

# 業務及び財産の状況に関する説明書

## 【平成 30 年 3 月期】

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

あおぞら証券株式会社

## I. 当社の概況及び組織に関する事項

### 1. 商号

あおぞら証券株式会社

### 2. 登録年月日（登録番号）

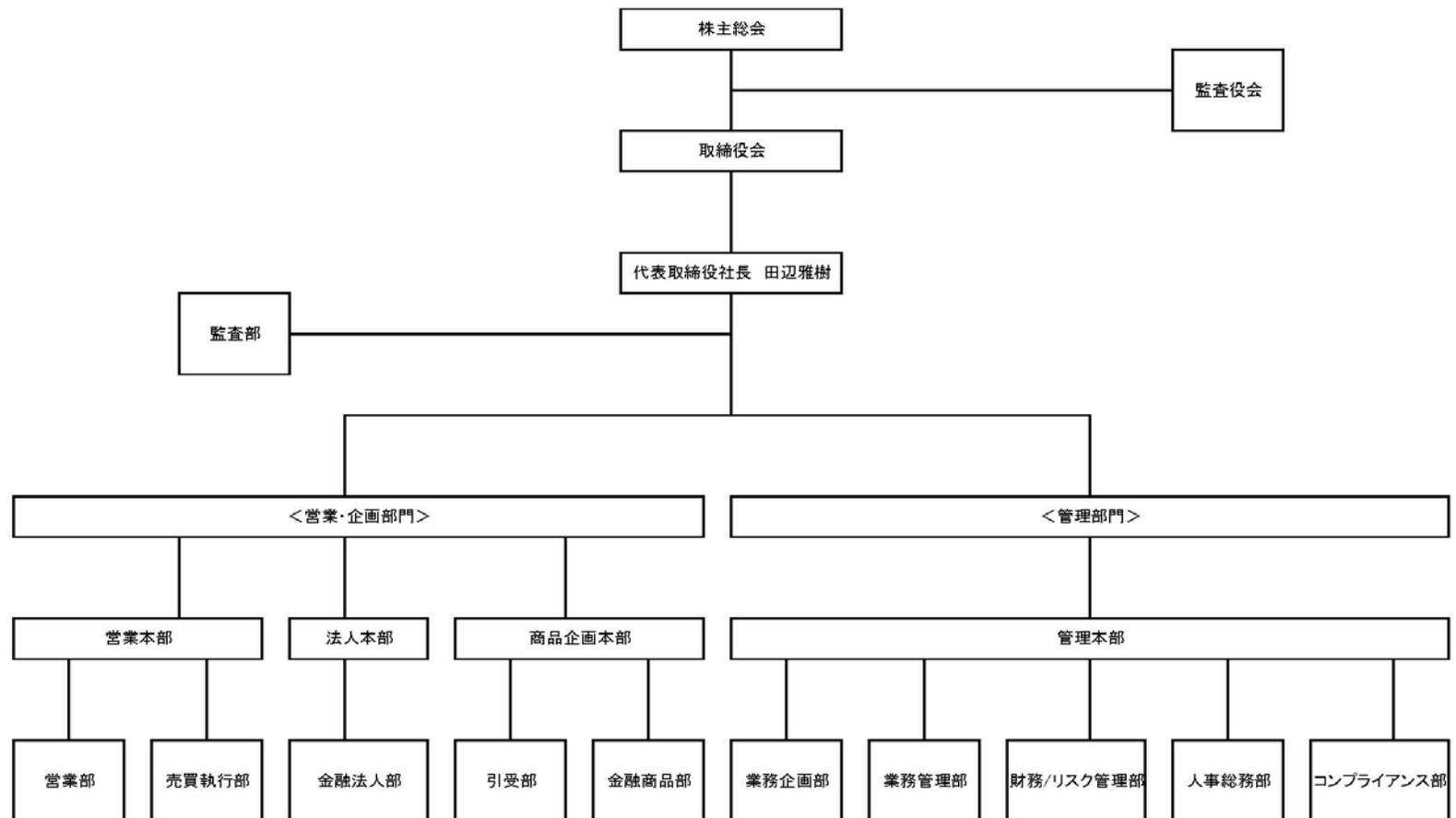
平成 20 年 3 月 13 日（関東財務局長（金商）第 1764 号）

### 3. 沿革及び経営の組織

#### (1) 会社の沿革

年 月	沿 革
平成 20 年 4 月	第一種金融商品取引業者として登録を受け、ジャパン・ウェルス・マネジメント証券株式会社が営業を開始。
平成 23 年 12 月	ジャパン・ウェルス・マネジメント証券株式会社は、株式会社あおぞら銀行の 100%子会社となる。
平成 24 年 2 月	株式会社あおぞら銀行の 100%子会社であるあおぞら証券株式会社と合併し、同日社名をあおぞら証券株式会社とした。
平成 25 年 11 月	本店を千代田区九段南へ移転。
平成 29 年 5 月	本店を千代田区麴町へ移転。

(2) 経営の組織（平成 30 年 3 月 31 日現在）



4. 株式の保有数の上位 10 位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合

氏名又は名称	保有株式数	割合
1. 株式会社あおぞら銀行	30,501 株	100.00%
2.		
3.		
4.		
5.		
6.		
7.		
8.		
9.		
10.		
<del>その他 ( 名)</del>		
計 1 名	30,501 株	100.00%

5. 役員（外国法人にあつては、国内における代表者を含む。）の氏名又は名称

役職名	氏名又は名称	代表権の有無	常勤・非常勤の別
代表取締役社長	田辺 雅樹	有	常勤
代表取締役副社長	尾崎 克行	有	常勤
取締役	山下 夏生	無	常勤
取締役	野村 孝禎	無	非常勤
取締役	小原 正好	無	非常勤
取締役	真野 征人	無	非常勤
社外常勤監査役	川村 英人	無	常勤
社外監査役	瀧野 弘和	無	非常勤
監査役	稲田 博志	無	非常勤

6. 政令で定める使用人の氏名

- (1) 金融商品取引業に関し、法令等（法令、法令に基づく行政官庁の処分又は定款その他の規則をいう。）を遵守させるための指導に関する業務を統括する者（部長、次長、課長その他いかなる名称を有する者であるかどうかを問わず、当該業務を統括する者の権限を代行し得る地位にある者を含む。）の氏名

氏 名	役 職 名
山下 夏生	取締役管理本部長

- (2) 投資助言業務（金融商品取引法（以下「法」という。）第 28 条第 6 項に規定する投資助言業務をいう。）又は投資運用業（同条第 4 項に規定する投資運用業をいう。）に関し、助言又は運用（その指図を含む。）を行う部門を統括する者（金融商品の価値等（法第 2 条第 8 項第 11 号ロに規定する金融商品の価値等をいう。）の分析に基づく投資判断を行う者を含む。）の氏名

氏 名	役 職 名

- (3) 投資助言・代理業（法第 28 条第 3 項に規定する投資助言・代理業をいう。）に関し、法第 29 条の 2 第 1 項第 6 号の営業所又は事務所の業務を統括する者（部長、次長、課長その他いかなる名称を有する者であるかどうかを問わず、当該業務を統括する者の権限を代行し得る地位にある者を含む。）の氏名

氏 名	役 職 名

## 7. 業務の種別

弊社が行う事業として下記の業務がある。

- (1) 金融商品取引業（金融商品取引法第 2 条第 8 項）
- ① 金融商品取引法第 28 条第 1 項第 1 号に掲げる行為に係る業務
  - ② 金融商品取引法第 28 条第 1 項第 2 号に掲げる行為に係る業務
  - ③ 金融商品取引法第 28 条第 1 項第 3 号ロに掲げる行為に係る業務
  - ④ 金融商品取引法第 28 条第 1 項第 3 号ハに掲げる行為に係る業務
  - ⑤ 有価証券等管理業務
  - ⑥ 第二種金融商品取引業
- (2) 金融商品取引業付随業務（金融商品取引法第 35 条第 1 項）
- ① 有価証券の貸借業務
  - ② 信用取引に付随する金銭の貸付業務
  - ③ 保護預り有価証券担保貸付業務
  - ④ 有価証券に関する顧客の代理業務

- ⑤ 受益証券に係る収益金、償還金又は解約金の支払いに係る代理業務
- ⑥ 投資証券等に係る金銭の分配、払戻金若しくは残余財産の分配又は利息若しくは償還金の支払に係る代理業務
- ⑦ 累積投資契約の締結業務
- ⑧ 有価証券に関連する情報の提供又は助言業務
- ⑨ 他の事業者の経営に関するコンサルティング業務
- ⑩ 外国通貨の売買、又はその媒介
- ⑪ 他の金融商品取引業者等の業務の代理

(3) その他業務（金融商品取引法第 35 条第 2 項）

- ① 顧客に対して他の事業者の紹介を行う業務
- ② 他の事業者の業務に関する広告又は宣伝を行う業務

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

- ① 有価証券関連業
- ② 不動産信託受益権等売買等業務

8. 本店その他の営業所又は事務所（外国法人にあつては、本店及び国内における主たる営業所又は事務所その他の営業所又は事務所）の名称及び所在地

名 称	所 在 地
あおぞら証券株式会社	〒102-0083 東京都千代田区麹町 6-1-1

9. 他に行っている事業の種類

なし

10. 苦情処理及び紛争解決の体制

(1) 第一種金融商品取引業務

金融商品取引法第 37 条の 7 第 1 項第 1 号イに規定する指定紛争解決機関である特定非営利活

動法人 証券・金融商品あっせん相談センターと特定第1種金融商品取引業務に係る手続実施基本契約を締結し利用する措置を講じています。

(2) 第二種金融商品取引業務

金融商品取引法第37条の7第1項第2号ロに規定する苦情処理措置及び紛争解決措置として一般社団法人第二種金融商品取引業協会（FINMACに業務委託）を利用する措置を講じています。

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

- ・日本証券業協会
- ・一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

12. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号

なし

13. 加入する投資者保護基金の名称

- ・日本投資者保護基金

## II. 業務の状況に関する事項

### 1. 当期の業務の概要

当事業年度における証券市場を取り巻く環境は、グローバルな景気回復を背景とした国内外における企業収益の改善、リーマンショック以降継続してきた日米欧の中央銀行による金融緩和策に支えられ、概ね第3四半期までは適温相場と呼ばれる株式市場等マーケットに優しい状況が続きました。一方、年明け以降は、米国トランプ政権による大規模減税策の導入等により、景気過熱を織り込む形で米国金利が上昇したため、これまでの適温相場の継続が難しくなったとの見方が広がり、マーケット全体が調整局面入りとなりました。

損益の状況につきましては、当事業年度の純営業収益は、55億7千5百万円を計上し、前期の53億3千4百万円から4.5%の増加となりました。

当社があおぞら銀行を販売委託先としたリテール顧客を対象とする金融商品仲介業務につきましては、内外株価の上昇に伴う仕組債の早期償還増加もあり、販売額が第3四半期終盤から期末にかけて大幅に増加しました。

その結果、当業務からの収益を中心とする債券等トレーディング収益及びその他受入手数料は合計で50億1千6百万円となり、前期の49億6千6百万円から1.0%の増加となりました。

リテール顧客を対象とするダイレクト業務につきましては、国内株式市場の回復基調を背景に株式等ブローカレッジの取引量が増え、信用取引を含むブローカレッジ取引金額は大幅に増加しました。

その結果、株式等委託手数料は2億5千6百万円となり、前期の1億1千7百万円から118.8%の増加となりました。

地域金融機関を主な顧客とする金融法人業務につきましては、主力の私募投信販売が米国金利の上昇局面入りに加え、為替ヘッジコストの高止まりが逆風となり、保護預かり残高は微増にとどまりました。一方、あおぞら銀行社債等の引受業務は、中央投資家等、新たな投資家層の開拓が奏功し、安定的な販売となりました。その結果、当業務からの収益は、その他の受入手数料及び引受・売出し等の手数料の合計で293百万円を計上し、前期の239百万円から22.5%の増加となりました。

一方、経費につきましては、金融商品仲介業務から生じる仲介手数料の支払いが適用料率の見直しに伴い減少したこと、加えて、当期のオフィス移転に備え、前期に行った固定資産加速度償却終了による減価償却費減少等を含む厳格な経費運営により、マイナンバー等の制度対応、並びにオフィス移転に関する一時費用増加等に伴う事務費等増加にもかかわらず、当期の販売費・一般管理費全体は、36億8千7百万円にとどまり、前期の38億4千1百万円から4.0%の減少となりました。

これにより、上記に営業外損益を加えた当期経常利益は、18億8千6百万円となり、前期の15億3百万円から25.4%の増加となりました。

一方、法人税等は5億9千2百万円の費用となりました。

以上の結果、当期純利益は12億9千3百万円となり、前期の11億8千万円から9.5%の増加となりました。

## 2. 業務の状況を示す指標

### (1) 経営成績等の推移

(単位：百万円)

	平成28年3月期	平成29年3月期	平成30年3月期
資本金	3,000	3,000	3,000
発行済株式総数	30,501	30,501	30,501
営業収益	3,330	5,354	5,608
(受入手数料)	725	2,199	2,760
((委託手数料))	294	117	256
((引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料))	49	56	69
((募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱い手数料))	65	0	0
((その他の受入手数料))	316	2,024	2,434

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
(トレーディング損益)	2,455	3,133	2,808

((株券等))	0	4	0
((債券等))	2,454	3,129	2,808
((その他))	0	0	0
純営業利益	3,196	5,334	5,575
経常利益	886	1,503	1,886
当期純利益	640	1,180	1,293

記載の金額は百万円単位を切り捨てて表示してあります。

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

(単位：百万円)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
自 己	46	2	-
委 託	54,243	19,236	47,956
計	54,290	19,238	47,956

② 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

(単位：千株、百万円)

区 分	引受高	売出高	特定投資家向け売付け勧誘等の総額	募集の取扱高	売出しの取扱高	私募の取扱高	特定投資家向け売付け勧誘等の取扱高
平成 30 年 3 月 期	株券						
	国債証券						
	地方債証券	200					
	特殊債券						
	社債券	65,504	60,000		16,300		
	受益証券				32	56,147	
	その他						
合 計	65,704	60,000		16,332	56,147		
平	株券						

区分	引受高	売出高	特定投資家向け売付け勧誘等の総額	募集の取扱高	売出しの取扱高	私募の取扱高	特定投資家向け売付け勧誘等の取扱高
成 29 年 3 月 期	国債証券						
	地方債証券	200					
	特殊債券						
	社債券	60,256	66,080		18,200		
	受益証券				593	67,280	
	その他						
	合計	60,456	66,080		18,793		67,280
平 成 28 年 3 月 期	株券						
	国債証券						
	地方債証券	300					
	特殊債券				34,350		
	社債券	21,536	57,206		16,700		
	受益証券					26,876	
	その他						
合計	21,836	57,206		51,050		26,876	

(3) その他業務の状況

(単位：百万円)

	平成28年3月期	平成29年3月期	平成30年3月期
コンサルティング料			
保険代理店手数料			

(4) 自己資本規制比率の状況

(単位：%、百万円)

	平成28年3月期	平成29年3月期	平成30年3月期
自己資本規制比率 (A/B × 100)	939.5	933.7	827.5
固定化されていない自己資本 (A)	6,467	7,677	8,916
リスク相当額 (B)	688	822	1,077
市場リスク相当額	0	0	4
取引先リスク相当額	38	35	39

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
基礎的リスク相当額	649	786	1,033

記載の金額は百万円単位を切り捨てて表示してあります。

(5) 使用人の総数及び外務員の総数

(単位：名)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
使用人	44	45	48
(うち外務員)	24	26	27

### Ⅲ. 財産の状況に関する事項

#### 1. 経理の状況

##### (1) 貸借対照表

単位：百万円	平成29年3月31日	平成30年3月31日
<b>(資産の部)</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	1,780	2,381
預託金	9,803	11,178
トレーディング商品	1	24
約定見返勘定	1,144	1,497
信用取引資産	1,446	1,589
有価証券担保貸付金	0	0
立替金	0	1
募集等払込金	0	0
短期差入保証金	285	181
短期貸付金	0	0
前払金	0	0
前払費用	14	14
未収入金	72	9
未収収益	31	40
繰延税金資産	0	52
その他の資産	58	0
<b>流動資産計</b>	<b>14,640</b>	<b>16,970</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	17	76
（建物付属設備）	2	53
（器具備品）	8	23
（建設仮勘定）	6	0
無形固定資産	34	29
（営業権）	0	0
（ソフトウェア）	34	29
（電話加入権）	0	0
投資等	0	0
（投資有価証券）	0	0
（長期差入保証金）	0	0
（長期前払費用）	0	0
（繰延税金資産）	0	0
（その他の投資等）	0	0
<b>固定資産計</b>	<b>52</b>	<b>106</b>
<b>資産合計</b>	<b>14,693</b>	<b>17,077</b>

単位：百万円

平成 29 年 3 月 31 日

平成 30 年 3 月 31 日

(負債の部)		
<b>流動負債</b>		
トレーディング商品	0	0
約定見返勘定	1,097	364
信用取引負債	1,446	1,589
有価証券担保借入金	0	0
未払消費税等	0	0
預り金	3,199	2,498
受入保証金	29	18
有価証券等受入未了勘定	0	0
短期借入金	0	2,500
未払金	988	746
未払費用	36	44
未払法人税等	70	156
賞与引当金	39	39
その他流動負債	18	0
<b>流動負債計</b>	<b>6,924</b>	<b>7,958</b>
<b>固定負債</b>		
繰延税金負債	0	13
資産除去債務	0	45
退職給付引当金	23	21
<b>固定負債計</b>	<b>23</b>	<b>81</b>
<b>引当金</b>		
金融商品取引責任準備金	8	8
<b>引当金計</b>	<b>8</b>	<b>8</b>
<b>負債合計</b>	<b>6,956</b>	<b>8,047</b>
<b>(資本の部)</b>		
資本金	3,000	3,000
資本剰余金	2,077	2,077
利益剰余金	2,659	3,953
(うち当期純利益)	1,180	1,293
<b>資本合計</b>	<b>7,736</b>	<b>9,030</b>
<b>負債・資本合計</b>	<b>14,693</b>	<b>17,077</b>

(注) 金額は百万円未満を切り捨てて表示。

## (2) 損益計算書

単位：百万円	平成29年3月期	平成30年3月期
<b>(経常損益の部)</b>		
<b>営業収益</b>		
受入手数料	2,199	2,760
(委託手数料)	(117)	(256)
(引受け・売出し手数料)	(56)	(69)
(募集・売出しの取扱手数料)	(0)	(0)
(その他の受入手数料)	(2,024)	(2,434)
トレーディング損益	3,133	2,808
(株券等トレーディング損益)	(4)	(0)
(債券等トレーディング損益)	(3,129)	(2,808)
(その他のトレーディング損益)	(0)	(0)
金融収益	21	39
<b>営業収益計</b>	<b>5,354</b>	<b>5,608</b>
金融費用	20	33
<b>純営業収益</b>	<b>5,334</b>	<b>5,575</b>
販売費・一般管理費	3,841	3,687
(取引関係費)	(2,841)	(2,526)
(人件費)	(598)	(681)
(不動産関係費)	(29)	(72)
(事務費)	(266)	(281)
(減価償却費)	(39)	(25)
(租税公課)	(63)	(80)
(その他)	(2)	(19)
<b>営業利益</b>	<b>1,492</b>	<b>1,887</b>
営業外収益	11	2
営業外費用	0	3
<b>経常利益</b>	<b>1,503</b>	<b>1,886</b>
<b>(特別損益の部)</b>		
<b>特別損益</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>税引前当期純利益</b>	<b>1,503</b>	<b>1,886</b>
<b>法人税等</b>	<b>384</b>	<b>573</b>
<b>法人税等調整額</b>	<b>▲62</b>	<b>19</b>
<b>当期純利益</b>	<b>1,180</b>	<b>1,293</b>

(注) 金額は百万円未満を切り捨てて表示。

## (3) 株主資本等変動計算書

平成28年4月1日から  
平成30年3月31日まで

(単位：百万円)

	株 主 資 本					純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	株主資本合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	その他利益剰余金		
				繰越利益剰余金		
前期首残高	3,000	1,275	802	1,478	6,555	6,555
前期変動額						
前期純利益	—	—	—	1,180	1,180	1,180
前期変動額合計	—	—	—	1,180	1,180	1,180
前期末残高/当期首残高	3,000	1,275	802	2,659	7,736	7,736
当期変動額						
当期純利益	—	—	—	1,293	1,293	1,293
当期変動額合計	—	—	—	1,293	1,293	1,293
当期末残高	3,000	1,275	802	3,953	9,030	9,030

(注) 金額は百万円未満を切り捨てて表示。

#### (4) 注記事項

(重要な会計方針)

##### ① 資産の評価基準及び評価方法

トレーディング商品に属する有価証券（売買目的有価証券）等の評価基準および評価方法  
トレーディング商品に属する有価証券については、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 固定資産の減価償却の方法

- イ．有形固定資産 主として定率法を採用しております。  
なお、主な耐用年数は以下の通りです。  
建物附属設備 10～15年  
器具・備品 4～15年
- ロ．無形固定資産 定額法を採用しております。  
なお、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年間）に基づく定額法を採用しております。

##### ③ 引当金及び準備金の計上基準

- イ．賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、賞与支給見込額のうち  
当事業年度に負担すべき金額を計上しております。
- ロ．退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退  
職給付債務の見込額に基づき計上しております。
- ハ．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及び金融商品取引業等に関する内閣府令第175条  
に基づき準備金を積み立てております。

##### ④ その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

- イ．外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準  
外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差  
額は損益として処理しております。
- ロ．消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式を採用しております。

(未適用の会計基準等)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)、「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

イ. 概要

上記会計基準等は、収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

ロ. 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

ハ. 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当計算書類の作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

- ① 差入れている有価証券及び差入れを受けている有価証券の時価は下記の通りであります。

(単位：千円)

イ. 有価証券等を差し入れた場合等の時価額	
信用取引貸証券	-
信用取引借入金の本担保証券	1,420,056
差入証拠金代用有価証券(顧客の直接預託にかかるものを除く)	-
差入保証金代用有価証券	1,121,371
ロ. 有価証券等の差し入れを受けた場合等の時価額	
信用取引貸付金の本担保証券	1,420,056
信用取引借証券	-
受入証拠金代用有価証券(再担保に供する旨の同意を得たものに限る)	4,541
受入保証金代用有価証券(再担保に供する旨の同意を得たものに限る)	1,527,196

② 有形固定資産の減価償却累計額 30,827 千円

③ 偶発債務

平成 28 年 7 月まで当社と信用取引等の株式取引のあった非上場企業 1 社から、当社及び当該企業元代表取締役社長を被告とする損害賠償請求訴訟の提起を受け、現在係争中です（訴状：平成 29 年 12 月 20 日付、訴状送達日：平成 30 年 1 月 10 日、訴額約 20 億円）。本件訴訟は結審まで相応の時間がかかると見込まれますが、訴えの内容は根拠に乏しいものと考えており、裁判において当社の考えを適切に主張していく所存です。

④ 関係会社に対する金銭債権

現金・預金	214,771 千円
前払費用	5,531 千円

⑤ 関係会社に対する金銭債務

借入金	2,500,000 千円
未払金	734,648 千円
未払費用	306 千円

(損益計算書関係)

関係会社との取引高	
営業収益	2,277,063 千円
金融費用	1,982 千円
販売費・一般管理費	2,503,692 千円

(株主資本等変動計算書関係)

① 当事業年度末における発行済株式の種類及び総数

普通株式	30,501 株
------	----------

② 配当に関する事項

該当はありません。

2. 借入金の主要な借入先及び借入金額

(単位：百万円)

(平成 29 年 3 月 31 日現在)

借入先の氏名又は名称	借入金額

(平成 30 年 3 月 31 日現在)

借入先の氏名又は名称	借入金額
株式会社あおぞら銀行	2,500

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

(単位：百万円)

	平成 29 年 3 月期			平成 30 年 3 月期		
	取得価額	時 価	評価損益	取得価額	時 価	評価損益
1. 流動資産						
(1) 株券						
(2) 債券						
(3) その他						
2. 固定資産						
(1) 株券						
(2) 債券						
(3) その他						
合 計						

(注) トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く。

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

(1) 先物取引・オプション取引の状況

① 株式

(単位：百万円)

	平成 29 年 3 月期			平成 30 年 3 月期		
	契約価額	時 価	評価損益	契約価額	時 価	評価損益
1. 株価指数先物取引						
(1) 売建						
(2) 買建						
2. 株価指数オプション取引						
(1) 売建						
① コール						
② プット						
(2) 買建						
① コール						
② プット						

(注) トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。

② 債券

(単位：百万円)

	平成 29 年 3 月期			平成 30 年 3 月期		
	契約価額	時 価	評価損益	契約価額	時 価	評価損益
1. 債券先物取引						
(1) 売建						
(2) 買建						
2. 債券オプション取引						
(1) 売建						
① コール						
② プット						
(2) 買建						
① コール						
② プット						

(注) トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。

(2) 有価証券店頭デリバティブ取引の状況

(単位：百万円)

	平成 29 年 3 月期			平成 30 年 3 月期		
	契約価額	時 価	評価損益	契約価額	時 価	評価損益
1. 有価証券先渡取引						
(1) 売建						
(2) 買建						
2. 有価証券店頭指数等先渡取引						
(1) 売建						
(2) 買建						
3. 有価証券店頭オプション取引						
(1) 売建						
① コール						
② プット						
(2) 買建						
① コール						
② プット						
4. 有価証券店頭指数等スワップ取引						

(注) トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。

5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無

当社は、会社法第436条第2項第1号に基づき、平成30年3月期については、有限責任監査法人トーマツにより監査を受け、監査報告書を受領しております。

## IV. 管理の状況

### 1. 内部管理の状況の概要

#### (1) コンプライアンス体制

当社は、コンプライアンスを経営の最重要課題の一つとして位置付け、代表取締役社長以下役職員が一体となりコンプライアンスの徹底に取り組んでいます。

当社はコンプライアンスの徹底を基本とする経営を行うために、内部管理体制の充実に努めると共に、コンプライアンスに関する年度計画であるコンプライアンス・プログラムを策定し、その推進を図っております。

各組織等の概要は以下の通りです。

##### ① 取締役会

当社のコンプライアンスに関する重要事項及びコンプライアンス・マニュアル、コンプライアンス・プログラムの制定・改廃等については取締役会において決定されます。

##### ② マネジメント・コミッティー

当社は代表取締役社長以下の取締役及び各本部長等で構成されるマネジメント・コミッティーにおいてコンプライアンスに関する重要事項を審議すると共に、役職員のコンプライアンスに関する課題意識の共有化、意識の向上を図っております。

##### ③ 内部管理統括責任者

日本証券業協会規則に基づく内部管理統括責任者は社内全体に法令等を遵守する営業姿勢を徹底させると共に、適正な顧客管理等を行えるよう内部管理体制の整備に努め、営業責任者・内部管理責任者の指導・監督を行っております。

##### ④ コンプライアンス部

コンプライアンス部は当社のコンプライアンスに関する事項を統括し、コンプライアンスに関する諸施策の立案・推進、各種案件に関するコンプライアンス面からの助言・指導及び社内研修等を行っております。また、市場取引の不正取引を防止するための売買審査及び顧客の苦情対応も行っております。さらに、反社会的勢力との関係遮断においては、グループ会社と連携し関係遮断に取り組んでおります。

##### ⑤ 営業責任者・内部管理責任者

営業単位における営業活動について、所属する職員に対し金融商品取引法、その他法令諸規則等の遵守を徹底させ、営業活動・顧客管理が適正に行われるよう指導・監督する営業責任者及び営業活動が金融商品取引法はじめその他法令諸規則等に準拠し、適正に遂行されているかを常時確認し適切な内部管理を行う職務としての内部管理責任者を日本証券業協会規則に基づき置いております。

#### (2) リスク管理体制

リスク管理体制につきましては、業務企画部及び財務/リスク管理部において、市場・信用・流動性・オペレーショナルリスクの各リスクのモニタリング・報告を一元的に行うと共にマネジメント・コミッティーにおいて、リスク管理に関する重要事項の協議・検討を行う体制を

構築しております。

(3) 内部監査体制

業務の適切な遂行を確保する上で不可欠なコンプライアンス態勢やリスク管理を含む内部管理態勢の適切性・有効性を他の業務部門から独立した立場で総合的に評価・検証を行い、改善に向けた提言を行う組織として、監査部を設置しております。

(4) お客様からのご意見及び苦情への対応について

当社ではお客様のご意見や苦情をお伺いできるよう専用ダイヤルを設けております。お客様相談受付窓口は、寄せられたお客様の声を真摯に受け止め、苦情並びにご意見・ご要望について内容を分析したうえで、役員をはじめ、関連部署と情報の共有を図り、お客様の声が反映されるよう業務運営の改善を図り、再発防止・お客様サービスの向上に努めお客様とのより深い信頼関係を築いていきたいと考えております。

2. 分別管理等の状況

(1) 金融商品取引法第43条の2の規定に基づく分別管理の状況

① 顧客分別金信託の状況

(単位：百万円)

項目	平成29年3月31日現在の金額	平成30年3月31日現在の金額
直近差替計算基準日の顧客分別金必要額	9,772	11,147
期末日現在の顧客分別金信託額	9,803	11,178
期末日現在の顧客分別金必要額	2,841	2,141

② 有価証券の分別管理の状況

イ 保護預り等有価証券

有価証券の種類		平成29年3月31日現在		平成30年3月31日現在	
		国内証券	外国証券	国内証券	外国証券
株券	株数	11,754千株	11,053千株	7,874千株	11,040千株
債券	額面金額	23,173百万円	92,963百万円	44,741百万円	91,257百万円
受益証券	口数	156,949百万口	185百万口	171,278百万口	103百万口
その他	額面金額	—	—	—	—

ロ 受入保証金代用有価証券

有価証券の種類

		平成 29 年 3 月 31 日現在	平成 30 年 3 月 31 日現在
		数 量	数 量
株券	株数	1,062 千株	1,623 千株
債券	額面金額	一百万円	一百万円
受益証券	口数	0 百万口	0 百万口
その他	額面金額	—	—

ハ 管理の状況

顧客の有価証券は、法令を遵守して下記のように分別管理しています。

有価証券の種類	会社の管理形態
国内株式 国内債券 国内受益証券	「社債、株式等の振替に関する法律」に基づき、当社は口座管理機関として株式会社証券保管振替機構、光証券株式会社及びシティバンク、エヌ・エイ東京支店において自己口座と顧客口座に区分した振替口座簿を設け、顧客の有価証券を管理しています。
外国株式 外国債券	顧客有価証券は、クリアストリーム銀行等にて保管しています。 クリアストリーム銀行等では、顧客有価証券は会社の有価証券と区分し、混蔵して管理しています。顧客の預託分については会社の帳簿により各顧客の持分を判別できるように管理しています。
外国受益証券	顧客有価証券は、クリアストリーム銀行、及びそれぞれの投資信託管理会社にて保管しています。 クリアストリーム銀行、及びそれぞれの投資信託管理会社では、顧客有価証券は会社の有価証券と区分し、混蔵して管理しています。顧客の預託分については会社の帳簿により各顧客の持分を判別できるように管理しています。

- ③ 対象有価証券関連店頭デリバティブ取引等に係る分別管理の状況  
該当ありません。

(2) 金融商品取引法第43条の2の2の規定に基づく区分管理の状況

① 商品顧客区分管理信託の状況

(単位：百万円)

項目	平成29年3月31日現在の金額	平成30年3月31日現在の金額
直近差替計算基準日の商品顧客区分管理必要額		
期末日現在の商品顧客区分管理信託額		
期末日現在の商品顧客区分管理必要額		

① 有価証券の区分管理の状況

イ. 有価証券等の種類ごとの数量等

有価証券の種類		平成29年3月31日現在		平成30年3月31日現在	
		国内証券	外国証券	国内証券	外国証券
株券	株数				
債券	額面金額				
受益証券	口数				
倉荷証券	額面金額				
その他	額面金額				

ロ. 管理の状況

該当ありません。

(3) 金融商品取引法第43条の3の規定に基づく区分管理の状況

① 法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況

(単位：百万円、千株等)

	管理の方法	当期末残高	前期末残高	内 訳
金銭有価証券等				

② 法第 43 条の 3 第 2 項の規定に基づく区分管理の状況

(単位：百万円、千株 等)

	管理の方法	当期末残高	前期末残高	内 訳
金 銭				
有 価 証 券 等				

V. 連結子会社等の状況に関する事項

1. 当社及びその子会社等の集団の構成

特になし

2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等

商号又は名称	本店所在地	資本金	事業内容	当社及び子会社等の保有する議決権の数	子会社等の総株主の議決権に占める当該保有する議決権の数の割合

以 上