

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2018年11月27日
【中間会計期間】	第14期中（自 2018年4月1日 至 2018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 荒木 三郎
【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 緒方 裕之
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区大手町一丁目9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 緒方 裕之
【縦覧に供する場所】	本店のほかに該当ありません。

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12期中	第13期中	第14期中	第12期	第13期
会計期間	自 2016年 4月1日 至 2016年 9月30日	自 2017年 4月1日 至 2017年 9月30日	自 2018年 4月1日 至 2018年 9月30日	自 2016年 4月1日 至 2017年 3月31日	自 2017年 4月1日 至 2018年 3月31日
営業収益 (百万円)	200,579	181,631	185,537	404,497	376,901
純営業収益 (百万円)	185,024	175,757	165,515	379,237	365,825
経常利益 (百万円)	47,745	35,191	28,864	99,595	84,206
親会社株主に帰属する中間 (当期)純利益 (百万円)	27,199	17,747	15,363	49,085	43,192
中間包括利益又は包括利益 (百万円)	20,466	28,712	11,905	22,836	74,902
純資産 (百万円)	932,329	976,929	961,443	959,450	996,688
総資産 (百万円)	30,358,612	25,875,999	23,937,165	30,493,167	22,344,541
1株当たり純資産 (円)	905.82	933.89	925.97	915.70	966.07
1株当たり中間(当期)純 利益 (円)	36.91	24.08	20.85	66.60	58.61
潜在株式調整後1株当たり 中間(当期)純利益 (円)	36.91	24.08	20.85	66.60	58.61
自己資本比率 (%)	2.2	2.7	2.9	2.2	3.2
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	307,754	155,729	487,326	369,635	210,861
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	14,265	73,966	41,392	59,718	101,723
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	350,417	250,622	235,523	745,838	626,684
現金及び現金同等物の 中間期末(期末)残高 (百万円)	1,146,725	1,787,049	1,841,151	1,614,478	2,143,610
従業員数 (人)	7,674	7,804	7,864	7,600	7,645
(外、平均臨時雇用人員)	(694)	(644)	(590)	(684)	(644)

(注)「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)等を当中間連結会計期間の期首より適用し、第13期中および第13期については当該会計方針の変更を反映した遡及適用後の数値を記載しております。

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12期中	第13期中	第14期中	第12期	第13期
会計期間	自 2016年 4月1日 至 2016年 9月30日	自 2017年 4月1日 至 2017年 9月30日	自 2018年 4月1日 至 2018年 9月30日	自 2016年 4月1日 至 2017年 3月31日	自 2017年 4月1日 至 2018年 3月31日
営業収益 (百万円)	19,958	22,048	24,706	32,923	54,235
経常利益 (百万円)	14,195	11,993	18,083	19,418	39,205
中間(当期)純利益 (百万円)	15,628	14,301	6,576	20,126	42,658
資本金 (百万円)	75,518	75,518	75,518	75,518	75,518
発行済株式総数 (千株)	736,985	736,985	736,985	736,985	736,985
純資産 (百万円)	648,771	651,799	639,034	644,183	670,902
総資産 (百万円)	1,686,645	1,918,967	2,282,042	1,854,133	2,108,964
1株当たり配当額 (円)	13.59	13.69	14.87	27.47	61.77
自己資本比率 (%)	38.5	34.0	28.0	34.7	31.8
従業員数 (人)	194	198	202	193	194

(注) 1. 第13期の1株当たり配当額には、配当財産が金銭以外の財産による特別配当39円10銭を含んでおります。

2. 「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)等を当中間会計期間の期首より適用し、第13期中および第13期については当該会計方針の変更を反映した遡及適用後の数値を記載しております。

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【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）

持分法適用関連会社 三菱UFJ国際投信株式会社

なお、前連結会計年度より報告セグメントの名称を変更しております。詳細は、「第5 経理の状況 1. 中間連結財務諸表等 (1) 中間連結財務諸表 注記事項（セグメント情報等）」に記載のとおりであります。

3【関係会社の状況】

当中間連結会計期間において、当社が持分法適用関連会社であった三菱UFJ国際投信株式会社の全株式を当社の親会社である株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループに現物配当したことに伴い、三菱UFJ国際投信株式会社を持分法適用関連会社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

2018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）	6,043（292）
証券業務（欧州）	635（196）
証券業務（米州）	494（54）
その他	1,180（100）
調整	488（52）
合 計	7,864（590）

（注）1. 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. 2016年7月1日付でMUF Gセキュリティーズアメリカは当社の連結範囲から除外されておりますが、セグメント情報においては、引き続き「証券業務（米州）」として開示を継続しているため、当中間連結会計期間末の従業員数との差を調整しております。

(2) 提出会社の状況

2018年9月30日現在

セグメントの名称	従業員数（人）
その他	202
合 計	202

（注）上記のほか、執行役員の2018年9月末の人数は21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【経営方針、経営環境及び対処すべき課題等】

文中における将来に関する事項は、半期報告書提出日（2018年11月27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）経営方針・経営戦略等および経営上の目標達成状況を判断するための客観的な指標

当中間連結会計期間において、当社グループが定めている経営方針・経営戦略等に重要な変更はありません。また、新たに定めた経営方針・経営戦略等若しくは指標等はありません。

（2）事業上および財務上の対処すべき課題

当中間連結会計期間において新たに生じた事業上および財務上の対処すべき課題は、次のとおりであります。当社子会社の三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社が、長期国債先物に係る相場操縦があったとして、2018年7月には、財務省より国債市場特別参加者制度に基づく特別資格の停止処分を受け、金融庁から課徴金納付命令を受けました。また、2018年9月には、大阪取引所から過剰金処分および一部業務に対する業務停止命令、東京証券取引所から戒告処分を受けました（同社は、2018年10月には、日本証券業協会から過剰金処分を受けました。）。三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社および当社は、当局からの処分等を踏まえ、協働して再発防止策を策定しました。今後、進捗状況は、定期的に経営会議へ報告し、改善度合いの可視化に努めてまいります。

2【事業等のリスク】

当中間連結会計期間において新たな発生した事業等のリスクの発生は、次のとおりであります。

なお、文中の将来に関する事項は、半期報告書提出日（2018年11月27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。

コンプライアンス（法令遵守）に関するリスク

当社子会社の三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社が、長期国債先物に係る相場操縦があったとして、2018年7月には、財務省より国債市場特別参加者制度に基づく特別資格の停止処分を受け、金融庁から課徴金納付命令を受けました。また、2018年9月には、大阪取引所から過剰金処分および一部業務に対する業務停止命令、東京証券取引所から戒告処分を受けました（同社は、2018年10月には、日本証券業協会から過剰金処分を受けました。）。

3【経営者による財政状態、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経営者による財政状態、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（2018年11月27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。

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。

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。

有形固定資産・無形固定資産

主に建物、器具備品、土地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、有形固定資産については個々の耐用年数に基づき主として定額法により、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。

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。

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。

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納税額を減額する効果が見込まれると判断される金額（将来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、繰延税金負債を計上しております。

退職給付会計

従業員の退職給付に係る負債（または資産）および退職給付費用については、割引率、退職率、年金資産の長期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。

(2) 経営者の視点による経営成績の認識および分析・検討内容

当社グループでは、「経営ビジョン」に基づいてお客さまに最適なソリューションをご提供すると共に、リスク管理、コンプライアンス、情報管理の徹底により、「信頼度・クオリティNo.1」で、本邦証券グループの中で「お客さまから真っ先に選ばれる存在」としての地位の確立をめざしています。当社グループの財政状態、経営成績等は、証券・金融商品取引業の性格上、国内外の経済情勢・市場動向の影響を受けて変動しやすい特性を持っています。

当中間連結会計期間の我が国の景気は、夏場にかけて軟調に推移しました。増加傾向を辿っていた輸出が停滞し、生産活動も鈍化する中、主要企業の設備投資計画は旺盛な効率化・省力化需要にもかかわらず下方修正されました。家計の雇用・所得環境は引き続き良好ですが、地震や台風などの大規模災害が消費者心理に影響を落としたこともあり、個人消費は夏場にかけて伸び悩みました。

株式市場では、21,441円でスタートした日経平均株価が、24,120円で終了しました。主要企業の好決算や為替レートの円安基調を追い風に、株価は4月から5月中旬にかけて上昇基調で推移しました。その後、米中貿易戦争やイタリアの政局不安、米国のイラン産原油の輸入停止要請などが悪材料視されて、株価は下落基調に転じましたが、7月には米国と欧州連合（EU）が貿易障壁削減に向けた交渉を開始したことなどを受けて再び反転・上昇しました。夏場にかけては、米国の輸入関税率引き上げ懸念などが株価の上値をおさえる局面も見られましたが、米国の通商政策に対する過度な懸念は徐々に後退し、株価は9月末にかけて上昇基調を強めました。

債券市場では、長期金利（新発10年国債利回り）が0.045%で始まり、0.125%で終了しました。原油高や米利上げ観測を受けて、長期金利が4月から5月にかけて一時的に上昇する局面も見られましたが、日銀による0%前後の誘導目標の下、長期金利は7月中旬頃まで概ね横ばい圏で推移しました。しかし7月下旬に日銀の金融政策の修正観測が浮上し、実際に日銀が0.2%程度までの金利上昇を事実上容認すると、長期金利は8月初に一時0.14%台まで上昇しました。その後、長期金利の急速な上昇には歯止めがかかりましたが、9月にかけては、株価や米長期金利の上昇、日銀オペの減額などを反映して、長期金利は緩やかな上昇傾向を辿りました。

こうした中、当社グループは、MUFJグループの有する顧客基盤やネットワーク、および強固な財務基盤と、Morgan Stanleyが有する質の高い商品、サービス、ネットワークを有機的に結び付けることで、法人、個人のお客さまに質の高い証券サービスの提供に努めています。また、徹底した経費抑制施策の実行により利益水準の向上にも努力しております。

この結果、当中間連結会計期間の連結純営業収益は1,655億15百万円（前年度中間期比94.2%）、販売費・一般管理費は1,445億16百万円（同96.9%）、連結経常利益は288億64百万円（同82.0%）、親会社株主に帰属する中間純利益は153億63百万円（同86.6%）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。

受入手数料

区 分	前中間連結会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日) (百万円)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日) (百万円)	前年度中間期比 (%)
受入手数料	76,513	73,353	95.9
委託手数料	19,567	17,187	87.8
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	11,521	12,544	108.9
募集・売出し・特定投資家向け売 付け勧誘等の取扱手数料	17,099	11,334	66.3
その他の受入手数料	28,324	32,287	114.0

受入手数料の合計は733億53百万円で前年度中間期比95.9%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18億70百万株（前年度中間期比77.8%）、金額で3兆213億円（同104.3%）となりました。このような状況の下、当社グループの株式委託手数料は167億3百万円（同88.1%）、債券委託手数料は6百万円（同46.5%）となり、委託手数料は合計で171億87百万円（同87.8%）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

国内株式発行市場は、大型の売出しや新規公開に加え、複数の転換社債の発行等があったものの、日本郵政の第2次売出しが行われた前年度中間期と比べると発行量は減少しました。当社グループはこのような環境の下、複数の案件で主幹事をつとめました。

国内債券発行市場は、低金利環境を生かし積極的に資金調達を行う発行体の動きが継続する中、事業法人による複数の大型起債、超長期債の発行も見られ、発行量は前年度中間期と同程度の高水準となりました。当社グループはこのような環境の下、多数の案件で主幹事をつとめました。

海外発行市場は、米金利の上昇や政治的不透明感および貿易摩擦等を背景とする市場のリスクオフの動きから、債券発行額は減少し、前年度中間期を下回る水準となりました。このような厳しい環境下においても、当社グループの海外現地法人は、株式会社三菱UFJ銀行との緊密な協働・連携により多数の主幹事案件を獲得しました。

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125億44百万円（前年度中間期比108.9%）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、その大半を連結子会社の三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社（以下、「MUMSS」といいます。）および三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社（以下、「PB証券」といいます。）における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、MUMSSにおいて、S&P/JPX配当貴族指数をベンチマークとし、これを上回る投資成果の獲得を目指す「明治安田クオリティ日本株ファンド（限定追加型・繰上償還条項付）」や主に先進国の医療テクノロジー関連企業の株式に実質的に投資を行う「アムンディ・次世代医療テクノロジー・ファンド（限定追加型・繰上償還条項付）」等の新規募集を行いました。また、「サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり）/（為替ヘッジなし）」等の新規取扱を開始したことに加え、従前よりニーズの高い「未来イノベーション成長株ファンド」や「グローバル・フィンテック株式ファンド」および「グローバル・フィンテック株式ファンド（年2回決算型）」等の継続募集にも注力した結果、株式投信販売額は前年度中間期比で増加しました。一方、募集取扱手数料はノーロード投信の増加等により減少しました。

MUMSSにおける当中間連結会計期間の投資信託の募集・売出し取扱高は2兆3,371億円（前年度中間期比80.6%）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6兆2,298億円（同114.4%）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113億34百万円（同66.3%）となりました。

d. その他の受入手数料

その他の受入手数料には、投資信託の代行手数料のほかに、M&A業務および財務アドバイザー業務にかかる手数料、証券化・不動産ファイナンス業務などを含んでおります。投資信託の代行手数料は、純資産残高の増加により前年度中間期比で増加しました。M&A業務では、MUFJとMorgan Stanleyが有する国内外ネットワークや、プロダクトに関する豊富な知見・経験の活用を通じ、国内/クロスボーダーを問わず多くの実績を積み重ね、お客さまの企業価値向上に貢献いたしました。

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322億87百万円（前年度中間期比114.0%）となりました。

トレーディング損益

区 分	前中間連結会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日) (百万円)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日) (百万円)	前年度中間期比 (%)
トレーディング損益	79,333	68,929	86.9
株券等トレーディング損益	17,031	1,433	-
債券等・その他トレーディング損益	62,302	70,363	112.9

国内株式市場は、日米金利差拡大が意識され円安が進行したことで日経平均株価は上昇して始まりましたが、5月以降は欧州政局不安や米国発の貿易摩擦、トルコショック等への懸念から、主に22,000円台でもみ合う展開となりました。9月には、貿易摩擦への警戒感が和らいだことや、自民党総裁選を受けた景気対策への期待から、24,000円を超える展開となりました。

「その他」

持株会社において営業外収益で計上される子会社からの受取配当金の増加等により、セグメント利益は増加しました。

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152億63百万円（前年度中間期比97.0%）、セグメント利益は226億39百万円（同125.1%）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。

また、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）等を当中間連結会計期間の期首から適用しており、経営成績については遡及適用後の前中間連結会計期間の数値で比較を行っております。

（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23兆9,371億65百万円（前年度末比1兆5,926億23百万円増）となりました。内訳は流動資産が23兆3,920億49百万円（同1兆6,304億79百万円増）であり、このうちトレーディング商品が10兆5,188億13百万円（同8,529億9百万円増）、有価証券担保貸付金が8兆5,927億71百万円（同1兆3,262億17百万円増）となっております。固定資産は5,451億15百万円（同378億55百万円減）となっております。

負債合計は、22兆9,757億21百万円（同1兆6,278億69百万円増）となりました。内訳は流動負債が21兆1,863億38百万円（同1兆4,736億42百万円増）であり、このうちトレーディング商品が8兆1,428億71百万円（同4,652億54百万円減）、有価証券担保借入金が5兆9,298億57百万円（同8,898億44百万円増）となっております。固定負債は1兆7,851億16百万円（同1,542億80百万円増）となっております。

純資産合計は9,614億43百万円（同352億45百万円減）となりました。うち、利益剰余金は持分法適用会社である三菱UFJ国際投信株式会社（以下、「MUKAM」といいます。）の除外による288億15百万円の減少、配当金支払いによる100億円の減少および親会社株主に帰属する中間純利益による153億63百万円の増加等の結果、1,921億87百万円（同192億91百万円減）となっております。また、為替換算調整勘定は279億25百万円（同107億46百万円減）となっております。

なお、「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）等を当中間連結会計期間の期首から適用しており、財政状態については遡及適用後の前連結会計年度末の数値で比較を行っております。

（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（資産・負債）の差引残高の減少による収入、社債の発行による収入および長期借入れによる収入等があったものの、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、有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の差引残高の増加による支出および社債の償還による支出等により、前年度末比3,024億59百万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1兆8,411億51百万円（前年度中間期末比103.0%）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、4,873億26百万円（前年度中間期比312.9%）となりました。これは主に、約定見返勘定（資産・負債）の差引残高の減少による収入1兆1,912億99百万円があったものの、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1兆3,932億85百万円や有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の差引残高の増加による支出4,471億74百万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、413億92百万円（前年度中間期は739億66百万円の増加）となりました。これは主に、投資有価証券の売却及び償還による収入872億36百万円があったものの、投資有価証券の取得による支出686億33百万円や有価証券の取得による支出588億39百万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、2,355億23百万円（前年度中間期比94.0%）となりました。これは主に、社債の償還による支出1,834億25百万円があったものの、社債の発行による収入3,769億97百万円や長期借入れによる収入1,695億58百万円があったこと等によるものであります。

(5) 資本の財源および資金の流動性に係る情報

資金の流動性

当社グループは、主たる事業として投資・金融サービス業を営んでおり、事業を継続する上で必要な流動性を十分かつ効率的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、短期社債、コールマネー等の無担保調達および現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、十分かつ効率的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から十分な資金を確保するよう努めております。また資金流動性の危機事象発生を想定したストレステストを実施することで、そのような環境下においても業務継続が可能となるよう資金繰りを管理しております。

当社グループでは、グループ全体での拠点横断・統合的な資金流動性管理を行うため、グループ主要各社共通の基本方針を定め、各社が当該方針および各国・地域の規制等に則った管理を行うと共に、当社においてもグループ全体の資金繰り状況のモニタリングを行っております。また資金調達においては、主要各社自身による資金調達に加えて当社を中心とした資金調達・供給体制を整備することで、各社の資金繰り状況に応じた機動的な流動性供給を行っております。

資本の財源

当社グループは、MUFJ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、ウェルスマネジメント業務等の幅広い投資・金融サービスを展開しており、当該業務を営む上で十分な資本を確保する必要があります。

当社グループの財務計画・事業戦略の策定・実施に当たっては、業務運営上のリスクに見合った適正な資本水準の設定・維持に努めており、加えて市場の急激な変動によりもたらされ得る大きな損失にも耐えることができる必要十分な資本水準が維持されるかについても、定期的に確認しております。また、当社グループは、国内外で投資・金融サービス業務を行っており、各国・地域における法規制上必要な資本も維持しなければなりません。

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また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。

第3【設備の状況】

1【主要な設備の状況】

当中間連結会計期間において、主要な設備に重要な異動はありません。

2【設備の新設、除却等の計画】

当中間連結会計期間において、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、除却等について、重要な変更はありません。また、新たに確定した重要な設備の新設、拡充、改修、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】

【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

【発行済株式】

種 類	中間会計期間末現在 発行数(株) (2018年9月30日)	提出日現在発行数(株) (2018年11月27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】

【ストックオプション制度の内容】

該当事項はありません。

【その他の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)【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)
2018年4月1日～ 2018年9月30日	-	736,985,496	-	75,518,843	-	426,944,245

(5)【大株主の状況】

2018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(自己 株式を除く。)の 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

(6) 【議決権の状況】

【発行済株式】

2018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	-

【自己株式等】

2018年9月30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	-	-	-	-	-

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ん。

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。以下「中間連結財務諸表規則」という。）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。以下「中間財務諸表等規則」という。）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、中間連結会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）の中間連結財務諸表および中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）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】

【中間連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,148,003	1,844,623
預託金	795,610	811,774
トレーディング商品	2,966,903	2,10,518,813
商品有価証券等	2,812,701	3,970,794
デリバティブ取引	6,853,202	6,548,019
約定見返勘定	230,932	-
信用取引資産	364,858	291,442
信用取引貸付金	279,722	208,642
信用取引借証券担保金	85,135	82,800
有価証券担保貸付金	7,266,553	8,592,771
借入有価証券担保金	4,122,970	2,389,734
現先取引貸付金	3,143,582	6,203,037
短期差入保証金	1,013,202	952,398
短期貸付金	117,231	107,055
有価証券	35,250	69,544
未収還付法人税等	-	3,612
その他の流動資産	124,022	200,012
流動資産計	21,761,569	23,392,049
固定資産		
有形固定資産	1,37,756	1,36,206
建物	21,348	20,885
器具備品	11,140	10,332
土地	4,709	4,709
建設仮勘定	195	1
その他	363	277
無形固定資産	109,172	107,791
ソフトウェア	75,553	75,236
その他	33,619	32,554
投資その他の資産	436,042	401,118
投資有価証券	380,845	339,774
長期貸付金	2,2,948	2,10,232
退職給付に係る資産	9,396	11,275
繰延税金資産	21,456	16,748
その他	22,319	23,970
貸倒引当金	924	881
固定資産計	582,971	545,115
資産合計	22,344,541	23,937,165

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	8,608,126	8,142,871
商品有価証券等	2,078,853	1,974,759
デリバティブ取引	6,529,273	6,168,112
約定見返勘定	-	960,968
信用取引負債	244,266	238,489
信用取引借入金	48,675	39,889
信用取引貸証券受入金	195,590	198,600
有価証券担保借入金	5,040,012	5,929,857
有価証券貸借取引受入金	1,699,216	1,478,492
現先取引借入金	3,340,796	4,451,364
預り金	597,218	655,562
受入保証金	1,820,188	1,831,844
短期借入金	2,215,366	2,218,198
1年内償還予定の社債	241,499	286,233
1年内返済予定の長期借入金	69,238	173,959
コマーシャル・ペーパー	811,926	681,011
未払法人税等	11,058	4,750
賞与引当金	26,828	17,295
偶発損失引当金	27	49
資産除去債務	177	28
その他の流動負債	86,759	80,216
流動負債計	19,712,696	21,186,338
固定負債		
社債	2,101,449	2,112,624
長期借入金	604,849	644,202
繰延税金負債	10	2
退職給付に係る負債	2,301	2,356
役員退職慰労引当金	33	30
資産除去債務	7,704	7,899
その他の固定負債	2,487	2,000
固定負債計	1,630,836	1,785,116
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	4,431,9	4,426,6
特別法上の準備金計	4,319	4,266
負債合計	21,347,852	22,975,721
純資産の部		
株主資本		
資本金	75,518	75,518
資本剰余金	438,808	438,808
利益剰余金	211,478	192,187
株主資本合計	725,806	706,515
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	1,703	1,996
繰延ヘッジ損益	85	142
為替換算調整勘定	17,179	27,925
退職給付に係る調整累計額	1,562	1,694
その他の包括利益累計額合計	13,827	24,091
新株予約権	19	27
非支配株主持分	284,690	278,992
純資産合計	996,688	961,443
負債・純資産合計	22,344,541	23,937,165

【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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
営業収益		
受入手数料	76,513	73,353
委託手数料	19,567	17,187
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘 等の手数料	11,521	12,544
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料	17,099	11,334
その他の受入手数料	28,324	32,287
トレーディング損益	79,333	68,929
金融収益	25,783	43,250
その他の営業収益	0	3
営業収益計	181,631	185,537
金融費用	5,873	20,022
純営業収益	175,757	165,515
販売費・一般管理費		
取引関係費	46,288	40,660
人件費	1 54,096	1 53,324
不動産関係費	12,206	12,160
事務費	15,968	16,305
減価償却費	12,908	13,527
租税公課	3,650	4,721
その他	4,070	3,815
販売費・一般管理費計	149,188	144,516
営業利益	26,568	20,998
営業外収益		
受取利息	1,387	1,015
持分法による投資利益	6,119	6,065
為替差益	94	1,145
その他	1,780	1,282
営業外収益計	9,381	9,508
営業外費用		
投資有価証券売却損	609	810
固定資産除却損	21	322
金銭の信託運用損	33	429
その他	92	79
営業外費用計	758	1,642
経常利益	35,191	28,864

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	35	-
金融商品取引責任準備金戻入	59	53
関係会社清算益	-	1,611
特別利益計	94	1,664
特別損失		
投資有価証券評価損	20	-
減損損失	316	316
その他	-	270
特別損失計	16	286
税金等調整前中間純利益	35,269	30,242
法人税、住民税及び事業税	6,576	2,904
法人税等調整額	2,884	4,825
法人税等合計	9,461	7,730
中間純利益	25,808	22,511
非支配株主に帰属する中間純利益	8,060	7,147
親会社株主に帰属する中間純利益	17,747	15,363

【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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
中間純利益	25,808	22,511
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	141	269
繰延ヘッジ損益	5	56
為替換算調整勘定	2,804	10,875
退職給付に係る調整額	261	57
持分法適用会社に対する持分相当額	215	-
その他の包括利益合計	2,904	10,606
中間包括利益	28,712	11,905
(内訳)		
親会社株主に係る中間包括利益	20,826	4,761
非支配株主に係る中間包括利益	7,886	7,143

【中間連結株主資本等変動計算書】

前中間連結会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	株主資本合計
当期首残高	75,518	438,916	185,688	700,123
会計方針の変更による 累積的影響額			2,916	2,916
会計方針の変更を反映し た当期首残高	75,518	438,916	188,604	703,039
当中間期変動額				
剰余金の配当			10,229	10,229
親会社株主に帰属する 中間純利益			17,747	17,747
連結範囲の変動			-	-
子会社株式の追加取得		111		111
子会社株式の一部売却		1		1
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	-	110	7,518	7,407
当中間期末残高	75,518	438,805	196,123	710,447

	その他の包括利益累計額					新株予約権	非支配 株主持分	純資産合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	為替換算 調整勘定	退職給付に係 る調整累計額	その他の 包括利益累 計額合計			
当期首残高	840	43	26,992	846	25,262	16	284,574	959,450
会計方針の変更による 累積的影響額								2,916
会計方針の変更を反映し た当期首残高	840	43	26,992	846	25,262	16	284,574	962,367
当中間期変動額								
剰余金の配当								10,229
親会社株主に帰属する 中間純利益								17,747
連結範囲の変動								-
子会社株式の追加取得								111
子会社株式の一部売却								1
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	500	4	2,716	142	3,079	3	4,071	7,154
当中間期変動額合計	500	4	2,716	142	3,079	3	4,071	14,562
当中間期末残高	1,340	48	24,276	704	22,183	19	288,645	976,929

当中間連結会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	株主資本合計
当期首残高	75,518	438,808	211,478	725,806
会計方針の変更による累積的影響額			-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	75,518	438,808	211,478	725,806
当中間期変動額				
剰余金の配当			38,816	38,816
親会社株主に帰属する中間純利益			15,363	15,363
連結範囲の変動			4,161	4,161
子会社株式の追加取得			-	-
子会社株式の一部売却			-	-
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	-	-	19,291	19,291
当中間期末残高	75,518	438,808	192,187	706,515

	その他の包括利益累計額					新株予約権	非支配株主持分	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	為替換算調整勘定	退職給付に係る調整累計額	その他の包括利益累計額合計			
当期首残高	1,703	85	17,179	1,562	13,827	19	284,690	996,688
会計方針の変更による累積的影響額								-
会計方針の変更を反映した当期首残高	1,703	85	17,179	1,562	13,827	19	284,690	996,688
当中間期変動額								
剰余金の配当								38,816
親会社株主に帰属する中間純利益								15,363
連結範囲の変動								4,161
子会社株式の追加取得								-
子会社株式の一部売却								-
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	293	56	10,746	132	10,264	8	5,698	15,954
当中間期変動額合計	293	56	10,746	132	10,264	8	5,698	35,245
当中間期末残高	1,996	142	27,925	1,694	24,091	27	278,992	961,443

【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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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	35,269	30,242
減価償却費	12,908	13,527
のれん償却額	1,038	1,038
貸倒引当金の増減額(は減少)	296	42
金融商品取引責任準備金の増減額(は減少)	59	53
退職給付に係る負債の増減額(は減少)	806	54
受取利息及び受取配当金	27,347	44,367
支払利息	5,873	20,022
持分法による投資損益(は益)	6,119	6,065
投資有価証券売却損益(は益)	364	574
関係会社清算損益(は益)	-	1,611
投資有価証券評価損益(は益)	0	-
減損損失	16	16
顧客分別金信託の増減額(は増加)	84,412	16,168
トレーディング商品の増減額	1,368,330	1,393,285
約定見返勘定の増減額(は増加)	633,343	1,191,299
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	23,647	67,638
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	409,849	447,174
立替金及び預り金の増減額	95,645	54,962
短期差入保証金の増減額(は増加)	146,215	41,131
受入保証金の増減額(は減少)	46,044	68,146
その他	7,101	98,242
小計	177,075	518,355
利息及び配当金の受取額	43,360	55,979
利息の支払額	7,366	17,679
法人税等の支払額	16,652	16,613
法人税等の還付額	2,004	9,341
営業活動によるキャッシュ・フロー	155,729	487,326

(単位：百万円)

	前中間連結会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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	2,610	373
定期預金の払戻による収入	2,645	1,212
有価証券の取得による支出	81,266	58,839
有価証券の売却及び償還による収入	40,327	8,109
投資有価証券の取得による支出	62,744	68,633
投資有価証券の売却及び償還による収入	182,627	87,236
有形固定資産の取得による支出	1,250	1,325
有形固定資産の売却による収入	2	0
有形固定資産の除却による支出	4	89
無形固定資産の取得による支出	10,065	11,581
貸付金の増減額（は増加）	6,305	2,892
投資活動によるキャッシュ・フロー	73,966	41,392
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）	172,989	44,740
コマーシャル・ペーパーの増減額（は減少）	31,235	121,390
長期借入れによる収入	75,670	169,558
長期借入金の返済による支出	65,974	27,078
社債の発行による収入	285,827	376,997
社債の償還による支出	234,950	183,425
配当金の支払額	10,229	10,000
非支配株主への分配金支払額	3,628	10,862
非支配株主への払戻による支出	-	2,946
連結の範囲の変更を伴わない子会社株式の取得による支出	318	-
その他	0	67
財務活動によるキャッシュ・フロー	250,622	235,523
現金及び現金同等物に係る換算差額	3,711	9,264
現金及び現金同等物の増減額（は減少）	172,570	302,459
現金及び現金同等物の期首残高	1,614,478	2,143,610
現金及び現金同等物の中間期末残高	1,787,049	1,841,151

【注記事項】

(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

12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
三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社
カブドットコム証券株式会社
MUSビジネスサービス株式会社
エム・ユー・エス情報システム株式会社
MUFJGセキュリティーズEMEA
MUFJGセキュリティーズ(ヨーロッパ)
三菱UFJウェルスマネジメント銀行(スイス) (注)
MUFJGセキュリティーズ(カナダ)
MUFJGセキュリティーズアジア
MUFJGセキュリティーズアジア(シンガポール)
MMパートナーシップ
(注)三菱UFJウェルスマネジメント銀行(スイス)は、現在清算中であります。

2. 持分法の適用に関する事項

関連会社1社について持分法を適用しております。

持分法適用関連会社名

モルガン・スタンレーMUFJG証券株式会社

(除外)

三菱UFJ国際投信株式会社

上記は、当社が三菱UFJ国際投信株式会社の全株式を当社の親会社である株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループに現物配当したことに伴い、持分法適用関連会社の範囲から除外しております。

3. 連結子会社の中間決算日等に関する事項

連結子会社の中間決算日は以下のとおりであります。

6月末日 7社

9月末日 5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7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. 会計方針に関する事項

(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

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。

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

有形固定資産の減価償却の方法（リース資産を除く）

当社および連結子会社は、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 6～50年

器具備品 4～15年

無形固定資産の減価償却の方法（リース資産を除く）

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（主として5年）に基づく定額法によっております。

(4) 重要な引当金の計上基準

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。

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。

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。

偶発損失引当金

各種の訴訟や規制当局による検査・調査等に関して偶発的に発生する損失に備えるため、将来発生する可能性のある損失の見積額を計上しております。

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要支給額を計上しております。

(5) 退職給付に係る会計処理の方法

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異および過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(6) 重要なヘッジ会計の方法

ヘッジ会計の方法

通貨スワップ、為替予約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。

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、為替予約

(b)ヘッジ対象

外貨建金融資産（現先取引貸付金、有価証券、投資有価証券）

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

有価証券、投資有価証券

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通貨スワップ取引および為替予約取引を行っているほか、一部の有価証券・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。

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。

(7) 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。）

(8) 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。

連結納税制度の適用

当社および一部の国内連結子会社は、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループを連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当中間連結会計期間の期首より適用し、個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いの見直しを行っております。当該適用指針の改正に伴う会計方針の変更は遡及適用され、前中間連結会計期間および前連結会計年度については遡及適用後の中間連結財務諸表および連結財務諸表となっております。

この結果、前連結会計年度の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、利益剰余金の前期首残高は2,916百万円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

(「税効果会計に係る会計基準」の一部改正の適用)

『税効果会計に係る会計基準』の一部改正(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間連結会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前連結会計年度の連結貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」19,401百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」21,456百万円に含めて表示しております。

(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「為替差益」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935百万円は、「為替差益」94百万円、「その他」840百万円として組み替えております。

2. 従来、「営業外収益」に独立掲記しておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の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、「営業外収益」の「投資有価証券売却益」に表示していた939百万円は、「その他」として組み替えております。

3. 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」および「金銭の信託運用損」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148百万円は、「固定資産除却損」21百万円、「金銭の信託運用損」33百万円、「その他」92百万円として組み替えております。

(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 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
減価償却累計額	31,828百万円	33,498百万円

2.担保に供している資産

前連結会計年度(2018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)	トレーディング商品 (百万円)	計 (百万円)
短期借入金	50,000	192,685	192,685
共通担保資金供給オペレーション	50,000	192,685	192,685
社債	6,229	6,350	6,350
計	56,229	199,036	199,036

(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110,238百万円、担保として受け入れた有価証券52,213百万円、および現先取引で買い付けた有価証券719百万円を差し入れております。また、社債に係る銀行保証に対して、長期貸付金3,187百万円を担保に供しております。

当中間連結会計期間(2018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	13,458	13,458	13,458
社債	3,545	3,533	3,533
計	17,004	16,992	16,992

(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。また、共通担保資金供給オペレーションによる資金調達等を行うためにトレーディング商品151,290百万円を差し入れております。

2.上記のほか、消費貸借契約により借り入れた有価証券21,789百万円、担保として受け入れた有価証券49,598百万円、および現先取引で買い付けた有価証券137,681百万円を差し入れております。また、社債に係る銀行保証に対して、長期貸付金10,221百万円を担保に供しております。

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 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
信用取引貸証券	198,608百万円	205,670百万円
信用取引借入金の本担保証券	48,745	40,035
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	2,688,944	2,647,625
現先取引で売却した有価証券	5,368,794	5,620,754
その他担保として差し入れた有価証券	821,594	874,621

(注) 担保に供している資産に属するものは除いております。

(2) 受け入れた有価証券

	前連結会計年度 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
信用取引貸付金の本担保証券	262,790百万円	202,502百万円
信用取引借証券	82,354	79,160
消費貸借契約により借り入れた有価証券	5,576,745	4,068,401
現先取引で買い付けた有価証券	4,960,534	7,516,583
その他担保として受け入れた有価証券	546,199	540,764

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 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
貸出コミットメントの総額	43,138百万円	43,296百万円
貸出実行残高	-	-
差引額	43,138	43,296

なお、当中間連結会計期間末における貸出コミットメントの総額のうち、15,899百万円(貸出実行残高 - 百万円)(前連結会計年度末は14,873百万円(貸出実行残高 - 百万円))は、資産担保証券を発行する特別目的事業体への流動性補完枠を提供するものです。但し、流動性補完枠提供に係るリスクは、連結子会社が同時に他社と締結した契約において実質的に移転しております。

(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(前連結会計年度末は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 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
当座貸越極度額	271,864百万円	271,721百万円
借入実行残高	9,000	5,000
差引額	262,864	266,721

6. 偶発債務

(保証債務)

当社は、MUGセキュリティーズアメリカが有価証券担保取引を行うに当たり、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、当中間連結会計期間末および前連結会計年度末において当該残高はありません。

(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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
賞与引当金繰入額	14,369百万円	12,276百万円
退職給付費用	1,026	342

2. 投資有価証券評価損

「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。

3. 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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

当中間連結会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(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 2017年4月1日 至 2017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

区分	当中間連結会計期間末残高 (百万円)
連結子会社	19

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
2017年5月1日 取締役会	普通株式	10,229	13.88	2017年3月31日	2017年5月16日

(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
次のとおり、決議を予定しております。

(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
2017年12月1日 取締役会	普通株式	10,089	利益剰余金	13.69	2017年9月30日	2017年12月4日

当中間連結会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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

区分	当中間連結会計期間末残高 （百万円）
連結子会社	27

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当財産の種類および 帳簿価額（百万円）	28,815	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年2月22日 取締役会	普通株式	三菱UFJ国際投信株式 会社の普通株式全て	28,815	39.10	-	2018年4月2日

（注）基準日は設定しておりません。配当の効力発生日時点の株主へ配当を実施しております。

（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
2018年5月15日 取締役会	普通株式	6,618	8.98	2018年3月31日	2018年5月16日

（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
2018年8月30日 取締役会	普通株式	3,382	4.59	-	2018年8月31日

（注）基準日は設定しておりません。配当の効力発生日時点の株主へ配当を実施しております。

(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
2018年11月27日 取締役会	普通株式	7,576	利益剰余金	10.28	2018年9月30日	2018年11月28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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
現金・預金	1,792,727百万円	1,844,623百万円
預入期間が3ヵ月を超える定期預金	5,677	3,472
現金及び現金同等物の中間期末残高	1,787,049	1,841,151

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引

(借主側)

重要性がないため、リース資産の内容および減価償却の方法の記載を省略しております。

(貸主側)

該当事項はありません。

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

(借主側)

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
1年内	9,371	9,692
1年超	52,843	48,526
合計	62,214	58,219

(貸主側)

該当事項はありません。

(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(2018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	2,148,003	2,148,003	-
(2) 預託金	795,610	794,433	1,177
(3) 商品有価証券等	2,812,701	2,812,701	-
(4) 約定見返勘定	230,932	230,932	-
(5) 信用取引資産	364,858	364,858	-
信用取引貸付金	279,722	279,722	-
信用取引借証券担保金	85,135	85,135	-
(6) 有価証券担保貸付金	7,266,553	7,266,541	12
借入有価証券担保金	4,122,970	4,122,970	-
現先取引貸付金	3,143,582	3,143,570	12
(7) 短期差入保証金	1,013,202	1,013,202	-
(8) 短期貸付金	117,231	117,231	-
(9) 有価証券および投資有価証券	129,964	129,964	-
(10) 長期貸付金	2,948	2,948	-
資 産 計	14,882,006	14,880,817	1,189
(1) 商品有価証券等	2,078,853	2,078,853	-
(2) 約定見返勘定	-	-	-
(3) 信用取引負債	244,266	244,266	-
信用取引借入金	48,675	48,675	-
信用取引貸証券受入金	195,590	195,590	-
(4) 有価証券担保借入金	5,040,012	5,040,012	-
有価証券貸借取引受入金	1,699,216	1,699,216	-
現先取引借入金	3,340,796	3,340,796	-
(5) 預り金	597,218	597,218	-
(6) 受入保証金	1,820,188	1,820,188	-
(7) 短期借入金	2,155,366	2,155,366	-
(8) 1年内返済予定の長期借入金	69,238	69,264	25
(9) コマーシャル・ペーパー	811,926	811,926	-
(10) 1年内償還予定の社債	241,499	241,654	155
(11) 社債	1,013,449	1,013,577	128
(12) 長期借入金	604,849	608,008	3,158
負 債 計	14,676,870	14,680,338	3,468
デリバティブ取引(*)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	324,462	324,462	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(533)	(533)	-
デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計	323,929	323,929	-

(*)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(2018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	1,844,623	1,844,623	-
(2) 預託金	811,774	810,026	1,748
(3) 商品有価証券等	3,970,794	3,970,794	-
(4) 約定見返勘定	-	-	-
(5) 信用取引資産	291,442	291,442	-
信用取引貸付金	208,642	208,642	-
信用取引借証券担保金	82,800	82,800	-
(6) 有価証券担保貸付金	8,592,771	8,592,771	-
借入有価証券担保金	2,389,734	2,389,734	-
現先取引貸付金	6,203,037	6,203,037	-
(7) 短期差入保証金	952,398	952,398	-
(8) 短期貸付金	107,055	107,055	-
(9) 有価証券および投資有価証券	157,613	157,613	-
(10) 長期貸付金	10,232	10,232	-
資 産 計	16,738,706	16,736,958	1,748
(1) 商品有価証券等	1,974,759	1,974,759	-
(2) 約定見返勘定	960,968	960,968	-
(3) 信用取引負債	238,489	238,489	-
信用取引借入金	39,889	39,889	-
信用取引貸証券受入金	198,600	198,600	-
(4) 有価証券担保借入金	5,929,857	5,929,857	-
有価証券貸借取引受入金	1,478,492	1,478,492	-
現先取引借入金	4,451,364	4,451,364	-
(5) 預り金	655,562	655,562	-
(6) 受入保証金	1,831,844	1,831,844	-
(7) 短期借入金	2,183,198	2,183,198	-
(8) 1年内返済予定の長期借入金	173,959	174,024	64
(9) コマーシャル・ペーパー	681,011	681,011	-
(10) 1年内償還予定の社債	286,233	286,311	77
(11) 社債	1,128,624	1,128,731	106
(12) 長期借入金	644,202	646,537	2,334
負 債 計	16,688,712	16,691,295	2,583
デリバティブ取引(*)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	379,876	379,876	-
ヘッジ会計が適用されているもの	30	30	-
デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計	379,907	379,907	-

(*)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ます。

(注1)金融商品の時価の算定方法なら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、一部の子会社においては、預託金に含まれる債券およびマルチコーラブル預金(定期預金)の時価は、取引金融機関等から提示された価格によっております。

(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) 短期差入保証金ならびに(8) 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。

(9) 有価証券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等によっております。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。

(10) 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り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、主に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。

(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。また、在外子会社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。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。

(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。なお、劣後特約付社債については、変動金利で当社の信用状態が発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社債の元利金の合計額を同様の発行において想定される利率で割り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社債の元利金の合計額を同様の発行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。

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。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(9) 有価証券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 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
非上場株式等(*1)	286,224	251,792
組合出資金等(*2)	-	4

(*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)

その他有価証券

前連結会計年度(2018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	5,897	2,351	3,545
	(2)債券	16,639	16,588	51
	(3)その他	312	234	77
	小計	22,848	19,174	3,674
連結貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	107,115	108,578	1,463
	(3)その他	-	-	-
	小計	107,115	108,578	1,463
合計		129,964	127,753	2,210

(注)非上場株式等(連結貸借対照表計上額 1,755百万円)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(2018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	6,869	2,367	4,501
	(2)債券	39,904	39,815	88
	(3)その他	-	-	-
	小計	46,773	42,183	4,590
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	-	-	-
	(2)債券	110,840	112,404	1,564
	(3)その他	-	-	-
	小計	110,840	112,404	1,564
合計		157,613	154,587	3,025

(注)非上場株式等(中間連結貸借対照表計上額 1,734百万円)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 4百万円)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。

(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（2018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	4,487,751	3,848,154	31	31
		買建	10,009,254	7,408,202	133	133
	金利オプション	売建	1,533,456	-	237	193
		買建	1,547,669	-	527	405
市場取引以外の取引	金利先渡契約	売建	29,940,891	2,133,496	44	44
		買建	30,157,830	1,301,882	47	47
	金利スワップ	受取固定・ 支払変動	299,820,596	224,933,036	4,139,809	4,139,809
		受取変動・ 支払固定	296,697,630	227,770,166	4,058,926	4,058,926
		受取変動・ 支払変動	57,924,176	47,983,010	52,791	52,791
		受取固定・ 支払固定	203,672	176,383	4,953	4,953
	金利スワップション	売建	22,250,630	18,137,277	517,498	212,700
		買建	19,577,869	15,740,901	415,224	117,928
	その他	売建	2,629,101	2,296,475	36,185	11,916
		買建	2,732,214	2,498,042	46,467	8,671
合計		-	-	47,029	230,471	

(注) 時価の算定方法

市場取引については、シカゴ・マーカンタイル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(2018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	4,584,224	3,957,531	633	633
		買建	7,880,105	5,603,590	702	702
	金利オプション	売建	860,876	140,784	614	332
		買建	559,464	131,777	226	346
市場取引以外の取引	金利先渡契約	売建	31,103,582	4,041,790	9,488	9,488
		買建	30,109,697	2,721,001	9,199	9,199
	金利スワップ	受取固定・ 支払変動	304,998,157	224,042,000	3,082,881	3,082,881
		受取変動・ 支払固定	298,094,402	225,518,028	3,030,363	3,030,363
		受取変動・ 支払変動	63,108,767	52,921,469	42,135	42,135
		受取固定・ 支払固定	209,756	186,488	5,510	5,510
	金利スワップション	売建	25,211,539	19,097,612	453,420	318,020
		買建	21,955,647	16,395,292	411,667	167,354
	その他	売建	2,721,724	2,470,741	36,852	10,817
		買建	2,937,768	2,607,096	46,293	7,195
合計			-	-	67,243	246,972

(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(2018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		37,887,031	31,406,955	164,092	164,092
	為替予約	売建	2,455,806	235,439	4,867	4,867
		買建	1,964,002	250,775	29,022	29,022
	通貨オプション	売建	2,610,869	1,992,428	7,466	35,647
		買建	2,122,693	1,706,756	25,933	10,097
合計			-	-	221,649	213,798

(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(2018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	通貨スワップ		39,934,513	33,128,732	202,818	202,818
	為替予約	売建	2,851,061	280,169	49,719	49,719
		買建	1,764,916	243,659	62,811	62,811
	通貨オプション	売建	2,693,023	2,116,292	4,851	29,960
		買建	1,959,776	1,555,385	15,349	17,145
合計			-	-	236,110	228,725

(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

前連結会計年度(2018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	353,668	17,184	9,243	9,243
		買建	198,734	20,790	6,269	6,269
	株式指数 オプション	売建	1,206,002	614,845	93,813	19,208
		買建	1,016,556	478,092	72,043	1,313
市場取引以外の取引	有価証券店頭 オプション	売建	509,682	305,777	77,020	46,574
		買建	603,347	429,618	95,009	81,208
	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	207,164	172,145	13,864	13,864
		金利受取・株価 指数変化率支払	840,000	394,732	41,456	41,456
	有価証券店頭 指数等先渡取引	売建	990	-	7	7
		買建	15,312	252	1,145	1,145
合計			-	-	21,990	80,926

(注) 時価の算定方法

市場取引については、大阪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(2018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	803,917	17,184	26,256	26,256
		買建	132,049	20,790	9,671	9,671
	株式指数 オプション	売建	1,194,047	650,038	85,486	25,300
		買建	984,322	468,292	67,581	2,380
市場取引以外の取引	有価証券 店頭オプション	売建	593,819	354,082	94,025	59,300
		買建	644,680	478,409	110,668	95,783
	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	268,759	204,573	1,498	1,498
		金利受取・株価 指数変化率支払	860,274	390,271	27,268	27,268
	有価証券店頭 指数等先渡取引	売建	194	-	11	11
		買建	17,102	246	1,634	1,634
合計			-	-	12,543	77,969

(注) 時価の算定方法

市場取引については、大阪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(2018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	260,647	-	182	182
		買建	475,069	-	499	499
	債券先物 オプション	売建	346,925	-	92	9
		買建	33,863	-	16	1
市場取引以外の取引	債券店頭 オプション	売建	224,446	-	498	80
		買建	224,515	-	319	66
	債券店頭 スワップ	受取固定・ 支払変動	21,400	21,400	2,192	2,192
		受取変動・ 支払固定	-	-	-	-
		受取変動・ 支払変動	233,652	233,652	10,736	10,736
		受取固定・ 支払固定	16,500	16,500	2,256	2,256
合計			-	-	7,222	7,104

(注)時価の算定方法

市場取引については、大阪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(2018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	261,041	-	85	85
		買建	365,461	-	86	86
	債券先物 オプション	売建	543,228	-	1,042	390
		買建	345,350	-	1,122	298
市場取引以外の取引	債券店頭 オプション	売建	154,808	-	269	72
		買建	161,308	-	403	72
	債券店頭 スワップ	受取固定・ 支払変動	16,100	16,100	2,270	2,270
		受取変動・ 支払固定	-	-	-	-
		受取変動・ 支払変動	399,385	399,385	14,625	14,625
		受取固定・ 支払固定	12,500	12,500	1,694	1,694
合計			-	-	18,976	18,998

(注)時価の算定方法

市場取引については、大阪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(2018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	商品スワップ	商品指数変化率 受取・金利支払	61,357	61,357	28,771	28,771
		金利受取・商品 指数変化率支払	61,357	61,357	28,771	28,771
	商品オプション	売建	100	100	71	71
合計			-	-	71	71

(注) 1 時価の算定方法

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 商品は主に天然ガスに係るものであります。

当中間連結会計期間(2018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	商品スワップ	商品指数変化率 受取・金利支払	59,471	59,471	26,028	26,028
		金利受取・商品 指数変化率支払	59,471	59,471	26,020	26,020
	商品オプション	売建	98	98	72	72
合計			-	-	80	80

(注) 1 時価の算定方法

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 商品は主に天然ガス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(2018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	2,584,460	1,926,438	55,370	55,370
		買建	3,246,376	2,686,512	14,059	14,059
	トータル・レート・オブ・リターンズワップ	買建	99,964	63,186	223	223
合計			-	-	41,087	41,087

(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。

当中間連結会計期間(2018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	2,635,570	2,128,815	41,383	41,383
		買建	3,357,864	2,917,611	3,685	3,685
	トータル・レート・オブ・リターンズワップ	買建	122,119	39,023	13	13
合計			-	-	45,082	45,082

(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。

(ストック・オプション等関係)

前中間連結会計期間(自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)

重要性がないため、記載を省略しております。

当中間連結会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

重要性がないため、記載を省略しております。

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

持分法適用関連会社の資本異動

1. 取引の概要

(1) 持分法適用関連会社の名称およびその事業の内容

持分法適用関連会社の名称 三菱UFJ国際投信株式会社
事業の内容 投資信託委託業務、投資顧問業務

(2) 企業結合日

2018年4月2日

(3) 企業結合の法的形式

現物配当

(4) 結合後企業の名称

名称の変更はありません。

(5) その他取引の概要に関する事項

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「MUFJ」といいます。)は、国内の低金利や世界経済の保護主義・地政学リスクの増大、FinTechの進展など、国内外の構造変化やMUFJを取り巻く経営環境の変化を迅速に捉え、お客さまの多様化・高度化するニーズに対し、その期待を上回る価値を提供できる体制構築をめざし、グループの「機能別再編」を行うことを決定しました。その一環として、MUFJの子会社である三菱UFJ信託銀行株式会社は、当社およびMUFJの子会社である株式会社三菱UFJ銀行がそれぞれ保有する三菱UFJ国際投信株式会社(以下「MUKAM」といいます。)の持分を譲り受けて完全子会社化しました。これにより、MUKAMは当社の持分法適用関連会社の範囲から除外されました。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13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 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として会計処理を行っております。

(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

当該資産除去債務の総額の増減

	前連結会計年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
期首残高	7,640百万円	7,882百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	119	160
時の経過による調整額	72	36
資産除去債務の履行による減少額	15	150
その他増減額	65	1
中間期末(期末)残高	7,882	7,927

(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（欧州）」「証券業務（米州）」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ます。

なお、前連結会計年度より、従来「証券業務（英国）」としていた報告セグメントの名称を「証券業務（欧州）」に、「証券業務（米国）」としていた報告セグメントの名称を「証券業務（米州）」にそれぞれ変更しております。当該変更は名称変更のみであり、セグメント情報に与える影響はありません。なお、前中間連結会計期間のセグメントについては、変更後の報告セグメントの名称で記載しております。

また、2016年7月1日付でM U F Gセキュリティーズアメリカ（以下「M U S A」といいます。）は当社の連結範囲から除外されておりますが、当社の社内収益管理は引き続き同社を含めて行うため、「証券業務（米州）」での開示を継続しております。なお、中間連結財務諸表計上額との差額は、調整額で調整しております。

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」における記載と概ね同一であります。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 2017年4月1日 至 2017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 (欧州)	証券業務 (米州)	計				
純営業収益								
外部顧客からの純営業収益	144,459	26,828	30,468	201,756	2,109	203,865	28,107	175,757
セグメント間の内部純営業 収益または振替高	1,931	3,098	1,920	6,951	13,624	20,576	20,576	-
計	146,391	29,927	32,389	208,708	15,733	224,442	48,684	175,757
セグメント利益	15,630	8,347	4,891	28,869	18,095	46,965	29,217	17,747
セグメント資産	14,138,953	12,242,282	3,410,063	29,791,298	2,464,543	32,255,842	6,379,843	25,875,999
その他の項目								
減価償却費	11,354	1,271	488	13,114	488	13,602	694	12,908
のれんの償却額	-	-	-	-	-	-	1,038	1,038
受取利息	0	1,386	-	1,387	0	1,387	-	1,387
支払利息	-	-	-	-	19	19	19	-
持分法投資利益または損失 ()	-	-	-	-	-	-	6,119	6,119
特別利益	869	-	-	869	2,375	3,244	3,149	94
(うち、投資有価証券売却 益)	(810)	(-)	(-)	(810)	(-)	(810)	(774)	(35)
(うち、金融商品取引責任 準備金戻入)	(59)	(-)	(-)	(59)	(-)	(59)	(-)	(59)
特別損失	16	-	-	16	-	16	0	16
(うち、減損損失)	(16)	(-)	(-)	(16)	(-)	(16)	(0)	(16)
税金費用	6,173	3,069	3,120	12,362	155	12,518	3,056	9,461
持分法適用会社への投資額	-	-	-	-	441,369	441,369	160,560	280,809
有形固定資産および無形固 定資産の増加額	8,542	2,430	911	11,884	313	12,197	1,077	11,120

(注)1. 「その他」には、証券持株会社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) 外部顧客からの純営業収益の調整額 28,107百万円は、主に当社の連結範囲から除外されたMUSAおよびその子会社であるMUFJGセキュリティーズ(カナダ)の外部顧客からの純営業収益の調整であります。
- (2) セグメント利益の調整額 29,217百万円には、セグメント間取引消去等 18,057百万円および当社の連結範囲から除外されたMUSAおよびその子会社であるMUFJGセキュリティーズ(カナダ)の中間純利益の調整 4,891百万円が含まれております。
- (3) セグメント資産の調整額 6,379,843百万円には、当社の連結範囲から除外されたMUSAおよびその子会社であるMUFJGセキュリティーズ(カナダ)の資産額 3,410,063百万円およびセグメント間の債権等の相殺消去 2,789,564百万円が含まれております。

3. セグメント利益は、中間連結財務諸表の親会社株主に帰属する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 2018年4月1日 至 2018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 (欧州)	証券業務 (米州)	計				
純営業収益								
外部顧客からの純営業収益	140,605	21,256	27,973	189,836	635	190,471	24,956	165,515
セグメント間の内部純営業 収益または振替高	1,233	4,050	2,332	7,616	14,628	22,244	22,244	-
計	141,839	25,307	30,305	197,452	15,263	212,716	47,201	165,515
セグメント利益	15,848	4,543	3,285	23,676	22,639	46,316	30,952	15,363
セグメント資産	14,873,417	8,512,479	4,581,905	27,967,802	2,816,093	30,783,896	6,846,731	23,937,165
その他の項目								
減価償却費	11,856	1,389	650	13,897	495	14,392	864	13,527
のれんの償却額	-	-	-	-	-	-	1,038	1,038
受取利息	0	1,015	-	1,015	0	1,015	-	1,015
支払利息	-	-	-	-	16	16	16	-
持分法投資利益または損失 ()	-	-	-	-	-	-	6,065	6,065
特別利益	53	-	-	53	2,455	2,509	844	1,664
(うち、関係会社清算益)	(-)	(-)	(-)	(-)	(2,331)	(2,331)	(720)	(1,611)
特別損失	275	-	-	275	13,125	13,400	13,114	286
(うち、減損損失)	(16)	(-)	(-)	(16)	(-)	(16)	(0)	(16)
(うち、関係会社株式評価 損)	(-)	(-)	(-)	(-)	(13,113)	(13,113)	(13,113)	(-)
税金費用	6,465	1,631	1,034	9,131	879	10,011	2,280	7,730
持分法適用会社への投資額	-	-	-	-	412,554	412,554	162,496	250,058
有形固定資産および無形固 定資産の増加額	10,596	1,497	578	12,672	499	13,171	567	12,603

(注)1. 「その他」には、証券持株会社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) 外部顧客からの純営業収益の調整額 24,956百万円は、主に当社の連結範囲から除外されたMUSAの外部顧客からの純営業収益の調整であります。

(2) セグメント利益の調整額 30,952百万円は、主にセグメント間取引消去等であります。

(3) セグメント資産の調整額 6,846,731百万円には、当社の連結範囲から除外されたMUSAの資産額 3,638,735百万円およびセグメント間の債権等の相殺消去 3,213,624百万円が含まれております。

3. セグメント利益は、中間連結財務諸表の親会社株主に帰属する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 2017年4月1日 至 2017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
145,089	24,756	5,911	175,757

（注）純営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国また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
36,125	2,367	272	38,764

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 2018年4月1日 至 2018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
140,818	19,800	4,895	165,515

（注）純営業収益は、顧客の所在地を基礎とし、国また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
33,639	2,175	391	36,206

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 2017年4月1日 至 2017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 2018年4月1日 至 2018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 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

（単位：百万円）

	証券業務 （国内）	証券業務 （欧州）	証券業務 （米州）	その他	全社・消去	合計
当中間期末残高	-	-	-	-	34,204	34,204

（注）「全社・消去」の金額は、「証券業務（国内）」セグメントに係るものであります。

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 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：百万円）

	証券業務 （国内）	証券業務 （欧州）	証券業務 （米州）	その他	全社・消去	合計
当中間期末残高	-	-	-	-	32,126	32,126

（注）「全社・消去」の金額は、「証券業務（国内）」セグメントに係るものであります。

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。

【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 2017年4月1日 至 2017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 2018年4月1日 至 2018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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
(1) 1株当たり中間純利益	24.08円	20.85円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する中間純利益 (百万円)	17,747	15,363
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る親会社株主に帰属する中間純 利益(百万円)	17,747	15,363
普通株式の期中平均株式数(千株)	736,985	736,985
(2) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益	24.08円	20.85円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する中間純利益調整額 (百万円)	0	0
(うち連結子会社の発行する潜在株式による 調整額(百万円))	(0)	(0)
普通株式増加数(千株)	-	-
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の算定に含めなかった潜在 株式の概要	-	-

	前連結会計年度 (2018年3月31日)	当中間連結会計期間 (2018年9月30日)
1株当たり純資産	966.07円	925.97円
(算定上の基礎)		
純資産の部の合計額(百万円)	996,688	961,443
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	284,710	279,020
(うち非支配株主持分)(百万円)	(284,690)	(278,992)
普通株式に係る中間期末(期末)の純資産 (百万円)	711,978	682,423
1株当たり純資産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】

【中間貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当中間会計期間 (2018年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	56,446	93,840
短期貸付金	698,754	818,414
借入有価証券代り金	249,310	273,480
短期差入保証金	108,947	91,035
その他	84,062	57,014
流動資産合計	1,197,521	1,333,784
固定資産		
有形固定資産	7	7
無形固定資産	2,205	2,334
投資その他の資産		
投資有価証券	671,884	715,865
長期貸付金	1,233,736	1,227,270
繰延税金資産	2,623	1,797
その他	985	982
投資その他の資産合計	909,229	945,915
固定資産合計	911,442	948,257
資産合計	2,108,964	2,282,042
負債の部		
流動負債		
1年内償還予定の社債	189,689	248,961
1年内返済予定の長期借入金	25,500	76,500
コマーシャル・ペーパー	80,000	30,000
未払法人税等	336	394
賞与引当金	525	352
その他	74,636	53,918
流動負債合計	370,688	410,127
固定負債		
社債	808,598	924,103
長期借入金	258,500	308,677
その他	275	99
固定負債合計	1,067,373	1,232,880
負債合計	1,438,062	1,643,008

(単位：百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当中間会計期間 (2018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	52,655	20,415
利益剰余金合計	139,417	107,177
株主資本合計	641,880	609,640
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	29,021	29,393
評価・換算差額等合計	29,021	29,393
純資産合計	670,902	639,034
負債純資産合計	2,108,964	2,282,042

【中間損益計算書】

(単位：百万円)

	前中間会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
営業収益		
関係会社受取配当金	13,340	18,994
関係会社受入手数料	3,278	2,909
関係会社貸付金利息	707	856
その他	4,722	1,945
営業収益合計	22,048	24,706
営業費用		
販売費及び一般管理費	1,252,234	1,249,998
金融費用	5,105	1,678
営業費用合計	10,340	6,677
営業利益	11,707	18,028
営業外収益	3,306	3,119
営業外費用	20	64
経常利益	11,993	18,083
特別利益		
関係会社清算益	2,375	2,331
特別利益合計	2,375	2,331
特別損失		
関係会社株式評価損	-	4,13,113
特別損失合計	-	13,113
税引前中間純利益	14,368	7,301
法人税、住民税及び事業税	0	62
法人税等調整額	67	662
法人税等合計	67	724
中間純利益	14,301	6,576

【中間株主資本等変動計算書】

前中間会計期間（自 2017年4月1日 至 2017年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本計 合
		資本準備金	資本剰余金 計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 計	
					別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75,518	426,944	426,944	12,208	74,553	27,399	114,161	616,624
会計方針の変更による 累積的影響額						2,916	2,916	2,916
会計方針の変更を反映し た当期首残高	75,518	426,944	426,944	12,208	74,553	30,316	117,078	619,541
当中間期変動額								
剰余金の配当						10,229	10,229	10,229
中間純利益						14,301	14,301	14,301
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	-	-	-	-	-	4,072	4,072	4,072
当中間期末残高	75,518	426,944	426,944	12,208	74,553	34,388	121,150	623,613

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	27,558	27,558	644,183
会計方針の変更による 累積的影響額			2,916
会計方針の変更を反映し た当期首残高	27,558	27,558	647,099
当中間期変動額			
剰余金の配当			10,229
中間純利益			14,301
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	627	627	627
当中間期変動額合計	627	627	4,699
当中間期末残高	28,186	28,186	651,799

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75,518	426,944	426,944	12,208	74,553	52,655	139,417	641,880
会計方針の変更による 累積的影響額						-	-	-
会計方針の変更を反映し た当期首残高	75,518	426,944	426,944	12,208	74,553	52,655	139,417	641,880
当中間期変動額								
剰余金の配当						38,816	38,816	38,816
中間純利益						6,576	6,576	6,576
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	-	-	-	-	-	32,239	32,239	32,239
当中間期末残高	75,518	426,944	426,944	12,208	74,553	20,415	107,177	609,640

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	29,021	29,021	670,902
会計方針の変更による 累積的影響額			-
会計方針の変更を反映し た当期首残高	29,021	29,021	670,902
当中間期変動額			
剰余金の配当			38,816
中間純利益			6,576
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	371	371	371
当中間期変動額合計	371	371	31,867
当中間期末残高	29,393	29,393	639,034

【注記事項】

(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

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。

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。

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、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) 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。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支払いに備えるため、当事業年度における支払見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

3. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

振当処理・特例処理の要件を満たしている通貨スワップ(金利通貨スワップ)については、一体処理(振当処理・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、ヘッジ方針

当社の内規に基づき、為替変動リスク、金利変動リスクをヘッジしております。

当中間会計期間にヘッジ会計を適用したヘッジ対象とヘッジ手段は以下のとおりです。

ヘッジ手段

通貨スワップ(金利通貨スワップ)

ヘッジ対象

外貨建貸付金

(3) ヘッジ有効性評価の方法

一体処理(振当処理・特例処理)によっている通貨スワップ(金利通貨スワップ)については有効性の判定を省略しております。

4. 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

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループを連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首より適用し、個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いの見直しを行っております。当該適用指針の改正に伴う会計方針の変更は遡及適用され、前中間会計期間および前事業年度については遡及適用後の中間財務諸表および財務諸表となっております。

この結果、前事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、利益剰余金の前期首残高は2,916百万円増加しております。

(表示方法の変更)

(「税効果会計に係る会計基準」の一部改正の適用)

『税効果会計に係る会計基準』の一部改正(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」1,136百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」2,623百万円に含めて表示しております。

(中間貸借対照表関係)

1. 担保に供している資産

社債に係る銀行保証に対して、長期貸付金を担保に供しております。なお、当中間会計期間末において当該残高は、10,221百万円(前事業年度末は3,187百万円)であります。

2. 担保として受け入れた有価証券の時価額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当中間会計期間 (2018年9月30日)
消費貸借契約により借り入れている有価証券の時価	249,428百万円	272,335百万円
うち再貸付に供している有価証券	249,428	272,335

3. 当座貸越契約および貸出コミットメント

(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 (2018年3月31日)	当中間会計期間 (2018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

4. 偶発債務

(保証債務)

- (1) MUF Gセキュリティーズ EMEAの一部のデリバティブ取引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、59,308百万円(前事業年度末は82,695百万円)であります。
- (2) MUF Gセキュリティーズ EMEA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、48,860百万円(前事業年度末は54,431百万円)であります。
- (3) MUF Gセキュリティーズ EMEA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、当中間会計期間末において当該残高はありません。(前事業年度末は6百万円)
- (4) MUF Gセキュリティーズアメリカが有価証券担保取引を行うに当たり、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、当中間会計期間末および前事業年度末において当該残高はありません。
- (5) 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社の一部のデリバティブ取引に対して保証を行っております。なお、当中間会計期間末および前事業年度末において当該残高はありません。
- (6) MUF Gセキュリティーズ(カナダ)の借入取引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、4,357百万円(前事業年度末は12,357百万円)であります。
- (7) MUF Gセキュリティーズ(カナダ)の金融機関へのクリアリングおよび決済に係る支払等の履行義務の一部に対して保証を行っております。なお、当中間会計期間末および前事業年度末において当該残高はありません。
- (8) MUF Gセキュリティーズ(カナダ)が有価証券担保取引を行うに当たり、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、当中間会計期間末および前事業年度末において当該残高はありません。

(契約上の債務)

当社はMUF Gセキュリティーズ EMEAとの間で、MUF Gセキュリティーズ EMEAが三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社と締結しているISDA契約、GMR A契約、GML A契約に基づくデリバティブ、レポ取引等に係る、MUF Gセキュリティーズ EMEAが三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社に対して有するエクスポージャーのうち通常のCredit Support Annexでカバーされない部分について、30,000百万円を上限として当社が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、30,000百万円(前事業年度末は30,000百万円)であります。

(中間損益計算書関係)

1. 販売費及び一般管理費は、全額が一般管理費に属するものであります。なお、主要な費目および金額は次のとおりであります。

	前中間会計期間 (自 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
支払手数料	1,719百万円	1,533百万円
従業員給料	837	822
賞与引当金繰入額	307	332
減価償却費	296	316

2. 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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有形固定資産	1百万円	0百万円
無形固定資産	294	316
計	296	316

3. 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 2017年4月1日 至 2017年9月30日)	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
受取配当金	48百万円	27百万円
有価証券償還益	152	29

4. 関係会社株式評価損

「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。

(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(2018年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価(百万円)	差額(百万円)
子会社株式	44,083	64,589	20,505

当中間会計期間(2018年9月30日)

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価(百万円)	差額(百万円)
子会社株式	44,083	67,766	23,682

(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 (2018年3月31日)	当中間会計期間 (2018年9月30日)
子会社株式	395,021	382,446
関連会社株式	183,523	154,707

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。

(企業結合等関係)

中間連結財務諸表「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。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(2)【その他】

2018年11月27日開催の取締役会において、第14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	7,576百万円
1株当たりの金額	10円28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)有価証券届出書の訂正届出書
2018年3月30日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年4月16日
関東財務局長に提出 |
| (2)有価証券届出書の訂正届出書
2018年3月30日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年4月16日
関東財務局長に提出 |
| (3)有価証券届出書の訂正届出書
2018年3月30日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年4月17日
関東財務局長に提出 |
| (4)有価証券届出書の訂正届出書
2018年3月30日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年4月17日
関東財務局長に提出 |
| (5)有価証券届出書(社債)およびその添付書類 | 2018年5月8日
関東財務局長に提出 |
| (6)有価証券届出書(社債)およびその添付書類 | 2018年5月8日
関東財務局長に提出 |
| (7)有価証券届出書(社債)およびその添付書類 | 2018年5月8日
関東財務局長に提出 |
| (8)有価証券届出書(社債)およびその添付書類 | 2018年5月8日
関東財務局長に提出 |
| (9)有価証券届出書の訂正届出書
2018年5月8日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年5月22日
関東財務局長に提出 |
| (10)有価証券届出書の訂正届出書
2018年5月8日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年5月22日
関東財務局長に提出 |
| (11)有価証券届出書の訂正届出書
2018年5月8日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年5月23日
関東財務局長に提出 |
| (12)有価証券届出書の訂正届出書
2018年5月8日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書 | 2018年5月23日
関東財務局長に提出 |

- (13)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13期）（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
2018年6月27日
関東財務局長に提出
- (14)有価証券届出書（社債）およびその添付書類
2018年6月28日
関東財務局長に提出
- (15)有価証券届出書（社債）およびその添付書類
2018年6月28日
関東財務局長に提出
- (16)有価証券届出書（社債）およびその添付書類
2018年6月28日
関東財務局長に提出
- (17)有価証券届出書（社債）およびその添付書類
2018年6月28日
関東財務局長に提出
- (18)有価証券届出書（社債）およびその添付書類
2018年6月28日
関東財務局長に提出
- (19)有価証券届出書の訂正届出書
2018年6月28日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書
2018年7月13日
関東財務局長に提出
- (20)有価証券届出書の訂正届出書
2018年6月28日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書
2018年7月13日
関東財務局長に提出
- (21)有価証券届出書の訂正届出書
2018年6月28日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書
2018年7月13日
関東財務局長に提出
- (22)有価証券届出書の訂正届出書
2018年6月28日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書
2018年7月17日
関東財務局長に提出
- (23)有価証券届出書の訂正届出書
2018年6月28日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書
2018年7月17日
関東財務局長に提出
- (24)発行登録書（社債）およびその添付書類
2018年8月10日
関東財務局長に提出
- (25)訂正発行登録書
2018年8月31日
関東財務局長に提出

(26)訂正発行登録書	2018年8月31日 関東財務局長に提出
(27)訂正発行登録書	2018年8月31日 関東財務局長に提出
(28)訂正発行登録書	2018年8月31日 関東財務局長に提出
(29)訂正発行登録書	2018年9月3日 関東財務局長に提出
(30)訂正発行登録書	2018年9月3日 関東財務局長に提出
(31)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類	2018年9月14日 関東財務局長に提出
(32)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類	2018年9月14日 関東財務局長に提出
(33)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類	2018年9月14日 関東財務局長に提出
(34)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類	2018年9月18日 関東財務局長に提出
(35)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類	2018年9月18日 関東財務局長に提出
(36)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類	2018年9月19日 関東財務局長に提出
(37)訂正発行登録書	2018年10月1日 関東財務局長に提出
(38)訂正発行登録書	2018年10月1日 関東財務局長に提出

(39)訂正発行登録書

2018年10月1日
関東財務局長に提出

(40)訂正発行登録書

2018年10月1日
関東財務局長に提出

(41)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類

2018年10月15日
関東財務局長に提出

(42)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類

2018年10月16日
関東財務局長に提出

(43)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類

2018年10月16日
関東財務局長に提出

(44)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類

2018年10月17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】

第1【保証会社情報】

該当事項はありません。

第2【保証会社以外の会社の情報】

該当事項はありません。

第3【指数等の情報】

1【当該指数等の情報の開示を必要とする理由】

日経平均株価

当該指数等の情報の開示を必要とする理由

(1) 当中間連結会計期間末日時点で当社の発行している有価証券

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2020年12月15日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2022年12月12日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年1月13日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年1月10日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年2月10日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年2月10日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動3段デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年4月9日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年4月11日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年4月11日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動3段デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年5月7日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年5月10日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年5月10日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動3段デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年7月9日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年7月12日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年7月12日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動3段デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年9月13日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年9月7日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年9月7日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動デジタルクーポン 円建社債

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年9月12日満期 期限前償還条項付

日経平均株価連動3段デジタルクーポン円建社債

(2) 上記(1)の各社債は、利息額、期限前償還の有無および満期償還金額が日経平均株価により決定されるため、日経平均株価についての開示を必要とします。

内容

日経平均株価は、株式会社日本経済新聞社が公表する、東京証券取引所において取引されている225銘柄から構成される株価指数であります。

2【当該指数等の推移】

日経平均株価の過去の推移（終値ベース）

（単位：円）

最近5事業年度の 年度別最高・最低値	年度	2013年	2014年	2015年	2016年	2017年
	最高	16,291.31	19,754.36	20,868.03	19,633.75	24,124.15
	最低	12,003.43	13,910.16	14,952.61	14,952.02	18,335.63

最近6ヶ月の月別 最高・最低値	月	2018年4月	2018年5月	2018年6月	2018年7月	2018年8月	2018年9月
	最高	22,467.87	23,002.37	22,966.38	22,794.19	22,869.50	24,120.04
	最低	21,292.29	22,018.52	22,171.35	21,546.99	21,857.43	22,307.06

出典：ブルームバーグ・エルピー

日経平均株価の過去の推移は日経平均株価の将来の動向を示唆するものではなく、上記の社債の時価の動向を示すものでもありません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月22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	坂本 一朗	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	高尾 大介	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2018年4月1日から2019年3月31日までの連結会計年度の中間連結会計期間（2018年4月1日から2018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に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2018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（2018年4月1日から2018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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月22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	坂本 一朗	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	高尾 大介	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2018年4月1日から2019年3月31日までの第14期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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に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2018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（2018年4月1日から2018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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。