

平成21年3月期 決算短信

平成21年4月28日

会社名 **みずほ証券株式会社**

URL <http://www.mizuho-sc.com/>

代表者 (役職名) 代表取締役社長

(氏名) 横尾 敬介

問合せ先責任者 (役職名) 常務執行役員 リスク管理・財務グループ長

(氏名) 染河 清剛

TEL (03)5208-2030

(百万円未満切捨て)

1. 平成21年3月期の連結業績 (平成20年4月1日～平成21年3月31日)

(1) 連結経営成績

(%表示は対前期増減率)

	営業収益	純営業収益	営業利益	経常利益
	百万円 %	百万円 %	百万円 %	百万円 %
21年3月期	304,252 (36.0)	98,335 (—)	△21,756 (—)	△20,486 (—)
20年3月期	223,677 (△65.4)	△296,567 (—)	△430,293 (—)	△433,672 (—)

	当期純利益	1株当たり 当期純利益	潜在株式調整後 1株当たり当期純利益
	百万円 %	円 銭	円 銭
21年3月期	△34,497 (—)	△5,160 39	— —
20年3月期	△418,669 (—)	△96,512 02	— —

(参考) 持分法投資損益 21年3月期 △63百万円 20年3月期 390百万円

(2) 連結財政状態

	総資産	純資産	自己資本比率	1株当たり純資産
	百万円	百万円	%	円 銭
21年3月期	16,443,324	279,043	1.6	39,368 47
20年3月期	21,122,253	331,031	1.6	49,437 93

(参考) 自己資本 21年3月期 263,178百万円 20年3月期 330,492百万円

2. 配当の状況

	1株当たり配当金					配当金総額 (年間)	配当性向 (連結)	純資産配当率 (連結)
	第1四半期末	第2四半期末	第3四半期末	期末	年間			
(基準日)	円 銭	円 銭	円 銭	円 銭	円 銭	百万円	%	%
20年3月期	— —	0 00	— —	0 00	0 00	—	—	—
21年3月期	— —	0 00	— —	0 00	0 00	—	—	—

3. その他

(1) 期中における重要な子会社の異動(連結範囲の変更を伴う特定子会社の異動) 無

(2) 連結財務諸表作成に係る会計処理の原則・手続、表示方法等の変更(連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更に記載されるもの)

① 会計基準等の改正に伴う変更 有

② ①以外の変更 有

(注) 詳細は、10ページ「連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更」をご覧ください。

(3) 発行済株式数(普通株式)

① 期末発行済株式数(自己株式を含む) 21年3月期 6,685,000株 20年3月期 6,685,000株

② 期末自己株式数 21年3月期 —株 20年3月期 —株

(参考)個別業績の概要

1. 平成21年3月期の個別業績(平成20年4月1日～平成21年3月31日)

(1)個別経営成績

(%表示は対前期増減率)

	営業収益	純営業収益	営業利益	経常利益
	百万円 %	百万円 %	百万円 %	百万円 %
21年3月期	108,127 (15.1)	64,505 (29.7)	△ 3,703 (-)	5,570 (-)
20年3月期	93,916 (△ 30.9)	49,716 (△ 56.9)	△ 30,252 (-)	△ 25,633 (-)

	当期純利益	1株当たり 当期純利益	潜在株式調整後 1株当たり当期純利益
	百万円 %	円 銭	円 銭
21年3月期	4,082 (-)	610 66	- -
20年3月期	△ 437,860 (-)	△ 100,935 91	- -

(2)個別財政状態

	総資産	純資産	自己資本比率	1株当たり純資産	自己資本規制比率
	百万円	百万円	%	円 銭	%
21年3月期	8,654,988	328,780	3.8	49,181 78	273.4
20年3月期	12,695,032	326,151	2.6	48,788 55	266.9

(参考) 自己資本 21年3月期 328,780 百万円 20年3月期 326,151 百万円

【企業集団の状況】

当社および当社の子会社・関連会社は、証券・インベストメントバンキング分野において、デット、エクイティ、M&A、ストラクチャードファイナンス等をコアビジネス領域とし、内外機関投資家や事業法人・金融法人・公共法人を中心とした幅広いニーズに対して、先進の金融技術を活かし、高付加価値のプロダクツやサービスを提供しております。

海外ネットワークに関しては英国、スイス、米国、香港、シンガポール等の金融市場に子会社を配し、株・公社債の引受・売買を中心に、グローバルなインベストメントバンキング業務の運営体制を整えております。

当企業集団の主たる会社は、以下の通りであります。

会社名	所在地	資本金	主要な事業の内容	議決権に対する 当社の保有割合
(親会社)				
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都 千代田区	百万円 1,540,965	金融持株会社	—
株式会社みずほコーポレート銀行	東京都 千代田区	百万円 1,070,965	銀行業務	—
(子会社)				
みずほセキュリティーズアジアリミテッド Mizuho Securities Asia Limited	中華人民共和国 香港特別行政区	百万香港ドル 330	証券業務	70.00%
株式会社日本投資環境研究所	東京都 千代田区	百万円 100	コンサルティング業務、 情報提供サービス業務	97.00%
ブリッジフォード・グループ The Bridgeford Group, Inc.	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	米ドル 1,000,000	M&A業務	100.00%
スイスみずほ銀行 Mizuho Bank (Switzerland) Ltd	スイス連邦 チューリッヒ市	百万スイスフラン 53	銀行業務・信託業務	70.00%
みずほインターナショナル Mizuho International plc	英国 ロンドン市	百万英ポンド 2,426	証券業務・銀行業務	100.00%
米国みずほ証券 Mizuho Securities USA Inc.	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	米ドル 231,300	証券業務	70.00%
ベーシック・キャピタル・マネジメント株式会社	東京都 千代田区	百万円 100	金融業務	100.00%
瑞穂投資諮詢(上海)有限公司	中華人民共和国 上海市	百萬元 10	コンサルティング業務	100.00%
株式会社インダストリアル・デベロップメント	東京都 品川区	百万円 40	コンサルティング業務	50.00%
みずほ証券・新光プリンシパルインベストメント株式会社	東京都 千代田区	百万円 5,000	投資業務	99.21%
みずほセキュリティーズシンガポール Mizuho Securities (Singapore) Pte., Ltd.	シンガポール共和国 シンガポール市	米ドル 2,488,785	証券業務	100.00%
(関連会社)				
モバイル・インターネットキャピタル株式会社	東京都 港区	百万円 100	ベンチャーキャピタル業務	30.00%
日本産業パートナーズ株式会社	東京都 千代田区	百万円 100	金融業務	25.00%
株式会社環境エネルギー投資	東京都 品川区	百万円 100	金融業務	50.00%

(注) みずほ証券・新光プリンシパルインベストメント株式会社は、平成20年7月及び平成21年2月の増資により資本金が1,000百万円から5,000百万円、当社の議決権保有割合が90%から99.21%にそれぞれ増加しております。

みずほセキュリティーズアジアリミテッド、スイスみずほ銀行及び米国みずほ証券は、平成21年3月に保有株式の一部を売却したことにより、それぞれ当社の議決権保有割合が従来の100%から70%に低下しております。

【連結財務諸表】

連 結 貸 借 対 照 表

(単位:百万円)

科 目	前連結会計年度 (20.3.31現在)	当連結会計年度 (21.3.31現在)
(資産の部)		
流 動 資 産	21,038,371	16,348,495
現 金 ・ 預 金	148,286	90,503
預 託 金	16,915	23,605
有 価 証 券	7,967	216
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	8,531,592	6,199,620
商 品 有 価 証 券 等	7,850,567	5,044,715
貸 付 債 権	40,279	37,929
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	640,746	1,116,976
営 業 有 価 証 券 等	74,157	78,296
営 業 貸 付 債 権	2,012	2,040
信 用 取 引 資 産	4,177	1,688
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	11,423,819	9,361,365
募 集 等 払 込 金	820	596
短 期 差 入 保 証 金	274,601	346,505
有 価 証 券 等 引 渡 未 了 勘 定	413,407	193,197
支 払 差 金 勘 定	58,051	—
短 期 貸 付 金	2,076	3,138
未 収 収 益	48,807	30,172
繰 延 税 金 資 産	11,900	7,835
そ の 他	19,830	9,768
貸 倒 引 当 金	△ 55	△ 56
固 定 資 産	83,882	94,828
有 形 固 定 資 産	14,822	11,625
建 物	5,762	4,675
器 具 ・ 備 品	9,060	6,949
無 形 固 定 資 産	14,223	13,817
ソ フ ト ウ ェ ア	14,163	13,758
そ の 他	60	59
投 資 そ の 他 の 資 産	54,836	69,385
投 資 有 価 証 券	22,664	23,528
出 資 金	591	231
長 期 差 入 保 証 金	6,441	7,072
長 期 前 払 費 用	1,397	1,037
繰 延 税 金 資 産	20,472	28,460
そ の 他	3,269	11,209
貸 倒 引 当 金	—	△ 2,155
資 産 合 計	21,122,253	16,443,324

(単位:百万円)

科 目	前連結会計年度 (20.3.31現在)	当連結会計年度 (21.3.31現在)
(負債の部)		
流 動 負 債	19,713,733	15,134,679
トレーディング商品	4,845,986	3,670,098
商品有価証券等	4,034,648	2,561,978
デリバティブ取引	811,338	1,108,120
約定見返勘定	206,352	373,740
信用取引負債	7,771	2,619
有価証券担保借入金	10,697,060	7,590,888
預 り 金	20,525	18,556
受 入 保 証 金	202,727	264,486
有価証券等受入未了勘定	436,170	289,090
受取差金勘定	—	9,066
短期借入金	2,830,083	2,542,049
コマーシャル・ペーパー	287,900	218,400
一年以内償還社債	104,472	92,313
未 払 費 用	46,783	24,116
未払法人税等	1,128	1,288
賞与引当金	21,345	18,809
繰延税金負債	6	7
そ の 他	5,420	19,150
固 定 負 債	1,075,460	1,028,184
社 債	597,701	486,824
長期借入金	469,287	534,406
繰延税金負債	641	25
退職給付引当金	7,315	6,343
役員退職慰労引当金	468	509
そ の 他	46	75
特別法上の準備金	2,027	1,416
金融商品取引責任準備金	—	1,416
証券取引責任準備金	1,922	—
金融先物取引責任準備金	104	—
負 債 合 計	20,791,222	16,164,281
(純資産の部)		
株 主 資 本	360,796	326,298
資 本 金	395,146	250,000
資 本 剰 余 金	325,288	75,742
利 益 剰 余 金	△ 359,638	556
評価・換算差額等	△ 30,303	△ 63,120
その他有価証券評価差額金	1,185	3
為替換算調整勘定	△ 31,489	△ 63,124
少数株主持分	538	15,864
純 資 産 合 計	331,031	279,043
負 債 ・ 純 資 産 合 計	21,122,253	16,443,324

連 結 損 益 計 算 書

(単位:百万円)

科 目	前連結会計年度 〔 自19.4.1 〕 〔 至20.3.31 〕	当連結会計年度 〔 自20.4.1 〕 〔 至21.3.31 〕
営 業 収 益	223,677	304,252
受 入 手 数 料	75,241	53,598
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	△ 413,259	540
営 業 有 価 証 券 等 損 益	3,388	△ 7,160
金 融 収 益	558,306	257,273
金 融 費 用	520,244	205,916
純営業収益又は純営業損失(△)	△ 296,567	98,335
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	133,725	120,092
取 引 関 係 費	27,573	24,112
人 件 費	64,798	57,456
不 動 産 関 係 費	17,781	16,003
事 務 費	7,877	4,760
減 価 償 却 費	7,671	8,320
の れ ん 償 却 額	52	17
租 税 公 課	2,094	1,785
そ の 他	5,877	7,637
営 業 損 失	430,293	21,756
営 業 外 収 益	3,026	2,111
持 分 法 に よ る 投 資 利 益	390	-
そ の 他	2,635	2,111
営 業 外 費 用	6,406	840
持 分 法 に よ る 投 資 損 失	-	63
そ の 他	6,406	776
経 常 損 失	433,672	20,486
特 別 利 益	19,881	2,942
特 別 損 失	13,160	8,640
税 金 等 調 整 前 当 期 純 損 失	426,951	26,184
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税	4,800	11,460
法 人 税 等 調 整 額	△ 13,043	△ 3,084
少 数 株 主 損 失 (△)	△ 38	△ 63
当 期 純 損 失	418,669	34,497

連結株主資本等変動計算書

(単位:百万円)

科 目	前連結会計年度	当連結会計年度
	〔 自19.4.1 至20.3.31 〕	〔 自20.4.1 至21.3.31 〕
株主資本		
資本金		
前期末残高	195,146	395,146
当期変動額		
新株の発行	200,000	—
減資	—	△ 145,146
当期変動額合計	200,000	△ 145,146
当期末残高	395,146	250,000
資本剰余金		
前期末残高	125,288	325,288
当期変動額		
新株の発行	200,000	—
減資	—	145,146
欠損填補	—	△ 394,692
当期変動額合計	200,000	△ 249,546
当期末残高	325,288	75,742
利益剰余金		
前期末残高	72,399	△ 359,638
在外子会社の会計処理変更に伴う増加額	634	—
当期変動額		
剰余金の配当	△ 14,003	—
当期純損失	△ 418,669	△ 34,497
欠損填補	—	394,692
当期変動額合計	△ 432,672	360,195
当期末残高	△ 359,638	556
株主資本合計		
前期末残高	392,833	360,796
在外子会社の会計処理変更に伴う増加額	634	—
当期変動額		
新株の発行	400,000	—
剰余金の配当	△ 14,003	—
当期純損失	△ 418,669	△ 34,497
当期変動額合計	△ 32,672	△ 34,497
当期末残高	360,796	326,298

(単位:百万円)

科 目	前連結会計年度	当連結会計年度
	〔 自19.4.1 至20.3.31 〕	〔 自20.4.1 至21.3.31 〕
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	29,579	1,185
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△ 28,393	△ 1,182
当期変動額合計	△ 28,393	△ 1,182
当期末残高	1,185	3
為替換算調整勘定		
前期末残高	16,837	△ 31,489
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△ 48,326	△ 31,634
当期変動額合計	△ 48,326	△ 31,634
当期末残高	△ 31,489	△ 63,124
評価・換算差額等合計		
前期末残高	46,416	△ 30,303
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△ 76,719	△ 32,817
当期変動額合計	△ 76,719	△ 32,817
当期末残高	△ 30,303	△ 63,120
少数株主持分		
前期末残高	7	538
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	531	15,326
当期変動額合計	531	15,326
当期末残高	538	15,864
純資産合計		
前期末残高	439,257	331,031
在外子会社の会計処理変更に伴う増加額	634	—
当期変動額		
新株の発行	400,000	—
剰余金の配当	△ 14,003	—
当期純損失	△ 418,669	△ 34,497
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△ 76,188	△ 17,491
当期変動額合計	△ 108,861	△ 51,988
当期末残高	331,031	279,043

【連結財務諸表の作成について】

当社の連結財務諸表は、「連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和51年大蔵省令第28号、以下「連結財務諸表規則」という。)、ならびに同規則第46条および第68条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)、「有価証券関連業経理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)、および「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」(平成11年総理府・大蔵省令第32号)に準拠して作成しております。

【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 (22 社)

主要な連結子会社の名称

みずほセキュリティーズアジアリミテッド
株式会社日本投資環境研究所
ブリッジフォード・グループ
スイスみずほ銀行
みずほインターナショナル
米国みずほ証券
ベーシック・キャピタル・マネジメント株式会社
瑞穂投資諮詢(上海)有限公司
株式会社インダストリアル・ディシジョンズ
みずほ証券・新光プリンシパルインベストメント株式会社
みずほセキュリティーズシンガポール

2. 持分法の適用に関する事項

持分法を適用した関連会社 (8 社)

主要な会社名

モバイル・インターネットキャピタル株式会社
日本産業パートナーズ株式会社
株式会社環境エネルギー投資

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社のうち瑞穂投資諮詢(上海)有限公司ほか3社の決算日は、12月31日であります。連結財務諸表の作成に当たっては、1社を除き同社の同決算日現在の財務諸表を使用することとしております。ただし、同決算日から連結決算日までの期間に発生した重要な取引については、連結上必要な調整を行っております。

4. 会計処理基準に関する事項

(1) トレーディング商品に属する有価証券およびデリバティブ取引等の評価基準ならびに評価方法

当社および連結子会社は、有価証券市場における公正な価格形成および円滑な流通を目的としてトレーディングを行っており、保有するトレーディング・ポジションは、顧客の資金運用やリスク・ヘッジなどのニーズに対応する為に行う顧客との取引、自己の計算において行っている取引(ディーリング業務)および市場リスクを中心とした各種リスクを回避する為に行うヘッジ取引から発生しております。

トレーディング商品に属する有価証券およびデリバティブ取引等については、時価法を採用しております。

(2) トレーディング関連以外の有価証券の評価基準および評価方法

その他有価証券等のうち、時価のあるものについては時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価(移動平均法による原価)ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入法を採用しております。

時価のないものについては移動平均法による原価法を採用しております。

なお、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に基づき、持分相当額を純額で取込む方法によっております。

(3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法

① 有形固定資産

当社および国内連結子会社においては、定率法によっております。ただし、当社および国内連結子会社は、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く。)については定額法を採用しております。

海外連結子会社は、主として定額法を採用しております。

② 無形固定資産

定額法を採用しております。なおソフトウェアの耐用年数は社内における利用可能期間(2年～10年)としております。

(4) 繰延資産の処理方法

社債発行費については、支出時に全額費用処理しております。

(5) 重要な引当金の計上基準**① 貸倒引当金**

貸倒引当金は、貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率に基づき、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することとしております。

② 賞与引当金

賞与引当金は、従業員等に対する賞与の支払いに備えるため、各社所定の計算方法により算出した支払見積額のうち当連結会計年度負担分を計上しております。

③ 退職給付引当金

退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当連結会計年度末における退職給付債務および年金資産の見込額に基づき計上しております。

また、過去勤務債務および数理計算上の差異の費用処理方法は、以下のとおりであります。

過去勤務債務 : その発生連結会計年度に一時損益処理

数理計算上の差異 : 各連結会計年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌連結会計年度から費用処理

④ 役員退職慰労引当金

役員退職慰労引当金は、役員および執行役員の退職により支給する退職慰労金に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 重要なヘッジ会計の方法

外貨建営業有価証券等の為替変動リスクをヘッジするための外貨建借入金については時価ヘッジ処理を採用しております。また、借入金の金利変動リスクをヘッジするための金利スワップ取引で、特例処理の要件を満たしているものについては特例処理を採用しております。

(7) その他連結財務諸表作成のための重要な事項**消費税等の会計処理方法**

消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

5. 連結子会社の資産および負債の評価に関する事項

連結子会社の資産および負債の評価については、全面時価評価法を採用しております。

【連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更】**1. リース取引に関する事項**

所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号)および「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号)が平成20年4月1日以後開始する連結会計年度に係る連結財務諸表から適用することができることになったため、当連結会計年度よりこれらの会計基準等を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、原則として、リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとする定率法を採用しております。

なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引について、会計処理の変更による影響額は特別損益として処理する方法によっております。これによる損益に与える影響は軽微であります。

2. 特別法上の準備金に関する事項

従来の証券取引責任準備金および金融先物取引責任準備金につきまして、金融商品取引法の施行に伴い、当連結会計年度より「金融商品取引責任準備金」として計上する方法に変更しております。この影響により、当期純損失が113百万円減少しております。

3. 劣後債務の支払利息に関する事項

従来、劣後債務に係る支払利息につきましては、「営業外費用」に計上しておりましたが、資金使途の変化の実態をより正確に反映させるため、当連結会計年度より「金融費用」に計上しております。この変更により、従来と同様の方法による場合と比べ、営業損失が4,577百万円増加しております。なお経常損失、税金等調整前当期純損失に与える影響はありません。

【注記事項】

(継続企業の前提に関する注記)

該当事項はございません。

(重要な後発事象の注記)

当社と新光証券株式会社は、平成21年3月4日付で、平成21年5月7日を合併効力発生日とする合併契約書を締結していましたが、平成21年4月3日の臨時株主総会において、本合併契約の承認を得ております。

(連結株主資本等変動計算書関係)

前連結会計年度(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

1. 発行済株式の種類および総数に関する事項

(単位:株)

株式の種類	前期末株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	3,685,000	3,000,000	—	6,685,000

(注) 当期株式数の増加は、株式会社みずほコーポレート銀行に対する第三者割当増資によるものであります。

2. 自己株式の種類および株式数に関する事項

当連結会計年度末において、自己株式の保有はございません。

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	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
平成19年6月25日 定時株主総会	普通株式	14,003百万円	3,800円	平成19年3月31日	平成19年6月26日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当はございません。

当連結会計年度(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1. 発行済株式の種類および総数に関する事項

(単位:株)

株式の種類	前期末株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	6,685,000	—	—	6,685,000

2. 自己株式の種類および株式数に関する事項

当連結会計年度末において、自己株式の保有はございません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当はございません。

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当はございません。

【決算資料(連結)】

1. 手数料収入

(1) 科目別内訳

(単位:百万円)

	前連結会計年度	当連結会計年度	前連結会計年度比 (%)
委託手数料	20,039	15,158	75.6%
(株券等)	(13,326)	(8,984)	(67.4%)
(債券等)	(6,701)	(6,167)	(92.0%)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	16,345	13,740	84.1%
(株券等)	(4,790)	(3,899)	(81.4%)
(債券等)	(10,651)	(9,585)	(90.0%)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	2,134	513	24.0%
(株券等)	(855)	(95)	(11.2%)
(債券等)	(371)	(39)	(10.6%)
(受益証券)	(500)	(87)	(17.6%)
その他の受入手数料	36,722	24,186	65.9%
合計	75,241	53,598	71.2%

(2) 商品別内訳

(単位:百万円)

	前連結会計年度	当連結会計年度	前連結会計年度比 (%)
株券等	19,591	13,137	67.1%
債券等	20,197	16,114	79.8%
受益証券	4,959	2,207	44.5%
その他の	30,492	22,138	72.6%
合計	75,241	53,598	71.2%

2. トレーディング損益

(単位:百万円)

	前連結会計年度	当連結会計年度	前連結会計年度比 (%)
株券等トレーディング損益	△ 16,077	△ 16,806	—
債券・為替等トレーディング損益	△ 397,182	17,347	—
合計	△ 413,259	540	—

(参考資料)

連結損益計算書の四半期推移

(単位:百万円)

科 目	前年度 第4四半期	当年度 第1四半期	当年度 第2四半期	当年度 第3四半期	当年度 第4四半期
	(20.1.1) (20.3.31)	(20.4.1) (20.6.30)	(20.7.1) (20.9.30)	(20.10.1) (20.12.31)	(21.1.1) (21.3.31)
営 業 収 益	△ 123,590	110,503	96,689	46,953	50,104
受 入 手 数 料	24,105	14,196	13,921	10,292	15,187
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	△ 222,274	2,258	△ 6,272	13,980	△ 9,425
営 業 有 価 証 券 等 損 益	241	1,589	△ 3,323	△ 1,780	△ 3,645
金 融 収 益	74,337	92,459	92,364	24,461	47,987
金 融 費 用	57,436	82,022	79,418	12,770	31,704
純営業収益又は純営業損失(△)	△ 181,026	28,481	17,271	34,183	18,399
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	30,626	31,844	31,147	25,299	31,801
取 引 関 係 費	7,209	5,924	7,012	3,302	7,873
人 件 費	11,404	15,720	12,894	15,006	13,834
不 動 産 関 係 費	4,609	4,531	4,084	3,573	3,813
事 務 費	2,054	1,445	1,641	652	1,019
減 価 償 却 費	2,059	2,272	2,036	1,832	2,178
の れ ん 償 却 額	7	—	23	—	△ 6
租 税 公 課	725	390	520	586	287
そ の 他	2,557	1,557	2,934	345	2,799
営業利益又は営業損失(△)	△ 211,652	△ 3,363	△ 13,876	8,884	△ 13,401
営 業 外 収 益	729	362	598	1,406	△ 255
持 分 法 に よ る 投 資 利 益	△ 181	32	△ 32	—	—
そ の 他	910	330	630	1,406	△ 255
営 業 外 費 用	2,051	4	708	89	38
持 分 法 に よ る 投 資 損 失	—	—	25	4	33
そ の 他	2,051	4	682	85	4
経常利益又は経常損失(△)	△ 212,974	△ 3,004	△ 13,986	10,201	△ 13,695
特 別 利 益	△ 190	1,208	1,221	△ 108	620
特 別 損 失	6,169	3,059	244	247	5,088
税金等調整前四半期純利益又は税金等調整前四半期純損失(△)	△ 219,334	△ 4,856	△ 13,010	9,845	△ 18,163
法人税、住民税及び事業税	1,215	1,090	1,995	4,745	3,629
法人税等調整額	1,453	1,906	△ 2,971	1,474	△ 3,493
少数株主利益又は少数株主損失(△)	△ 43	△ 49	△ 25	△ 12	24
四半期純利益又は四半期純損失(△)	△ 221,960	△ 7,802	△ 12,007	3,638	△ 18,324

【個別財務諸表】

貸借対照表

(単位:百万円)

科 目	前 期 (20.3.31現在)	当 期 (21.3.31現在)
(資産の部)		
流 動 資 産	12,476,240	8,433,183
現 金 ・ 預 金	39,462	31,363
預 託 金	16,915	23,605
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	7,543,860	5,083,231
商 品 有 価 証 券 等	7,002,202	4,053,687
貸 付 債 権	40,279	37,929
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	501,379	991,614
営 業 有 価 証 券 等	33,433	28,513
営 業 貸 付 債 権	2,012	0
信 用 取 引 資 産	1,974	432
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	4,657,424	3,019,692
募 集 等 払 込 金	820	596
短 期 差 入 保 証 金	99,606	163,172
支 払 差 金 勘 定	8,644	-
短 期 貸 付 金	27,915	57,775
未 収 収 益	22,460	14,900
未 収 法 人 税 等	5,949	775
繰 延 税 金 資 産	11,497	7,199
そ の 他	4,267	1,925
貸 倒 引 当 金	4	0
固 定 資 産	218,791	221,804
有 形 固 定 資 産	10,435	8,499
建 物	2,846	2,655
器 具 ・ 備 品	7,588	5,844
無 形 固 定 資 産	12,370	12,822
ソ フ ト ウ ェ ア	12,320	12,776
そ の 他	49	46
投 資 そ の 他 の 資 産	195,986	200,482
投 資 有 価 証 券	7,260	3,071
関 係 会 社 株 式	148,781	159,546
関 係 会 社 長 期 貸 付 金	8,970	-
長 期 差 入 保 証 金	6,197	6,772
長 期 前 払 費 用	1,397	1,037
繰 延 税 金 資 産	22,018	28,742
そ の 他	1,361	2,955
貸 倒 引 当 金	0	1,643
資 産 合 計	12,695,032	8,654,988

(単位:百万円)

科 目	前 期 (20.3.31現在)	当 期 (21.3.31現在)
(負債の部)		
流 動 負 債	11,561,216	7,579,363
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	4,155,816	3,116,491
商 品 有 価 証 券 等	3,655,375	2,247,360
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	500,440	869,130
約 定 見 返 勘 定	197,253	18,048
信 用 取 引 負 債	7,771	2,619
有 価 証 券 担 保 借 入 金	4,118,380	1,635,110
預 り 金	14,974	10,325
受 入 保 証 金	34,789	67,788
有 価 証 券 等 受 入 未 了 勘 定	6	-
受 取 差 金 勘 定	-	494
短 期 借 入 金	2,658,236	2,428,175
コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー	287,900	218,400
一 年 以 内 償 還 社 債	65,700	62,620
前 受 金	11	0
未 払 費 用	16,698	13,529
賞 与 引 当 金	3,243	4,226
そ の 他	433	1,534
固 定 負 債	805,636	745,427
社 債	331,100	227,900
長 期 借 入 金	244,878	242,955
関 係 会 社 長 期 借 入 金	222,000	268,000
退 職 給 付 引 当 金	7,189	5,985
役 員 退 職 慰 労 引 当 金	468	508
そ の 他	-	78
特 別 法 上 の 準 備 金	2,027	1,416
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金	-	1,416
証 券 取 引 責 任 準 備 金	1,922	-
金 融 先 物 取 引 責 任 準 備 金	104	-
負 債 合 計	12,368,880	8,326,207
(純資産の部)		
株 主 資 本	325,742	329,824
資 本 金	395,146	250,000
資 本 剰 余 金	325,288	75,742
資 本 準 備 金	325,288	-
そ の 他 資 本 剰 余 金	-	75,742
利 益 剰 余 金	394,692	4,082
利 益 準 備 金	870	-
そ の 他 利 益 剰 余 金	395,562	4,082
別 途 積 立 金	1,500	-
繰 越 利 益 剰 余 金	397,062	4,082
評 価 ・ 換 算 差 額 等	409	1,044
そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	409	572
繰 延 ヘ ッ ジ 損 益	-	472
純 資 産 合 計	326,151	328,780
負 債 ・ 純 資 産 合 計	12,695,032	8,654,988

損 益 計 算 書

(単位:百万円)

科 目	前 期 〔 自19.4.1 至20.3.31 〕	当 期 〔 自20.4.1 至21.3.31 〕
営 業 収 益	93,916	108,127
受 入 手 数 料	59,813	41,538
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	26,393	15,010
営 業 有 価 証 券 等 損 益	5,626	1,615
金 融 収 益	54,869	53,194
金 融 費 用	44,200	43,621
純 営 業 収 益	49,716	64,505
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	79,968	68,209
取 引 関 係 費	21,657	13,502
人 件 費	28,013	25,681
不 動 産 関 係 費	15,122	13,836
事 務 費	5,405	3,452
減 価 償 却 費	5,486	6,635
の れ ん 償 却 額	60	-
租 税 公 課	2,012	1,634
そ の 他	2,209	3,467
営 業 損 失	30,252	3,703
営 業 外 収 益	10,788	9,303
営 業 外 費 用	6,169	29
経 常 利 益 又 は 経 常 損 失 ()	25,633	5,570
特 別 利 益	18,452	6,122
特 別 損 失	439,074	8,787
税 引 前 当 期 純 利 益 又 は 税 引 前 当 期 純 損 失 ()	446,256	2,904
法 人 税、住 民 税 及 び 事 業 税	978	251
法 人 税 等 調 整 額	9,373	1,429
当 期 純 利 益 又 は 当 期 純 損 失 ()	437,860	4,082

株主資本等変動計算書

(単位:百万円)

科 目	前 期	当 期
	〔 自19.4.1 至20.3.31 〕	〔 自20.4.1 至21.3.31 〕
株主資本		
資本金		
前期末残高	195,146	395,146
当期変動額		
新株の発行	200,000	-
減資	-	145,146
当期変動額合計	200,000	145,146
当期末残高	395,146	250,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	125,288	325,288
当期変動額		
新株の発行	200,000	-
資本準備金の取崩	-	325,288
当期変動額合計	200,000	325,288
当期末残高	325,288	-
その他資本剰余金		
前期末残高	-	-
当期変動額		
減資	-	145,146
資本準備金の取崩	-	325,288
欠損填補	-	394,692
当期変動額合計	-	75,742
当期末残高	-	75,742
資本剰余金合計		
前期末残高	125,288	325,288
当期変動額		
新株の発行	200,000	-
減資	-	145,146
欠損填補	-	394,692
当期変動額合計	200,000	249,546
当期末残高	325,288	75,742
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	870	870
当期変動額		
利益準備金の取崩	-	870
当期変動額合計	-	870
当期末残高	870	-
その他利益剰余金		
特別償却準備金		
前期末残高	12	-
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	12	-
当期変動額合計	12	-
当期末残高	-	-
別途積立金		
前期末残高	1,500	1,500
当期変動額		
欠損填補	-	1,500
当期変動額合計	-	1,500
当期末残高	1,500	-

(単位:百万円)

科 目	前 期	当 期
	〔 自19.4.1 至20.3.31 〕	〔 自20.4.1 至21.3.31 〕
繰越利益剰余金		
前期末残高	54,788	397,062
当期変動額		
剰余金の配当	14,003	-
当期純利益又は当期純損失()	437,860	4,082
特別償却準備金の取崩	12	-
利益準備金の取崩	-	870
欠損填補	-	396,192
当期変動額合計	451,851	401,144
当期末残高	397,062	4,082
利益剰余金合計		
前期末残高	57,171	394,692
当期変動額		
剰余金の配当	14,003	-
当期純利益又は当期純損失()	437,860	4,082
欠損填補	-	394,692
当期変動額合計	451,863	398,774
当期末残高	394,692	4,082
株主資本合計		
前期末残高	377,605	325,742
当期変動額		
新株の発行	400,000	-
剰余金の配当	14,003	-
当期純利益又は当期純損失()	437,860	4,082
当期変動額合計	51,863	4,082
当期末残高	325,742	329,824
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	29,174	409
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	28,765	981
当期変動額合計	28,765	981
当期末残高	409	572
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	3,154	-
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	3,154	472
当期変動額合計	3,154	472
当期末残高	-	472
評価・換算差額等合計		
前期末残高	26,020	409
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	25,611	1,453
当期変動額合計	25,611	1,453
当期末残高	409	1,044
純資産合計		
前期末残高	403,626	326,151
当期変動額		
新株の発行	400,000	-
剰余金の配当	14,003	-
当期純利益又は当期純損失()	437,860	4,082
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	25,611	1,453
当期変動額合計	77,474	2,628
当期末残高	326,151	328,780

【個別財務諸表の作成について】

当社の個別財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)、「有価証券関連業経理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)、および「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」(平成11年総理府・大蔵省令第32号)に準拠して作成しております。

【重要な会計方針】

1. トレーディング商品に属する有価証券およびデリバティブ取引等の評価基準および評価方法

当社は、有価証券市場における公正な価格形成および円滑な流通を目的としてトレーディングを行っており、保有するトレーディング・ポジションは、顧客の資金運用やリスク・ヘッジなどのニーズに対応する為に行う顧客との取引、自己の計算において行っている取引(ディーリング業務)および市場リスクを中心とした各種リスクを回避する為に行うヘッジ取引から発生しております。

トレーディング商品に属する有価証券およびデリバティブ取引等については、時価法を採用しております。
2. トレーディング関連以外の有価証券の評価基準および評価方法
 - (1) 子会社株式および関連会社株式については、移動平均法による原価法を採用しております。
 - (2) その他有価証券等のうち、時価のあるものについては時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価(移動平均法による原価)ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入法を採用しております。時価のないものについては移動平均法による原価法を採用しております。

なお、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に基づき、持分相当額を純額で取込む方法によっております。
3. 固定資産の減価償却の方法
 - (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く。)については定額法を採用しております。
 - (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なおソフトウェアの耐用年数は社内における利用可能期間(5年～10年)としております。
4. 繰延資産の処理方法

社債発行費については、支出時に全額費用処理しております。
5. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金

貸倒引当金は、貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率に基づき、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することとしております。
 - (2) 賞与引当金

賞与引当金は、従業員等に対する賞与の支払いに備えるため、当社所定の計算方法により算出した支払見積額のうち当期負担分を計上しております。
 - (3) 退職給付引当金

退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務および年金資産の見込額に基づき計上しております。

また、過去勤務債務および数理計算上の差異の費用処理方法は、以下のとおりであります。

過去勤務債務	： その発生年度に一時損益処理
数理計算上の差異	： 各年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌期から費用処理
 - (4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労引当金は、役員および執行役員の退職により支給する退職慰労金に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
6. ヘッジ会計の方法

外貨建営業有価証券等の為替変動リスクをヘッジするための外貨建借入金については時価ヘッジ処理を採用しております。また、借入金の金利変動リスクをヘッジするための金利スワップ取引で、特例処理の要件を満たしているものについては特例処理を採用しております。外貨建貸付金に係る為替変動リスクをヘッジするための通貨スワップ取引で、振当処理の要件を満たしているものについては振当処理を採用しております。
7. 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、税抜方式によっております。

【重要な会計方針の変更】

1. リース取引に関する事項

所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号)および「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号)が平成20年4月1日以後開始する事業年度に係る財務諸表から適用することができることになったため、当期よりこれらの会計基準等を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、原則として、リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとする定率法を採用しております。

なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引について、会計処理の変更による影響額は特別損益として処理する方法によっております。これによる損益に与える影響は軽微であります。

2. 特別法上の準備金に関する事項

従来の証券取引責任準備金および金融先物取引責任準備金につきまして、金融商品取引法の施行に伴い、当期より「金融商品取引責任準備金」として計上する方法に変更しております。この影響により、当期純利益が113百万円増加しております。

3. 劣後債務の支払利息に関する事項

従来、劣後債務に係る支払利息につきましては、「営業外費用」に計上しておりましたが、資金使途の変化の実態をより正確に反映させるため、当期より「金融費用」に計上しております。この変更により、従来と同様の方法によった場合と比べ、営業損失が4,577百万円増加しております。なお経常利益、税引前当期純利益に与える影響はありません。

【注記事項】

(継続企業の前提に関する注記)

該当事項はございません。

(重要な後発事象の注記)

当社と新光証券株式会社は、平成21年3月4日付で、平成21年5月7日を合併効力発生日とする合併契約書を締結しておりましたが、平成21年4月3日の臨時株主総会において、本合併契約の承認を得ております。

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額	(前期)	(当期)
	9,266 百万円	11,663 百万円

2. 劣後債務

社債(一年以内償還社債を含む。)、短期借入金、長期借入金および関係会社長期借入金には「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)第176条に定める以下の劣後債務が含まれております。

	(前期)	(当期)
劣後特約付社債(社債)	40,000 百万円	- 百万円
劣後特約付借入金	236,000 百万円	276,000 百万円
(短期借入金・長期借入金・関係会社長期借入金)		

3. 「貸金業の規制等に関する法律」(昭和58年法律第32号)上の貸付債権残高

	(前期)	(当期)
	2,028 百万円	2,899 百万円

(損益計算書関係)

1. 1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	(前期)	(当期)
	100,935 円 91銭	610 円 66銭

2. 特別損益の内訳

特別利益	(前期)	(当期)
投資有価証券売却益	18,442 百万円	5,340 百万円
金融商品取引責任準備金戻入	- 百万円	611 百万円
移転補償金	- 百万円	161 百万円
貸倒引当金戻入	0 百万円	3 百万円
その他の	9 百万円	5 百万円

特別損失	(前期)	(当期)
固定資産除却損	662 百万円	207 百万円
リース資産売却損	- 百万円	40 百万円
投資有価証券売却損	- 百万円	1,076 百万円
投資有価証券評価損	4,535 百万円	3,138 百万円
投資有価証券清算損	8 百万円	- 百万円
子会社株式評価損	431,011 百万円	- 百万円
減損損失	4 百万円	- 百万円
ゴルフ会員権評価損	5 百万円	10 百万円
合併関連費用	2,847 百万円	2,439 百万円
希望退職に係る特別退職金	- 百万円	1,874 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

自己株式の種類および株式数に関する事項

前期末および当期末において、自己株式の保有はございません。

【決算資料(個別)】

1. 手数料収入

(1) 科目別内訳

(単位:百万円)

	前 期	当 期	前 期 比 (%)
委 託 手 数 料	6,274	4,264	68.0%
(株 券 等)	(5,823)	(4,065)	(69.8%)
(債 券 等)	(431)	(186)	(43.2%)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	14,725	10,869	73.8%
(株 券 等)	(4,537)	(3,208)	(70.7%)
(債 券 等)	(9,284)	(7,405)	(79.8%)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	2,145	513	23.9%
(株 券 等)	(866)	(95)	(11.0%)
(債 券 等)	(371)	(39)	(10.6%)
(受 益 証 券)	(500)	(87)	(17.6%)
その他の受入手数料	36,668	25,890	70.6%
合 計	59,813	41,538	69.4%

(2) 商品別内訳

(単位:百万円)

	前 期	当 期	前 期 比 (%)
株 券 等	13,976	9,306	66.6%
債 券 等	18,108	11,779	65.1%
受 益 証 券	4,968	2,212	44.5%
そ の 他	22,759	18,238	80.1%
合 計	59,813	41,538	69.4%

2. トレーディング損益

(単位:百万円)

	前 期	当 期	前 期 比 (%)
株 券 等 トレーディング損益	12,362	18,018	-
債 券 等 トレーディング損益	26,813	119,101	-
その他のトレーディング損益	12,783	86,073	-
(うち外国通貨に係る取引)	(13,737)	(82,640)	(-)
合 計	26,393	15,010	-

3. 自己資本規制比率

(単位:百万円)

		前 期 末	当 期 末
基本的項目	(A)	325,742	329,252
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	409	472
	金融商品取引責任準備金等	2,027	1,416
	一般貸倒引当金	4	0
	長期劣後債務	153,000	153,000
	短期劣後債務	123,000	123,000
	計	(B) 278,441	276,945
控除資産	(C)	228,333	233,854
控除後自己資本	(A) + (B) - (C)	(D) 375,849	372,343
リスク相当額	市場リスク相当額	90,833	70,482
	取引先リスク相当額	21,171	39,119
	基礎的リスク相当額	28,802	26,577
	計	(E) 140,808	136,180
自己資本規制比率	(D)/(E)	266.9%	273.4%

(注) 1. 市場リスク相当額の算出に関しては、内部管理モデル方式を用いております。

2. 当期末の長期・短期劣後債務の内訳は以下の通りです。

(単位:百万円)

	発行日・借入日	償還・弁済期日	金 額	区 分	備 考	
劣後特約付借入金	平成17年3月29日	平成27年4月20日	20,000	長期	期限一括弁済	
	平成18年5月30日	平成28年5月30日	10,000	長期	期限一括弁済	
	平成18年5月30日	平成22年3月31日	5,000	短期	分割弁済	
			5,000			
		平成24年3月31日	3,000	長期		
			2,000			
		平成25年3月31日	6,000	短期		最終弁済
			9,000			
	平成18年9月28日	平成22年9月28日	5,000	短期	分割弁済	
			5,000			
		平成24年9月28日	2,000	長期		
			3,000			
		平成25年9月28日	3,000	短期		最終弁済
			12,000			
	平成19年1月31日	平成23年1月31日	5,000	短期	分割弁済	
			5,000			
		平成25年1月31日	2,000	長期		
			3,000			
		平成26年1月31日	3,000	短期		最終弁済
			12,000			
	平成19年7月20日	平成23年7月20日	5,000	短期	分割弁済	
			5,000			
		平成25年7月20日	1,000	長期		
			4,000			
平成20年3月28日	平成25年4月28日	2,000	短期	分割弁済		
		8,000				
		10,000				
平成20年3月28日	平成25年2月28日	10,000	短期	分割弁済		
		15,000				
平成20年9月30日	平成24年9月28日	15,000	短期	期限一括弁済		
平成20年9月30日	平成26年9月30日	15,000	長期	期限一括弁済		
平成21年3月19日	平成23年9月30日	21,000	短期	期限一括弁済		
長期劣後債務計			153,000			
短期劣後債務計			123,000			

(参考資料)

損益計算書の四半期推移

(単位:百万円)

科 目	前年度 第4四半期	当年度 第1四半期	当年度 第2四半期	当年度 第3四半期	当年度 第4四半期
	(20.1.1 20.3.31)	(20.4.1 20.6.30)	(20.7.1 20.9.30)	(20.10.1 20.12.31)	(21.1.1 21.3.31)
営 業 収 益	9,460	33,739	24,003	32,154	18,230
受 入 手 数 料	18,074	9,427	11,239	9,632	11,238
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	29,496	10,977	2,631	10,673	4,009
営 業 有 価 証 券 等 損 益	2,220	474	742	709	638
金 融 収 益	18,662	12,858	16,137	12,557	11,640
金 融 費 用	13,122	11,595	11,358	11,645	9,022
純営業収益又は純営業損失()	3,661	22,143	12,644	20,508	9,208
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	19,986	18,125	17,412	16,144	16,526
取 引 関 係 費	4,544	3,504	3,642	3,319	3,036
人 件 費	7,006	7,290	5,571	6,303	6,515
不 動 産 関 係 費	4,197	3,888	3,557	3,206	3,184
事 務 費	1,244	785	1,069	637	959
減 価 償 却 費	1,740	1,729	1,543	1,673	1,688
の れ ん 償 却 額	15	-	-	-	-
租 税 公 課	697	360	466	549	257
そ の 他	541	567	1,561	453	885
営業利益又は営業損失()	23,648	4,018	4,767	4,363	7,318
営 業 外 収 益	923	3,582	309	423	4,987
営 業 外 費 用	2,125	1	6	20	0
経常利益又は経常損失()	24,850	7,599	4,464	4,766	2,331
特 別 利 益	83	1,210	162	10	4,738
特 別 損 失	247,047	3,055	238	238	5,255
税引前四半期純利益又は 税引前四半期純損失()	271,813	5,755	4,540	4,539	2,848
法人税、住民税及び事業税	116	29	206	1	14
法人税等調整額	8,591	2,359	2,795	1,688	2,681
四半期純利益又は四半期純損失()	263,106	3,366	1,951	2,848	181

〔ご参考〕証券化商品の状況（みずほ証券（含む海外現法）分）

1. 外貨建て証券化商品の状況

（単位：億円、概数）

〔管理会計ベース〕

◆みずほ証券（含む海外現法）…トレーディング勘定

	H20/3末	H20/3末	H21/3末	H21/3末	H20年度累計 実現損益
	残高	マーク率	残高	マーク率	
	(時価)	(時価÷額面)	(時価)	(時価÷額面)	(H20/4～ H21/3)
1 外貨建て証券化商品	1,050	22	*1 390	12	△120
2 ABSCDO、CDO	500	18	60	2	△60
3 RMBSを裏付資産とするもの	240	10	*2 60	2	△60
4 非投資適格先とのCDSによるヘッジ分	*3 110	*3 17	*3 -	*3 -	*3 -
5 その他のCDO	*4,5 260	*5 83	*5 -	*5 -	*5 0
6 事業法人向け債権を裏付資産とするもの	160	92	-	-	-
7 非投資適格先とのCDSによるヘッジ分	*3 -	*3 -	*3 -	*3 -	*3 -
8 CMBSを裏付資産とするもの	0	8	-	-	0
9 RMBS	530	27	10	1	△10
10 米国サブプライムRMBS	150	31	0	2	△0
11 上記以外のRMBS (ミッドプライムローン、プライムローン等を裏付資産とするもの)	*6 380	*6 26	*6 10	*6 1	*6 △10
12 ミッドプライムローン(Alt-A)	190	26	0	1	
13 ABS、CLO等	20	67	320	79	△50
14 CLO	*5 20	*5 73	*5 240	*5 83	*5 △30
15 CMBS	0	43	0	14	△0
16 SIV関連	-	-	*7 80	72	△20

*1: H20/3 末比増減(約△660 億円)のうち、約△20 億円は為替影響(主として米ドルに対する円高要因)によるもの

*2: 裏付資産に占める米国サブプライム関連資産の比率は約 1 割
時価残高に占める最優先部分(スーパーシニアトランシェ)の比率は約 5 割

*3: 非投資適格先(H20/3 末における外部格付を基準)の米国金融保証会社(モノライン)との間でクレジットデフォルトスワップ(CDS)によりヘッジを行っている部分(引当金控除後)のエクスポージャーを記載(なお当該ヘッジ取引は H20/8 に終了)

*4: 全て一次証券化商品

*5: 区分見直しにより、H20/3 末に項番 5 に計上していたものにつき、第 1 四半期決算資料より項番 14 に計上

*6: 米国政府系機関債・政府支援機関債を除く(なお、当グループが保有するそれらの残高については「その他の関連情報」をご参照)

*7: CDO 組成のため行っていたクレジットデフォルトスワップ(CDS)取引の決済に伴い、担保となっていた SIV 発行のシニア債券の受渡しにより取得したもの

(ご参考) 証券化商品に係るクレジットデフォルトスワップ(CDS)の状況(H21/3 末)

- みずほ証券における証券化商品を参照債権とするクレジットデフォルトスワップ(CDS)^{*1}の想定元本は約 2,980 億円(H20/3 末約 3,660 億円)、参照債権の時価評価額は約 2,080 億円(H20/3 末約 3,020 億円)。差額のうち、ヘッジ先に対する請求可能見積額は約 700 億円(ヘッジ先より当該差額に係るキャッシュ受領済み分(約 200 億円^{*2})を除く)。なお、当該請求可能見積額から引当(約 200 億円)を除いた金額は約 500 億円

(上記 CDS 契約のうち、米国モノライン(H21/3 末現在の外部格付 AA-^{*3})をヘッジ先とする CDS 想定元本は約 270 億円、その参照債権の時価評価額は約 200 億円…いずれも内数)

※1 上記表項番 4 及び 7 に記載のものは除く

※2 外貨キャッシュ相当額を H21/3 末為替レートで換算

※3 格付は H21/3 末における外部格付のうち最も低い格付を基準に分類

- 上記 CDS 契約の過半は、外部格付 AA 格以上の先(H21/3 末現在)をヘッジ先とするものであり、かつ、参照債権は主に事業法人向け債権を裏付資産とするもの

2. その他の関連情報(H21/3 末)

(計数は 10 億円ベースでの概数)

➤ 米国政府系機関債(ジニーメイ)、政府支援機関(GSE)債(ファニーメイ、フレディーマック)(トレーディング勘定)

- 米国政府系機関、GSE による住宅ローン担保証券(RMBS)の保有額は僅少

- 米連邦住宅抵当公社(ファニーメイ)及び米連邦住宅貸付抵当公社(フレディーマック)の発行する社債を、米国市場におけるマーケットメイク目的等で約 380 億円保有、全額時価評価を行っており含み損はなし(H20 年度における実現損益は約△20 億円)

なお、これらの機関の株式は保有せず