

【表紙】

| | |
|------------|---|
| 【提出書類】 | 半期報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 2020年11月27日 |
| 【中間会計期間】 | 第16期中（自 2020年4月1日 至 2020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。 |

(注) 2020年12月21日から本店は下記に移転する予定であります。

| | |
|----------|-------------------|
| 本店の所在の場所 | 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) |

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14期中 | 第15期中 | 第16期中 | 第14期 | 第15期 |
|--------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 会計期間 | 自 2018年 4月1日 至 2018年 9月30日 | 自 2019年 4月1日 至 2019年 9月30日 | 自 2020年 4月1日 至 2020年 9月30日 | 自 2018年 4月1日 至 2019年 3月31日 | 自 2019年 4月1日 至 2020年 3月31日 |
| 営業収益 (百万円) | 185,537 | 204,655 | 191,720 | 371,484 | 455,781 |
| 純営業収益 (百万円) | 165,515 | 141,633 | 148,526 | 313,399 | 322,164 |
| 経常利益 (百万円) | 28,864 | 10,012 | 25,746 | 42,363 | 48,502 |
| 親会社株主に帰属する中間 (当期)純利益 (百万円) | 15,363 | 4,186 | 14,829 | 25,141 | 21,142 |
| 中間包括利益又は包括利益 (百万円) | 11,905 | 1,229 | 550 | 18,320 | 34,730 |
| 純資産 (百万円) | 961,443 | 935,637 | 931,937 | 948,743 | 943,963 |
| 総資産 (百万円) | 23,937,165 | 28,153,076 | 31,741,557 | 24,508,629 | 31,866,151 |
| 1株当たり純資産 (円) | 925.97 | 897.81 | 898.39 | 911.63 | 914.36 |
| 1株当たり中間(当期)純 利益 (円) | 20.85 | 5.68 | 20.12 | 34.11 | 28.69 |
| 潜在株式調整後1株当たり 中間(当期)純利益 (円) | 20.85 | - | - | 34.11 | - |
| 自己資本比率 (%) | 2.9 | 2.4 | 2.1 | 2.7 | 2.1 |
| 営業活動による キャッシュ・フロー (百万円) | 487,326 | 340,986 | 660,060 | 689,356 | 441,388 |
| 投資活動による キャッシュ・フロー (百万円) | 41,392 | 98,570 | 26,369 | 27,488 | 153,265 |
| 財務活動による キャッシュ・フロー (百万円) | 235,523 | 709,368 | 953,713 | 504,944 | 803,964 |
| 現金及び現金同等物の 中間期末(期末)残高 (百万円) | 1,841,151 | 1,503,754 | 1,859,656 | 1,972,693 | 2,183,232 |
| 従業員数 (人) | 7,864 | 7,934 | 7,778 | 7,768 | 7,811 |
| (外、平均臨時雇用人員) | (590) | (565) | (438) | (596) | (536) |

(注) 第15期中、第15期および第16期中の潜在株式調整後1株当たり中間(当期)純利益については、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) 提出会社の経営指標等

| 回次 | 第14期中 | 第15期中 | 第16期中 | 第14期 | 第15期 |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 会計期間 | 自 2018年 4月1日 至 2018年 9月30日 | 自 2019年 4月1日 至 2019年 9月30日 | 自 2020年 4月1日 至 2020年 9月30日 | 自 2018年 4月1日 至 2019年 3月31日 | 自 2019年 4月1日 至 2020年 3月31日 |
| 営業収益 (百万円) | 24,706 | 25,741 | 16,864 | 42,436 | 38,463 |
| 経常利益 (百万円) | 18,083 | 13,919 | 5,085 | 27,027 | 17,875 |
| 中間(当期)純利益 (百万円) | 6,576 | 13,347 | 4,296 | 15,113 | 13,603 |
| 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) | 639,034 | 638,660 | 624,463 | 633,733 | 627,874 |
| 総資産 (百万円) | 2,282,042 | 2,348,053 | 2,440,735 | 2,353,759 | 2,602,051 |
| 1株当たり配当額 (円) | 14.87 | 10.54 | 9.50 | 33.92 | 24.33 |
| 自己資本比率 (%) | 28.0 | 27.2 | 25.6 | 26.9 | 24.1 |
| 従業員数 (人) | 202 | 186 | 171 | 198 | 175 |

(注) 1. 第14期の1株当たり配当額には、特別配当12円84銭を含んでおります。

2. 第15期の1株当たり配当額には、特別配当3円05銭を含んでおります。

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、次の通りです。

（除外）

連結子会社 三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社

3【関係会社の状況】

当中間連結会計期間において、連結子会社であった三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社は、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社との吸収合併に伴い、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

2020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） | 6,051（238） |
| 証券業務（欧州） | 713（152） |
| 証券業務（米州） | 487（64） |
| その他 | 1,003（48） |
| 調整 | 476（64） |
| 合 計 | 7,778（438） |

（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。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。

(2) 提出会社の状況

2020年9月30日現在

| セグメントの名称 | 従業員数（人） |
|----------|---------|
| その他 | 171 |
| 合 計 | 171 |

（注）上記のほか、執行役員は2020年9月末の人数は23人です。

(3) 労働組合の状況

労使関係について特記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（2020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）優先的に対処すべき事業上および財務上の課題

当中間連結会計期間において、当社グループが優先的に対処すべき事業上および財務上の課題に重要な変更はありません。
また、新たに生じた優先的に対処すべき事業上および財務上の課題はありません。

2【事業等のリスク】

当中間連結会計期間において、新たに認識した事業等のリスクは、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（2020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。

気候変動に関するリスク

気候変動に伴う自然災害や異常気象の増加等によってもたらされる物理的な被害、気候関連の規制強化および低炭素社会への移行が、当社グループの取引先の事業や財務状況に影響を及ぼし、取引先への影響を通じて当社グループの経営成績や財政状態に悪影響を与える可能性があります。

当社グループは、気候変動に関するリスクの把握・評価や、情報開示の重要性を認識し、金融安定理事会によって設立された気候関連財務情報開示タスクフォース（Task Force on Climate-related Financial Disclosures。以下、「TCFD」といいます。）が策定した気候変動関連財務情報開示に関する提言を支持するとともに、TCFDに沿ったリスクの把握・評価や情報開示の拡充に取り組んでおりますが、気候変動に関するリスクへの取組みや情報開示が不十分であった場合またはそのように見做され、社会に対する責任を十分に果たしていないと見做された場合などには、当社グループの企業価値の毀損に繋がるおそれがあり、当社グループの事業、財政状態および経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

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（2020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

当社グループ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（デリバティブを含む）および投資についての評価、固定資産の減損、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、貸付等債権に対する貸倒引当金、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。なお、前事業年度の有価証券報告書に記載した「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」中の会計上の見積りおよび当該見積りに用いた仮定の記載について重要な変更はありません。

当社グループの中間連結財務諸表で採用する重要な会計方針は「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（中間連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項）」に記載しております。

（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、新型コロナウイルスの感染拡大によって急速に悪化しましたが、6月以降は下げ止まりました。緊急事態宣言の発令を受けて、企業の生産や投資が急失速したものの、新型コロナウイルスの感染拡大がいち早く収束した中国向けを中心に輸出が持ち直し、製造業の生産も6月から増加に転じました。大きく落ち込んだ個人消費も、緊急事態宣言が解除された5月下旬以降、徐々に持ち直しています。

株式市場では、18,686円でスタートした日経平均株価が、23,185円で終了しました。政府の緊急経済対策や新型コロナウイルス感染者数の増加ペースの鈍化、海外での経済活動再開などを好感して上昇傾向に転じ、一時23,000円を上回りました。6月から7月にかけては、米国で感染第二波への警戒感が強まったこともあり、軟調な推移となりましたが、8月に入ると、トランプ米大統領が追加経済対策を発表したことなどをを受けて持ち直しました。

債券市場では、長期金利（新発10年国債利回り）が-0.02%で始まり、0.02%で終了しました。4月から6月にかけては、日銀の追加緩和観測で一時的に-0.06%まで低下する局面や、株価上昇を受けて一時的に0.05%に上昇する動きも見られましたが、概ねゼロ%近傍で安定的に推移しました。7月以降は、日銀による長期国債買入れの増額見送りや、米国の追加経済対策の発表、米連邦準備制度理事会のインフレ容認姿勢などによる米長期金利上昇等を背景に、0.05%近傍まで水準を切り上げました。しかし9月に入ると、安倍前首相の後任に選出された菅首相が現行の金融緩和スタンスを維持するとの見方が強まり、再び低下傾向を迎えました。

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純営業収益は1,485億26百万円（前年度中間期比104.9%）、販売費・一般管理費は1,308億66百万円（同91.8%）、経常利益は257億46百万円（同257.1%）、親会社株主に帰属する中間純利益は148億29百万円（同354.2%）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。

受入手数料

| 区 分 | 前中間連結会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日) (百万円) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) (百万円) | 前年度中間期比 (%) |
|--------------------------------|---|---|----------------|
| 受入手数料 | 68,129 | 62,840 | 92.2 |
| 委託手数料 | 12,052 | 13,232 | 109.8 |
| 引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料 | 15,979 | 12,398 | 77.6 |
| 募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料 | 8,145 | 7,626 | 93.6 |
| その他の受入手数料 | 31,951 | 29,582 | 92.6 |

受入手数料の合計は628億40百万円で前年度中間期比92.2%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19億6百万株(前年度中間期比122.4%)、金額で2兆9,037億円(同112.7%)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125億65百万円(同108.3%)、債券委託手数料は3百万円(同220.1%)となり、委託手数料は合計で132億32百万円(同109.8%)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、年度初は新型コロナウイルス感染拡大の影響により低調だったものの、市場環境の回復に伴い、過去最大級の売出しが実施されたことで、前年度中間期と比べ発行額は増加しました。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、年度初は新型コロナウイルス感染拡大の影響もあり不安定な市場環境となりましたが、日銀の金融緩和政策もあり、手元資金確保を目的とした起債に加え、ESG債や劣後債の発行も複数見られ、発行額は前年度中間期と同程度の規模となりました。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。

海外発行市場は、年度初は新型コロナウイルス感染拡大を背景とした景気減速懸念により低調でしたが、各国中央銀行の債券購入等の緊急支援策を受け、債券発行額は前年度中間期を上回る水準となりました。当社グループの海外現地法人は、このような環境を追い風に、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123億98百万円(前年度中間期比77.6%)となりました。

c. 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料

募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は、その大半を連結子会社の三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社(以下「MUMSS」といいます。)における投資信託の募集取扱手数料が占めるほか、私募による有価証券の取扱手数料などを含んでおります。

当中間連結会計期間は、MUMSSにおける株式投資信託と公社債投資信託を合算した募集・売出し取扱高が1兆8,689億円(前年度中間期比104.7%)となりました。このうち、株式投資信託の販売では、相対的に利回りが高いと判断される先進国CB等に投資を行う「JPMグローバル高利回りCBファンド(限定追加型)2020-06」や「シュローダー先進国好利回りCBファンド2020-07(限定追加型)」の新規募集を行うとともに、「netWINGSテクノロジー株式ファンド」や「米国株式シグナルチェンジ戦略ファンド」等の継続募集にも注力しました。新型コロナウイルス感染拡大の影響による対面提案活動への制約等から私募による株式投資信託の販売額は前年度中間期比で減少しましたが、株価の回復に伴う投資マインドの改善等を背景に公募による株式投資信託の販売額が増加したことから、投信信託の募集取扱手数料は前年度中間期比で増加しました。

一方、私募による有価証券の取扱手数料は新型コロナウイルス感染拡大の影響もあり前年度中間期比で減少しました。

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76億26百万円(同93.6%)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295億82百万円（前年度中間期比92.6%）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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) (百万円) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) (百万円) | 前年度中間期比 (%) |
|------------------|---|---|----------------|
| トレーディング損益 | 65,669 | 68,955 | 105.0 |
| 株券等トレーディング損益 | 32,500 | 18,320 | 56.4 |
| 債券等・その他トレーディング損益 | 33,169 | 50,635 | 152.7 |

国内株式市場では、緊急事態宣言解除後の経済活動の段階的な再開等を背景に日経平均株価は上昇しました。

国内債券市場では、経済活動の鈍化への懸念を背景に10年物国債利回りは、一時-0.06%まで低下しましたが、その後、緊急事態宣言解除後の経済活動の段階的な再開への期待や国債増発に伴う需給悪化懸念などを背景に0.02~0.05%まで上昇しました。また、10年物米国債利回りは、過去最大規模の国債増発等を受け、一時0.80%台まで上昇しましたが、米中対立の激化に伴う景気悪化懸念等を背景に、0.50~0.70%台まで低下しました。一方、クレジット市場では、企業のクレジットリスクの高まりを受け、3月にスプレッドが急拡大していましたが、4月以降は徐々に落ち着きを取り戻しました。

このような環境下、当社グループはお客さまのニーズに応じた商品提供に努めました。

海外市場（1~6月）では、新型コロナウイルス感染拡大の影響を受けて、米国株価指数は大幅に下落し、クレジットスプレッドも大幅に拡大しましたが、日米欧中銀による金融緩和や財政による景気刺激策により、落ち着きを取り戻し、10年物米国債利回りも過去最低を更新して一時0.50%台まで低下しました。こうした中、当社グループの海外現地法人は、比較的シンプルな米ドル建およびユーロ建金利商品およびクレジット商品を中心にお客さまのニーズに合致した商品提供に努めました。

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183億20百万円（前年度中間期比56.4%）、債券等・その他によるものが506億35百万円（同152.7%）、合計では689億55百万円（同105.0%）となりました。

金融収支

当中間連結会計期間の金融収益599億19百万円（前年度中間期比84.6%）から金融費用431億93百万円（同68.5%）を差し引いた金融収支は、167億26百万円の利益（同213.6%）となりました。

販売費・一般管理費

証券仲介手数料等の取引関係費が大幅に減少したことや、前年度に実施したコスト構造改革も寄与し、当中間連結会計期間の販売費・一般管理費は1,308億66百万円（前年度中間期比91.8%）となりました。

特別損益

当中間連結会計期間の特別利益は6百万円（前年度中間期は5億33百万円）、特別損失は4億69百万円（前年度中間期は6億10百万円）となりました。特別利益は、投資有価証券売却益が6百万円であります。特別損失のうち主なものは、減損損失2億77百万円、金融商品取引責任準備金繰入れ97百万円、投資有価証券評価損15百万円であります。

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）」

国内では、国内営業において、アドバイザー型ビジネスへのモデルシフトの進展や、前年度から取り組んできたコスト構造改革が寄与し、前年度中間期からは復調しました。しかしながら、インベストメントバンキング業務において、債券引受や株式引受の大型案件が剥落する等で低調だったほか、グローバルマーケット業務においても、エクイティデリバティブでポジション損失を計上し、セグメント収益・セグメント利益ともに減少しました。

この結果、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1,139億40百万円（前年度中間期比97.8%）、セグメント利益は25億96百万円（同83.0%）となりました。

なお、新型コロナウイルスの影響は、上記の主要な収益・費用の概況に記載した内容のほかにも広範囲に及び、その影響を定量的に示すことは困難ですが、主に対面・非対面営業の業務量やボラティリティ上昇による収益機会などの増減として現れています。

「証券業務（欧州）」

欧州では、グローバルマーケット業務において、コロナ禍による高ボラティリティ環境や流動性需要拡大等の収益機会を捉え、レポビジネスや金利トレーディング収益が伸長したほか、エクイティデリバティブも健闘したことにより、セグメント収益・セグメント利益ともに増加しました。

この結果、当中間連結会計期間における証券業務（欧州）の純営業収益は317億32百万円（前年度中間期比148.0%）、セグメント利益は79億97百万円（同760.2%）となりました。

なお、新型コロナウイルスの影響は、上記の主要な収益・費用の概況に記載した内容のほかにも広範囲に及び、その影響を定量的に示すことは困難ですが、主にボラティリティ上昇等による収益機会などの増減として現れています。

「証券業務（米州）」

米州では、インベストメントバンキング業務において、起債市場拡大を背景に債券引受が好調に推移しました。また、グローバルマーケット業務においても、コロナ禍による高ボラティリティ環境や流動性需要拡大を背景にレポビジネスが好調だったことから、セグメント収益・セグメント利益ともに増加しました。

この結果、当中間連結会計期間における証券業務（米州）の純営業収益は487億69百万円（前年度中間期比165.1%）、セグメント利益は135億89百万円（同570.4%）となりました。

なお、新型コロナウイルスの影響は、上記の主要な収益・費用の概況に記載した内容のほかにも広範囲に及び、その影響を定量的に示すことは困難ですが、主にボラティリティ上昇等による収益機会などの増減として現れています。

「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減少等により、セグメント利益は減少しました。

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143億50百万円（前年度中間期比83.0%）、セグメント利益は137億41百万円（同54.5%）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。

(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31兆7,415億57百万円（前年度末比1,245億93百万円減）となりました。内訳は流動資産が31兆1,232億42百万円（同1,151億4百万円減）であり、このうちトレーディング商品が1兆1,516億62百万円（同2兆2,818億31百万円増）、有価証券担保貸付金が1兆6,816億44百万円（同1兆5,596億22百万円減）となっております。固定資産は6,183億15百万円（同94億89百万円減）となっております。

負債合計は、30兆8,096億19百万円（同1,125億68百万円減）となりました。内訳は流動負債が29兆1,813億36百万円（同532億50百万円増）であり、このうちトレーディング商品が1兆9,237億98百万円（同1,585億42百万円増）、有価証券担保借入金が10兆758億18百万円（同1,584億78百万円減）となっております。固定負債は1兆6,239億15百万円（同1,659億16百万円減）となっております。

純資産合計は9,319億37百万円（同120億25百万円減）となりました。うち、利益剰余金は配当金支払いによる79億15百万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148億29百万円の増加の結果、1,980億79百万円（同69億14百万円増）となっております。また、為替換算調整勘定は471億99百万円（同187億82百万円減）となっております。

(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、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減少による収入、約定見返勘定の差引残高の減少による収入および社債の発行による収入等があったものの、トレーディング商品の差引残高の増加による支出、短期借入金の減少による支出、社債の償還による支出および有価証券の取得による支出等により、前年度末比3,235億75百万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1兆8,596億56百万円（前年度中間期末比123.7%）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増加は、6,600億60百万円（前年度中間期比193.6%）となりました。これは主に、トレーディング商品の差引残高の増加による支出2兆1,915億80百万円があったものの、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減少による収入1兆3,879億63百万円および約定見返勘定の差引残高の減少による収入1兆3,155億17百万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、263億69百万円（前年度中間期比26.8%）となりました。これは主に、貸付金の減少による収入711億69百万円、投資有価証券の売却及び償還による収入576億34百万円および有価証券の売却及び償還による収入449億78百万円があったものの、有価証券の取得による支出1,266億19百万円および投資有価証券の取得による支出605億54百万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減少は、9,537億13百万円（前年度中間期比134.4%）となりました。これは主に、社債の発行による収入2,171億27百万円および長期借入れによる収入1,139億42百万円があったものの、短期借入金の減少による支出9,124億68百万円、社債の償還による支出2,602億94百万円、長期借入金の返済による支出526億22百万円およびコマーシャル・ペーパーの減少による支出473億98百万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、加えて新型コロナウイルスの影響等による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。

資金調達の基本方針

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。

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。また新型コロナウイルスの影響等による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、そのような環境が一定期間以上継続した場合でも資金流動性が枯渇しないだけの資金量を確保しております。

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。

資金調達の方法及び状況

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ます。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、仮に資金流動性の危機事象が発生した場合でも業務を継続するための十分な資金を確保しております。

資金需要の動向

当社グループが投資・金融サービス業を営むうえでは、トレーディング業務等における商品在庫確保などのために資金需要が発生しますが、資金需要の総量はマーケット環境や顧客動向によって変動します。そのため、当社グループではグループ主要各社共通の基本方針に従い、発生する無担保資金需要の総額を各社の調達力の範囲内に抑えることを目的に、無担保資金需要の総量枠を各社にて設定しております。また、当社および各子会社にて資金需要の状況を日次でモニタリングし、資金需要の総量に見合った資金調達を行っております。

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】

前連結会計年度末において、計画中または実施中の重要な設備の新設、除却等はありません。また、当中間連結会計期間において、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) (2020年9月30日) | 提出日現在発行数(株) (2020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) |
|--------------------------|-----------------------|----------------------|----------------|---------------|------------------------|----------------------|
| 2020年4月1日～ 2020年9月30日 | - | 736,985,496 | - | 75,518,843 | - | 426,944,245 |

(5)【大株主の状況】

2020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】

2020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】

2020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 【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。

なお、当中間連結会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」(令和2年3月6日内閣府令第9号。以下「改正府令」という。)附則第6条第1項ただし書きにより、改正後の中間連結財務諸表規則に基づいて作成しております。

(2) 当社の中間財務諸表は、「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。

なお、当中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、中間連結会計期間(2020年4月1日から2020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(2020年4月1日から2020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 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|-------------|-------------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 2,185,650 | 1,862,077 |
| 預託金 | 858,165 | 917,059 |
| トレーディング商品 | ² 12,869,831 | ² 15,151,662 |
| 商品有価証券等 | 4,727,433 | 7,201,019 |
| デリバティブ取引 | 8,142,397 | 7,950,643 |
| 約定見返勘定 | 552,675 | - |
| 信用取引資産 | 214,735 | 248,276 |
| 信用取引貸付金 | 138,556 | 174,237 |
| 信用取引借証券担保金 | 76,178 | 74,038 |
| 有価証券担保貸付金 | 13,241,266 | 11,681,644 |
| 借入有価証券担保金 | 2,616,190 | 2,504,882 |
| 現先取引貸付金 | 10,625,076 | 9,176,761 |
| 短期差入保証金 | 1,016,119 | 989,876 |
| 短期貸付金 | 122,620 | 52,977 |
| 有価証券 | 5,618 | 84,383 |
| 未収還付法人税等 | 5,459 | 3,053 |
| その他の流動資産 | 166,203 | 132,230 |
| 流動資産計 | 31,238,347 | 31,123,242 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | ¹ 32,088 | ¹ 30,208 |
| 建物 | 16,324 | 15,674 |
| 器具備品 | 9,482 | 8,670 |
| 建設仮勘定 | 75 | 2 |
| その他 | 6,206 | 5,860 |
| 無形固定資産 | 106,827 | 103,424 |
| ソフトウェア | 77,423 | 75,064 |
| その他 | 29,404 | 28,359 |
| 投資その他の資産 | 488,887 | 484,681 |
| 投資有価証券 | 435,616 | 443,754 |
| 長期貸付金 | ² 9,800 | ² 3,180 |
| 退職給付に係る資産 | 7,281 | 5,100 |
| 繰延税金資産 | 13,296 | 11,680 |
| その他 | 24,091 | 22,796 |
| 貸倒引当金 | 1,199 | 1,830 |
| 固定資産計 | 627,804 | 618,315 |
| 資産合計 | 31,866,151 | 31,741,557 |

(単位：百万円)

| | 前連結会計年度 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|--------------------|-------------------------|---------------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| トレーディング商品 | 11,765,256 | 11,923,798 |
| 商品有価証券等 | 4,002,899 | 4,278,618 |
| デリバティブ取引 | 7,762,356 | 7,645,180 |
| 約定見返勘定 | - | 763,426 |
| 信用取引負債 | 179,207 | 172,427 |
| 信用取引借入金 | 12,591 | 15,429 |
| 信用取引貸証券受入金 | 166,616 | 156,998 |
| 有価証券担保借入金 | 10,234,296 | 10,075,818 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 986,685 | 808,249 |
| 現先取引借入金 | 9,247,611 | 9,267,569 |
| 預り金 | 633,930 | 688,359 |
| 受入保証金 | 1,802,023 | 1,859,464 |
| 短期借入金 | 2 3,259,551 | 2 2,344,145 |
| 1年内償還予定の社債 | 276,710 | 354,024 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | 2 115,501 | 2 215,351 |
| コマーシャル・ペーパー | 729,871 | 672,892 |
| 未払法人税等 | 7,417 | 4,987 |
| 賞与引当金 | 22,111 | 17,421 |
| 偶発損失引当金 | 680 | 666 |
| 資産除去債務 | 103 | - |
| その他の流動負債 | 101,423 | 88,553 |
| 流動負債計 | 29,128,086 | 29,181,336 |
| 固定負債 | | |
| 社債 | 1,017,479 | 884,365 |
| 長期借入金 | 2 753,034 | 720,223 |
| 繰延税金負債 | 116 | 217 |
| 退職給付に係る負債 | 2,641 | 2,590 |
| 役員退職慰労引当金 | 93 | 33 |
| 資産除去債務 | 7,787 | 8,214 |
| その他の固定負債 | 8,678 | 8,270 |
| 固定負債計 | 1,789,832 | 1,623,915 |
| 特別法上の準備金 | | |
| 金融商品取引責任準備金 | 4 4,269 | 4 4,367 |
| 特別法上の準備金計 | 4,269 | 4,367 |
| 負債合計 | 30,922,188 | 30,809,619 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 75,518 | 75,518 |
| 資本剰余金 | 434,441 | 434,441 |
| 利益剰余金 | 191,165 | 198,079 |
| 株主資本合計 | 701,126 | 708,040 |
| その他の包括利益累計額 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 571 | 675 |
| 繰延ヘッジ損益 | 20 | 28 |
| 為替換算調整勘定 | 28,417 | 47,199 |
| 退職給付に係る調整累計額 | 566 | 553 |
| その他の包括利益累計額合計 | 27,259 | 45,942 |
| 非支配株主持分 | 270,096 | 269,840 |
| 純資産合計 | 943,963 | 931,937 |
| 負債・純資産合計 | 31,866,151 | 31,741,557 |

【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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|--------------------------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受入手数料 | 68,129 | 62,840 |
| 委託手数料 | 12,052 | 13,232 |
| 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘 等の手数料 | 15,979 | 12,398 |
| 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料 | 8,145 | 7,626 |
| その他の受入手数料 | 31,951 | 29,582 |
| トレーディング損益 | 65,669 | 68,955 |
| 金融収益 | 70,852 | 59,919 |
| その他の営業収益 | 4 | 4 |
| 営業収益計 | 204,655 | 191,720 |
| 金融費用 | 63,021 | 43,193 |
| 純営業収益 | 141,633 | 148,526 |
| 販売費・一般管理費 | | |
| 取引関係費 | 36,984 | 26,897 |
| 人件費 | 1 53,727 | 1 53,000 |
| 不動産関係費 | 12,279 | 11,632 |
| 事務費 | 16,141 | 15,916 |
| 減価償却費 | 15,160 | 15,324 |
| 租税公課 | 4,423 | 3,859 |
| その他 | 3,786 | 4,236 |
| 販売費・一般管理費計 | 142,503 | 130,866 |
| 営業利益又は営業損失() | 869 | 17,659 |
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 1,399 | 1,872 |
| 持分法による投資利益 | 8,148 | 2,985 |
| 投資有価証券売却益 | 109 | 2,546 |
| その他 | 1,331 | 1,298 |
| 営業外収益計 | 10,989 | 8,702 |
| 営業外費用 | | |
| 固定資産除却損 | 52 | 61 |
| 金銭の信託運用損 | - | 444 |
| その他 | 54 | 110 |
| 営業外費用計 | 107 | 616 |
| 経常利益 | 10,012 | 25,746 |

(単位：百万円)

| | 前中間連結会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|--------------------|--|--|
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 471 | 6 |
| 金融商品取引責任準備金戻入 | 1 | - |
| その他 | 59 | - |
| 特別利益計 | 533 | 6 |
| 特別損失 | | |
| 投資有価証券評価損 | 2 37 | 2 15 |
| 固定資産売却損 | 3 8 | - |
| 減損損失 | 4 336 | 4 277 |
| 金融商品取引責任準備金繰入れ | - | 97 |
| その他 | 228 | 79 |
| 特別損失計 | 610 | 469 |
| 税金等調整前中間純利益 | 9,934 | 25,282 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,007 | 5,752 |
| 法人税等調整額 | 418 | 1,553 |
| 法人税等合計 | 2,425 | 7,305 |
| 中間純利益 | 7,509 | 17,977 |
| 非支配株主に帰属する中間純利益 | 3,322 | 3,147 |
| 親会社株主に帰属する中間純利益 | 4,186 | 14,829 |

【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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|----------------|--|--|
| 中間純利益 | 7,509 | 17,977 |
| その他の包括利益 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 537 | 268 |
| 繰延ヘッジ損益 | 16 | 7 |
| 為替換算調整勘定 | 5,778 | 18,782 |
| 退職給付に係る調整額 | 20 | 21 |
| その他の包括利益合計 | 6,279 | 18,527 |
| 中間包括利益 | 1,229 | 550 |
| (内訳) | | |
| 親会社株主に係る中間包括利益 | 1,907 | 3,853 |
| 非支配株主に係る中間包括利益 | 3,137 | 3,303 |

【中間連結株主資本等変動計算書】

前中間連結会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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 | 188,309 | 702,636 |
| 会計方針の変更による 累積的影響額 | | | 311 | 311 |
| 会計方針の変更を反映し た当期首残高 | 75,518 | 438,808 | 187,997 | 702,324 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 7,959 | 7,959 |
| 親会社株主に帰属する 中間純利益 | | | 4,186 | 4,186 |
| 子会社株式の追加取得 | | 0 | | 0 |
| 子会社株式の一部売却 | | 0 | | 0 |
| 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 | - | 0 | 3,772 | 3,773 |
| 当中間期末残高 | 75,518 | 438,808 | 184,224 | 698,551 |

| | 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 | 1,484 | 7 | 33,532 | 1,258 | 30,781 | 27 | 276,860 | 948,743 |
| 会計方針の変更による 累積的影響額 | | | | | | | | 311 |
| 会計方針の変更を反映し た当期首残高 | 1,484 | 7 | 33,532 | 1,258 | 30,781 | 27 | 276,860 | 948,431 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | | 7,959 |
| 親会社株主に帰属する 中間純利益 | | | | | | | | 4,186 |
| 子会社株式の追加取得 | | | | | | | | 0 |
| 子会社株式の一部売却 | | | | | | | | 0 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額） | 345 | 16 | 5,778 | 12 | 6,094 | 27 | 2,899 | 9,021 |
| 当中間期変動額合計 | 345 | 16 | 5,778 | 12 | 6,094 | 27 | 2,899 | 12,794 |
| 当中間期末残高 | 1,138 | 24 | 39,310 | 1,271 | 36,875 | - | 273,961 | 935,637 |

当中間連結会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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 | 434,441 | 191,165 | 701,126 |
| 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 | 434,441 | 191,165 | 701,126 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 7,915 | 7,915 |
| 親会社株主に帰属する 中間純利益 | | | 14,829 | 14,829 |
| 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 | - | - | 6,914 | 6,914 |
| 当中間期末残高 | 75,518 | 434,441 | 198,079 | 708,040 |

| | 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 | 571 | 20 | 28,417 | 566 | 27,259 | - | 270,096 | 943,963 |
| 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 | 571 | 20 | 28,417 | 566 | 27,259 | - | 270,096 | 943,963 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | | 7,915 |
| 親会社株主に帰属する 中間純利益 | | | | | | | | 14,829 |
| 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） | 103 | 7 | 18,782 | 12 | 18,683 | - | 256 | 18,939 |
| 当中間期変動額合計 | 103 | 7 | 18,782 | 12 | 18,683 | - | 256 | 12,025 |
| 当中間期末残高 | 675 | 28 | 47,199 | 553 | 45,942 | - | 269,840 | 931,937 |

【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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020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 | 9,934 | 25,282 |
| 減価償却費 | 15,160 | 15,324 |
| のれん償却額 | 1,038 | 1,038 |
| 貸倒引当金の増減額(は減少) | 48 | 630 |
| 金融商品取引責任準備金の増減額(は減少) | 1 | 97 |
| 退職給付に係る負債の増減額(は減少) | 106 | 51 |
| 受取利息及び受取配当金 | 72,374 | 61,865 |
| 支払利息 | 63,021 | 43,193 |
| 持分法による投資損益(は益) | 8,148 | 2,985 |
| 投資有価証券売却損益(は益) | 581 | 2,517 |
| 投資有価証券評価損益(は益) | 26 | 20 |
| 固定資産売却損益(は益) | 8 | - |
| 減損損失 | 336 | 277 |
| 顧客分別金信託の増減額(は増加) | 23,209 | 58,972 |
| トレーディング商品の増減額 | 111,198 | 2,191,580 |
| 約定見返勘定の増減額(は増加) | 499,230 | 1,315,517 |
| 信用取引資産及び信用取引負債の増減額 | 23,481 | 40,321 |
| 有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額 | 555,916 | 1,387,963 |
| 立替金及び預り金の増減額 | 8,961 | 55,495 |
| 短期差入保証金の増減額(は増加) | 36,901 | 682 |
| 受入保証金の増減額(は減少) | 38,843 | 137,841 |
| その他 | 126,341 | 9,380 |
| 小計 | 309,996 | 634,453 |
| 利息及び配当金の受取額 | 90,340 | 73,236 |
| 利息の支払額 | 62,520 | 45,169 |
| 法人税等の支払額 | 10,406 | 12,109 |
| 法人税等の還付額 | 13,576 | 9,648 |
| 営業活動によるキャッシュ・フロー | 340,986 | 660,060 |

(単位：百万円)

| | 前中間連結会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020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 | 1,553 | 1,497 |
| 定期預金の払戻による収入 | 4,544 | 1,490 |
| 有価証券の取得による支出 | 7,508 | 126,619 |
| 有価証券の売却及び償還による収入 | 4,831 | 44,978 |
| 投資有価証券の取得による支出 | 95,267 | 60,554 |
| 投資有価証券の売却及び償還による収入 | 19,396 | 57,634 |
| 有形固定資産の取得による支出 | 2,250 | 987 |
| 有形固定資産の売却による収入 | 0 | - |
| 有形固定資産の除却による支出 | 51 | 215 |
| 無形固定資産の取得による支出 | 13,442 | 11,784 |
| 貸付金の増減額（は増加） | 7,269 | 71,169 |
| その他 | - | 14 |
| 投資活動によるキャッシュ・フロー | 98,570 | 26,369 |
| 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） | 493,994 | 912,468 |
| コマーシャル・ペーパーの増減額（は減少） | 101,571 | 47,398 |
| 長期借入れによる収入 | 226,413 | 113,942 |
| 長期借入金の返済による支出 | 322,577 | 52,622 |
| 社債の発行による収入 | 234,150 | 217,127 |
| 社債の償還による支出 | 236,271 | 260,294 |
| 配当金の支払額 | 7,959 | 7,915 |
| 非支配株主への分配金支払額 | 6,974 | 3,559 |
| 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 | 0 | - |
| 連結の範囲の変更を伴わない子会社株式の売却による収入 | 0 | - |
| その他 | 580 | 524 |
| 財務活動によるキャッシュ・フロー | 709,368 | 953,713 |
| 現金及び現金同等物に係る換算差額 | 1,987 | 3,552 |
| 現金及び現金同等物の増減額（は減少） | 468,939 | 323,575 |
| 現金及び現金同等物の期首残高 | 1,972,693 | 2,183,232 |
| 現金及び現金同等物の中間期末残高 | 1,503,754 | 1,859,656 |

【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

連結子会社数 10社

連結子会社名

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
auカブコム証券株式会社
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
MUF Gセキュリティーズ EMEA
MUF Gセキュリティーズ(ヨーロッパ)
MUF Gセキュリティーズ(カナダ)
MUF Gセキュリティーズアジア
MUF G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

(除外)

三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社他1社

上記は、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社との吸収合併等に伴い、連結の範囲から除外しております。

2. 持分法の適用に関する事項

持分法適用関連会社数 1社

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

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 6社

9月末日 4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6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．市場価格のない株式等以外のもの

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．市場価格のない株式等

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。

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未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等を適用しております。

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（投資有価証券、在外子会社に対する投資への持分）

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、長期借入金

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・投資有価証券および長期借入金の金利変動リスクを回避する目的で金利スワップ取引を行っており、ヘッジ対象の識別は個別契約ごとに行っております。

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。

連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社および一部の国内連結子会社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行およびグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「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）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産および繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(表示方法の変更)

(中間連結損益計算書)

従来、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」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1,441百万円は、「投資有価証券売却益」109百万円、「その他」1,331百万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 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|---------|-------------------------|---------------------------|
| 減価償却累計額 | 34,845百万円 | 36,838百万円 |

2. 担保に供している資産

前連結会計年度(2020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 | 361,550 | 490,808 | 490,808 |
| 共通担保資金供給オペレーション | 361,550 | 490,808 | 490,808 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | 2,038 | 2,038 | 2,038 |
| 長期借入金 | 563 | 563 | 563 |
| 計 | 364,153 | 493,411 | 493,411 |

(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)の担保として現先取引で買い付けた有価証券244,585百万円、消費貸借契約により借り入れた有価証券163,543百万円、およびその他担保として受け入れた有価証券45,625百万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9,794百万円を担保に供しております。

当中間連結会計期間(2020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 | 215,148 | 297,408 | 297,408 |
| 共通担保資金供給オペレーション | 200,000 | 282,260 | 282,260 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | 54,342 | 54,342 | 54,342 |
| 計 | 269,491 | 351,751 | 351,751 |

(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)の担保として現先取引で買い付けた有価証券194,964百万円、消費貸借契約により借り入れた有価証券16,164百万円、およびその他担保として受け入れた有価証券33,444百万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3,174百万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 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|--------------------|-------------------------|---------------------------|
| 信用取引貸証券 | 156,923百万円 | 158,680百万円 |
| 信用取引借入金の本担保証券 | 12,136 | 15,202 |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 3,613,770 | 3,061,809 |
| 現先取引で売却した有価証券 | 10,679,251 | 10,374,877 |
| その他担保として差し入れた有価証券 | 1,378,201 | 1,226,194 |

(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 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|--------------------|-------------------------|---------------------------|
| 信用取引貸付金の本担保証券 | 113,990百万円 | 167,568百万円 |
| 信用取引借証券 | 69,695 | 69,575 |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 5,999,076 | 5,179,120 |
| 現先取引で買い付けた有価証券 | 11,500,808 | 10,159,668 |
| その他担保として受け入れた有価証券 | 443,459 | 495,671 |

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 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|--------------|-------------------------|---------------------------|
| 貸出コミットメントの総額 | 197,774百万円 | 131,478百万円 |
| 貸出実行残高 | 91,465 | 73,202 |
| 差引額 | 106,309 | 58,276 |

また、前連結会計年度末における貸出コミットメントの総額のうち、15,236百万円(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。なお、当中間連結会計期間末において、流動性補完枠の提供はありません。

(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6行(前連結会計年度末7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 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|---------|-------------------------|---------------------------|
| 当座貸越極度額 | 268,696百万円 | 213,192百万円 |
| 借入実行残高 | 41,000 | 15,000 |
| 差引額 | 227,696 | 198,192 |

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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|----------|--|--|
| 賞与引当金繰入額 | 11,188百万円 | 11,517百万円 |
| 退職給付費用 | 2,966 | 4,004 |

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. 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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|------|--|--|
| 器具備品 | 8百万円 | - 百万円 |

4. 減損損失

前中間連結会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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 2020年4月1日 至 2020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 2019年4月1日 至 2019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

| (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 |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2019年5月15日 取締役会 | 普通株式 | 7,959 | 10.80 | 2019年3月31日 | 2019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 |
|--------------------|-------|-----------------|-------|-----------------|------------|------------|
| 2019年12月2日 取締役会 | 普通株式 | 7,767 | 利益剰余金 | 10.54 | 2019年9月30日 | 2019年12月3日 |

当中間連結会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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

| （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 |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2020年5月15日 取締役会 | 普通株式 | 7,915 | 10.74 | 2020年3月31日 | 2020年5月18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 |
|---------------------|-------|-----------------|-------|-----------------|------------|------------|
| 2020年11月30日 取締役会 | 普通株式 | 7,001 | 利益剰余金 | 9.50 | 2020年9月30日 | 2020年12月1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 2019年4月1日 至 2019年9月30日） | 当中間連結会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日） |
|------------------|--|--|
| 現金・預金 | 1,505,891百万円 | 1,862,077百万円 |
| 預入期間が3ヵ月を超える定期預金 | 2,136 | 2,421 |
| 現金及び現金同等物の中間期末残高 | 1,503,754 | 1,859,656 |

(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)

重要性がないため、リース投資資産の内訳およびリース投資資産に係るリース料債権部分の中間連結決算日後(連結決算日後)の回収予定額の記載を省略しております。

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

(借主側)

(単位：百万円)

| | 前連結会計年度 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|-----|-------------------------|---------------------------|
| 1年内 | 7,840 | 7,371 |
| 1年超 | 30,116 | 26,294 |
| 合計 | 37,957 | 33,666 |

(貸主側)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 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。

前連結会計年度(2020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) 商品有価証券等 | 4,727,433 | 4,727,433 | - |
| (2) 有価証券および投資有価証券(*2) | 191,870 | 191,870 | - |
| 資 産 計 | 4,919,304 | 4,919,304 | - |
| (1) 商品有価証券等 | 4,002,899 | 4,002,899 | - |
| (2) 1年内返済予定の長期借入金 | 115,501 | 115,606 | 105 |
| (3) 1年内償還予定の社債 | 276,710 | 276,761 | 51 |
| (4) 社債 | 1,017,479 | 1,017,479 | - |
| (5) 長期借入金 | 753,034 | 745,404 | 7,630 |
| 負 債 計 | 6,165,626 | 6,158,151 | 7,474 |
| デリバティブ取引(*3) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | 380,184 | 380,184 | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | (144) | (144) | - |
| デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計 | 380,040 | 380,040 | - |

(*1) 現金は注記を省略しており、預金、預託金、約定見返勘定、信用取引資産、信用取引負債、有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金、預り金、短期差入保証金、受入保証金、短期貸付金、短期借入金、コマーシャル・ペーパー、長期貸付金は時価が帳簿価額に近似することから、記載を省略しております。

(*2) 市場価格のない株式等は「(2) 有価証券および投資有価証券」には含まれておりません。当該金融商品の連結貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

| 区分 | 前連結会計年度(百万円) |
|--------|--------------|
| 非上場株式等 | 249,283 |
| 組合出資金 | 174 |

(*3) 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。

(*4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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おります。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る場合、当該価額が異なることもあります。また、「(注1)有価証券およびデリバティブ取引に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクではありません。

当中間連結会計期間（2020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) 商品有価証券等 | 7,201,019 | 7,201,019 | - |
| (2) 有価証券および投資有価証券(*2) | 281,311 | 281,311 | - |
| 資 産 計 | 7,482,331 | 7,482,331 | - |
| (1) 商品有価証券等 | 4,278,618 | 4,278,618 | - |
| (2) 1年内返済予定の長期借入金 | 215,351 | 215,352 | 0 |
| (3) 1年内償還予定の社債 | 354,024 | 354,052 | 27 |
| (4) 社債 | 884,365 | 884,365 | - |
| (5) 長期借入金 | 720,223 | 725,926 | 5,703 |
| 負 債 計 | 6,452,583 | 6,458,315 | 5,731 |
| デリバティブ取引(*3) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | 305,864 | 305,864 | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | (401) | (401) | - |
| デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計 | 305,462 | 305,462 | - |

(*1) 現金は注記を省略しており、預金、預託金、約定見返勘定、信用取引資産、信用取引負債、有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金、預り金、短期差入保証金、受入保証金、短期貸付金、短期借入金、コマーシャル・ペーパー、長期貸付金は時価が帳簿価額に近似することから、記載を省略しております。

(*2) 市場価格のない株式等は「(2) 有価証券および投資有価証券」には含まれておりません。当該金融商品の中間連結貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

| 区分 | 当中間連結会計期間（百万円） |
|--------|----------------|
| 非上場株式等 | 246,721 |
| 組合出資金 | 197 |

(*3) 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。

(*4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、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おります。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る場合、当該価額が異なることもあります。また、「(注1) 有価証券およびデリバティブ取引に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクではありません。

(注1) 有価証券およびデリバティブ取引に関する事項

(1) 有価証券および投資有価証券

保有目的ごとの有価証券に関する注記事項は以下のとおりであります。

その他有価証券

前連結会計年度(2020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 | (a)株式 | 1,633 | 616 | 1,016 |
| | (b)債券 | 132,130 | 129,772 | 2,358 |
| | (c)その他 | - | - | - |
| | 小計 | 133,763 | 130,389 | 3,374 |
| 連結貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないも の | (a)株式 | - | - | - |
| | (b)債券 | 58,106 | 58,349 | 243 |
| | (c)その他 | - | - | - |
| | 小計 | 58,106 | 58,349 | 243 |
| 合計 | | 191,870 | 188,739 | 3,131 |

(*) 市場価格のない株式等(非上場株式等(連結貸借対照表計上額 1,707百万円)および組合出資金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 174百万円))は、上表の「その他有価証券」には含まれておりません。

当中間連結会計期間(2020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 | (a)株式 | 2,168 | 612 | 1,555 |
| | (b)債券 | 157,132 | 150,961 | 6,171 |
| | (c)その他 | - | - | - |
| | 小計 | 159,301 | 151,574 | 7,726 |
| 中間連結貸借対 照表計上額が取 得原価を超えな いもの | (a)株式 | - | - | - |
| | (b)債券 | 122,010 | 122,394 | 384 |
| | (c)その他 | - | - | - |
| | 小計 | 122,010 | 122,394 | 384 |
| 合計 | | 281,311 | 273,969 | 7,342 |

(*) 市場価格のない株式等(非上場株式等(中間連結貸借対照表計上額 1,691百万円)および組合出資金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 197百万円))は、上表の「その他有価証券」には含まれておりません。

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37百万円(その他有価証券の株式37百万円)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15百万円(その他有価証券の株式15百万円)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、市場価格のない株式等以外のもの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、また市場価格のない株式等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。

(2) デリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないもの

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決算日(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(2020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 | 3,927,839 | 2,772,229 | 692 | 692 |
| | | 買建 | 1,669,147 | 432,084 | 369 | 369 |
| | 金利オプション | 売建 | 2,557,767 | 110,285 | 3,304 | 281 |
| | | 買建 | 1,517,084 | 261,673 | 1,579 | 746 |
| 市場取引以外の取引 | 金利先渡契約 | 売建 | 61,396,958 | 3,463,051 | 100 | 100 |
| | | 買建 | 61,264,935 | 4,730,247 | 508 | 508 |
| | 金利スワップ | 受取固定・ 支払変動 | 330,709,200 | 268,295,311 | 5,630,114 | 5,630,114 |
| | | 受取変動・ 支払固定 | 329,376,133 | 266,909,313 | 5,365,854 | 5,365,854 |
| | | 受取変動・ 支払変動 | 77,715,137 | 65,462,583 | 5,590 | 5,590 |
| | | 受取固定・ 支払固定 | 257,931 | 192,754 | 8,232 | 8,232 |
| | 金利スワップ ション | 売建 | 27,934,240 | 16,350,576 | 400,387 | 108,894 |
| | | 買建 | 25,760,293 | 14,053,986 | 293,380 | 97,977 |
| | その他 | 売建 | 3,747,820 | 3,034,450 | 32,266 | 5,190 |
| | | 買建 | 3,591,998 | 3,051,104 | 40,115 | 1,694 |
| 合計 | | | - | - | 165,732 | 251,738 |

当中間連結会計期間(2020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 | 5,154,732 | 3,102,125 | 2,238 | 2,238 |
| | | 買建 | 1,093,633 | 922,805 | 1,414 | 1,414 |
| | 金利オプション | 売建 | 1,133,254 | 113,434 | 4,822 | 4,007 |
| | | 買建 | 1,674,815 | 391,454 | 4,167 | 2,210 |
| 市場取引以外の取引 | 金利先渡契約 | 売建 | 77,068,555 | 7,018,282 | 737 | 737 |
| | | 買建 | 77,196,510 | 7,637,371 | 1,270 | 1,270 |
| | 金利スワップ | 受取固定・ 支払変動 | 322,615,402 | 249,554,626 | 5,309,924 | 5,309,924 |
| | | 受取変動・ 支払固定 | 316,046,541 | 247,464,032 | 5,070,809 | 5,070,809 |
| | | 受取変動・ 支払変動 | 79,838,578 | 65,616,078 | 3,085 | 3,085 |
| | | 受取固定・ 支払固定 | 252,070 | 162,262 | 5,186 | 5,186 |
| | 金利スワップ ション | 売建 | 27,607,554 | 17,793,769 | 671,064 | 442,236 |
| | | 買建 | 24,560,373 | 14,440,936 | 598,175 | 462,183 |
| | その他 | 売建 | 3,982,067 | 3,577,240 | 35,921 | 7,767 |
| | | 買建 | 3,892,854 | 3,316,158 | 43,008 | 3,834 |
| 合計 | | | - | - | 173,401 | 254,075 |

(b) 通貨関連取引

前連結会計年度(2020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 | 43,250,735 | 34,233,576 | 69,521 | 69,521 | |
| | 為替予約 | 5,459,990 | 552,259 | 15,150 | 15,150 | |
| | 通貨オプション | 売建 | 2,516,542 | 2,006,337 | 7,494 | 29,313 |
| | | 買建 | 1,681,892 | 1,309,124 | 8,712 | 14,006 |
| 合計 | | - | - | 100,877 | 99,979 | |

当中間連結会計期間(2020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 | 42,363,867 | 33,408,094 | 70,934 | 70,934 | |
| | 為替予約 | 5,168,209 | 681,119 | 19,150 | 19,150 | |
| | 通貨オプション | 売建 | 2,442,096 | 1,861,137 | 19,358 | 40,583 |
| | | 買建 | 1,610,574 | 1,257,611 | 1,539 | 19,533 |
| 合計 | | - | - | 72,681 | 72,834 | |

(c) 株式関連取引

前連結会計年度(2020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 | 484,713 | 23,303 | 2,299 | 2,299 |
| | | 買建 | 793,400 | 25,989 | 29,717 | 29,717 |
| | 株式指数 オプション | 売建 | 1,268,020 | 493,448 | 97,324 | 10,355 |
| | | 買建 | 883,291 | 304,209 | 67,613 | 12,378 |
| 市場取引以外の 取引 | 有価証券店頭 オプション | 売建 | 373,087 | 134,350 | 59,402 | 38,847 |
| | | 買建 | 569,309 | 446,808 | 59,582 | 51,974 |
| | 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 | 367,403 | 156,990 | 20,219 | 20,219 |
| | | 金利受取・ 株価指数変 化率支払 | 2,404,404 | 483,443 | 120,735 | 120,735 |
| | 有価証券店頭 指数等先渡取 引 | 売建 | 1,119 | - | 20 | 20 |
| | | 買建 | 45,281 | 4,154 | 10,156 | 10,156 |
| 合計 | | | - | - | 88,266 | 132,948 |

当中間連結会計期間(2020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 | 168,744 | 20,821 | 3,645 | 3,645 |
| | | 買建 | 326,721 | 43,020 | 9,417 | 9,417 |
| | 株式指数 オプション | 売建 | 1,069,050 | 502,002 | 87,809 | 2,816 |
| | | 買建 | 698,228 | 339,285 | 50,577 | 3,229 |
| 市場取引以外の 取引 | 有価証券店頭 オプション | 売建 | 378,179 | 138,759 | 68,131 | 47,540 |
| | | 買建 | 667,908 | 428,045 | 79,814 | 71,159 |
| | 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 | 519,920 | 133,370 | 6,264 | 6,264 |
| | | 金利受取・ 株価指数変 化率支払 | 2,063,339 | 367,796 | 61,613 | 61,613 |
| | 有価証券店頭 指数等先渡取 引 | 売建 | - | - | - | - |
| | | 買建 | 71,702 | 2,508 | 815 | 815 |
| 合計 | | | - | - | 36,386 | 85,968 |

(d) 債券関連取引

前連結会計年度(2020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 | 149,753 | - | 192 | 192 |
| | | 買建 | 332,150 | - | 344 | 344 |
| | 債券先物 オプション | 売建 | 65,290 | - | 198 | 33 |
| | | 買建 | 111,474 | - | 622 | 138 |
| 市場取引以外の取引 | 債券店頭 オプション | 売建 | 296,960 | - | 1,519 | 738 |
| | | 買建 | 296,960 | - | 1,420 | 838 |
| | 債券店頭 スワップ | 受取固定・ 支払変動 | - | - | - | - |
| | | 受取変動・ 支払固定 | - | - | - | - |
| | | 受取変動・ 支払変動 | 350,472 | 350,472 | 7,962 | 7,962 |
| | | 受取固定・ 支払固定 | 6,700 | 6,700 | 955 | 955 |
| 合計 | | | - | - | 6,530 | 7,060 |

当中間連結会計期間(2020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 | 613,022 | - | 315 | 315 |
| | | 買建 | 101,810 | - | 73 | 73 |
| | 債券先物 オプション | 売建 | 129,844 | - | 387 | 151 |
| | | 買建 | 97,657 | - | 205 | 11 |
| 市場取引以外の取引 | 債券店頭 オプション | 売建 | 207,697 | - | 373 | 162 |
| | | 買建 | 234,884 | - | 535 | 89 |
| | 債券店頭 スワップ | 受取固定・ 支払変動 | 7,000 | 7,000 | 1,127 | 1,127 |
| | | 受取変動・ 支払固定 | - | - | - | - |
| | | 受取変動・ 支払変動 | 343,377 | 343,377 | 14,777 | 14,777 |
| | | 受取固定・ 支払固定 | 6,700 | 6,700 | 856 | 856 |
| 合計 | | | - | - | 12,424 | 12,191 |

(e) 商品関連取引

前連結会計年度(2020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 | 58,858 | 58,858 | 26,347 | 26,347 |
| | | 金利受取・商品指数変化率支払 | 58,858 | 58,858 | 26,346 | 26,346 |
| | 商品オプション | 売建 | 99 | 99 | 65 | 65 |
| 合計 | | | - | - | 65 | 65 |

当中間連結会計期間(2020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 | 58,193 | 58,193 | 30,543 | 30,543 |
| | | 金利受取・商品指数変化率支払 | 58,193 | 58,193 | 30,543 | 30,543 |
| | 商品オプション | 売建 | 99 | 99 | 70 | 70 |
| 合計 | | | - | - | 71 | 71 |

(f) クレジットデリバティブ取引

前連結会計年度(2020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 | 3,603,059 | 3,162,501 | 69,201 | 69,201 |
| | | 買建 | 4,287,034 | 3,824,907 | 37,806 | 37,806 |
| | トータル・レート・オブ・リターン・スワップ | 買建 | 31,085 | 11,088 | 508 | 508 |
| 合計 | | | - | - | 31,903 | 31,903 |

当中間連結会計期間(2020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 | 4,026,113 | 3,515,883 | 42,978 | 42,978 |
| | | 買建 | 4,776,746 | 4,249,685 | 7,024 | 7,024 |
| | トータル・レート・オブ・リターン・スワップ | 買建 | 40,830 | 14,638 | 64 | 64 |
| 合計 | | | - | - | 35,889 | 35,889 |

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性および重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産または負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間連結（連結）貸借対照表価額とする金融資産および金融負債
前連結会計年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

| 区分 | 時価 | | | |
|-------------------|-----------|---------|--------|-----------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 商品有価証券等 | 3,806,755 | 915,515 | 5,162 | 4,727,433 |
| 有価証券および投資有価証券 | | | | |
| 株式 | 1,447 | 17 | 168 | 1,633 |
| 債券 | 122,339 | 67,897 | - | 190,237 |
| その他 | - | - | - | - |
| 資 産 計 | 3,930,542 | 983,431 | 5,330 | 4,919,304 |
| 商品有価証券等 | 3,963,020 | 39,878 | - | 4,002,899 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | - | 99,122 | - | 99,122 |
| 1年内償還予定の社債 | - | 58,867 | 2,170 | 61,037 |
| 社債 | - | 88,641 | 29,052 | 117,693 |
| 長期借入金 | - | 26,782 | - | 26,782 |
| 負 債 計 | 3,963,020 | 313,291 | 31,222 | 4,307,535 |
| デリバティブ取引(*) | | | | |
| 金利関連取引 | (1,402) | 157,178 | 9,828 | 165,603 |
| 通貨関連取引 | - | 96,007 | 4,855 | 100,862 |
| 株式関連取引 | (2,293) | 80,129 | 10,430 | 88,266 |
| 債券関連取引 | 575 | (8,062) | 955 | (6,530) |
| 商品関連取引 | - | - | (65) | (65) |
| クレジットデリバティブ取引 | - | 30,524 | 1,379 | 31,903 |
| デ リ バ テ ィ ブ 取 引 計 | (3,120) | 355,776 | 27,384 | 380,040 |

(*) 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（2020年9月30日）

（単位：百万円）

| 区分 | 時価 | | | |
|---------------|-----------|----------|--------|-----------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 商品有価証券等 | 6,308,485 | 885,971 | 6,563 | 7,201,019 |
| 有価証券および投資有価証券 | | | | |
| 株式 | 1,990 | 17 | 160 | 2,168 |
| 債券 | 189,462 | 89,680 | - | 279,143 |
| その他 | - | - | - | - |
| 資産計 | 6,499,938 | 975,669 | 6,723 | 7,482,331 |
| 商品有価証券等 | 4,244,450 | 34,167 | - | 4,278,618 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | - | 188,471 | - | 188,471 |
| 1年内償還予定の社債 | - | 33,843 | 1,865 | 35,709 |
| 社債 | - | 97,852 | 57,002 | 154,854 |
| 長期借入金 | - | 18,273 | - | 18,273 |
| 負債計 | 4,244,450 | 372,608 | 58,868 | 4,675,926 |
| デリバティブ取引(*) | | | | |
| 金利関連取引 | (1,478) | 161,186 | 13,682 | 173,390 |
| 通貨関連取引 | - | 67,596 | 4,695 | 72,291 |
| 株式関連取引 | (31,459) | 56,307 | 11,539 | 36,386 |
| 債券関連取引 | 207 | (14,615) | 1,983 | (12,424) |
| 商品関連取引 | - | - | (71) | (71) |
| クレジットデリバティブ取引 | - | 35,787 | 102 | 35,889 |
| デリバティブ取引計 | (32,731) | 306,262 | 31,931 | 305,462 |

(*) 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。

- (2) 時価をもって中間連結（連結）貸借対照表価額としない金融資産および金融負債
前連結会計年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

| 区分 | 時価 | | | |
|---------------|------|-----------|------|-----------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | - | 16,484 | - | 16,484 |
| 1年内償還予定の社債 | - | 215,724 | - | 215,724 |
| 社債 | - | 899,786 | - | 899,786 |
| 長期借入金 | - | 718,621 | - | 718,621 |
| 負債計 | - | 1,850,616 | - | 1,850,616 |

当中間連結会計期間（2020年9月30日）

（単位：百万円）

| 区分 | 時価 | | | |
|---------------|------|-----------|------|-----------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | - | 26,880 | - | 26,880 |
| 1年内償還予定の社債 | - | 318,343 | - | 318,343 |
| 社債 | - | 729,510 | - | 729,510 |
| 長期借入金 | - | 707,653 | - | 707,653 |
| 負債計 | - | 1,782,388 | - | 1,782,388 |

(注1) 時価の算定に用いた評価技法およびインプットの説明

商品有価証券等、有価証券および投資有価証券

活発な市場において相場価格が入手可能な場合には、無調整の相場価格を用いており、レベル1の時価に分類しております。国債および外国国債、市場価格のある株式等がこれに含まれます。

相場価格を用いるとしても活発な市場で取引されていない場合には、レベル2の時価に分類しております。一部の国債、地方債、社債、株式等がこれに含まれます。

相場価格が入手できない場合には、内部モデルを用いて算出した理論価格、類似した特性を有する有価証券の相場価格または独立した第三者から入手した相場価格を用いて時価を算定しております。

有価証券の流動性が低い場合や、時価の算定にあたり重要な観察できないインプットを用いている場合には、レベル3の時価に分類しております。

1年内返済予定の長期借入金、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限り、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、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。これらについては、レベル2の時価に分類しております。

1年内償還予定の社債、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。これらについては、レベル2の時価に分類しております。

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。算定にあたり観察可能なインプットを用いている場合には、レベル2の時価に分類し、重要な観察できないインプットを用いている場合には、レベル3の時価に分類しております。

デリバティブ取引

活発な市場における無調整の相場価格を用いて評価された上場デリバティブ取引については、レベル1の時価に分類しております。株価指数先物取引等がこれに含まれます。

デリバティブ取引の大部分である店頭デリバティブ取引については、評価技法を用いて時価を算定しております。デリバティブ取引の種類や契約条件によって、評価技法やインプットは異なります。デリバティブ取引の時価の算定に用いられる評価技法には、オプション・モデル、割引現在価値法等があります。インプットは、金利、為替レート等であり、これらの評価技法は市場で一般的に受け入れられており、その主要なインプットは一般に活発な市場で容易に観察可能なものであります。このような評価技法およびインプットを用いて評価されるデリバティブ取引は、レベル2の時価に分類しております。プレイン・パンラ型の金利スワップ取引、為替予約、通貨オプション等がこれに含まれます。

重要な観察できないインプットを用いて評価されるデリバティブ取引は、レベル3の時価に分類しております。長期の金利スワップや通貨スワップ等がこれに含まれ、インプット間の相関係数等が重要な観察できないインプットとなります。

(注2) 時価をもって中間連結(連結)貸借対照表計上額とする金融資産および金融負債のうちレベル3の時価に関する情報

(1) 重要な観察できないインプットに関する定量的情報
前連結会計年度(2020年3月31日)

| 区分 | 評価技法 | 主な観察できないインプット | インプットの範囲 | インプットの加重平均 |
|----------|------------|---------------|---------------|------------|
| 商品有価証券等 | | | | |
| 国内債券 | 割引現在価値法 | 調達スプレッド | 0.7% - 1.1% | 1.1% |
| 外国債券 | モンテカルロ法 | 金利間相関係数 | 41.5% - 62.5% | 57.8% |
| | | 金利為替間相関係数 | 30.2% - 59.9% | 41.3% |
| デリバティブ取引 | | | | |
| 金利関連取引 | オプション評価モデル | 金利間相関係数 | 35.0% - 62.5% | - |
| | | 金利為替間相関係数 | 21.4% - 60.0% | - |
| | | オプション・ボラティリティ | 0.0% - 100.0% | - |
| 通貨関連取引 | オプション評価モデル | 金利間相関係数 | 30.0% - 70.0% | - |
| | | 金利為替間相関係数 | 15.8% - 60.0% | - |
| | | 為替間相関係数 | 60.0% | - |
| | | オプション・ボラティリティ | 7.5% - 17.0% | - |
| 株式関連取引 | オプション評価モデル | 株式ボラティリティ | 24.2% - 37.9% | - |
| | | 金利株価間相関係数 | 39.0% | - |
| | | 為替株価間相関係数 | 58.4% - 56.9% | - |
| | | 株式間相関係数 | 13.0% - 81.3% | - |
| | 割引現在価値法 | 訴訟期間(月) | 1 - 13 | - |

当中間連結会計期間(2020年9月30日)

| 区分 | 評価技法 | 主な観察できないインプット | インプットの範囲 | インプットの加重平均 |
|----------|------------|---------------|---------------|------------|
| 商品有価証券等 | | | | |
| 国内債券 | 割引現在価値法 | 調達スプレッド | 0.8% | 0.8% |
| 外国債券 | モンテカルロ法 | 金利間相関係数 | 42.8% - 63.2% | 56.7% |
| | | 金利為替間相関係数 | 28.0% - 53.5% | 39.2% |
| デリバティブ取引 | | | | |
| 金利関連取引 | オプション評価モデル | 金利間相関係数 | 30.0% - 63.2% | - |
| | | 金利為替間相関係数 | 20.6% - 60.0% | - |
| | | オプション・ボラティリティ | 0.0% - 100.0% | - |
| 通貨関連取引 | オプション評価モデル | 金利間相関係数 | 30.0% - 70.0% | - |
| | | 金利為替間相関係数 | 17.4% - 60.0% | - |
| | | 為替間相関係数 | 55.0% | - |
| | | オプション・ボラティリティ | 9.5% - 22.3% | - |
| 株式関連取引 | オプション評価モデル | 株式ボラティリティ | 24.0% - 41.0% | - |
| | | 金利株価間相関係数 | 39.0% | - |
| | | 為替株価間相関係数 | 58.4% - 56.4% | - |
| | | 株式間相関係数 | 16.3% - 96.0% | - |
| | 割引現在価値法 | 訴訟期間(月) | 1 - 14 | - |

(2) 期首残高から期末残高への調整表、当期の損益に認識した評価損益
当中間連結会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

| | 期首残高 | 当期の損益 に計上 (*1) | その他の包 括利益に計 上 (*2) | 購入・売 却・発行・ 決済による 変動額 | レベル3の 時価への振 替 (*3) | レベル3の 時価からの 振替 (*3) | 期末残高 | 当期の損益 に計上した 額のうち中 間連結貸借 対照表日 において保有 する金融資 産および金 融負債の評 価損益 (*1) |
|-------------------|--------|-----------------------|------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-------------------------------|--------|---|
| 商品有価証券等 | 5,162 | 260 | - | 1,198 | 2 | 59 | 6,563 | 75 |
| 有価証券および投 資有価証券 | | | | | | | | |
| 株式 | 168 | 5 | 2 | - | - | - | 160 | 159 |
| 資 産 計 | 5,330 | 255 | 2 | 1,198 | 2 | 59 | 6,723 | 234 |
| 1年内償還予定の 社債 | 2,170 | 59 | 354 | 1,430 | 1,509 | 89 | 1,865 | 711 |
| 社債 | 29,052 | 398 | 2,460 | 25,837 | 9,937 | 5,762 | 57,002 | 35 |
| 負 債 計 | 31,222 | 458 | 2,814 | 24,406 | 11,447 | 5,851 | 58,868 | 746 |
| デリバティブ取引 (*4) | | | | | | | | |
| 金利関連取引 | 9,828 | 40,606 | 976 | 45,098 | - | 1,614 | 13,682 | 10,735 |
| 通貨関連取引 | 4,855 | 1,105 | 265 | 548 | - | 452 | 4,695 | 297 |
| 株式関連取引 | 10,430 | 13,202 | 74 | 11,797 | 116 | 338 | 11,539 | 1,109 |
| 債券関連取引 | 955 | 96 | - | 1,124 | - | - | 1,983 | 96 |
| 商品関連取引 | (65) | 10 | 5 | 0 | - | - | (71) | - |
| クレジットデリ バティブ取引 | 1,379 | 1,368 | 0 | 90 | - | - | 102 | 1,354 |
| デリバティブ 取引計 | 27,384 | 27,774 | 641 | 33,967 | 116 | 2,404 | 31,931 | 12,999 |

(*1) 中間連結損益計算書の「トレーディング損益」等に含まれております。

(*2) 中間連結包括利益計算書の「その他の包括利益」の「為替換算調整勘定」に含まれております。

(*3) レベル2の時価からレベル3の時価への振替およびレベル3の時価からレベル2の時価への振替であり、主に社債に係る組込デリバティブの時価の算定に用いた観察可能なインプットの重要性の低下（増加）および重要な観察できないインプットの重要性の増加（低下）によるものであります。当該振替は中間連結会計期間の期首に行っております。

(*4) 期首残高および期末残高については、デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務を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。

(3) 時価の評価プロセスの説明

当社グループは財務企画部署にて時価の算定に関する方針および手続を定めており、これに沿って各取引部門が時価を算定しております。算定された時価は、予め定められた方法に基づいて、各取引部門から独立したミドル部門であるプロダクトコントロール部署が時価の算定に用いられた評価技法およびインプットの妥当性ならびに時価のレベルの分類の適切性を検証しております。検証結果は定期的に関連会議体に報告され、時価の算定の方針および手続に関する適正性が確保されております。

時価の算定にあたっては、個々の資産の性質、特性およびリスクを最も適切に反映できる評価モデルを用いております。また、第三者から入手した相場価格を利用する場合においても、利用されている評価技法およびインプットの確認や類似の金融商品の時価との比較等の適切な方法により価格の妥当性を検証しております。

(4) 重要な観察できないインプットを変化させた場合の時価に対する影響に関する説明

ボラティリティ

ボラティリティは、市場価格の変化のスピードと程度を測る数値であり、価格決定における重要な要素であります。ボラティリティの著しい上昇（低下）は、オプションの価値の著しい増加（減少）を生じさせ、これにより時価の著しい増加（減少）を生じさせます。ボラティリティの水準は、一般的に、原資産の期間と行使価格または契約で定義された水準に左右され、特定の期間と行使価格の組み合わせのボラティリティは観察できるものではありません。

相関係数

相関係数は、2つの変数の動きの間の関係、すなわち1つの変数の変化が他の変数の変化にどのように影響するかについて計測する数値であります。外国政府・公的機関債、資産担保証券、社債、デリバティブ取引、その他の商品等、幅広い商品について、多くの相関係数に関連する仮定が求められますが、多くの場合、使用される相関係数は市場において観察できないものであり、過去の情報を用いて推定する必要があります。相関係数の変化は、その性質によって、金融商品の価値に有利か不利かを問わず、大きな影響を与える可能性があります。さらに、主に金融商品の複雑かつ固有の性質により、相関係数の範囲は広くなることがあります。相関係数には、金利と株価の間の相関といった異なる資産間の相関係数や、金利間の相関といった同一資産間の相関係数等、様々な種類があります。相関係数の水準は、市場の状況に大きく左右され、資産クラス内または資産クラス間で相対的に幅広くなる可能性があります。

金利関連取引および通貨関連取引については、様々な通貨や取引条件を有する取引の時価が複数の為替相場や金利カーブを用いて算定されることから、当社グループが保有するポートフォリオの多様性が幅広い範囲の相関係数に反映されております。株式関連取引については、主に満期が異なる相関のペアが多いことから、金利と株価の相関係数の範囲が広いものとなっております。

訴訟期間

訴訟期間とは、当社グループが購入した制限株式に関する訴訟が解決するまでの見積り期間であり、スワップ取引により参照されているものであります。これらのスワップ取引は、割引現在価値法を用いて評価され、訴訟の最終的な解決に左右されます。訴訟が解決するまでの期間は市場で観察できないことから、レベル3のインプットに分類しております。当社グループが購入した制限株式は、訴訟の解決時に発行体の上場株式に転換可能なものであります。制限株式は、訴訟解決のための清算金によって希薄化され、制限株式の希薄化は、制限株式の転換比率の調整によって行われます。当社グループは、転換比率の下落をヘッジするため、転換比率を参照するスワップ取引を締結しております。これらの時価は、発行体の訴訟における最終的な契約、すなわち契約が参照

している訴訟の最低条件に左右されます。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

連結子会社間の合併

1. 取引の概要

(1) 結合当事企業の名称およびその事業の内容

吸収合併存続会社の名称 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

事業の内容 金融商品取引業

吸収合併消滅会社の名称 三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社

事業の内容 金融商品取引業

(2) 企業結合日

2020年8月1日

(3) 企業結合の法的形式

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社を吸収合併存続会社、三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併

(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

ウェルスマネジメントビジネスの強化を目的としております。

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31年1月16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31年1月16日)に基づき、共通支配下の取引等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

(1) 当該資産除去債務の総額の増減

| | 前連結会計年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|-----------------|--|--|
| 期首残高 | 7,943百万円 | 7,890百万円 |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額 | 150 | 21 |
| 時の経過による調整額 | 72 | 33 |
| 資産除去債務の履行による減少額 | 353 | 104 |
| 見積りの変更による増減額 | 72 | 373 |
| その他増減額 | 5 | 1 |
| 中間期末(期末)残高 | 7,890 | 8,214 |

(2) 当該資産除去債務の見積りを変更した場合の概要および影響額

前連結会計年度(自 2019年4月1日 至 2020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、既見積額を超過す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72百万円加算しております。

当中間連結会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

当中間連結会計期間において、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、既見積額を超過す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373百万円加算しております。

(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、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 2019年4月1日 至 2019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 | 115,849 | 20,113 | 28,649 | 164,613 | 1,494 | 166,108 | 24,474 | 141,633 |
| セグメント間の内部純営業収益または振替高 | 646 | 1,321 | 887 | 2,856 | 15,800 | 18,656 | 18,656 | - |
| 計 | 116,496 | 21,435 | 29,537 | 167,469 | 17,295 | 184,765 | 43,131 | 141,633 |
| セグメント利益 | 3,128 | 1,052 | 2,382 | 6,562 | 25,226 | 31,789 | 27,602 | 4,186 |
| セグメント資産 | 16,896,732 | 9,490,609 | 6,419,907 | 32,807,250 | 2,877,680 | 35,684,930 | 7,531,853 | 28,153,076 |
| その他の項目 | | | | | | | | |
| 減価償却費 | 12,470 | 2,037 | 912 | 15,420 | 746 | 16,167 | 1,006 | 15,160 |
| のれんの償却額 | - | - | - | - | - | - | 1,038 | 1,038 |
| 受取利息 | 0 | 1,399 | - | 1,399 | 0 | 1,399 | - | 1,399 |
| 持分法投資利益または損失 () | - | - | - | - | - | - | 8,148 | 8,148 |
| 特別利益 (うち、投資有価証券売却 益) | 601 (553) | - (-) | - (-) | 601 (553) | 9 (-) | 610 (553) | 77 (81) | 533 (471) |
| 特別損失 (うち、減損損失) | 602 (336) | - (-) | - (-) | 602 (336) | 8 (-) | 610 (336) | - (-) | 610 (336) |
| 税金費用 | 553 | 239 | 597 | 1,391 | 687 | 2,078 | 347 | 2,425 |
| 持分法適用会社への投資額 | - | - | - | - | 412,554 | 412,554 | 167,122 | 245,431 |
| 有形固定資産および無形固 定資産の増加額 | 12,069 | 3,061 | 6,294 | 21,425 | 639 | 22,064 | 6,688 | 15,376 |

(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 24,474百万円は、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 27,602百万円は、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 7,531,853百万円には、当社の連結範囲から除外されたMUSAの資産額 3,786,935百万円およびセグメント間の債権等の相殺消去 3,694,043百万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 2020年4月1日 至 2020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 | 113,205 | 30,862 | 48,039 | 192,107 | 3,581 | 188,526 | 39,999 | 148,526 |
| セグメント間の内部純営業収益または振替高 | 734 | 869 | 730 | 2,335 | 17,931 | 20,266 | 20,266 | - |
| 計 | 113,940 | 31,732 | 48,769 | 194,442 | 14,350 | 208,792 | 60,266 | 148,526 |
| セグメント利益 | 2,596 | 7,997 | 13,589 | 24,182 | 13,741 | 37,923 | 23,094 | 14,829 |
| セグメント資産 | 20,156,989 | 10,251,262 | 5,337,150 | 35,745,402 | 2,970,690 | 38,716,093 | 6,974,535 | 31,741,557 |
| その他の項目 | | | | | | | | |
| 減価償却費 | 12,560 | 2,282 | 826 | 15,668 | 570 | 16,238 | 914 | 15,324 |
| のれんの償却額 | 375 | - | - | 375 | - | 375 | 663 | 1,038 |
| 受取利息 | - | 1,872 | - | 1,872 | 0 | 1,872 | - | 1,872 |
| 支払利息 | - | - | 786 | 786 | - | 786 | 786 | - |
| 持分法投資利益または損失 () | - | - | - | - | - | - | 2,985 | 2,985 |
| 特別利益 | 6 | - | - | 6 | - | 6 | - | 6 |
| (うち、投資有価証券売却 益) | (6) | (-) | (-) | (6) | (-) | (6) | (-) | (6) |
| 特別損失 | 5,019 | - | - | 5,019 | - | 5,019 | 4,549 | 469 |
| (うち、減損損失) | (277) | (-) | (-) | (277) | (-) | (277) | (-) | (277) |
| (うち、金融商品取引責任 準備金繰入れ) | (97) | (-) | (-) | (97) | (-) | (97) | (-) | (97) |
| (うち、抱合せ株式消滅 差損) | (4,549) | (-) | (-) | (4,549) | (-) | (4,549) | (4,549) | (-) |
| 税金費用 | 3,265 | 2,777 | 4,690 | 10,734 | 852 | 11,587 | 4,281 | 7,305 |
| 持分法適用会社への投資額 | - | - | - | - | 412,554 | 412,554 | 167,525 | 245,029 |
| 有形固定資産および無形固 定資産の増加額 | 9,715 | 2,640 | 543 | 12,899 | 284 | 13,184 | 710 | 12,474 |

(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 39,999百万円は、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 23,094百万円は、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 6,974,535百万円には、当社の連結範囲から除外されたMUSAの資産額 3,004,038百万円およびセグメント間の債権等の相殺消去 3,917,410百万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 2019年4月1日 至 2019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 |
|---------|--------|-------|---------|
| 116,957 | 17,973 | 6,702 | 141,633 |

（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 |
|--------|-------|-------|--------|
| 24,854 | 7,469 | 1,840 | 34,165 |

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 2020年4月1日 至 2020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 |
|---------|--------|-------|---------|
| 109,760 | 30,338 | 8,427 | 148,526 |

（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 |
|--------|-------|-------|--------|
| 22,493 | 5,965 | 1,750 | 30,208 |

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 2019年4月1日 至 2019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 2020年4月1日 至 2020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 2019年4月1日 至 2019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 | - | - | - | - | 30,048 | 30,048 |

（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 2020年4月1日 至 2020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 | 33,713 | - | - | - | 5,743 | 27,970 |

（注）三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社と三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社の合併に伴い、「証券業務（国内）」セグメントにおいてのれんが発生しております。「全社・消去」の金額は、「証券業務（国内）」セグメントに係るものの調整であります。

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 2019年4月1日 至 2019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 2020年4月1日 至 2020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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間連結会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|---------------------------------|--|--|
| 1株当たり中間純利益 | 5.68円 | 20.12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) | 4,186 | 14,829 |
| 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) | 4,186 | 14,829 |
| 普通株式の期中平均株式数(千株) | 736,985 | 736,985 |

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

| | 前連結会計年度 (2020年3月31日) | 当中間連結会計期間 (2020年9月30日) |
|--|-------------------------|---------------------------|
| 1株当たり純資産 | 914.36円 | 898.39円 |
| (算定上の基礎) | | |
| 純資産の部の合計額(百万円) | 943,963 | 931,937 |
| 純資産の部の合計額から控除する金額(百万円) | 270,096 | 269,840 |
| (うち非支配株主持分)(百万円) | (270,096) | (269,840) |
| 普通株式に係る中間期末(期末)の純資産 (百万円) | 673,866 | 662,097 |
| 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 (2020年3月31日) | 当中間会計期間 (2020年9月30日) |
|---------------|-----------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 167,252 | 194,956 |
| 短期貸付金 | 526,920 | 593,866 |
| 借入有価証券代り金 | 332,181 | 342,137 |
| 短期差入保証金 | 234,731 | 94,523 |
| その他 | 161,317 | 82,158 |
| 流動資産合計 | 1,422,403 | 1,307,641 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 52 | 50 |
| 無形固定資産 | 2,039 | 1,919 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 766,170 | 765,509 |
| 長期貸付金 | 1,408,741 | 1,364,090 |
| 繰延税金資産 | 1,728 | 637 |
| その他 | 914 | 885 |
| 投資その他の資産合計 | 1,177,555 | 1,131,123 |
| 固定資産合計 | 1,179,648 | 1,133,093 |
| 資産合計 | 2,602,051 | 2,440,735 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 1年内償還予定の社債 | 215,672 | 318,315 |
| 1年内返済予定の長期借入金 | 2,000 | 2,000 |
| コマーシャル・ペーパー | 175,000 | 171,000 |
| 未払法人税等 | 648 | 384 |
| 賞与引当金 | 379 | 289 |
| その他 | 151,504 | 78,425 |
| 流動負債合計 | 545,205 | 570,415 |
| 固定負債 | | |
| 社債 | 899,786 | 729,510 |
| 長期借入金 | 528,952 | 516,150 |
| その他 | 232 | 196 |
| 固定負債合計 | 1,428,971 | 1,245,856 |
| 負債合計 | 1,974,176 | 1,816,272 |

(単位：百万円)

| | 前事業年度 (2020年3月31日) | 当中間会計期間 (2020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 | 10,924 | 7,306 |
| 利益剰余金合計 | 97,686 | 94,067 |
| 株主資本合計 | 600,149 | 596,530 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 27,725 | 27,932 |
| 評価・換算差額等合計 | 27,725 | 27,932 |
| 純資産合計 | 627,874 | 624,463 |
| 負債純資産合計 | 2,602,051 | 2,440,735 |

【中間損益計算書】

(単位：百万円)

| | 前中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|--------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 関係会社受取配当金 | 14,352 | 6,709 |
| 関係会社受入手数料 | 3,227 | 3,820 |
| 関係会社貸付金利息 | 697 | 2,059 |
| その他 | 7,465 | 4,275 |
| 営業収益合計 | 25,741 | 16,864 |
| 営業費用 | | |
| 販売費及び一般管理費 | 1,260,043 | 1,260,007 |
| 金融費用 | 5,774 | 5,776 |
| 営業費用合計 | 11,818 | 11,783 |
| 営業利益 | 13,923 | 5,081 |
| 営業外収益 | 3,163 | 3,69 |
| 営業外費用 | 4,167 | 4,65 |
| 経常利益 | 13,919 | 5,085 |
| 特別利益 | | |
| その他 | 9 | - |
| 特別利益合計 | 9 | - |
| 税引前中間純利益 | 13,928 | 5,085 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 75 | 211 |
| 法人税等調整額 | 505 | 999 |
| 法人税等合計 | 581 | 788 |
| 中間純利益 | 13,347 | 4,296 |

【中間株主資本等変動計算書】

前中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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 | 15,296 | 102,058 | 604,521 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | 7,959 | 7,959 | 7,959 |
| 中間純利益 | | | | | | 13,347 | 13,347 | 13,347 |
| 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 | - | - | - | - | - | 5,387 | 5,387 | 5,387 |
| 当中間期末残高 | 75,518 | 426,944 | 426,944 | 12,208 | 74,553 | 20,684 | 107,445 | 609,908 |

| | 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 | 29,212 | 29,212 | 633,733 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 7,959 |
| 中間純利益 | | | 13,347 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額） | 460 | 460 | 460 |
| 当中間期変動額合計 | 460 | 460 | 4,927 |
| 当中間期末残高 | 28,751 | 28,751 | 638,660 |

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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 | 10,924 | 97,686 | 600,149 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | 7,915 | 7,915 | 7,915 |
| 中間純利益 | | | | | | 4,296 | 4,296 | 4,296 |
| 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 | - | - | - | - | - | 3,618 | 3,618 | 3,618 |
| 当中間期末残高 | 75,518 | 426,944 | 426,944 | 12,208 | 74,553 | 7,306 | 94,067 | 596,530 |

| | 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 | 27,725 | 27,725 | 627,874 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 7,915 |
| 中間純利益 | | | 4,296 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額） | 207 | 207 | 207 |
| 当中間期変動額合計 | 207 | 207 | 3,410 |
| 当中間期末残高 | 27,932 | 27,932 | 624,463 |

【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. 市場価格のない株式等以外のもの

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. 市場価格のない株式等

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のうち当中間会計期間の負担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。

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行およびグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「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)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産および繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(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、3,174百万円(前事業年度末は9,794百万円)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 (2020年3月31日) | 当中間会計期間 (2020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 | 329,164百万円 | 340,466百万円 |
| うち再貸付に供している有価証券 | 329,164 | 340,466 |

3. 当座貸越契約

(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 (2020年3月31日) | 当中間会計期間 (2020年9月30日) |
|------------|-----------------------|-------------------------|
| 当座貸越極度額の総額 | 45,000百万円 | 19,350百万円 |
| 借入実行残高 | - | - |
| 差引額 | 45,000 | 19,350 |

4. 偶発債務

(保証債務)

- (1) M U F Gセキュリティーズ E M E A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、76,121百万円(前事業年度末は73,348百万円)であります。
- (2) M U F Gセキュリティーズ E M E A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、46,462百万円(前事業年度末は48,332百万円)であります。
- (3) M U F Gセキュリティーズ E M E A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、当中間会計期間末および前事業年度末において当該残高はありません。
- (4) M U F 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、当中間会計期間末において当該残高はありません(前事業年度末は138百万円)。
- (6) M U F 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、22,918百万円(前事業年度末は28,342百万円)であります。
- (7) M U F 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) M U F 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、当中間会計期間末において当該残高は、745百万円(前事業年度末は10,304百万円)であります。
- (9) M U F Gセキュリティーズ(ヨーロッパ)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、20,049百万円(前事業年度末は34,923百万円)であります。
- (10) M U F Gセキュリティーズ(ヨーロッパ)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EME Aとの間で、MUF GセキュリティーズEME A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、GMRA契約、GMLA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EME A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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|----------|--|--|
| 支払手数料 | 2,226百万円 | 2,270百万円 |
| 従業員給料 | 844 | 848 |
| 賞与引当金繰入額 | 240 | 289 |
| 減価償却費 | 480 | 338 |

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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|--------|--|--|
| 有形固定資産 | 2百万円 | 2百万円 |
| 無形固定資産 | 478 | 335 |
| 計 | 480 | 338 |

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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|-------|--|--|
| 受取利息 | 147百万円 | 62百万円 |
| 受取配当金 | 6 | 5 |

4. 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 2019年4月1日 至 2019年9月30日) | 当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日) |
|------|--|--|
| 社債利息 | 143百万円 | 58百万円 |

(有価証券関係)

子会社株式および関連会社株式

子会社株式および関連会社株式で市場価格のある株式等はありません。

(注) 市場価格のない株式等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 (2020年3月31日) | 当中間会計期間 (2020年9月30日) |
|--------|-----------------------|-------------------------|
| 子会社株式 | 466,380 | 466,380 |
| 関連会社株式 | 154,707 | 154,707 |

(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。

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)臨時報告書 金融商品取引法第24条の5第4項および企業内容等の開示に関する内閣府令 第19条第2項第3号(特定子会社の異動) | 2020年5月1日 関東財務局長に提出 |
| (2)発行登録書 | 2020年6月17日 関東財務局長に提出 |
| (3)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15期)(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | 2020年6月26日 関東財務局長に提出 |
| (4)訂正発行登録書 | 2020年6月29日 関東財務局長に提出 |
| (5)訂正発行登録書 | 2020年6月29日 関東財務局長に提出 |
| (6)訂正発行登録書 | 2020年6月29日 関東財務局長に提出 |
| (7)訂正発行登録書 | 2020年6月29日 関東財務局長に提出 |
| (8)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類 | 2020年7月10日 関東財務局長に提出 |
| (9)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類 | 2020年7月10日 関東財務局長に提出 |
| (10)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類 | 2020年7月13日 関東財務局長に提出 |
| (11)発行登録追補書類(社債)およびその添付書類 | 2020年7月13日 関東財務局長に提出 |
| (12)訂正発行登録書 | 2020年7月30日 関東財務局長に提出 |

| | |
|---------------------------|-------------------------|
| (13)訂正発行登録書 | 2020年7月30日 関東財務局長に提出 |
| (14)訂正発行登録書 | 2020年7月30日 関東財務局長に提出 |
| (15)訂正発行登録書 | 2020年7月30日 関東財務局長に提出 |
| (16)訂正発行登録書 | 2020年7月31日 関東財務局長に提出 |
| (17)訂正発行登録書 | 2020年7月31日 関東財務局長に提出 |
| (18)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年8月14日 関東財務局長に提出 |
| (19)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年8月14日 関東財務局長に提出 |
| (20)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年8月17日 関東財務局長に提出 |
| (21)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年8月17日 関東財務局長に提出 |
| (22)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年8月17日 関東財務局長に提出 |
| (23)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年8月17日 関東財務局長に提出 |
| (24)訂正発行登録書 | 2020年8月27日 関東財務局長に提出 |
| (25)訂正発行登録書 | 2020年8月27日 関東財務局長に提出 |

| | |
|---------------------------|--------------------------|
| (26)訂正発行登録書 | 2020年8月27日 関東財務局長に提出 |
| (27)訂正発行登録書 | 2020年8月28日 関東財務局長に提出 |
| (28)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年9月11日 関東財務局長に提出 |
| (29)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年9月11日 関東財務局長に提出 |
| (30)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | 2020年9月11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 | 2020年9月14日 関東財務局長に提出 |
| (32)訂正発行登録書 | 2020年9月25日 関東財務局長に提出 |
| (33)訂正発行登録書 | 2020年9月29日 関東財務局長に提出 |
| (34)訂正発行登録書 | 2020年9月29日 関東財務局長に提出 |
| (35)訂正発行登録書 | 2020年9月29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 | 2020年10月12日 関東財務局長に提出 |
| (37)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類 | |

2020年10月12日
関東財務局長に提出

(38)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類

2020年10月13日
関東財務局長に提出

(39)発行登録追補書類（社債）およびその添付書類

2020年10月13日
関東財務局長に提出

(40)有価証券届出書（有価証券信託受益証券）およびその添付書類

2020年11月4日
関東財務局長に提出

(41)有価証券届出書の訂正届出書

2020年11月4日提出の有価証券届出書に係る訂正届出書

2020年11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】

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 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 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 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
- 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年4月14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10月17日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動
円建社債(ノックイン65%)
- 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2022年10月17日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動
円建社債(ノックイン60%)
- 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2021年6月16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 2024年12月9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1月16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 2025年1月9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 2025年2月14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 2025年2月18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 2023年4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(ノックイン65%)
- 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2025年4月16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13日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動
円建社債(ノックイン60%)
- 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年5月12日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動
円建社債(ノックイン65%)
- 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2025年5月19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

22. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年5月12日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動円建社債(ノックイン60%)
23. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年7月14日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動円建社債(ノックイン65%)
24. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年7月14日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動円建社債(ノックイン60%)
25. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2025年7月8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
26. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年8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(ノックイン65%)
27. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2025年8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
28. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2022年2月16日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動円建社債
29. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年8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(ノックイン60%)
30. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2025年8月19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
31. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年9月8日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動円建社債(ノックイン65%)
32. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2023年9月8日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動円建社債(ノックイン60%)
33. 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 2025年9月16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

(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 | 2015年 | 2016年 | 2017年 | 2018年 | 2019年 |
|-----------------------|----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 最高 | 20,868.03 | 19,633.75 | 24,124.15 | 24,270.62 | 24,083.51 |
| | 最低 | 14,952.61 | 14,952.02 | 18,335.63 | 19,155.74 | 16,552.83 |

| 最近6ヶ月の月別 最高・最低値 | 月 | 2020年4月 | 2020年5月 | 2020年6月 | 2020年7月 | 2020年8月 | 2020年9月 |
|--------------------|----|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 最高 | 20,193.69 | 21,916.31 | 23,178.10 | 22,945.50 | 23,296.77 | 23,559.30 |
| | 最低 | 17,818.72 | 19,619.35 | 21,530.95 | 21,710.00 | 22,195.38 | 23,032.54 |

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

2020年11月25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

東京事務所

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

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 高尾 大介 |
|--------------------|-------|-------|

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 齋藤 大樹 |
|--------------------|-------|-------|

中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの連結会計年度の中間連結会計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020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（2020年4月1日から2020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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間連結財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社及び連結子会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間連結財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

中間連結財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間連結財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間連結財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間連結財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・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リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・中間連結財務諸表監査の目的は、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、監査人は、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。
- ・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間連結財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間連結財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間連結財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間連結財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間連結財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間連結財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間連結財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。
- ・中間連結財務諸表に対する意見を表明するために、会社及び連結子会社の財務情報に関する十分かつ適切な監査証拠を入手する。監査人は、中間連結財務諸表の中間監査に関する指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で中間監査意見に対して責任を負う。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社及び連結子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. X B R L 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

2020年11月25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

東京事務所

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

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 高尾 大介 |
|--------------------|-------|-------|

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 齋藤 大樹 |
|--------------------|-------|-------|

中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第16期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020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（2020年4月1日から2020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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・中間財務諸表監査の目的は、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、監査人は、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。
- ・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。