株式調整後1株当たり 中間(当期)純利益金額 (円)	—	—	—	—	—
1株当たり配当額 (円)	—	—	9.72	—	—
自己資本比率 (%)	59.6	59.6	54.6	58.3	57.8
従業員数 (人)	125	130	135	125	113

- (注) 1. 第6期中および第6期の潜在株式調整後1株当たり中間(当期)純利益金額については、1株当たり中間(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。
2. 第7期中、第7期および第8期中の潜在株式調整後1株当たり中間(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。

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【事業の内容】

当中間連結会計期間において、当社グループ（当社および当社の関係会社）が営む事業の内容について、重要な変更はありません。

主要な関係会社の異動は、次のとおりです。

(除外)

子会社 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（セグメントの名称：その他）

3【関係会社の状況】

当中間連結会計期間において、重要な関係会社の異動は以下のとおりです。

連結子会社であったティ・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は、清算終了に伴い、連結の範囲から除外しております。

4【従業員の状況】

(1) 連結会社の状況

平成24年9月30日現在

セグメントの名称	従業員数 (人)
証券業務 (国内)	4,633 (268)
証券業務 (英国)	564 (86)
証券業務 (米国)	197 (1)
投信投資顧問業	329 (15)
その他	1,039 (38)
合計	6,762 (408)

(注) 従業員数は、就業人員数であり、臨時従業員数は () 内に当中間連結会計期間の平均人員数を外数で記載しております。

(2) 提出会社の状況

平成24年9月30日現在

従業員数 (人)	135
----------	-----

(注) 上記のほか、執行役員の平成24年9月末の人数は17人であります。

(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

当中間連結会計期間の連結営業収益は1,552億85百万円（前年度中間期比101.6%）となりました。受入手数料は690億91百万円（同94.5%）、トレーディング損益は494億7百万円（同135.3%）となりました。金融収益は367億81百万円（同82.4%）、金融費用は261億66百万円（同67.6%）となり、連結純営業収益は1,291億19百万円（同113.2%）となりました。また、販売費・一般管理費は1,175億47百万円（同96.4%）となったことから、連結営業利益は115億71百万円（前年度中間期は78億87百万円の損失）、連結経常利益は305億2百万円（前年度中間期比171.9%）、連結中間純利益は180億17百万円（同110.2%）となりました。

当中間連結会計期間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690億91百万円（前年度中間期比94.5%）となりました。内訳は次のとおりです。

区 分	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日) (百万円)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) (百万円)	前年度中間期比 (%)
受入手数料	73,089	69,091	94.5
委託手数料	9,227	7,353	79.7
引受け・売出し・特定投資家向け売付け 勧誘等の手数料	6,640	12,748	192.0
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧 誘等の取扱手数料	17,952	14,996	83.5
その他の受入手数料	39,268	33,993	86.6

a. 委託手数料

当中間連結会計期間の委託手数料は合計で73億53百万円（前年度中間期比79.7%）となりました。株式委託手数料は71億74百万円（同79.6%）となり、債券委託手数料は81百万円（同82.5%）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

当中間連結会計期間の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は合計で127億48百万円（前年度中間期比192.0%）となりました。株式の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は33億42百万円（同289.0%）となり、債券の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は94億6百万円（同171.5%）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。当中間連結会計期間の投資信託の募集・売出し取扱高は2兆3,945億円（前年度中間期比103.5%）となり、当中間連結会計期間の募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は149億96百万円（同83.5%）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。当中間連結会計期間のその他の受入手数料は339億93百万円（前年度中間期比86.6%）となりました。

② トレーディング損益

当中間連結会計期間のトレーディング損益は、株券等によるものが93億62百万円の損失（前年度中間期は90億49百万円の損失）、債券等によるものが657億80百万円の利益（前年度中間期比88.5%）、その他が70億11百万円の損失（前年度中間期は287億86百万円の損失）、合計では494億7百万円の利益（前年度中間期比135.3%）となりました。

区 分	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日) (百万円)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) (百万円)	前年度中間期比 (%)
トレーディング損益	36,511	49,407	135.3
株券等トレーディング損益	△9,049	△9,362	—
債券等トレーディング損益	74,347	65,780	88.5
その他のトレーディング損益	△28,786	△7,011	—

③ 金融収支

金融収益367億81百万円（前年度中間期比82.4%）から金融費用261億66百万円（同67.6%）を差引いた結果、当中間連結会計期間の金融収支は106億14百万円の利益（同180.1%）となりました。

④ 販売費・一般管理費

一般的に経費抑制を徹底し、当中間連結会計期間の販売費・一般管理費は1,175億47百万円（前年度中間期比96.4%）となりました。

当中間連結会計期間のセグメントの業績は、次のとおりであります。

「証券業務（国内）」

市況低迷を背景に委託手数料、投資信託の募集・売出しが減少したものの、引受・売出手数料およびトレーディング損益が増収となりました。

これらの結果、当中間連結会計期間における証券業務（国内）の純営業収益は948億1百万円（前年度中間期比116.4%）、セグメント利益は189億35百万円（前年度中間期は31億58百万円の損失）となりました。

「証券業務（英国）」

引受業務が好調に推移し、またデリバティブ取引の実績積み上げ等により、増収となりました。

これらの結果、当中間連結会計期間における証券業務（英国）の純営業収益は123億41百万円（前年度中間期比131.3%）、セグメント利益は28億59百万円（前年度中間期は2億75百万円の損失）となりました。

「証券業務（米国）」

引受業務での主幹事案件が増加するなど、プライマリー業務が牽引し、増収となりました。

これらの結果、当中間連結会計期間における証券業務（米国）の純営業収益は77億33百万円（前年度中間期比138.2%）、セグメント損失は1億20百万円（前年度中間期は1億31百万円の損失）となりました。

「投信投資顧問業」

新規投資信託の設定・販売拡大や経費削減に取り組んだものの、旗艦ファンドの運用残高減少を背景に委託者報酬が減少し、減益となりました。

これらの結果、当中間連結会計期間における投信投資顧問業の純営業収益は170億円（前年度中間期比71.8%）、セグメント利益は27億28百万円となりました（同63.4%）。

「その他」

当セグメントは、証券持株会社、有価証券投資業務等が含まれております。当中間連結会計期間における証券持株会社の主な収益として子会社からの受取配当金等を計上しました。

この結果、当中間連結会計期間におけるその他の純営業収益は79億24百万円（前年度中間期比110.4%）、セグメント利益は265億48百万円（同43.1%）となりました。

なお、上記のセグメント別純営業収益には、セグメント間の内部純営業収益または振替高が含まれておりません。

(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3,985億55百万円があったものの、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7,439億89百万円があったこと等により2,379億99百万円の資金の減少（前年度中間期比157.1%）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、有価証券の売却及び償還による収入3,570億44百万円や投資有価証券の売却及び償還による収入435億84百万円があったものの、有価証券の取得による支出3,619億95百万円や投資有価証券の取得による支出1,337億49百万円があったこと等により722億36百万円の資金の減少（前年度中間期は264億62百万円の資金の増加）となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、コマーシャル・ペーパーの減少による支出1,080億円や長期借入金の返済による支出951億51百万円があったものの、短期借入金の増加による収入2,662億78百万円や社債の発行による収入1,875億60百万円があったこと等により2,172億42百万円の資金の増加（前年度中間期は485億71百万円の資金の減少）となりました。これらの結果、現金及び現金同等物の当中間連結会計期間末残高は、前年度末比918億22百万円減少して3,306億98百万円（前年度中間期末比75.0%）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：当中間連結会計期間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	前中間連結会計期間 (平成23年9月30日) (百万円)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日) (百万円)
トレーディング商品（資産の部）	12,661,737	13,798,896
商品有価証券等	5,676,806	5,258,304
株式・ワラント	392,245	499,614
債券	5,208,769	4,683,428
受益証券	60,026	67,637
その他	15,764	7,623
デリバティブ取引	6,984,930	8,540,592
オプション取引	1,288,566	1,104,220
派生商品評価勘定	5,696,363	7,436,372
為替予約取引	38,373	46,934
先物取引	17,068	8,647
スワップ取引	5,640,920	7,380,790
トレーディング商品（負債の部）	10,991,352	11,635,903
商品有価証券等	4,168,476	3,113,079
株式・ワラント	47,470	19,072
債券	4,121,005	3,094,006
デリバティブ取引	6,822,876	8,522,824
オプション取引	1,453,172	1,274,852
派生商品評価勘定	5,369,704	7,247,971
為替予約取引	34,603	29,786
先物取引	15,639	49,512
スワップ取引	5,319,461	7,168,672

(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24年9月30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	1	100	3,000	100	2.34
	合計	1	100	3,000	100	2.34

(ロ) 資金調達内訳

平成24年9月30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	389,500	0.67	
その他	766,653	0.22	
	社債・CP	766,653	0.22
合計	1,156,153	0.37	
自己資本	865,001	—	
	資本金・出資額	75,518	—

(注1) 貸付債権譲渡額 26,556百万円

(注2) 「自己資本」は、資産の合計額より負債の合計額並びに配当金及び役員賞与金の予定額を控除し、引当金（特別法上の引当金を含む）の合計額を加えた額を記載しております。

(ハ) 業種別貸付金残高内訳

平成24年9月30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		1	100.0	3,000	100.0
不動産業		—	—	—	—
サービス業		—	—	—	—
個人		—	—	—	—
その他		—	—	—	—
	合計	1	100	3,000	100

(二) 担保別貸付金残高内訳

平成24年9月30日現在

受入担保の種類	残高 (百万円)	構成割合 (%)
有価証券	—	—
うち株式	—	—
債権	—	—
うち預金	—	—
商品	—	—
不動産	—	—
財団	—	—
その他	—	—
計	—	—
保証	—	—
無担保	3,000	100.0
合計	3,000	100

(ホ) 期間別貸付金残高内訳

平成24年9月30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 (%)	構成割合 (%)	構成割合 (%)
1年以下	—	—	—	—	—
1年超 5年以下	—	—	—	—	—
5年超 10年以下	—	—	—	—	—
10年超 15年以下	—	—	—	—	—
15年超 20年以下	—	—	—	—	—
20年超 25年以下	—	—	—	—	—
25年超	1	100.0	3,000	100.0	—
合計	1	100	3,000	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】

当中間連結会計期間において、当社グループが対処すべき課題に重要な変更はありません。

なお、前連結会計年度に掲げた課題のうち、「市場商品業務」の課題につきましては、当中間連結会計期間において、次のように対処しております。

- ・ 市場商品業務においては、市況に左右されにくい収益構造への転換を図るべく、お客様のニーズに基づくフロービジネスを追求すると共に、在庫回転率を高めることによりリスク対比の収益力向上に努めてまいりました。今後も上記施策の定着を進め、収益基盤の安定化を磐石なものとし、お客さまから支持される国内トッププレイヤーを目指してまいります。

3 【事業等のリスク】

当中間連結会計期間において、新たな事業等のリスクの発生、または、前事業年度の有価証券報告書に記載した事業等のリスクについての重要な変更はありません。

4 【経営上の重要な契約等】

当中間連結会計期間において、経営上の重要な契約等の決定又は締結等はありません。

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】

当中間連結会計期間の財政状態、経営成績およびキャッシュ・フローの状況の分析は、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、半期報告書提出日（平成24年11月29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

当社の中間連結財務諸表は、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。この中間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。

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額法または定率法により、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等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、将来の合理的な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、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

当中間連結会計期間のわが国の景気は、弱めの推移となりました。東日本大震災からの復興需要の景気押し上げ効果が縮小し、公共投資を中心に政府支出の増加ペースが鈍っているほか、欧州経済の低迷や中国経済の減速を受け、輸出が減少基調となりました。また、ボーナスの減少などから、夏場以降、個人消費も低調に推移しました。こうした中、企業の生産活動の落ち込みが続き、企業の景況感の悪化も確認されており、すでに景気後退局面に入っている可能性が出てきました。

株式市場では、10,161円でスタートした日経平均株価が、8,870円で終了しました。欧州の債務危機拡大や世界経済失速への懸念に加え、円高進行もあり、日経平均株価は低下基調となり、6月4日には、一時、8,238円まで低下し、およそ半年ぶりの安値を記録しました。その後、欧州の債務問題への対応策の進展への期待や米国の金融緩和の継続などから下落に歯止めがかかり、9,000円台を回復する局面もありましたが、欧州危機拡大や世界経済失速の懸念が払拭しきれず、株価の上昇基調は続かず、再び8,000円台の推移となりました。

債券市場では、新発10年国債利回りが1.010%で始まり、0.765%で終了しました。世界経済の先行き不透明感の拡大に円高・株安も加わり、利回りは低下基調となりました。また、欧州の債務危機拡大への懸念も根強く、相対的に「安全資産」とみなされている日米独の国債への資金シフトも続きました。こうした中、新発10年国債利回りは、7月23日には、0.720%まで低下し、9年1カ月ぶりの低水準となりました。その後、欧州の債務問題への対応策の進展などを受け、0.8%台まで上昇しましたが、欧州危機拡大の懸念が再燃したほか、9月の内外の追加金融緩和もあり、再び低下基調となりました。

このような環境の下、当中間連結会計期間の連結営業利益は115億71百万円（前年度中間期は78億87百万円の損失）、連結経常利益は305億2百万円（前年度中間期比171.9%）、連結中間純利益は180億17百万円（同110.2%）となりました。

当中間連結会計期間の主要な収益・費用の概況は以下のとおりです。

① 受入手数料

受入手数料の合計は690億91百万円（前年度中間期比94.5%）となりました。内訳は次のとおりです。

a. 委託手数料

当中間連結会計期間の東証の1日平均売買高（内国普通株合計）は、株数で18億92百万株（前年度中間期比89.4%）、金額で1兆1,372億円（同83.1%）となりました。このような状況のもと、当社グループの株式委託手数料は71億74百万円（同79.6%）となりました。一方、債券委託手数料は81百万円（同82.5%）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

国内株式発行市場では、欧州債務危機を巡る不透明感等から株価は低迷したものの、日本航空による再上場案件が見られたこともあり、発行量は前年度中間期比で増加しました。当社グループはこのような環境の下、株式発行市場を通じた資金調達案件で実績を積み重ねました。

国内債券発行市場では、電力債の発行の本格化も見られ、震災の影響で調達額が大幅に減少した前年度中間期と比べてやや回復しました。当社グループはこのような環境の下、債券発行市場を通じた資金調達案件で多数の主幹事をつとめました。

欧米拠点においては、欧州ソブリン危機による不安定な市場環境の中、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）が、三菱東京UFJ銀行およびUnion Bankとの連携強化により多数の主幹事案件を獲得し、前年度中間期比で増収となりました。

以上の結果、当中間連結会計期間の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は合計で127億48百万円（前年度中間期比192.0%）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。当中間連結会計期間は、ヘッジファンドが投資助言するファンドのリターンを反映する「国際オルタナティブ戦略 QTX-ウィントン・アルファ・インベストメント・オープン」、高利回りCBに投資を行う「ブラックロック・アジア高利回りCBファンド2012-04」、「JPMグローバル高利回りCBファンド2012-08」、世界の金融機関が発行する外貨建て債券等に投資を行う「東京海上Rogge 投資適格世界金融機関債券ファンド2012-05」、「東京海上Rogge 投資適格世界金融機関債券ファンド2012-07」、日本株に投資を行う「日本株セレクション 好配当優良株ジャパン・オープン」、世界のインフラ関連企業が発行する債券に投資を行う

「三菱UFJ／AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり／為替ヘッジなし>（毎月決算型）」、ユーロ建てのハイイールド債券を主な投資対象とする「三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンドユーロ円プレミアム（毎月分配型）」、アジア・オセアニア諸国・地域の上場株式およびリートを主要投資対象とする「アジア・オセアニア好配当株オープン（毎月決算型）」、オーストラリアの債券に投資する「米ドル建オーストラリア債券オープン 毎月分配型」、トルコの債券および株式に投資を行う「トルコ債券&株式ファンド2012-09」、高利回りの社債に投資を行う「短期高利回り社債ファンド2012-10」、「短期高利回り社債ファンド2012-10 円建 円高ヘッジ・円安追随型」の新規募集を行いました。また、「三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ」、「ピクテ新興国インカム株式ファンド（毎月決算型）」、「エマージング・ソブリン・オープン（毎月決算型）為替ヘッジあり」、「三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド通貨選択シリーズ」等の継続募集にも注力しましたが、投資信託の販売額および募集取扱手数料は前年度中間期を下回る結果となりました。当社グループの当中間連結会計期間の投資信託の募集取扱高は2兆3,945億円（前年中間期比103.5%）となり、当中間連結会計期間末における投資信託の残存元本は、外国投資信託を含め4兆6,480億円（前年度末比99.6%）となりました。

以上の結果、当中間連結会計期間の募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は149億96百万円（前年度中間期比83.5%）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（以下、KAM）における投資信託の委託者報酬などを含んでおります。投資信託の代行手数料は、当中間連結会計期間の純資産残高の減少等により前年度中間期比で減少する結果となりました。M&A業務では、三菱UFJフィナンシャル・グループとモルガン・スタンレーが有する国内外ネットワークの活用・連携等を通じ、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、国内／クロスボーダーを問わず多くの実績を積み重ねました。個人向けの年金保険に関しては、定額年金「エムソリューションⅢ年金型」、一時払終身保険「エムソリューションⅢ終身保険型」、法人向けの事業保険に関しては「終身がん保険」「逓増定期保険」等の販売に注力しましたが、市場金利の低下や法人税制変更の影響により、年金保険に関する受入手数料は前年度中間期比で減少となりました。また、KAMにおける投資信託の委託者報酬についても、投資信託運用残高の減少により前年度中間期比で減少する結果となりました。

以上の結果、当中間連結会計期間のその他の受入手数料は339億93百万円（前年度中間期比86.6%）となりました。

② トレーディング損益

国内株式市場は、欧州の債務問題や円高による企業業績悪化懸念が強まり、4月から5月にかけて市場は大幅に下落しました。6月には円高一服や欧州不安の一時的な沈静化を受けて相場下落に一旦歯止めがかかったものの、その後も欧州不安は根強く世界的なリスクオフの動きが続く中で、上値の重い展開となり市場の出来高も減少となりました。このように総じて厳しい環境の中、お客様のニーズに応じた商品提供を行い取引フローの確保に努めました。海外株式市場は、ギリシャ問題や世界的景気減速懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり市場が下落する局面もありましたが、金融緩和への期待が高まり欧米株式市場が上昇基調に転じたことから、外国株式の売買収益は増加しました。

国内の国債市場は、7月中旬頃までは欧州の債務問題や米国の景気減速懸念を受けたリスクオフの動きから相場は大きく上昇（金利低下）しました。その後は、海外金利の反発や消費増税法案に絡む政局の混乱が懸念されて、一時的に相場が下落（金利上昇）するなど、相場は上昇基調から高値圏での横這い推移となりました。クレジット市場は、ギリシャの政局不安や米銀の巨額損失問題からリスクオフの動きが広がり、5月中旬頃まではスプレッドが拡大基調を辿りました。その後も、尖閣諸島を巡る日中関係の悪化による企業業績への影響が懸念されたことなどから、スプレッドは高止まりとなりました。このような相場環境の下で、当社グループでは債券店頭取引やクレジット商品の売買を中心に収益を計上しました。

以上の結果、当中間連結会計期間のトレーディング損益は、株券等によるものが93億62百万円の損失（前年度中間期は90億49百万円の損失）、債券等によるものが657億80百万円の利益（前年度中間期比88.5%）、その他が70億11百万円の損失（前年度中間期は287億86百万円の損失）、合計では494億7百万円の利益（前年度中間期比135.3%）となりました。

③ 金融収支

当中間連結会計期間の金融収益367億81百万円（前年度中間期比82.4%）から金融費用261億66百万円（同67.6%）を差し引いた金融収支は、106億14百万円の利益（同180.1%）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。本社移転や営業店統廃合に伴う不動産関係費の減少やシステム投資の効率化による減価償却費の減少等により、当中間連結会計期間の販売費・一般管理費は1,175億47百万円（前年度中間期比96.4%）となりました。

⑤ 特別損益

当中間連結会計期間の特別利益は26億10百万円（前年度中間期比15.5%）、特別損失は14億89百万円（同14.8%）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22億55百万円であります。特別損失のうち主なものは、減損損失10億57百万円であります。

(3) 財政状態の分析

当中間連結会計期間末における総資産は24兆9,297億25百万円（前年度末比2兆4,934億65百万円増）となりました。内訳は流動資産が24兆1,577億8百万円（同2兆4,292億43百万円増）であり、このうちトレーディング商品が13兆7,988億96百万円（同1兆6,150億51百万円増）、有価証券担保貸付金が8兆7,666億16百万円（同1兆825億37百万円増）となっております。固定資産は7,720億16百万円（同642億22百万円増）となっております。

負債合計は、2兆863億20百万円（同2兆4,697億11百万円増）となりました。内訳は流動負債が2兆185億48百万円（同2兆4,230億52百万円増）であり、このうちトレーディング商品が1兆6,359億3百万円（同8,731億33百万円増）、有価証券担保借入金が8兆6,070億円（同1兆1,208億97百万円増）となっております。固定負債は1兆668億16百万円（同466億92百万円増）となっております。

純資産合計は8,434億5百万円（同237億53百万円増）となりました。主な増減の要因は、中間純利益による利益剰余金の増加180億17百万円、その他有価証券評価差額金の減少19億34百万円、為替換算調整勘定の増加32億66百万円、および少数株主持分の増加38億円33百万円であります。

(4) キャッシュ・フローの状況

当中間連結会計期間における現金及び現金同等物（以下「資金」といいます。）は、約定見返勘定の差引残高の減少、有価証券の売却や償還、短期借入金の増加および社債の発行等による収入があったものの、トレーディング商品（資産・負債）の差引残高の増加、有価証券および投資有価証券の取得による支出、コマーシャル・ペーパーの減少による支出等により、前年度比918億22百万円の資金の減少となり、当中間連結会計期間末の資金残高は3,306億98百万円（前年度中間期末比75.0%）となりました。

（営業活動によるキャッシュ・フロー）

当中間連結会計期間における営業活動による資金の減少は、2,379億99百万円（前年度中間期比157.1%）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3,985億55百万円があったものの、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7,439億89百万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）

当中間連結会計期間における投資活動による資金の減少は、722億36百万円（前年度中間期は264億62百万円の資金の増加）となりました。これは主に、有価証券の売却及び償還による収入3,570億44百万円や投資有価証券の売却及び償還による収入435億84百万円があったものの、有価証券の取得による支出3,619億95百万円や投資有価証券の取得による支出1,337億49百万円があったこと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）

当中間連結会計期間における財務活動による資金の増加は、2,172億42百万円（前年度中間期は485億71百万円の資金の減少）となりました。これは主に、コマーシャル・ペーパーの減少による支出1,080億円や長期借入金の返済による支出951億51百万円があったものの、短期借入金の増加による収入2,662億78百万円や社債の発行による収入1,875億60百万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【主要な設備の状況】

(1) 当中間連結会計期間中に完了した新設、改修、除却、売却等は、次のとおりであります。

①新設、改修等

重要なものではありません。

②除却、売却等

重要なものではありません。

(2) 当中間連結会計期間中における主要な設備の重要な異動は、次のとおりであります。

重要なものではありません。

2【設備の新設、除却等の計画】

(1) 前連結会計年度末において計画中であった重要な設備の新設、改修、除却、売却等のうち、当中間連結会計期間中に重要な変更があったものは次のとおりであります。

①新設、改修計画等

会社名	セグメント の名称	店舗名 その他	所在地	区分	設備の内容	変更の内容
三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券株式会 社	証券業務 (国内)	本社ほか	東京都 千代田 区ほか	更改	持株会管理システ ム	完了予定日を平成24年8月から平成25 年2月に変更しました。

②除却、売却計画等

重要なものはありません。

(2) 前連結会計年度末において計画中であった重要な設備の新設、改修、除却、売却等のうち、当中間連結会計期間中に完了したものは次のとおりであります。

①新設、改修計画等

会社名	セグメント の名称	店舗名 その他	所在地	区分	設備の内容	完了年月
三菱UFJモル ガン・スタン レー証券株式 会社	証券業務 (国内)	本社ほか	東京都千代 田区ほか	更改	新会計システム構築	平成24年4月
三菱UFJモル ガン・スタン レー証券株式 会社	証券業務 (国内)	本社ほか	東京都千代 田区ほか	更改	情報系基盤更改	平成24年5月
三菱UFJモル ガン・スタン レー証券株式 会社	証券業務 (国内)	本社ほか	東京都千代 田区ほか	更改	営業店端末システム 更改	平成24年9月

②除却、売却計画等

重要なものはありません。

(3) 当中間連結会計期間中に新たに確定した重要な設備の新設、改修、除却、売却等の計画は次のとおりであります。

①新設、改修計画等

重要なものはありません。

②除却、売却計画等

重要なものはありません。

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	中間会計期間末現在 発行数 (株) (平成24年9月30日)	提出日現在発行数 (株) (平成24年11月29日)	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	736,985,496	736,985,496	—	単元株式数 1,000株
計	736,985,496	736,985,496	—	—

(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、資本金等の状況】

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24年4月1日～ 平成24年9月30日	—	736,985,496	—	75,518,843	—	426,944,245

(6)【大株主の状況】

平成24年9月30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	736,985	100.00
計	—	736,985	100.00

(7) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

平成24年9月30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 736,985,000	736,985	—
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	736,985,496	—	—
総株主の議決権	—	736,985	—

② 【自己株式等】

平成24年9月30日現在

所有者の氏名又は名称	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	—	—	—	—	—

2 【株価の推移】

当社株式は非上場でありますので、該当事項はありません。

3 【役員 の 状 況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当半期報告書の提出日までにおいて、役員 の 異 動 は あ り ま せ ン。

第5【経理の状況】

1. 中間連結財務諸表および中間財務諸表の作成方法について

- (1) 当社の中間連結財務諸表は、「中間連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（平成11年大蔵省令第24号）ならびに同規則第48条および第69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。
- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条および第57条の規定に基づき、「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。

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、中間連結会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）の中間連結財務諸表および中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

1 【中間連結財務諸表等】
 (1) 【中間連結財務諸表】
 ① 【中間連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	※2 452,899	332,856
預託金	98,242	88,722
トレーディング商品	※2 12,183,845	※2 13,798,896
商品有価証券等	4,743,416	5,258,304
デリバティブ取引	7,440,428	8,540,592
約定見返勘定	232,720	—
営業投資有価証券等	※2 31,791	※2 30,903
信用取引資産	39,566	34,101
信用取引貸付金	29,395	28,998
信用取引借証券担保金	10,171	5,102
有価証券担保貸付金	7,684,079	8,766,616
借入有価証券担保金	3,621,431	3,983,242
現先取引貸付金	4,062,647	4,783,374
立替金	8,716	5,411
短期差入保証金	645,600	760,869
短期貸付金	101	98
親会社株式	254	225
有価証券	241,410	199,645
未収還付法人税等	9,147	3,591
繰延税金資産	11,575	16,019
その他の流動資産	88,561	119,788
貸倒引当金	△48	△38
流動資産計	21,728,465	24,157,708
固定資産		
有形固定資産	※1 29,209	※1 27,707
建物	15,760	14,536
器具備品	7,899	7,883
土地	5,399	5,144
リース資産	0	—
建設仮勘定	149	142
無形固定資産	26,233	24,831
ソフトウェア	25,773	24,443
その他	460	388
投資その他の資産	652,350	719,478
投資有価証券	630,686	698,956
長期貸付金	3,585	3,502
繰延税金資産	3,289	2,429
その他	15,924	15,719
貸倒引当金	△1,136	△1,129
固定資産計	707,794	772,016
資産合計	22,436,260	24,929,725

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	10,762,769	11,635,903
商品有価証券等	3,290,150	3,113,079
デリバティブ取引	7,472,619	8,522,824
約定見返勘定	—	166,838
信用取引負債	15,258	12,489
信用取引借入金	※2 7,798	※2 3,647
信用取引貸証券受入金	7,460	8,841
有価証券担保借入金	7,486,103	8,607,000
有価証券貸借取引受入金	3,093,995	3,394,163
現先取引借入金	4,392,107	5,212,836
預り金	89,715	109,319
受入保証金	757,258	825,134
短期借入金	※2 617,497	※2 903,353
1年内返済予定の長期借入金	※2 111,056	※2 69,496
コマーシャル・ペーパー	530,100	422,100
1年内償還予定の社債	※2 158,678	※2 204,080
未払法人税等	3,164	2,740
賞与引当金	15,321	15,436
資産除去債務	1,107	—
その他の流動負債	47,463	44,654
流動負債計	20,595,495	23,018,548
固定負債		
社債	※2 689,490	※2 725,037
長期借入金	※2 310,489	※2 322,173
繰延税金負債	3,840	4,294
退職給付引当金	11,575	10,822
役員退職慰労引当金	541	376
資産除去債務	3,927	3,916
その他の固定負債	257	196
固定負債計	1,020,123	1,066,816
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	※4 989	※4 955
特別法上の準備金計	989	955
負債合計	21,616,609	24,086,320

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	75,518	75,518
資本剰余金	426,948	426,948
利益剰余金	145,830	163,847
株主資本合計	648,297	666,315
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	△4,166	△6,101
繰延ヘッジ損益	△898	△326
為替換算調整勘定	△47,709	△44,443
その他の包括利益累計額合計	△52,775	△50,872
少数株主持分	224,128	227,962
純資産合計	819,651	843,405
負債・純資産合計	22,436,260	24,929,725

②【中間連結損益計算書及び中間連結包括利益計算書】
【中間連結損益計算書】

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月 30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月 30日)
営業収益		
受入手数料	73,089	69,091
委託手数料	9,227	7,353
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	6,640	12,748
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	17,952	14,996
その他の受入手数料	39,268	33,993
トレーディング損益	36,511	49,407
営業投資有価証券等損益	△1,422	△39
その他の商品売買損益	6	44
金融収益	44,616	36,781
営業収益計	152,800	155,285
金融費用	38,721	26,166
純営業収益	114,079	129,119
販売費・一般管理費		
取引関係費	32,966	32,784
人件費	※1 48,440	※1 48,257
不動産関係費	13,379	10,767
事務費	12,003	12,798
減価償却費	8,741	6,991
租税公課	3,300	3,194
その他	3,135	2,754
販売費・一般管理費計	121,966	117,547
営業利益又は営業損失(△)	△7,887	11,571
営業外収益		
受取利息	3,631	3,591
持分法による投資利益	19,745	12,007
投資有価証券評価益	※2 2,360	※2 2,664
その他	1,871	1,533
営業外収益計	27,608	19,796
営業外費用		
固定資産除却損	148	140
為替差損	1,067	488
その他	762	236
営業外費用計	1,978	865
経常利益	17,743	30,502

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	4,134	2,255
関係会社株式売却益	12,318	—
固定資産売却益	※3 17	※3 321
金融商品取引責任準備金戻入	384	33
特別利益計	16,853	2,610
特別損失		
投資有価証券売却損	335	68
関係会社株式売却損	75	—
投資有価証券評価損	※4 7,955	※4 92
固定資産売却損	※5 107	※5 19
減損損失	※6 177	※6 1,057
本社移転費用	1,396	—
割増退職金	—	252
特別損失計	10,048	1,489
税金等調整前中間純利益	24,548	31,623
法人税、住民税及び事業税	3,795	2,370
法人税等調整額	△2,223	△2,560
法人税等合計	1,571	△190
少数株主損益調整前中間純利益	22,976	31,814
少数株主利益	6,622	13,796
中間純利益	16,353	18,017

【中間連結包括利益計算書】

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
少数株主損益調整前中間純利益	22,976	31,814
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	1,809	△2,575
繰延ヘッジ損益	29	571
為替換算調整勘定	3,580	3,293
持分法適用会社に対する持分相当額	2,593	2
その他の包括利益合計	8,013	1,292
中間包括利益	30,989	33,106
(内訳)		
親会社株主に係る中間包括利益	24,721	19,920
少数株主に係る中間包括利益	6,268	13,185

③【中間連結株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月 30 日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月 30 日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	65,518	75,518
当中間期変動額		
当中間期変動額合計	—	—
当中間期末残高	65,518	75,518
資本剰余金		
当期首残高	416,948	426,948
当中間期変動額		
当中間期変動額合計	—	—
当中間期末残高	416,948	426,948
利益剰余金		
当期首残高	126,812	145,830
当中間期変動額		
中間純利益	16,353	18,017
当中間期変動額合計	16,353	18,017
当中間期末残高	143,165	163,847
株主資本合計		
当期首残高	609,280	648,297
当中間期変動額		
中間純利益	16,353	18,017
当中間期変動額合計	16,353	18,017
当中間期末残高	625,633	666,315
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	△7,682	△4,166
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額 (純額)	2,207	△1,934
当中間期変動額合計	2,207	△1,934
当中間期末残高	△5,474	△6,101
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	6	△898
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額 (純額)	29	571
当中間期変動額合計	29	571
当中間期末残高	36	△326
為替換算調整勘定		
当期首残高	△43,690	△47,709
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額 (純額)	6,130	3,266
当中間期変動額合計	6,130	3,266
当中間期末残高	△37,559	△44,443

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
その他の包括利益累計額合計		
当期首残高	△51,366	△52,775
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	8,368	1,903
当中間期変動額合計	8,368	1,903
当中間期末残高	△42,998	△50,872
新株予約権		
当期首残高	4	—
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	—	—
当中間期変動額合計	—	—
当中間期末残高	4	—
少数株主持分		
当期首残高	244,188	224,128
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△13,486	3,833
当中間期変動額合計	△13,486	3,833
当中間期末残高	230,701	227,962
純資産合計		
当期首残高	802,106	819,651
当中間期変動額		
中間純利益	16,353	18,017
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△5,118	5,736
当中間期変動額合計	11,235	23,753
当中間期末残高	813,341	843,405

④【中間連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前中間純利益	24,548	31,623
減価償却費	8,741	6,991
のれん償却額	130	—
退職給付引当金の増減額 (△は減少)	509	△772
役員退職慰労引当金の増減額 (△は減少)	△42	△164
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	△1,101	△16
金融商品取引責任準備金の増減額 (△は減少)	△384	△33
受取利息及び受取配当金	△48,664	△41,041
支払利息	39,034	26,166
持分法による投資損益 (△は益)	△19,745	△12,007
投資有価証券売却損益 (△は益)	△3,798	△2,187
関係会社株式売却損益 (△は益)	△12,243	—
投資有価証券評価損益 (△は益)	5,595	△2,572
固定資産売却損益 (△は益)	90	△302
減損損失	177	1,057
本社移転費用	1,396	—
割増退職金	—	252
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	△16,647	8,561
トレーディング商品の増減額	△414,840	△743,989
約定見返勘定の増減額 (△は増加)	114,905	398,555
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	△5,888	2,695
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金 の増減額	303,083	45,174
立替金及び預り金の増減額	36,697	24,068
短期差入保証金の増減額 (△は増加)	△114,413	△104,996
受入保証金の増減額 (△は減少)	△35,581	52,473
その他	△18,568	32,017
小計	△157,007	△278,448
利息及び配当金の受取額	65,474	60,189
利息の支払額	△42,157	△21,207
本社移転費用の支払額	△1,416	△464
早期割増退職金の支払額	△5,640	△742
割増退職金の支払額	—	△159
法人税等の支払額	△11,944	△5,882
法人税等の還付額	1,207	8,714
営業活動によるキャッシュ・フロー	△151,485	△237,999

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30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	△2,899	△941
定期預金の払戻による収入	2,913	29,872
有価証券の取得による支出	△212,490	△361,995
有価証券の売却及び償還による収入	204,003	357,044
投資有価証券の取得による支出	△69,895	△133,749
投資有価証券の売却及び償還による収入	108,739	43,584
有形固定資産の取得による支出	△6,307	△1,323
有形固定資産の売却による収入	1	712
有形固定資産の除却による支出	△450	△1,133
無形固定資産の取得による支出	△6,718	△4,429
無形固定資産の売却による収入	8,909	14
貸付金の増減額 (△は増加)	△137	86
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の売却による収入	794	—
その他	—	19
投資活動によるキャッシュ・フロー	26,462	△72,236
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)	△58,259	266,278
コマーシャル・ペーパーの増減額 (△は減少)	31,400	△108,000
長期借入れによる収入	43,300	66,700
長期借入金の返済による支出	△45,012	△95,151
社債の発行による収入	92,482	187,560
社債の償還による支出	△92,747	△92,667
少数株主への分配金支払額	△20,090	△7,513
少数株主からの払込みによる収入	356	35
財務活動によるキャッシュ・フロー	△48,571	217,242
現金及び現金同等物に係る換算差額	1,989	1,170
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	△171,604	△91,822
現金及び現金同等物の期首残高	612,678	422,521
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)	△0	—
現金及び現金同等物の中間期末残高	※ 441,073	※ 330,698

【中間連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項】

1. 連結の範囲に関する事項

(1) 25社を連結しております。

連結子会社名

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
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
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)
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.

MMパートナーシップ

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

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

当中間連結会計期間中の連結子会社の増減は次のとおりであります。

(除外)

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

上記は、清算終了に伴い、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の会社等の名称

投資事業有限責任組合しょうなん産学連携事業化支援ファンド

投資事業有限責任組合ぐんまチャレンジファンド

株式会社フーズネット

ヤマガタ食品株式会社

株式会社グリーン・ベル

株式会社パトライト

ドリームインフィニティ株式会社

(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4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

モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社

丸の内キャピタル株式会社

KE Capital Partners Pte. Ltd.

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. 連結子社の中間決算日等に関する事項

連結子社の中間決算日は以下のとおりであります。

6月末日 18社

8月末日 1社

9月末日 6社

中間決算日が中間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19社については、各社の中間決算日現在の中間財務諸表を使用しております。ただし、各社の中間決算日から中間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。

4. 会計処理基準に関する事項

(1) トレーディングに関する有価証券等の評価基準および評価方法

トレーディングに関する有価証券(売買目的有価証券)およびデリバティブ取引等については、原則として時価法を採用しております。

(2) トレーディング関連以外の有価証券等の評価基準および評価方法

① 満期保有目的債券

償却原価法によっております。

② その他有価証券

ア. 時価のあるもの

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

イ. 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

③ 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り込む方法によっております。

(3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法

① 有形固定資産の減価償却の方法（リース資産を除く）

当社は、定率法を採用しております。

国内連結子会社および在外連結子会社は、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。

建物 8～50年

器具備品 3～15年

② 無形固定資産の減価償却の方法

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

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、当連結会計年度における支給見込額のうち当中間連結会計期間の負担額を計上しております。

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き、当中間連結会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

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（主として12年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、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中間連結会計期間末支給額を計上しております。

(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。

② ヘッジ手段とヘッジ対象

ア. 為替変動リスク

ヘッジ手段…為替予約（為替スワップ取引）

ヘッジ対象…外貨建金融資産・負債（現先取引貸付金、有価証券、投資有価証券、在外子会社等に対する投資への持分、社債）

イ. 金利変動リスク

ヘッジ手段…金利スワップ

ヘッジ対象…投資有価証券

③ ヘッジ方針

外貨建金融資産・負債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。

(6) 中間連結キャッシュ・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。）

(7) その他中間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。

【表示方法の変更】

(中間連結損益計算書)

1. 従来、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券評価益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当中間連結会計期間より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前中間連結会計期間の中間連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前中間連結会計期間の中間連結損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた4,231百万円は、「投資有価証券評価益」2,360百万円、「その他」1,871百万円として組み替えております。

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、当中間連結会計期間より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前中間連結会計期間の中間連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前中間連結会計期間の中間連結損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた597百万円は、「固定資産除却損」148百万円、「その他」449百万円として組み替えております。

3. 従来、「営業外費用」に独立掲記しておりました「支払利息」は、営業外費用の総額の100分の10を下回ったため、当中間連結会計期間より「その他」に含めることとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前中間連結会計期間の中間連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前中間連結会計期間の中間連結損益計算書において、「営業外費用」の「支払利息」に表示していた313百万円は、「その他」として組み替えております。

(中間連結キャッシュ・フロー計算書)

従来、「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「法人税等の支払額」に含めておりました「法人税等の還付額」は、金額的重要性が増したため、当中間連結会計期間より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前中間連結会計期間の中間連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前中間連結会計期間の中間連結キャッシュ・フロー計算書において、「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「法人税等の支払額」に表示していた△10,736百万円は、「法人税等の支払額」△11,944百万円、「法人税等の還付額」1,207百万円として組み替えております。

【注記事項】

(中間連結貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
減価償却累計額	28,603百万円	27,579百万円

※2. 担保に供している資産

前連結会計年度(平成24年3月31日)

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)	計 (百万円)
短期借入金	122,500	—	100,582	100,582
共通担保資金供給オペレーション	122,500	—	100,582	100,582
1年内返済予定の長期借入金	26,056	26,056	—	26,056
信用取引借入金	7,798	—	6,883	6,883
1年内償還予定の社債	8,782	—	8,036	8,036
社債	27,380	—	28,078	28,078
長期借入金	9,721	—	9,798	9,798
計	202,240	26,056	153,379	179,435

(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165,166百万円および担保として受け入れた有価証券127,078百万円、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2,076百万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40,502百万円を、DVP決済等の担保としてトレーディング商品3,213百万円を差し入れております。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

被担保債務		担保に供している資産	
科目	中間期末残高 (百万円)	トレーディング 商品 (百万円)	計 (百万円)
短期借入金	434,600	415,337	415,337
共通担保資金供給オペレーション	434,600	415,337	415,337
1年内返済予定の長期借入金	3,696	3,787	3,787
信用取引借入金	3,647	3,636	3,636
1年内償還予定の社債	7,344	7,270	7,270
社債	23,264	24,393	24,393
長期借入金	5,816	5,786	5,786
計	478,368	460,212	460,212

(注) 1. 担保に供している資産は中間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110,171百万円および担保として受け入れた有価証券160,811百万円、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2,076百万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32,118百万円を、DVP決済等の担保としてトレーディング商品2,937百万円を差し入れております。

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

(1) 差し入れた有価証券

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
信用取引貸証券	8,318百万円	8,803百万円
信用取引借入金の本担保証券	7,798	3,647
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,370,855	3,765,683
現先取引で売却した有価証券	6,300,023	6,148,282
その他担保として差し入れた有価証券	101,590	117,257

(2) 受け入れた有価証券

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
信用取引貸付金の本担保証券	31,018百万円	26,133百万円
信用取引借証券	10,171	5,102
消費貸借契約により借り入れた有価証券	4,064,667	4,483,239
現先取引で買い付けた有価証券	5,959,258	5,671,831
その他担保として受け入れた有価証券	164,088	213,409

※4. 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

5. 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。この契約に基づく貸出未実行残高は以下のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
貸出コミットメントの総額	15,572百万円	—百万円
貸出実行残高	—	—
差引額	15,572	—

(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（前年度末は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借入未実行残高は以下のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
当座貸越極度額	248,969百万円	248,486百万円
借入実行残高	8,000	8,000
差引額	240,969	240,486

(中間連結損益計算書関係)

※1. 人件費には、次のものが含まれております。

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
賞与引当金繰入額	7,862百万円	11,405百万円
退職給付費用	2,751	2,179

※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。

※3. 固定資産売却益の内容は次のとおりであります。

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
建物	5百万円	218百万円
器具備品	7	2
土地	4	100
計	17	321

※4. 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、金融商品に関する会計基準に基づき減損処理を行ったものであります。

※5. 固定資産売却損の内容は次のとおりであります。

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
建物	357百万円	△7百万円
器具備品	2	△0
土地	△252	—
無形固定資産 その他	—	26
計	107	19

※6. 減損損失

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。

前中間連結会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

場所	用途	種類	減損損失額（百万円）
神奈川県戸塚区 他4箇所	店舗設備	建物	103
		その他	0
その他	業務システム	ソフトウェア	71
	本社オフィス等	建物	1
		器具備品	0

当社グループは、主要な連結子会社である三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社については、同社の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を行っており、その他の連結子会社のうち、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、当社を含むそれ以外の会社については原則として、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を行い減損の兆候を判断しております。

当中間連結会計期間において、店舗網見直しによる廃止予定店舗などの建物・その他、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、本社オフィス移転につき、使用が見込まれなくなった退去フロアなどの建物・器具備品について、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、減損損失（177百万円）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、店舗網見直しによる廃止予定店舗などの建物・その他および本社オフィス移転につき、使用が見込まれなくなった退去フロアなどの建物・器具備品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1.0%で割り引いて算定しております。

当中間連結会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

場所	用途	種類	減損損失額（百万円）
東京都渋谷区	移転予定オフィス	建物	709
		器具備品	41
東京都江東区	業務システム	ソフトウェア	235
その他	遊休資産	建物	60
		土地	8
		器具備品	0

当社グループは、主要な連結子会社である三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社については、同社の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を行っており、その他の連結子会社のうち、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、当社を含むそれ以外の会社については原則として、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を行い減損の兆候を判断しております。

当中間連結会計期間において、移転予定オフィスにつき、使用が見込まれなくなった退去フロアなどの建物・器具備品、業務システムの一部更改による廃止等に伴うソフトウェア、時価が著しく下落した遊休資産の建物・土地・器具備品について、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、減損損失（1,057百万円）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、遊休資産の建物・土地・器具備品については正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額または合理的な見積りにより評価しております。

また、移転予定オフィスにつき、使用が見込まれなくなった退去フロアなどの建物・器具備品および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0.8%で割り引いて算定しております。

(中間連結株主資本等変動計算書関係)

前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30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

	当連結会計年度期 首株式数 (千株)	当中間連結会計期 間増加株式数 (千株)	当中間連結会計期 間減少株式数 (千株)	当中間連結会計期 間末株式数 (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	当中間連結会 計期間末残高 (百万円)
連結子会社	4

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間連結会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が中間連結会計期間末後となるもの
該当事項はありません。

当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30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

	当連結会計年度期 首株式数 (千株)	当中間連結会計期 間増加株式数 (千株)	当中間連結会計期 間減少株式数 (千株)	当中間連結会計期 間末株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	736,985	—	—	736,985
合計	736,985	—	—	736,985

(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

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間連結会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が中間連結会計期間末後となるもの

(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24年10月30日 取締役会	普通株式	7,163	利益剰余金	9.72	平成24年9月30日	平成24年11月15日

(中間連結キャッシュ・フロー計算書関係)

※ 現金及び現金同等物の中間期末残高と中間連結貸借対照表に掲記する科目の金額との関係

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
現金・預金	447,156百万円	332,856百万円
預入期間が3ヵ月を超える定期預金	△6,082	△2,157
現金及び現金同等物の中間期末残高	441,073	330,698

(リース取引関係)

(借主側)

1. ファイナンス・リース取引

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

前連結会計年度(平成24年3月31日)

主として、複合機(器具備品)であります。

当中間連結会計期間(平成24年9月30日)

該当事項はありません。

(2) リース資産の減価償却の方法

中間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中間期末(期末)残高相当額
(単位:百万円)

	前連結会計年度(平成24年3月31日)		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	17	15	2
ソフトウェア	6,154	5,660	494
合計	6,172	5,675	496

(単位:百万円)

	当中間連結会計期間(平成24年9月30日)		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	中間期末残高相当額
器具備品	3	3	0
ソフトウェア	6,154	6,051	103
合計	6,158	6,054	103

(2) 未経過リース料中間期末(期末)残高相当額等

(単位:百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
未経過リース料中間期末(期末) 残高相当額		
1年内	547	114
1年超	—	—
合計	547	114

(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

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
支払リース料	1,183	436
減価償却費相当額	1,077	392
支払利息相当額	28	5

(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。

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

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
1年内	7,888	8,049
1年超	47,176	47,087
合計	55,064	55,136

(金融商品関係)

金融商品の時価等に関する事項

中間連結（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）

前連結会計年度（平成24年3月31日）

	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	452,899	452,899	—
(2) 預託金	98,242	98,242	—
(3) 商品有価証券等	4,743,416	4,743,416	—
(4) 約定見返勘定	232,720	232,720	—
(5) 信用取引資産	39,545	39,545	—
①信用取引貸付金(*1)	29,395		
貸倒引当金	△21		
②信用取引借証券担保金	10,171	10,171	—
(6) 有価証券担保貸付金	7,684,079	7,684,071	△7
①借入有価証券担保金	3,621,431	3,621,431	—
②現先取引貸付金	4,062,647	4,062,639	△7
(7) 立替金	8,716	8,716	—
(8) 短期差入保証金	645,600	645,600	—
(9) 短期貸付金(*1)	101		
貸倒引当金	△0		
(10) 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	595,805	579,617	△16,188
(11) 長期貸付金(*1)	3,585		
貸倒引当金	△55		
	3,529	3,626	96
資 産 計	14,504,657	14,488,558	△16,099
(1) 商品有価証券等	3,290,150	3,290,150	—
(2) 約定見返勘定	—	—	—
(3) 信用取引負債	15,258	15,258	—
①信用取引借入金	7,798	7,798	—
②信用取引貸証券受入金	7,460	7,460	—
(4) 有価証券担保借入金	7,486,103	7,486,110	7
①有価証券貸借取引受入金	3,093,995	3,093,995	—
②現先取引借入金	4,392,107	4,392,114	7
(5) 預り金	89,715	89,715	—
(6) 受入保証金	757,258	757,258	—
(7) 短期借入金	617,497	617,497	—
(8) 1年内返済予定の長期借入金	111,056	111,058	1
(9) コマーシャル・ペーパー	530,100	530,100	—
(10) 1年内償還予定の社債	158,678	158,484	△194
(11) 社債	689,490	689,296	△193
(12) 長期借入金	310,489	309,769	△720
負 債 計	14,055,799	14,054,701	△1,098
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	(38,977)	(38,977)	—
②ヘッジ会計が適用されているもの	6,786	6,786	—
デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計	(32,190)	(32,190)	—

(*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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

	中間連結貸借 対照表計上額 (百万円)	時 価 (百万円)	差 額 (百万円)
(1) 現金・預金	332,856	332,856	—
(2) 預託金	88,722	88,722	—
(3) 商品有価証券等	5,258,304	5,258,304	—
(4) 約定見返勘定	—	—	—
(5) 信用取引資産	34,085	34,085	—
①信用取引貸付金(*1)	28,998		
貸倒引当金	△16		
②信用取引借証券担保金	28,982	28,982	—
①借入有価証券担保金	5,102	5,102	—
(6) 有価証券担保貸付金	8,766,616	8,766,618	2
①借入有価証券担保金	3,983,242	3,983,242	—
②現先取引貸付金	4,783,374	4,783,376	2
(7) 立替金	5,411	5,411	—
(8) 短期差入保証金	760,869	760,869	—
(9) 短期貸付金(*1)	98		
貸倒引当金	△0		
(10) 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	98	98	—
(11) 長期貸付金(*1)	629,611	621,752	△7,859
貸倒引当金	3,502		
	△55		
	3,446	3,542	96
資 産 計	15,880,023	15,872,262	△7,760
(1) 商品有価証券等	3,113,079	3,113,079	—
(2) 約定見返勘定	166,838	166,838	—
(3) 信用取引負債	12,489	12,489	—
①信用取引借入金	3,647	3,647	—
②信用取引貸証券受入金	8,841	8,841	—
(4) 有価証券担保借入金	8,607,000	8,607,000	—
①有価証券貸借取引受入金	3,394,163	3,394,163	—
②現先取引借入金	5,212,836	5,212,836	—
(5) 預り金	109,319	109,319	—
(6) 受入保証金	825,134	825,134	—
(7) 短期借入金	903,353	903,353	—
(8) 1年内返済予定の長期借入金	69,496	69,480	△15
(9) コマーシャル・ペーパー	422,100	422,100	—
(10) 1年内償還予定の社債	204,080	204,055	△25
(11) 社債	725,037	725,727	689
(12) 長期借入金	322,173	322,252	79
負 債 計	15,480,103	15,480,831	728
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	15,954	15,954	—
②ヘッジ会計が適用されているもの	1,813	1,813	—
デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計	17,768	17,768	—

(*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。

(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) 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。

(6) 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。

(7) 立替金、(8) 短期差入保証金ならびに(9) 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。

(10) 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」注記をご参照ください。

(11) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 預り金、(6) 受入保証金ならびに(7) 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。

(8) 1年内返済予定の長期借入金ならびに(12)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引いて現在価値を算定しております。

(9) 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。

(10) 1年内償還予定の社債ならびに(11) 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

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。

(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の中間連結（連結）貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価情報の「資産(10)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。

(単位：百万円)

区分	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
① 非上場株式等 (*1)	300,078	291,633
② 組合出資金等 (*2)	8,259	8,485

(*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)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、「デリバティブ取引関係」注記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。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前連結会計年度 (平成24年 3月31日)

	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	1,099	1,102	3
	(3) 社債	5,714	5,751	36
	(4) 外国債券	—	—	—
	(5) その他	—	—	—
	小計	6,814	6,853	39
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	1,400	1,387	△12
	(4) 外国債券	181,952	165,560	△16,392
	(5) その他	—	—	—
	小計	183,353	166,948	△16,404
合計		190,167	173,802	△16,364

当中間連結会計期間 (平成24年 9月30日)

	種類	中間連結貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
時価が中間連結貸借対照 表計上額を超えるもの	(1) 国債・地方債	—	—	—
	(2) 特殊債	—	—	—
	(3) 社債	1,107	1,122	14
	(4) 外国債券	—	—	—
	(5) その他	—	—	—
	小計	1,107	1,122	14
時価が中間連結貸借対照 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	180,215	172,104	△8,110
	(5) その他	—	—	—
	小計	180,215	172,104	△8,110
合計		181,323	173,227	△8,095

2. その他有価証券

前連結会計年度（平成24年3月31日）

	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	6,608	2,856	3,751
	(2) 債券	301,327	297,336	3,990
	(3) その他	3,231	2,988	242
	小計	311,167	303,181	7,985
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	8,552	9,816	△1,263
	(2) 債券	71,650	71,737	△87
	(3) その他	14,268	14,917	△648
	小計	94,471	96,471	△1,999
合計		405,638	399,652	5,985

(注) 非上場株式等（連結貸借対照表計上額 19,324百万円）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 8,259百万円）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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

	種類	中間連結貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間連結貸借対照表計上 額が取得原価を超えるもの	(1) 株式	2,774	1,357	1,416
	(2) 債券	350,990	342,978	8,012
	(3) その他	4,223	4,070	153
	小計	357,988	348,406	9,582
中間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	7,105	10,180	△3,074
	(2) 債券	70,824	71,047	△222
	(3) その他	12,369	13,179	△809
	小計	90,299	94,406	△4,106
合計		448,288	442,813	5,475

(注) 非上場株式等（中間連結貸借対照表計上額 18,870百万円）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（中間連結貸借対照表計上額 8,485百万円）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。

3. 減損処理を行った有価証券

前連結会計年度において、有価証券について9,910百万円（その他有価証券の株式7,074百万円、その他有価証券のその他2,836百万円）減損処理を行っております。

当中間連結会計期間において、有価証券について303百万円（その他有価証券の株式303百万円）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中間連結決算日（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。

(デリバティブ取引関係)

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中間連結（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

前連結会計年度（平成24年3月31日）

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	9,919,990	6,243,757	△31,914	△31,914
		買建	859,177	700,666	9,509	9,509
	金利オプション	売建	566,753	—	100	190
		買建	664,293	—	△44	△219
市場取引以外 の取引	金利先渡契約	売建	19,664,422	401,362	630	630
		買建	18,452,506	393,575	549	549
	金利スワップ	受取固定・ 支払変動	205,788,899	146,739,407	5,439,991	5,439,991
		受取変動・ 支払固定	197,639,016	138,272,780	△5,306,076	△5,306,076
		受取変動・ 支払変動	14,653,046	11,459,493	15,724	15,724
		受取固定・ 支払固定	631,587	624,075	4,309	4,309
	金利スワップション	売建	91,491,792	53,295,703	△999,986	△56,663
		買建	89,774,958	52,350,420	891,265	△28,437
	その他	売建	4,543,788	3,863,030	△38,191	△9,519
		買建	3,161,624	2,177,262	31,737	10,824
	合計			—	—	17,606

(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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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	8,789,727	6,507,608	△36,348	△36,348	
		買建	1,365,199	1,254,721	8,842	8,842	
	金利オプション	売建	1,695,760	—	242	323	
		買建	1,429,199	9,811	△114	△272	
市場取引以外の取引	金利先渡契約	売建	25,756,165	780,225	5,826	5,826	
		買建	25,626,510	989,912	△4,590	△4,590	
	金利スワップ	受取固定・ 支払変動	207,354,112	150,118,391	6,576,171	6,576,171	
		受取変動・ 支払固定	201,078,171	146,761,835	△6,435,913	△6,435,913	
		受取変動・ 支払変動	15,291,635	11,912,929	11,358	11,358	
		受取固定・ 支払固定	685,073	676,228	7,233	7,233	
	金利スワップション	売建	72,537,403	42,300,055	△992,084	△131,885	
		買建	70,750,563	41,362,447	890,077	49,597	
	その他	売建	4,470,422	1,949,210	△40,145	△15,213	
		買建	2,745,447	2,029,095	31,675	11,503	
	合計			—	—	22,231	46,632

(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

前連結会計年度（平成24年3月31日）

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		12,870,036	10,374,934	4,099	4,099
	為替予約	売建	1,552,802	250,176	△2,648	△2,648
		買建	841,950	240,525	7,408	7,408
	通貨オプション	売建	3,031,289	2,172,661	△193,204	△84,067
		買建	2,267,189	1,753,623	145,101	49,009
合計			—	—	△39,242	△26,198

(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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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	通貨先物	売建	937	—	0	0
		買建	—	—	—	—
市場取引以外の取引	通貨スワップ		13,125,427	10,985,304	16,543	16,543
	為替予約	売建	1,482,833	249,021	7,953	7,953
		買建	918,193	230,755	2,904	2,904
	通貨オプション	売建	3,120,640	2,052,564	△164,141	△49,686
		買建	2,460,618	1,697,851	124,278	27,141
合計			—	—	△12,462	4,855

(注) 時価の算定方法

市場取引については、シカゴ・マーカントイル取引所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。

(c)株式関連取引

前連結会計年度（平成24年3月31日）

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	579,921	—	△40,453	△40,453
		買建	112,512	—	2,502	2,502
	株式指数 オプション	売建	247,931	85,081	△17,299	957
		買建	328,087	111,035	15,531	△6,555
市場取引以外の取引	有価証券 店頭オプション	売建	403,388	268,906	△50,322	△13,332
		買建	289,856	183,301	32,413	7,232
	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	121,973	121,150	△1,210	△1,210
		金利受取・株価 指数変化率支払	201,476	189,545	14,839	14,839
	有価証券店頭 指数等先渡取引	売建	591	—	26	26
		買建	5,783	2,727	65	65
	合計			—	—	△43,906

(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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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	486,860	—	△1,647	△1,647
		買建	20,460	99	△167	△167
	株式指数 オプション	売建	252,282	114,147	△15,433	6,210
		買建	387,212	129,510	15,741	△10,213
市場取引以外の取引	有価証券 店頭オプション	売建	458,610	298,516	△45,603	△10,674
		買建	270,832	181,761	23,876	△1,167
	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	121,193	120,950	△3,352	△3,352
		金利受取・株価 指数変化率支払	202,245	200,865	23,325	23,325
	有価証券店頭 指数等先渡取引	売建	526	—	10	10
		買建	5,386	529	△47	△47
合計			—	—	△3,299	2,275

(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

前連結会計年度（平成24年3月31日）

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	289,832	42,559	△901	△901	
		買建	327,039	6,302	972	972	
	債券先物 オプション	売建	347,478	40,288	△557	34	
		買建	171,198	28,808	61	△172	
市場取引以外の取引	債券店頭 オプション	売建	137,494	—	△57	1,171	
		買建	44,790	—	17	△52	
	債券店頭 スワップ	受取固定・ 支払変動	3,300	3,300	287	287	
		受取変動・ 支払固定	3,000	3,000	53	53	
		受取変動・ 支払変動	132,000	132,000	△2,844	△2,844	
		受取固定・ 支払固定	10,300	10,300	835	835	
	合計			—	—	△2,134	△617

(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、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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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	390,397	107,461	△337	△337	
		買建	184,972	64,110	△121	△121	
	債券先物 オプション	売建	369,961	189,608	△422	△148	
		買建	207,798	152,367	336	142	
市場取引以外の取引	債券店頭 オプション	売建	264,008	—	△1,230	927	
		買建	184,232	—	582	△636	
	債券店頭 スワップ	受取固定・ 支払変動	3,300	3,300	303	303	
		受取変動・ 支払固定	3,000	3,000	104	104	
		受取変動・ 支払変動	132,000	132,000	△2,426	△2,426	
		受取固定・ 支払固定	11,300	11,300	892	892	
	合計			—	—	△2,318	△1,300

(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、割引現在価値やオプション価格計算モデル等により算定しております。

(e)商品関連取引

前連結会計年度（平成24年3月31日）

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	77,319	14,474	6,132	6,132
		買建	173,725	64,082	△7,949	△7,949
	商品オプション	売建	86,782	9,949	△5,185	△2,984
		買建	80,567	8,790	5,207	2,534
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	238,787	109,990	△16,166	△16,166
		金利受取・商品 指数変化率支払	93,858	39,151	45,213	45,213
	商品オプション	売建	272,368	76,879	△15,398	△6,087
		買建	294,926	99,756	16,215	6,044
合計			—	—	28,069	26,737

(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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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	48,552	13,253	5,457	5,457
		買建	186,127	77,421	△17,741	△17,741
	商品オプション	売建	96,530	15,100	△5,250	△2,758
		買建	91,782	13,624	6,043	2,912
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	308,256	129,074	3,417	3,417
		金利受取・商品 指数変化率支払	107,070	43,853	23,019	23,019
	商品オプション	売建	288,763	94,730	△10,339	△1,603
		買建	292,646	106,673	11,281	2,009
合計			—	—	15,887	14,712

(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
前連結会計年度（平成24年3月31日）

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・オプション	売建	2,749,357	1,949,853	△6,418	△6,371
		買建	2,362,817	1,783,689	7,174	7,111
合計			—	—	756	740

(注) 1 時価の算定方法

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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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・オプション	売建	2,971,370	2,193,235	△59,755	△59,755
		買建	2,676,434	2,114,465	55,724	55,724
	トータル・レート・オブ・リターンスワップ	売建	—	—	—	—
		買建	1,194	—	△9	△9
合計			—	—	△4,039	△4,039

(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
前連結会計年度（平成24年3月31日）

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	地震デリバティブ	売建	4,282	—	△178	△178
		買建	4,282	—	53	53
合計			—	—	△125	△125

(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。

当中間連結会計期間（平成24年9月30日）

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	地震デリバティブ	売建	4,317	—	△59	△59
		買建	4,317	—	15	15
合計			—	—	△44	△44

(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。

(ストック・オプション等関係)

前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1. スtock・オプションに係る当中間連結会計期間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tock・オプションに係る当初の資産計上額及び科目名
現金・預金 4百万円

3. 当中間連結会計期間に付与したストック・オプションの内容
該当事項はありません。

当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち中間連結(連結)貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の総額の増減

	前連結会計年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
期首残高	5,104百万円	5,035百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	1,356	2
時の経過による調整額	80	31
資産除去債務の履行による減少額	△984	△1,152
見積りの変更による減少額	△521	—
中間期末(期末)残高	5,035	3,916

(2) 資産除去債務の見積りを変更した場合の概要及び影響額

前連結会計年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

当連結会計年度において、一部の資産の除去時点において必要とされる除去費用が、既見積額を下回る見込みであることが明らかになったことから、変更前の資産除去債務残高より521百万円減算している。

当中間連結会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

1. 報告セグメントの概要

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

当社グループは、金融商品取引業を中心とする営業活動を各地域で展開し、投資・金融サービスに係る事業を行っております。その中で当社は、証券持株会社として傘下の事業会社各社のグループ間連携を推進しつつ、業態毎に経営資源の配分や業績の検討を行っております。

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

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

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

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

3. 報告セグメントごとの純営業収益、利益または損失、資産その他の項目の金額に関する情報
前中間連結会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

（単位：百万円）

	報告セグメント					その他 (注) 1	合計	調整額 (注) 2	中間連結 財務諸表 計上額 (注) 3
	証券業務 (国内)	証券業務 (英国)	証券業務 (米国)	投信投資 顧問業	計				
純営業収益									
外部顧客からの純営業 収益	80,319	7,957	4,511	23,684	116,472	△ 2,393	114,079	—	114,079
セグメント間の内部純 営業収益または振替高	1,134	1,445	1,083	—	3,663	9,572	13,235	△13,235	—
計	81,454	9,403	5,594	23,684	120,136	7,178	127,314	△ 13,235	114,079
セグメント利益または 損失 (△)	△ 3,158	△ 275	△ 131	4,303	738	61,573	62,312	△ 45,959	16,353
セグメント資産	14,796,863	7,647,499	2,159,902	85,235	24,689,501	1,843,236	26,532,737	△ 2,169,069	24,363,668
その他の項目									
減価償却費	7,783	617	171	356	8,928	114	9,042	△ 300	8,741
のれんの償却額	—	—	—	—	—	81	81	48	130
受取利息	4	3,307	—	299	3,611	83	3,694	△ 62	3,631
支払利息	—	—	—	—	—	320	320	△ 7	313
持分法投資利益または 損失 (△)	—	—	—	—	—	—	—	19,745	19,745
特別利益	4,446	437	—	11	4,895	17,049	21,945	△ 5,092	16,853
（うち、投資有価証券 売却益）	(3,691)	(430)	(—)	(11)	(4,134)	(0)	(4,135)	(△ 0)	(4,134)
（うち、関係会社株式 売却益）	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(16,947)	(16,947)	(△ 4,628)	(12,318)
特別損失	3,965	—	—	74	4,040	6,410	10,450	△ 401	10,048
（うち、投資有価証券 評価損）	(1,948)	(—)	(—)	(12)	(1,960)	(5,995)	(7,955)	(—)	(7,955)
（うち、減損損失）	(177)	(—)	(—)	(—)	(177)	(2)	(179)	(△ 2)	(177)
（うち、本社移転費 用）	(1,324)	(—)	(—)	(—)	(1,324)	(181)	(1,506)	(△ 109)	(1,396)
税金費用	△ 748	285	△ 121	3,001	2,417	△ 851	1,566	5	1,571
持分法適用会社への投 資額	—	—	—	—	—	466,400	466,400	△ 160,147	306,253
有形固定資産および無 形固定資産の増加額	11,737	1,168	196	311	13,412	7,974	21,387	△ 8,204	13,182

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

2. 調整額は、以下のとおりであります。

(1) セグメント利益または損失の調整額△45,959百万円には、セグメント間取引消去等△54,307百万円、持分法適用関連会社の株式売却益の修正△4,829百万円、および各セグメントに配分していない持分法投資損益・税金費用・少数株主損益13,014百万円が含まれております。

(2) セグメント資産の調整額は、主にセグメント間の債権等の相殺消去です。

3. セグメント利益または損失は、中間連結財務諸表の中間純利益と調整を行っております。

当中間連結会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

（単位：百万円）

	報告セグメント					その他 (注) 1	合計	調整額 (注) 2	中間連結 財務諸表 計上額 (注) 3
	証券業務 (国内)	証券業務 (英国)	証券業務 (米国)	投信投資 顧問業	計				
純営業収益									
外部顧客からの純営業 収益	94,651	10,948	7,883	17,000	130,483	△ 1,364	129,119	—	129,119
セグメント間の内部純 営業収益または振替高	149	1,393	△149	—	1,393	9,288	10,682	△10,682	—
計	94,801	12,341	7,733	17,000	131,876	7,924	139,801	△ 10,682	129,119
セグメント利益または 損失 (△)	18,935	2,859	△ 120	2,728	24,403	26,548	50,951	△ 32,934	18,017
セグメント資産	13,799,187	9,876,133	1,914,606	87,404	25,677,332	1,979,449	27,656,782	△ 2,727,056	24,929,725
その他の項目									
減価償却費	5,971	554	156	344	7,027	194	7,221	△ 230	6,991
受取利息	4	3,355	—	212	3,571	82	3,654	△ 62	3,591
支払利息	—	—	—	—	—	28	28	△ 28	—
持分法投資利益または 損失 (△)	—	—	—	—	—	—	—	12,007	12,007
特別利益	2,173	401	0	2	2,576	33	2,610	—	2,610
（うち、投資有価証券 売却益）	(1,851)	(401)	(—)	(2)	(2,255)	(—)	(2,255)	(—)	(2,255)
（うち、固定資産売却 益）	(287)	(—)	(0)	(—)	(287)	(33)	(321)	(—)	(321)
特別損失	1,236	0	252	—	1,489	—	1,489	△ 0	1,489
（うち、減損損失）	(1,057)	(—)	(—)	(—)	(1,057)	(—)	(1,057)	(△ 0)	(1,057)
（うち、割増退職金）	(—)	(—)	(252)	(—)	(252)	(—)	(252)	(—)	(252)
税金費用	△ 3,648	1,100	△ 145	1,682	△ 1,010	923	△ 87	△ 103	△ 190
持分法適用会社への投 資額	—	—	—	—	—	413,132	413,132	△ 140,369	272,763
有形固定資産および無 形固定資産の増加額	4,476	655	189	191	5,514	270	5,784	△ 166	5,618

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

2. 調整額は、以下のとおりであります。

(1) セグメント利益または損失の調整額△32,934百万円には、セグメント間取引消去等△30,737百万円、および各セグメントに配分していない持分法投資損益・税金費用・少数株主損益△1,717百万円が含まれております。

(2) セグメント資産の調整額は、主にセグメント間の債権等の相殺消去です。

3. セグメント利益または損失は、中間連結財務諸表の中間純利益と調整を行っております。

【関連情報】

前中間連結会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1. サービスごとの情報

セグメント情報に同様の情報を開示しているため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 純営業収益

(単位：百万円)

日本	欧州	その他	合計
101,703	7,419	4,956	114,079

(注) 純営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

(単位：百万円)

日本	欧州	その他	合計
24,694	3,245	722	28,662

3. 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客からの純営業収益で中間連結損益計算書の純営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

当中間連結会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. サービスごとの情報

セグメント情報に同様の情報を開示しているため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 純営業収益

(単位：百万円)

日本	欧州	その他	合計
109,370	11,424	8,323	129,119

(注) 純営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

(単位：百万円)

日本	欧州	その他	合計
24,071	2,832	803	27,707

3. 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客からの純営業収益で中間連結損益計算書の純営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

【報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報】

前中間連結会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

セグメント情報に同様の情報を開示しているため、記載を省略しております。

当中間連結会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

セグメント情報に同様の情報を開示しているため、記載を省略しております。

【報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報】

前中間連結会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

（単位：百万円）

	証券業務 （国内）	証券業務 （英国）	証券業務 （米国）	投信投資 顧問業	その他	全社・消去	合計
当中間期末残高	-	-	-	-	570	-	570

（注）その他の金額は全て有価証券投資業務に係る金額であります。

なお、のれんの償却額に関しては、セグメント情報に同様の情報を開示しているため、記載を省略しております。

当中間連結会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

【報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報】

前中間連結会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

当中間連結会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	前中間連結会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	22.81円	24.45円
(算定上の基礎)		
中間純利益金額(百万円)	16,353	18,017
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—	—
普通株式に係る中間純利益金額(百万円)	16,353	18,017
普通株式の期中平均株式数(千株)	716,985	736,985
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額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株式会社 福寅 ① 新株予約権(ストックオプション) ・付与日 平成22年3月24日 ・行使期限 平成26年3月24日 ・権利行使価格 12,000円 ・当初付与個数 9,830個 ・23年9月末現在個数 9,830個 ② 新株予約権(ストックオプション) ・付与日 平成22年3月24日 ・行使期限 平成26年3月24日 ・権利行使価格 12,000円 ・当初付与個数 2,540個 ・23年9月末現在個数 2,540個	—

(注) 当中間連結会計期間の潜在株式調整後1株当たり中間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いません。なお、前中間連結会計期間の潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、希薄化効果を有している潜在株式が存在しないため記載していません。

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当中間連結会計期間 (平成24年9月30日)
1株当たり純資産額	808.05円	835.08円
(算定上の基礎)		
純資産の部の合計額(百万円)	819,651	843,405
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	224,128	227,962
(うち少数株主持分)(百万円)	(224,128)	(227,962)
普通株式に係る中間期末(期末)の純資産額(百万円)	595,522	615,442
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末(期末)の普通株式の数(千株)	736,985	736,985

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(2) 【その他】

該当事項はありません。

2 【中間財務諸表等】
 (1) 【中間財務諸表】
 ① 【中間貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当中間会計期間 (平成24年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	6,328	16,807
有価証券	57,852	49,081
親会社株式	254	225
繰延税金資産	501	730
短期貸付金	247,610	400,382
未収還付法人税等	7,440	2,701
短期差入保証金	2,853	7,210
その他	30,261	36,559
流動資産合計	353,103	513,697
固定資産		
有形固定資産	※1 48	※1 48
無形固定資産	125	143
投資その他の資産		
投資有価証券	※4 665,286	※4 663,289
長期貸付金	206,367	138,018
その他	481	352
貸倒引当金	△55	△55
投資その他の資産合計	872,079	801,604
固定資産合計	872,253	801,796
資産合計	1,225,356	1,315,493
負債の部		
流動負債		
1年内返済予定の長期借入金	73,000	59,500
1年内償還予定の社債	43,225	70,405
未払法人税等	205	203
賞与引当金	117	248
その他	20,814	23,131
流動負債合計	137,362	153,488
固定負債		
社債	222,421	274,148
長期借入金	156,800	168,800
繰延税金負債	138	1,075
その他	193	115
固定負債合計	379,553	444,139
負債合計	516,916	597,627

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当中間会計期間 (平成24年9月30日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	75,518	75,518
資本剰余金		
資本準備金	426,944	426,944
資本剰余金合計	426,944	426,944
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	92,519	103,660
利益剰余金合計	179,280	190,422
株主資本合計	681,743	692,885
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	26,696	24,981
評価・換算差額等合計	26,696	24,981
純資産合計	708,440	717,866
負債純資産合計	1,225,356	1,315,493

②【中間損益計算書】

(単位：百万円)

	前中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月 30日)		当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月 30日)	
営業収益				
関係会社受取配当金		37,921		13,042
関係会社受入手数料		1,454		2,407
関係会社貸付金利息		1,718		2,137
その他		521		2,310
営業収益合計		41,615		19,897
営業費用				
販売費及び一般管理費				
取引関係費		1,205		1,588
人件費		1,281		1,617
不動産関係費		96		104
事務費		148		168
減価償却費	※1	5	※1	16
租税公課		226		174
その他		127		120
販売費及び一般管理費合計		3,090		3,789
金融費用		1,531		4,060
営業費用合計		4,621		7,849
営業利益		36,993		12,048
営業外収益	※2	1,196	※2	836
営業外費用	※3	928	※3	873
経常利益		37,261		12,011
特別利益				
関係会社株式売却益		16,947		—
固定資産売却益		0		0
特別利益合計		16,947		0
特別損失				
投資有価証券評価損	※4	5,995		—
減損損失		2		—
本社移転費用		92		—
特別損失合計		6,090		—
税引前中間純利益		48,118		12,011
法人税、住民税及び事業税		797		3
法人税等調整額		△1,869		867
法人税等合計		△1,071		870
中間純利益		49,190		11,141

③【中間株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	前中間会計期間 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月 30 日)		当中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月 30 日)	
株主資本				
資本金				
当期首残高		65,518		75,518
当中間期変動額				
当中間期変動額合計		—		—
当中間期末残高		65,518		75,518
資本剰余金				
資本準備金				
当期首残高		416,944		426,944
当中間期変動額				
当中間期変動額合計		—		—
当中間期末残高		416,944		426,944
資本剰余金合計				
当期首残高		416,944		426,944
当中間期変動額				
当中間期変動額合計		—		—
当中間期末残高		416,944		426,944
利益剰余金				
利益準備金				
当期首残高		12,208		12,208
当中間期変動額				
当中間期変動額合計		—		—
当中間期末残高		12,208		12,208
その他利益剰余金				
別途積立金				
当期首残高		74,553		74,553
当中間期変動額				
当中間期変動額合計		—		—
当中間期末残高		74,553		74,553
繰越利益剰余金				
当期首残高		32,591		92,519
当中間期変動額				
中間純利益		49,190		11,141
当中間期変動額合計		49,190		11,141
当中間期末残高		81,781		103,660
利益剰余金合計				
当期首残高		119,352		179,280
当中間期変動額				
中間純利益		49,190		11,141
当中間期変動額合計		49,190		11,141
当中間期末残高		168,543		190,422

(単位：百万円)

	前中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
株主資本合計		
当期首残高	601,815	681,743
当中間期変動額		
中間純利益	49,190	11,141
当中間期変動額合計	49,190	11,141
当中間期末残高	651,006	692,885
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	27,366	26,696
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	2,708	△1,715
当中間期変動額合計	2,708	△1,715
当中間期末残高	30,074	24,981
評価・換算差額等合計		
当期首残高	27,366	26,696
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	2,708	△1,715
当中間期変動額合計	2,708	△1,715
当中間期末残高	30,074	24,981
純資産合計		
当期首残高	629,182	708,440
当中間期変動額		
中間純利益	49,190	11,141
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	2,708	△1,715
当中間期変動額合計	51,898	9,426
当中間期末残高	681,080	717,866

【重要な会計方針】

1. 資産の評価基準および評価方法

(1) 有価証券の評価基準および評価方法

① 売買目的有価証券

時価法（売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

② 子会社株式および関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

③ その他有価証券

ア. 時価のあるもの

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

イ. 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

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、原則として持分相当額を純額で取り込む方法によっております。なお、当社の子会社であるMMパートナーシップへの出資については、経済実態を適切に反映するため、資産、負債および収益、費用を出資持分割合に応じて取り込む方法によっております。

(2) デリバティブの評価基準および評価方法

時価法を採用しております。

2. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、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. その他中間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。

【注記事項】

(中間貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年 3月31日)	当中間会計期間 (平成24年 9月30日)
減価償却累計額	260百万円	263百万円

2. 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。この契約に基づく貸出未実行残高は以下のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年 3月31日)	当中間会計期間 (平成24年 9月30日)
貸出コミットメントの総額	5,000百万円	5,000百万円
貸出実行残高	—	—
差引額	5,000	5,000

(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1行と当座貸越契約を締結しております。この契約に基づく借入未実行残高は以下のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年 3月31日)	当中間会計期間 (平成24年 9月30日)
当座貸越極度額の総額	45,000百万円	45,000百万円
借入実行残高	—	—
差引額	45,000	45,000

3. 偶発債務

(保証債務)

- 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、当中間会計期間末において当該残高は、それぞれ82,839百万円(前事業年度末は71,382百万円)および600百万円(前事業年度末は600百万円)であります。
- 三菱UFJセキュリティーズインターナショナルが受け入れた担保の返還債務に対して保証を行っております。なお、当中間会計期間末において当該残高は、92,551百万円(前事業年度末は90,947百万円)であります。
- 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社の証券・資金決済機関への債務に対して保証を行っております。なお、当中間会計期間末における保証極度額は、46,560百万円(前事業年度末は49,314百万円)であります。
- 三菱UFJセキュリティーズ(USA)がクレジットデリバティブ取引を行うにあたり取引の相手方となる金融機関への債務に対して保証を行っております。なお、当中間会計期間末及び前事業年度末において当該残高はございません。
- 三菱UFJセキュリティーズインターナショナルの清算機関への債務に対して保証を行っております。なお、当中間会計期間末及び前事業年度末において当該残高はございません。

(契約上の債務)

当社は、三菱UFJセキュリティーズインターナショナルとの間でISDA契約に基づく取引先がデフォルトした際において対象取引の再構築に係る損失を負担する契約を締結しております。なお、当中間会計期間末において当該残高は、5,296百万円(前事業年度末は9,284百万円)であります。

※4. 投資有価証券

関係会社株式およびその他の関係会社有価証券の残高は以下のとおりであります。

	前事業年度 (平成24年 3月31日)	当中間会計期間 (平成24年 9月30日)
	655,589百万円	655,136百万円

(中間損益計算書関係)

※ 1. 減価償却実施額は次のとおりであります。

	前中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月 30日)	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月 30日)
有形固定資産	3百万円	2百万円
無形固定資産	1	13
計	5	16

※ 2. 営業外収益のうち主なものは次のとおりであります。

	前中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月 30日)	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月 30日)
受取配当金	254百万円	426百万円
有価証券運用益	429	—
デリバティブ運用益	—	359
貸倒引当金戻入額	488	—

※ 3. 営業外費用のうち主なものは次のとおりであります。

	前中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月 30日)	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月 30日)
投資事業有限責任組合等出資損失	95百万円	115百万円
有価証券運用損失	—	746
デリバティブ運用損失	820	—

※ 4. 投資有価証券評価損

上場の投資有価証券について、金融商品に関する会計基準に基づき減損処理を行ったものであります。

(中間株主資本等変動計算書関係)

前中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月 30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。

当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月 30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。

(有価証券関係)

子会社株式および関連会社株式

前事業年度(平成24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はありません。

当中間会計期間(平成24年9月30日)

子会社株式および関連会社株式で時価のあるものはありません。

(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の中間貸借対照表計上額(貸借対照表計上額)

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (平成24年3月31日)	当中間会計期間 (平成24年9月30日)
子会社株式	499,581	499,581
関連会社株式	155,286	155,286

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、「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、「投資有価証券」に計上されているみなし有価証券(当中間会計期間 269百万円、前事業年度 722百万円)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。

(1株当たり情報)

	前中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	68.61円	15.12円
(算定上の基礎)		
中間純利益金額(百万円)	49,190	11,141
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—	—
普通株式に係る中間純利益金額(百万円)	49,190	11,141
普通株式の期中平均株式数(千株)	716,985	736,985

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間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。

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当中間会計期間 (平成24年9月30日)
1株当たり純資産額	961.27円	974.06円
(算定上の基礎)		
純資産の部の合計額(百万円)	708,440	717,866
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	—	—
普通株式に係る中間期末(期末)の純資産額 (百万円)	708,440	717,866
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末 (期末)の普通株式の数(千株)	736,985	736,985

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(2) 【その他】

平成24年10月30日開催の取締役会において、第8期の中間配当に関し、次のとおり決議いたしました。

中間配当による配当金の総額	7,163百万円
1株当たりの金額	9円72銭

第6【提出会社の参考情報】

当中間会計期間の開始日から半期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7期)(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

平成24年6月27日
関東財務局長に提出

(2) 臨時報告書

金融商品取引法第24条の5第4項なら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9号(代表取締役の異動)

平成24年6月18日
関東財務局長に提出

金融商品取引法第24条の5第4項なら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9号(代表取締役の異動)

平成24年6月18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。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月28日

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社

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 古澤 茂 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の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの連結会計年度の中間連結会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間連結財務諸表、すなわち、中間連結貸借対照表、中間連結損益計算書、中間連結包括利益計算書、中間連結株主資本等変動計算書、中間連結キャッシュ・フロー計算書、中間連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項及びその他の注記について中間監査を行った。

中間連結財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間連結財務諸表の作成基準に準拠して中間連結財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間連結財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間連結財務諸表には全体として中間連結財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間連結財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間連結財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間連結財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間連結財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間連結財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ証券ホールディングス株式会社及び連結子会社の平成24年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間連結会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績及びキャッシュ・フローの状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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、中間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. 中間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。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月28日

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社

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 古澤 茂 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の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第8期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ証券ホールディングス株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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、中間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. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。