

# 業務及び財産の状況に関する説明書

平成19年3月期

自平成18年4月1日 至平成19年3月31日

この説明書は、証券取引法第50条及び金融先物取引法第80条に基づき、全ての営業所に備え置き公衆の縦覧に供するため作成したものです。

# CONTENTS

- I. 当社の概況及び組織に関する事項…………… 1-6
  - 1. 商号
  - 2. 登録年月日
  - 3. 沿革及び経営の組織
  - 4. 株主の氏名又は名称及び所有株式数
  - 5. 取締役及び監査役の氏名及び役職名
  - 6. 本店その他の営業所の名称及び所在地
  - 7. 営んでいる業務の種類
  - 8. 加入している投資者保護基金
  - 9. 加入している証券業協会等
  - 10. 加入している証券取引所等
- II. 業務の状況に関する事項…………… 7-10
  - 1. 営業の概況
  - 2. 業務の状況を示す指標
- III. 財産の状況…………… 11-16
  - 1. 経理の状況
  - 2. 借入金の主な借入先及び借入金額
  - 3. 保有有価証券の状況
  - 4. 先物取引・オプション取引等の状況
  - 5. 有価証券店頭デリバティブ取引の状況
  - 6. 財務諸表に関する監査法人等による監査の有無
- IV. 管理の状況…………… 17-25
  - 1. 内部管理の状況の概要
  - 2. 分別保管の状況
- V. 連結子会社等の状況…………… 26-27
  - 1. 企業集団の構成
  - 2. 主要な子会社等の商号、所在地、資本、事業内容等

# I 当社の概況及び組織に関する事項

## 1. 商号

大和証券エスエムビーシー株式会社

## 2. 登録年月日

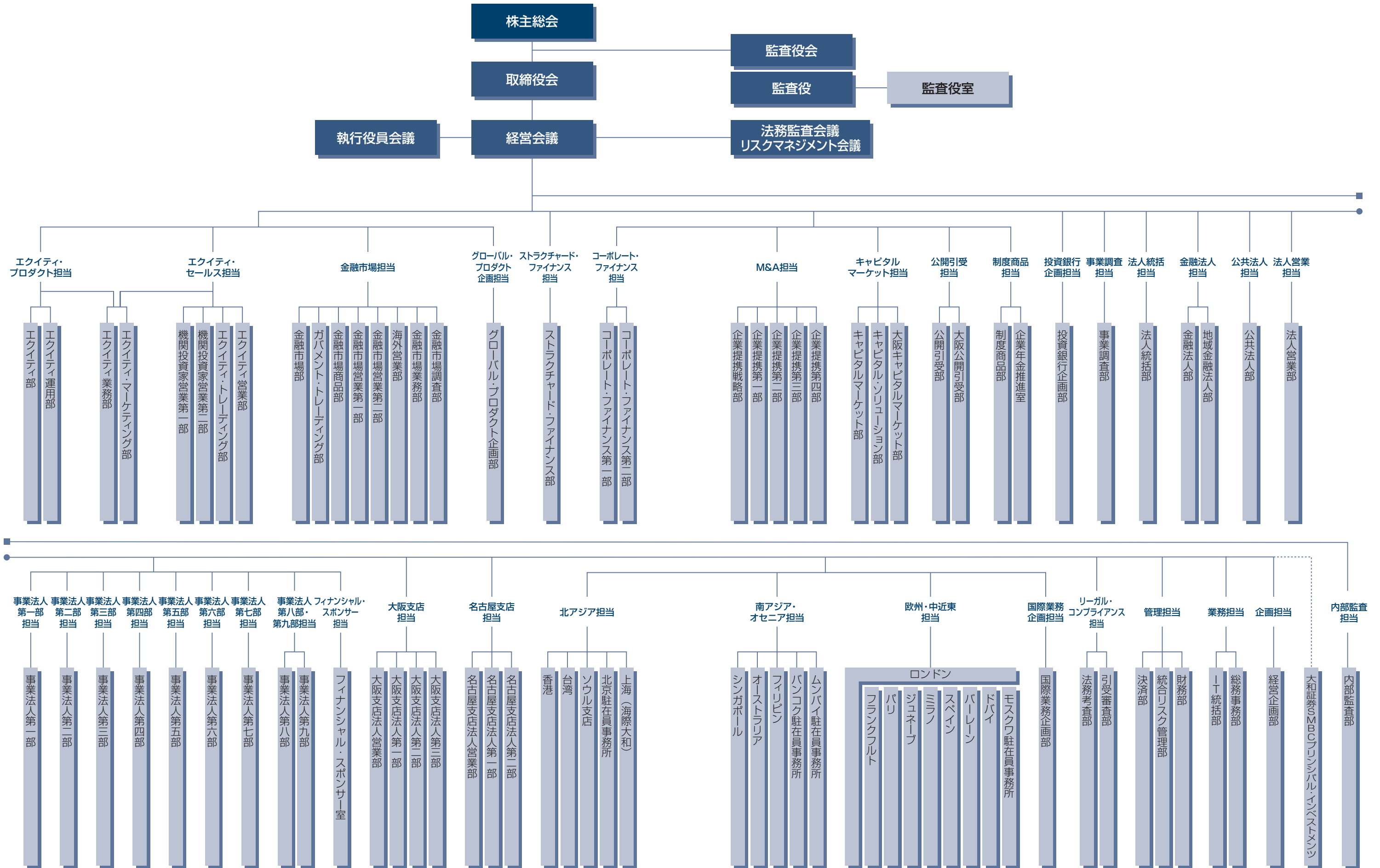
平成11年2月26日 登録番号／関東財務局長(証)第143号  
平成17年7月 1日 登録番号／関東財務局長(金先)第21号

## 3. 沿革及び経営の組織

(1) 会社の沿革

年 月	沿 革
平成11年 4月	大和証券株式会社(現 株式会社大和証券グループ本社)より営業の一部(ホールセール部門)および住友キャピタル証券株式会社より営業の全部を譲受け、大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社として営業開始(東京都中央区八重洲)
平成11年10月	株式会社大和証券グループ本社より欧州・中近東およびアジア・オセアニアの証券関連業務を営む海外現地法人の株式を譲受け、子会社化。
平成12年10月	英国現地法人のスペイン支店(マドリッド)を開設。
平成12年11月	英国現地法人のミラノ支店を開設。
平成13年 4月	さくら証券株式会社の営業譲渡および株式会社さくら銀行のホールセール証券業務の一部統合を受け、「大和証券エスエムビーシー株式会社」に商号変更。
平成13年10月	プライベートエクイティ・不動産・不良債権などへの投資業務を行う100%子会社「大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社」が営業開始。
平成15年11月	本店を東京都千代田区丸の内に移転。 永代を除く都内の営業所を統合。
平成16年11月	上海国際集団有限公司傘下の上海証券と合併証券会社「海際大和証券有限責任公司」を設立し、開業。
平成18年 1月	タイにバンコク駐在員事務所を開設。
平成18年 2月	インドにムンバイ駐在員事務所を開設。
平成19年 4月	ロシアに英国現地法人のモスクワ駐在員事務所を開設。
平成19年 4月	アラブ首長国連邦(UAE)に英国現地法人のドバイ支店を開設。

(2) 経営の組織（平成19年7月2日現在）



#### 4. 株主の氏名又は名称及び所有株式数

(平成19年3月31日現在)

氏名、商号又は名称	持株数	持株割合
1 株式会社 大和証券グループ本社	2,280株	60.0%
2 株式会社 三井住友フィナンシャルグループ	1,520株	40.0%
合 計	3,800株	100.0%

#### 5. 取締役及び監査役の氏名及び役職名

(平成19年6月23日現在)

地位	氏名	担 当
代表取締役社長	吉留 真	
代表取締役副社長	東 俊太郎	内部管理統括責任者 兼 内部監査担当
代表取締役専務取締役	森 郁夫	海外上席担当 兼 国際業務企画担当 兼 大和証券SMBCアジアホールディングB.V.社長
専務取締役	渡辺 秀雄	大和証券SMBCプリンシパル・インベストメンツ(株)代表取締役社長
専務取締役	赤松 和彦	法人営業上席担当 兼 事業法人上席担当 兼 法人統括担当
常務取締役	山口 隆	事業法人第五部担当 兼 事業法人第六部担当 兼 事業法人第七部担当
常務取締役	上田 照章	M&A上席担当 兼 コーポレート・ファイナンス担当 兼 事業調査担当
代表取締役常務取締役	山根 正喜	大阪支店上席担当 兼 大阪支店長
常務取締役	田中 光晴	事業法人第一部担当 兼 事業法人第二部担当
取締役	藤澤 哲史	ストラクチャード・ファイナンス担当 兼 コーポレート・ファイナンス副担当
監査役	富永 繁治	
監査役	大津 悟	
監査役	吉武 文徳	
監査役	永本 芳生	

#### 6. 本店その他の営業所の名称及び所在地

名 称	所 在 地
本店	〒100-8289 東京都千代田区丸の内一丁目8番1号
大阪支店	〒530-8231 大阪府大阪市北区曽根崎新地一丁目13番20号
名古屋支店	〒460-8691 愛知県名古屋市中区錦三丁目15番30号
ソウル支店	大韓民国ソウル市永登浦区汝矣島洞27-3
永代営業所	〒135-0034 東京都江東区永代一丁目14番5号

#### 7. 営んでいる業務の種類

##### (1) 証券業（証券取引法第2条第8項）

- 有価証券の売買、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引又は外国市場証券先物取引
- 有価証券の売買、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引又は外国市場証券先物取引の媒介、取次ぎ又は代理
- 取引所有価証券市場における有価証券の売買、有価証券指数等先物取引又は有価証券オプション取引、外国有価証券市場における有価証券の売買又は外国市場証券先物取引の委託の媒介、取次ぎ又は代理
- 有価証券店頭デリバティブ取引又はこれらの取引の媒介、取次ぎ若しくは代理
- 有価証券等清算取次ぎ
- 有価証券の引受け
- 有価証券の売出し
- 有価証券の募集若しくは売出しの取扱い又は私募の取扱い

##### (2) 証券業付随業務（証券取引法第34条第1項）

業務の種類
有価証券の保護預り業務
口座管理機関として行う振替業
有価証券の貸借業務
信用取引に付随する金銭の貸付け業務
保護預り有価証券担保貸付業務
有価証券に関する顧客の代理業務
公社債払込・元利金払込代理業務
株式事務代理業務
受益証券等に係る収益金、償還金又は解約金の支払に係る代理業務
投資証券等に係る金銭の分配、払戻金又は残余財産の分配に係る代理業務
累積投資契約の締結業務
有価証券に関連する情報の提供又は助言業務
他の証券会社の業務の代理業務
公共料金等の収納代行業務
貸金庫業務
有価証券に関する常任代理業務
累積投資業務に係る代理業務
確定拠出年金の運用の方法の選定に係る勧誘業務

## II 業務の状況に関する事項

### 1. 営業の概況

#### (1) 当社をめぐる経済環境

当期におけるわが国経済は、企業部門の好調さが家計部門へ波及し国内民間需要に支えられて、企業部門、家計部門がバランスよく回復し、順調に回復しております。企業部門の収益構造の改善は著しく、設備投資は増加を続けております。雇用情勢は、厳しさが残るものの、改善傾向がみられ、雇用面で新卒採用および中途での採用の積極化、賃金面では賞与での収益還元を志向する企業の増加が確認されております。その結果、景気は昨年11月にいざなぎ景気を超え戦後最長の景気拡大となり、回復を続けております。

世界経済は、アメリカ経済の減速、原油価格の高騰等の懸念材料はあるものの、前年度から引き継いだ各国・地域の回復が進み、安定的に成長しております。

#### (2) 業界の状況

株式市場においては、日経平均株価は、4月上旬にわが国のファンダメンタルズの良好さと米欧株価の堅調推移を背景に17,500円台まで上昇したものの、5月に入るとコモディティ、新興国市場などで始まった価格調整が主要国の株式市場などに拡大し6月半ばにかけ14,000円近辺まで下落、その後価格調整がやや収まった6月半ば以降年末にかけては、世界経済の持続的な拡大を背景とする好調な企業業績が好感される中、上昇基調を辿っております。年初の日経平均株価は冴えない動きで始まったものの、追加利上げの見送り、円安進行を材料に2月下旬に18,000円台まで上昇、その後2月末の中国株式市場の急落に端を発した世界連鎖株安により大きく下落しましたが、3月末にかけてやや回復いたしました。平成19年3月末の日経平均株価は17,287円となり、年度1年間の騰落率は1.3%となりました。

金融市場においては、年度当初からは景気が着実な回復を続ける中で、長期金利が一時2%近辺まで上昇し、7月のゼロ金利解除以降、年末にかけては市場参加者による先行きの景気・物価見通し、政策金利水準調整に対する見方や、米国長期金利の低下を受けて、長期金利は中長期ゾーンを中心に総じて低下基調を辿りました。1月以降の長期金利は狭いレンジでの動きに終始して、年度末は1.65%となりました。

#### (3) 当社の営業状況

当期の業績は、純営業収益2,019億19百万円(前期比24.2%減)となり、経常利益は709億92百万円(前期比38.9%減)となっております。特別損失に本社移転関連費用の47億40百万円を計上したこと等により、特別損失は60億68百万円となりました。当期純利益は398億69百万円(前期比41.9%減)と減益となりました。

#### 1) 受入手数料

当期の受入手数料合計は926億33百万円(前期比9.6%減)となりました。項目別の内訳は以下のとおりであります。

#### イ) 委託手数料

委託手数料は、株式市場の活況を反映し199億02百万円(前期比6.9%増)と増加いたしました。

#### ロ) 引受け・売出し手数料

引受け・売出し手数料は483億14百万円(前期比17.9%減)と減少いたしました。PO・IPO銘柄の取扱実績が減少したことにより株券等の引受け・売出し手数料は382億35百万円(前期比21.4%減)と減少いたしました。一方、債券等の引受け・売出し手数料は89億26百万円(前期比4.2%増)と増加いたしました。

#### ハ) 募集・売出しの取扱手数料

募集・売出しの取扱手数料は12億48百万円(前期比9.5%減)となりました。主に株券等の募集取扱手数料の減少によるものです。

#### (3) その他業務(証券取引法第34条第2項及び第4項)

業務の種類
金融先物取引法第2条第12項に規定する金融先物取引業
有価証券関連以外のデリバティブ取引
通貨の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
貸金業の規制等に関する法律第2条第1項に規定する貸金業
譲渡性預金の預金証書の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
民法第667条に規定する組合契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務又は商法第535条に規定する匿名組合契約の締結の媒介、取次ぎ又は代理に係る業務
金銭債権の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
貸出参加契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
他の事業者の経営に関する相談に応じる業務
信託契約代理業
信託業法第2条第10項に規定する信託受益権販売業
クレジットデリバティブ取引に関する業務
リミテッド・パートナーシップへの出資、出資の媒介、取次ぎ及び代理に係る業務
顧客紹介業務
不動産売買等に関する顧客紹介業務
国外の商品市場における取引(自己勘定)に係る業務

(注) 平成18年9月19日より「国外の商品市場における取引(自己勘定)に係る業務」を開始いたしました。

### 8. 加入している投資者保護基金

日本投資者保護基金

### 9. 加入している証券業協会等

日本証券業協会

金融先物取引業協会

### 10. 加入している証券取引所等

東京証券取引所(総合取引参加者)

大阪証券取引所(現物及び先物取引等取引参加者)

名古屋証券取引所(総合取引参加者)

ジャスダック証券取引所(取引参加者)

韓国証券先物取引所(決済会員)

東京金融先物取引所

二) その他の受入手数料

その他の受入手数料は231億68百万円(前期比2.1%減)となりました。M&A業務、ファイナンシャル・アドバイザー業務、情報提供・コンサルタント業務等での受入手数料が183億66百万円(前期比3.2%減)と減少したことによるものです。

2) トレーディング損益

当期の株券等トレーディング損益は172億98百万円(前期比83.3%減)と大幅に減少いたしました。一方で、債券等及び為替等のトレーディング損益合計は859億72百万円(前期比51.1%増)となっております。トレーディング損益の合計は1,032億71百万円(前期比35.7%減)と減少いたしました。

3) 金融収支

当期の金融収益は448億04百万円、また金融費用は387億89百万円で、金融収益から金融費用を差し引いた金融収支は60億14百万円(前期比73.2%増)となりました。

4) 販売費・一般管理費

当期の販売費・一般管理費は、取引関係費が731億56百万円(前期比7.1%減)、人件費が300億42百万円(前期比2.9%減)、不動産関係費が110億57百万円(前期比0.6%減)、事務費が163億55百万円(前期比4.1%増)、減価償却費が105億44百万円(前期比5.8%減)となり、合計では1,461億03百万円(前期比4.5%減)となりました。

(4) 当期の損益の状況

以上の状況から、当期は営業収益2,407億09百万円となり、これから金融費用を差し引いた純営業収益は2,019億19百万円となりました。これから販売費・一般管理費を差し引いた営業利益は558億15百万円、経常利益は709億92百万円となりました。特別損益は△60億68百万円となりました。当期純利益は398億69百万円となりました。

(5) 金融先物取引業の業務の状況

1) 業務の概要

委託取引は、取引数量ゼロとなりました。自己取引においては、日銀の2回の金融政策変更により、ヘッジ・ニーズも高まり、ユーロ円短期金利先物の取引量は、大幅に増加しました。

2) 受入手数料の内訳

受入手数料はありませんでした。

3) 自己取引に係る損益の内訳

自己取引に係る取引所取引に関する損益の内訳は下記の通りです。

(単位：百万円)

金融先物取引 にかかる損益	取引所	
	国内	海外
平成17年3月期	△184	199
平成18年3月期	170	△248
平成19年3月期	△893	△78

2. 業務の状況を示す指標

(1) 経営成績等の推移

(単位：百万円)

	平成17年3月期	平成18年3月期	平成19年3月期
資本金	205,600	205,600	255,700
発行済株式総数	3,200株	3,200株	3,800株
営業収益	203,609	292,446	240,709
(受入手数料)	( 80,288 )	(102,488 )	( 92,633 )
((委託手数料))	(( 13,887 ))	(( 18,611 ))	(( 19,902 ))
((引受け・売出し手数料))	(( 45,775 ))	(( 58,830 ))	(( 48,314 ))
((募集・売出し取扱手数料))	(( 1,013 ))	(( 1,379 ))	(( 1,248 ))
((その他の受入手数料))	(( 19,612 ))	(( 23,666 ))	(( 23,168 ))
(トレーディング損益)	(105,927 )	(160,488 )	(103,271 )
((株券等トレーディング損益))	(( 45,072 ))	((103,599 ))	(( 17,298 ))
((債券等トレーディング損益))	(( 42,051 ))	(( 20,249 ))	(( 30,967 ))
((その他のトレーディング損益))	(( 18,803 ))	(( 36,639 ))	(( 55,004 ))
純営業収益	185,373	266,449	201,919
経常利益	73,781	116,180	70,992
当期純利益	46,514	68,616	39,869

(2) 有価証券引受・売買等の状況

①株券売買高の推移(先物取引を除く)

(単位：百万円)

	自己	委託	計
平成17年3月期	31,564,906	22,677,168	54,242,074
平成18年3月期	42,581,383	31,789,288	74,370,671
平成19年3月期	51,524,285	36,593,107	88,117,392

②有価証券引受け・売出し及び募集・売出し又は私募の取扱高

(単位：百万円)

株券	引受高	売出高	募集取扱高	売出取扱高	私募取扱高
平成17年3月期	845,390	845,377	—	20	15,253
平成18年3月期	1,331,498	1,306,054	—	25	16,346
平成19年3月期	956,356	955,132	4,034	37	29,408

(単位：百万円)

債券	引受高	売出高	募集取扱高	売出取扱高	私募取扱高
平成17年3月期	国債	1,490,365	—	1,484,265	—
	社債	1,431,290	—	1,201,876	—
平成18年3月期	国債	3,472,653	—	3,467,154	—
	社債	1,552,250	—	1,240,251	—
平成19年3月期	国債	—	—	—	—
	社債	1,643,650	—	1,323,364	—

(単位：百万円)

受益証券	引受高	売出高	募集取扱高	私募取扱高
平成17年3月期	—	—	360,374	267,837
平成18年3月期	9,551	—	282,020	604,312
平成19年3月期	—	—	287,075	393,571

### III 財産の状況

#### 1. 経理の状況

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

資産の部			負債の部		
科目	前期 (18.3.31)	当期 (19.3.31)	科目	前期 (18.3.31)	当期 (19.3.31)
流動資産	10,658,663	9,190,900	流動負債	9,543,458	7,843,373
現金・預金	71,980	52,658	トレーディング商品	4,622,071	3,535,328
預託金	75,165	30,043	商品有価証券等	3,066,728	2,838,818
トレーディング商品	5,686,385	4,364,842	デリバティブ取引	1,555,342	696,509
商品有価証券等	4,018,917	3,511,488	約定見返勘定	195,318	—
デリバティブ取引	1,667,467	853,353	信用取引負債	176,268	201,105
約定見返勘定	—	9,784	信用取引借入金	—	22
信用取引資産	205,935	241,058	信用取引貸証券受入金	176,268	201,082
信用取引貸付金	3,535	7,570	有価証券担保借入金	2,632,402	2,383,944
信用取引借証券担保金	202,399	233,488	有価証券貸借取引受入金	1,760,389	1,598,568
有価証券担保貸付金	4,303,263	4,067,408	現先取引借入金	872,013	785,375
借入有価証券担保金	3,738,214	3,690,354	預り金	18,891	17,604
現先取引貸付金	565,049	377,053	受入保証金	22,139	17,841
短期差入保証金	30,809	31,781	短期借入金	1,466,299	1,313,049
短期貸付金	242,753	361,580	コマーシャル・ペーパー	234,210	301,500
未収収益	9,827	9,483	一年以内償還社債	79,606	25,912
繰延税金資産	7,520	2,552	未払費用	14,589	14,981
その他の流動資産	25,268	19,931	未払法人税等	55,013	239
貸倒引当金	△248	△226	その他の流動負債	26,649	31,867
固定資産	106,517	128,605	固定負債	750,822	894,968
有形固定資産	3,836	3,796	社債	581,153	727,473
無形固定資産	29,275	39,529	長期借入金	165,000	158,500
投資その他の資産	73,405	85,279	退職給付引当金	4,194	4,446
投資有価証券	62,698	64,373	本社移転関連費用引当金	—	4,200
長期貸付金	2,577	10,618	その他の固定負債	474	349
長期差入保証金	5,062	5,009	特別法上の準備金	5,177	5,365
繰延税金資産	1,072	3,391	証券取引責任準備金	5,177	5,365
その他	2,501	2,397	金融先物取引責任準備金	0	0
貸倒引当金	△507	△511	負債合計	10,299,459	8,743,707
資産合計	10,765,181	9,319,505	資本の部		
			資本金	205,600	—
			資本剰余金	117,321	—
			資本準備金	117,321	—
			利益剰余金	140,849	—
			任意積立金	39,381	—
			当期末処分利益	101,468	—
			その他有価証券評価差額金	1,951	—
			資本合計	465,721	—
			負債・資本合計	10,765,181	—
			純資産の部		
			株主資本	—	574,067
			資本金	—	255,700
			資本剰余金	—	167,421
			資本準備金	—	167,421
			利益剰余金	—	150,946
			その他利益剰余金	—	150,946
			任意積立金	—	38,639
			別途積立金	—	38,000
			特別償却準備金	—	639
			繰越利益剰余金	—	112,306
			評価・換算差額等	—	1,730
			その他有価証券評価差額金	—	1,730
			純資産合計	—	575,797
			負債・純資産合計	—	9,319,505

(単位：百万円)

その他	引受高	売出高	募集取扱高	売出取扱高	私募集扱高
平成17年3月期	1,583,040	—	—	—	1,546,343
平成18年3月期	1,854,626	—	—	—	1,915,371
平成19年3月期	1,407,827	—	—	—	1,454,949

#### (3) その他業務の状況

##### ① 有価証券の保護預り業務

区分	株	債	債券	受益証券	その他	
平成17年3月期	国内有価証券	千株	百万円	百万円	新株予約権証券 コマーシャル・ペーパー	19千証券 182,420百万円
	外国有価証券	1,511,448	6,264,141	7,132	新株予約権証券	0千証券
平成18年3月期	国内有価証券	千株	百万円	百万円	新株予約権証券 コマーシャル・ペーパー	16千証券 28,900百万円
	外国有価証券	1,516,441	6,570,622	4,214	新株予約権証券	11千証券
平成19年3月期	国内有価証券	千株	百万円	百万円	新株予約権証券 コマーシャル・ペーパー	41千証券 6,000百万円
	外国有価証券	1,655,488	6,729,306	1,724	新株予約権証券	9,450千証券

(注) 国内有価証券(株券)には市場性のない株式を含んでおります。

##### ② 有価証券の貸借業務

	株	債	債券
平成17年3月期	千株	百万円	百万円
	1,711,364	422,679,863	
平成18年3月期	千株	百万円	百万円
	1,089,674	477,855,539	
平成19年3月期	千株	百万円	百万円
	777,017	538,891,655	

#### (4) 自己資本規制比率の状況

(単位：百万円)

	平成17年3月期	平成18年3月期	平成19年3月期	
基本的項目	資本合計 (A)	395,154	433,997	548,113
	その他有価証券評価差額金(評価益)等	2,416	1,951	1,730
	特別法上の準備金	4,351	5,177	5,365
補完的項目	一般貸倒引当金	40	248	226
	劣後債務	210,000	210,000	210,000
	計 (B)	216,809	217,376	217,322
控除資産	(C)	246,528	196,125	126,881
固定化されていない自己資本の額 (A) + (B) - (C)	(D)	365,434	455,248	638,553
リスク相当額				
	市場リスク相当額	52,530	67,251	59,041
	取引先リスク相当額	26,225	39,111	43,408
	基礎的リスク相当額	24,040	29,071	34,775
	計 (E)	102,797	135,433	137,225
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 (%)		355.4%	336.1%	465.3%

#### (5) 役員・使用人の総数及び外務員の総数

区分	平成17年3月期	平成18年3月期	平成19年3月期
役員	14人	14人	14人
使用人	1,738人	1,818人	1,855人
合計	1,752人	1,832人	1,869人
うち外務員(証券業)	1,376人	1,431人	1,448人
うち外務員(金融先物取引業)	—	450人	479人

## (2) 損益計算書

(単位：百万円)

科 目	前期	当期
	(17. 4. 1~ 18. 3.31)	(18. 4. 1~ 19. 3.31)
営業収益	292,446	240,709
受入手数料	102,488	92,633
トレーディング損益	160,488	103,271
金融収益	29,470	44,804
金融費用	25,997	38,789
純営業収益	266,449	201,919
販売費・一般管理費	152,975	146,103
取引関係費	78,731	73,156
人件費	30,928	30,042
不動産関係費	11,119	11,057
事務費	15,713	16,355
減価償却費	11,191	10,544
租税公課	3,329	2,742
その他	1,961	2,205
営業利益	113,473	55,815
営業外収益	3,078	15,970
営業外費用	372	793
経常利益	116,180	70,992
特別利益	3,568	—
特別損失	1,422	6,068
税引前当期純利益	118,325	64,924
法人税、住民税及び事業税	53,007	22,253
法人税等調整額	△3,298	2,800
当期純利益	68,616	39,869
前期繰越利益	32,851	—
当期末処分利益	101,468	—

## (3) 株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

項 目	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計		
		資本準備金	その他利益剰余金							利益剰余金 合計
			任意積立金	繰越利益 剰余金	繰越利益 剰余金					
別途 積立金	特別償却 準備金	繰越利益 剰余金	繰越利益 剰余金	繰越利益 剰余金						
平成18年3月31日残高	205,600	117,321	38,000	1,381	101,468	140,849	463,770	1,951	1,951	465,721
当期変動額										
新株の発行	50,100	50,100	—	—	—	—	100,200	—	—	100,200
剰余金の配当	—	—	—	—	△28,800	△28,800	△28,800	—	—	△28,800
取締役賞与	—	—	—	—	△973	△973	△973	—	—	△973
当期純利益	—	—	—	—	39,869	39,869	39,869	—	—	39,869
特別償却準備金の取崩	—	—	—	△741	741	—	—	—	—	—
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	—	—	—	—	—	—	—	△220	△220	△220
当期変動額合計	50,100	50,100	—	△741	10,838	10,096	110,296	△220	△220	110,075
平成19年3月31日残高	255,700	167,421	38,000	639	112,306	150,946	574,067	1,730	1,730	575,797

## 〈参考〉利益処分計算書

(単位：百万円)

区 分	平成18年3月期
当期末処分利益	101,468
特別償却準備金取崩額	370
計	101,839
利益処分額	29,773
配当金	28,800
取締役賞与金	973
次期繰越利益	72,065

## 〔財務諸表の作成について〕

当社の貸借対照表及び損益計算書は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)の規定のほか、「証券会社に関する内閣府令」(平成10年総理府令・大蔵省令第32号)、及び「証券業經理の統一について」(昭和49年11月14日付日本証券業協会理事会決議)に準拠して作成しております。

なお、記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## 〔重要な会計方針〕

### 1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) トレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引等については、時価法で計上しております。なお、トレーディング商品とは、トレーディング目的の金融商品をいい、当社が所有する売買目的有価証券及び売買目的有価証券に準ずる金融商品並びにデリバティブ取引(ヘッジ取引を除く)であります。

(2) トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及び評価方法

① 子会社株式及び関連会社株式については、移動平均法による原価法によっております。

② その他有価証券等のうち、時価のあるものについては決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法に基づく原価法で計上しております。

ただし、時価のないものうち、平成16年の証券取引法の改正により有価証券としてみなされることとなった投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資は、組合等の営業により獲得した損益の持分相当額を当期の損益として計上し、組合等の保有する有価証券の評価差額のうち持分相当額を全部純資産直入法により計上しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。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)については定額法によっております。なお、耐用年数については、法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

(2) 無形固定資産、投資その他の資産

定額法を採用しております。なお、耐用年数については、法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

### 3. 重要な引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

(2) 賞与引当金

役職員に対する賞与の支払いに備えるため、当社所定の計算基準による支払見積額の当期負担分を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく期末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。

(4) 本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する費用に備えるため、合理的な見積額を計上しております。

### 4. リース取引の処理方法

リース物件の所有権が借主に移転されると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。

5. その他の重要な事項

(1) 消費税等の会計処理方法

消費税及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

連結納税制度を適用しております。

6. 会計方針の変更

(1) 貸借対照表の「純資産の部」の表示

当期より「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」(企業会計基準第5号)及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」(企業会計基準適用指針第8号)を適用しております。従来の基準に従った資本の部の合計に相当する金額は575,797百万円であります。

(2) 取締役賞与の会計処理

当期より「役員賞与に関する会計基準」(企業会計基準第4号)を適用しております。これにより、従来、株主総会決議時に利益剰余金の減少として会計処理していた取締役賞与を当期より発生時に費用として計上しております。この結果、従来の方法と比較して、営業利益、経常利益及び税引前当期利益はそれぞれ588百万円減少しております。

## 〔注記事項〕

### 貸借対照表関係

	(当 期)	(前 期)
(1) 有形固定資産の減価償却累計額	9,098百万円	9,803百万円
(2) 保証債務	5,292百万円	25,364百万円
(3) 株式会社大和証券グループ本社からの借入金(長期90,000百万円、短期18,000百万円)、株式会社三井住友銀行からの借入金(長期60,000百万円、短期12,000百万円)及び住友信託銀行株式会社からの借入金(短期30,000百万円)は「証券会社の自己資本規制に関する内閣府令」(平成13年内閣府令第23号)第2条に定める劣後債務(劣後特約付借入金)であります。		

### 損益計算書関係

特別損益の内訳	(当 期)	(前 期)
特別利益		
投資有価証券売却益	-百万円	3,568百万円
特別損失		
投資有価証券評価減	667百万円	378百万円
固定資産評価損	-百万円	14百万円
固定資産除却損	209百万円	-百万円
投資有価証券売却損	262百万円	3百万円
証券取引責任準備金繰入	188百万円	826百万円
証券市場基盤整備基金拠出金	-百万円	200百万円
本社移転関連費用	4,740百万円	-百万円

2. 借入金の主な借入先及び借入金額

	借入先	借入金の種類	借入金残高
平成18年3月31期	日本銀行	短期借入金 (注1)	1,045,300百万円
	株式会社三井住友銀行	短期借入金	2,349百万円
		短期借入金 (注2)	50,000百万円
		短期借入金 (注3,4)	20,000百万円
		長期借入金 (注3)	52,000百万円
	株式会社大和証券グループ本社	短期借入金 (注3,4)	30,000百万円
		長期借入金 (注3)	78,000百万円
	株式会社整理回収機構	短期借入金 (注2)	100,000百万円
日本郵政公社簡易保険事業本部	短期借入金 (注2)	53,800百万円	
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	短期借入金 (注2)	50,000百万円	
住友信託銀行株式会社	長期借入金 (注3)	30,000百万円	
平成19年3月31期	日本銀行	短期借入金 (注1)	553,300百万円
	株式会社三井住友銀行	短期借入金	10,565百万円
		短期借入金 (注2)	30,000百万円
		短期借入金 (注3)	12,000百万円
		長期借入金 (注3)	60,000百万円
	株式会社大和証券グループ本社	短期借入金 (注3)	18,000百万円
		長期借入金 (注3)	90,000百万円
	全国共済農業協同組合連合会	短期借入金 (注2)	100,000百万円
株式会社京都銀行	短期借入金 (注2)	80,000百万円	
城南信用金庫	短期借入金 (注2)	79,000百万円	
株式会社整理回収機構	短期借入金 (注2)	52,400百万円	

(注) 1. 共通担保資金供給オペレーションによるものであります。  
 2. コールマネーによる借入であります。  
 3. 「証券会社の自己資本規制に関する内閣府令」(平成13年内閣府令第23号) 第2条に定める劣後債務(劣後特約付借入金)であります。

3. 保有有価証券の状況

トレーディングに係るもの以外

(単位:百万円)

種類	平成18年3月期 (18.3.31)			平成19年3月期 (19.3.31)		
	取得価額	時価	評価損益	取得価額	時価	評価損益
固定資産に属するもの						
株式	2,788	4,670	1,882	2,181	5,032	2,850
債券	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—
合計	2,788	4,670	1,882	2,181	5,032	2,850

(注) 1. 時価等の算定方法  
 上場有価証券……………主たる証券取引所の最終価格  
 2. 開示対象から除いた有価証券の貸借対照表計上額  
 固定資産に属するもの  
 株式 [非上場株式] 平成18年3月期 49,107 平成19年3月期 50,839 (百万円)  
 受益証券 3,524 3,541 (百万円)  
 その他 [投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資] 5,396 4,960 (百万円)

4. 先物取引・オプション取引等の状況

当社のトレーディングに係るもの以外の先物取引・オプション取引等の該当はありません。

5. 有価証券店頭デリバティブ取引の状況

当社のトレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引の該当はありません。

6. 財務諸表に関する監査法人等による監査の有無

当社は、会社法第436条第2項第1号の規定に基づき、会社法第435条第2項で定められた計算書類(貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書及び個別注記表)及びその附属明細書について会計監査人による監査を受けております。

1. 内部管理の状況の概要

(1) 内部管理の状況の概要

当社は、証券市場の仲介者として社会的責任を認識し、法令等遵守及び内部管理体制の確立を経営の最重要課題の一つとして位置づけ、その実践に取り組んでおります。当社の内部管理体制の概要図は、次頁のとおりです。経営会議の分科会である法務監査会議は、コンプライアンス・内部監査に関する全般的方針、具体的施策等について審議、決定、承認等を行います。各部署では、日常業務の中で法令等諸規則の遵守状況を営業責任者、内部管理責任者、内部管理者が常時監視するとともに、これらの監視が有効に機能しているかどうかを検証するために部内検査を実施しております。法務審査部は、法令違反の未然予防重視の観点からコンプライアンスに関する事前相談、指導、モニタリング及びコンプライアンスに関する研修等を行っております。又、内部監査部は、内部管理態勢の適切性・有効性等を検証する観点から監査計画を立案し、部署別監査、項目別監査等を行っております。当社のコンプライアンスに関する具体的な施策は、毎年アクションプランとしてコンプライアンス・プログラムを策定し、これらを実践することで法令遵守の徹底と内部管理体制の強化に取り組んでおります。

各組織等の概要は次のとおりです。

①法務監査会議

経営会議の分科会として、取締役社長が、原則として隔月毎に招集し、当社における法令等の遵守、企業倫理の確立、内部管理等に係る事項に関して、取締役会に付議提案すべき事項並びに全般的方針、具体的施策等について審議・決定及び承認を行っております。

②内部管理統括責任者・内部管理統括補助責任者

内部管理統括責任者は、証券業協会規則に基づき代表取締役が就き、法令遵守の徹底を図るべく、内部管理体制の整備と内部管理責任者等の指揮・監督を行っております。又、内部管理統括補助責任者は内部管理統括責任者の職務を輔佐します。

③法務審査部

法令遵守の統括部署として、以下の機能を担います。

- 企画課……………コンプライアンス研修計画や社内規程の見直し等、法令違反・事故等を防止するために必要な具体的施策を全社的観点から企画立案しております。
- 法務審査課……………主に投資銀行業務、エクイティ・債券等の商品に関する業務、営業に関する業務等の業務執行に関して、法令諸規則等における相談、法的判断についての的確なアドバイスを行っております。又、コンプライアンスに関して、営業員、内部管理責任者等への教育・指導等を行っております。
- 取引審査課……………取引価格のチェック、不公正取引等の監視、インサイダー情報等の情報管理、外部機関への報告等を行っております。

④内部監査部

国内の部室及び海外拠点に対し、内部管理態勢の適切性・有効性を検証し、法令違反・事故等の早期発見、監査結果に基づく内部管理態勢等の改善指導を行っております。また、海外拠点に対する監査では、関連する国内部室からのコントロール機能の発揮状況についても検証を行っております。

⑤営業責任者・内部管理責任者・内部管理者

各営業部店に、証券業協会規則に基づく「営業責任者・内部管理責任者」を置き、営業活動、お客様の管理等に際して、日々の業務が法令等に準拠し適切に遂行されているかを常時監視しております。又、非営業部店には、「内部管理者」を置き、一般法令に違反する行為の有無を監視しております。



#### (4) 株券等の配分に係る基本方針

##### 基本理念

当社は、引受活動を通じ、企業等の資金調達と投資家の資金運用ニーズに的確に応えるとともに、証券の流通促進を図り、証券市場の拡大・発展に寄与していくことが当社の使命であると認識し、業務を遂行しております。

株券等の募集・売出し及びその取扱いを行うに当りましては、特定のお客様に過度に集中すること等のないようバランスに十分配慮し公正な配分を原則としております。

##### 具体的配分方針

当社が株券等の募集・売出し及びその取扱いを行う場合は、原則として需要積上げ（ブックビルディング）方式を実施することでお客様の需要を的確に把握するとともに、お客様の属性についても十分勘案した上で次の方針により配分を行っております。

##### 1) 配分の原則

新規公開及びそれ以外の株券等の配分につきましては、お客様の運用ニーズに則した商品を販売することを大前提とし、次に掲げる事項を総合的に勘案し配分することとしております。

- ①お客様の需要申告の内容等
- ②お客様の需要積上げに対する参加の積極性
- ③お客様の資産状況、リスクの認識度、投資経験・知識、投資方針
- ④お客様の当社との取引状況

当社は配分を決定するに当り、上記の事項を総合的に勘案し配分を決定する結果、ブックビルディングに需要申告されていないお客様にも配分を行う場合があります。

なお、当社はホールセール業務に特化し営業を行っておりますので、同一条件の下に全社で一括して行う抽選による配分の方法は、原則として採用しておりません。

##### 2) 上記原則に準拠しない場合

引受額が少なく、広く販売することが困難な場合や商品性、法令・諸規則からの制約がある場合には、配分先のお客様を限定あるいは一件当りの株数（金額）の上・下限を設定させていただく場合があります。

##### 公正な配分の遵守

当社は、上記の配分方針の他、配分のあり方について以下の事項を社内規則に明記し公正な配分に努める所存であります。

- 1) お客様の損失を補填し又は利益を追加する目的での株券等の配分を行わない等、証券取引法や自主規制機関の規則を遵守すること
- 2) ①発行会社が指定する者、②当社の役職員、③当社に対して特定の利便を与える等、社会的に不公平感を生じせしめる者、④暴力団員及び暴力団関係者、いわゆる総会屋等社会的公益に反する行為をなす者への配分を行わないこと（需要申告及び配分の申込みがこれらに該当するお客様からのものであることが判明した場合、その申告又は申込みはお受けいたしません）
- 3) 同一のお客様への過度な集中配分を行わないこと
- 4) 他の商品の購入を条件に新規公開株の配分を行う等の不公正な配分を行わないこと

##### ご参考

需要申告の受付期間、受付方法、仮条件等、各個別案件における具体的なブックビルディングの要領については、各案件の発行会社が作成する目論見書をご覧ください。

#### (5) 最良執行方針

この最良執行方針は、証券取引法第43条の2第1項の規定に従い、お客様にとって最良の取引の条件で執行するための方針及び方法を定めたものです。

当社では、お客様から国内の証券取引所市場に上場されている有価証券の注文を受託した際に、お客様から取引の執行に関するご指示がない場合につきましては、以下の方針に従い執行することに努めます。

##### 1) 対象となる有価証券

- (1) 国内の証券取引所市場に上場されている株券、新株予約権付社債券、ETF（株価指数連動型投資信託受益証券）、REIT（不動産投資信託の投資証券）等、証券取引法施行令第16条の2に規定される「上場株券等」
- (2) グリーンシート銘柄である株券、新株予約権付社債券等、証券取引法第40条第1項第1号に規定される「取扱有価証券」

##### 2) 最良の取引の条件で執行するための方法

当社においては、お客様からいただいた注文に対し、基本的に当社が自己で直接の相手方となる売買は行わず、委託注文として取り次ぎます。

##### (1) 上場株券等

当社においては、お客様からいただいた上場株券等に係る注文は、基本的に証券取引所市場に取り次ぐこととし、PTSへの取り次ぎを含む取引所外売買の取扱いはいりません。

①お客様から委託注文を受託いたしましたら、速やかに国内の当該銘柄が上場している証券取引所市場に取り次ぐことといたします。証券取引所市場の売買立会時間外に受注した委託注文については、証券取引所市場における売買立会が再開された後に証券取引所市場に取り次ぐことといたします。

②①において、委託注文の証券取引所市場への取次ぎは、次のとおり行います。

- a) 上場している証券取引所市場が1箇所である場合（単独上場）には、当該証券取引所市場へ取り次ぎます。
- b) 複数の証券取引所市場に上場（重複上場）されている場合には、当該注文執行時点において、株式会社QUICKの情報端末において対象銘柄の証券コードを入力して検索した際に最初に株価情報が表示される証券取引所市場（当該市場は、同社所定の計算方法により一定期間において最も売買高が多いとして選定されたものです。以下「主市場」と言います。）に取り次ぎます。
- c) a)又はb)により選定した証券取引所市場が、当社が取引参加者又は会員となっていないところ（福岡証券取引所及び札幌証券取引所）である場合には、当該証券取引所市場の取引参加者又は会員のうち、当該証券取引所市場への注文の取り次ぎについて契約を締結している者を経由して、当該証券取引所市場に取り次ぎます。

③②のb)において、お客様から受注した委託注文を主市場に取り次いだ後に、当該銘柄の主市場の変更が行われた場合には、以下の通り対応いたします。

- a) 一定期間有効な注文として受注した注文が有効な間に当該銘柄の主市場が変更された場合において、お客様からの市場変更のお申し出がない場合には、同一市場に注文を取り次ぎます。なお、主市場の変更については、株式会社QUICKの情報端末をご利用いただくことによりご確認いただけます。
- b) 制度信用取引及び一般信用取引で新規建てを行った銘柄において、反対売買を行う前に主市場が変更された場合には、原則として変更後の主市場に反対売買を取り次ぎます。ただし、お客様から同意をいただいた場合には、新規建てを行った市場と同一市場に反対売買を取り次ぎます。

④適格機関投資家であるお客様等からあらかじめ同意を得ている場合には、同意した内容に基づき、証券取引所市場に取り次ぐ方法又は当社が自己で直接の相手方となる方法もしくはその双方の方法にて執行いたします。

## (2) 取扱有価証券

当社においては、原則として取扱有価証券（グリーンシート銘柄）のご注文をお受けしておりません。ただし、お客様から取引の要望があり、当社とお客様が合意したものについては、合意した内容に基づき執行することがございます。また、当社が投資勧誘を行っており、気配を提示している銘柄について、お客様が注文執行時点における当該銘柄の気配（投資勧誘を行っている他の証券会社の気配）を確認し、当社と合意した場合に限り、当社が自己で直接の相手方となる方法で執行いたします。

なお、当社が投資勧誘を行っている銘柄及び投資勧誘を行っている他の証券会社については、日本証券業協会のホームページにおいてご確認ください。

## 3) 当該方法を選択する理由

### (1) 上場株券等

証券取引所市場は多くの投資家の需給が集中しており、流動性を最も提供できる場であり、公共性も高いことから、価格、約定可能性、取引のスピード等を総合的に勘案して、ここで執行することが、お客様にとって最も合理的であると判断されるからです。

また、複数の証券取引所市場に上場されている場合には、その中で最も流動性が高い主市場において執行することが、お客様にとって最も合理的であると判断されるからです。

一定期間有効な注文として受注した注文が有効な間に主市場が変更された場合において、お客様からのお申し出がない場合に、同一市場に注文を取り次ぐ理由は、お客様に当該注文を確認して再度注文を発注し直すといった対応を行う場合と比較して、当該対応によるコストの増加及び執行の遅延等が発生しないという点で、より最良執行の効果が損なわれる可能性が低く、お客様にとって最も合理的であると判断されるからです。

制度信用取引及び一般信用取引で反対売買を行う前に主市場が変更された場合に、お客様から同意をいただき、新規建てを行った市場と同一市場で反対売買を取り次ぐ理由は、お客様のご都合により建玉の市場変更を行っていない場合等、新規建てを行った市場と同一の市場に取り次ぐ方が、お客様にとって合理的な状況があると判断されるからです。

適格機関投資家であるお客様等からあらかじめ同意を得ている場合に、同意した内容に基づき、証券取引所市場に取り次ぐ方法のほかに当社が自己で直接の相手方となる方法で執行する理由は、取り次ぎを行おうとする時点において、証券取引所市場における執行と比較して、価格、約定可能性、取引のスピード等を勘案した結果、同等以上の条件で当該注文を執行できる場合にそのような機会を提供することが、お客様にとって最も合理的であると判断されるからです。

## (2) 取扱有価証券

当社においては、取扱有価証券（グリーンシート銘柄）のうち当社が投資勧誘を行っており、気配を提示している銘柄に限りお取り扱いしております。その場合に、当該銘柄の執行を、お客様が注文執行時点における当該銘柄の他の証券会社の気配を確認した上で合意した場合に限るものとしている理由は、価格、約定可能性、執行コスト等の総合的な判断に基づいて当社と合意していただくことが、お客様にとって最も合理的であると判断されるからです。

## 4) その他

(1) 次に掲げる取引については、2) に掲げる方法によらず、それぞれ次に掲げる方法により執行いたします。

①お客様から執行方法に関するご指示（当社が自己で直接の相手方となる売買のご希望、執行する証券取引所市場のご希望、お取引の時間帯のご希望等）があった取引

当該ご指示いただいた執行方法

②投資一任契約等に基づく執行

当該契約等においてお客様から委任された範囲内において当社が選定する方法

③株式累積投資や株式ミニ投資等、取引約款等において執行方法を特定している取引

当該執行方法

## ④端株及び単元未満株の取引

端株及び単元未満株を取り扱っている証券会社に取り次ぐ方法

(2) システム障害等により、やむを得ず、最良執行方針に基づいて選択する方法とは異なる方法により執行する場合がございます。その場合でも、その時点で最良の条件で執行するよう努めます。

最良執行義務は、価格のみならず、例えば、コスト、スピード、執行の可能性等さまざまな要素を総合的に勘案して執行する義務となります。

したがって、価格のみに着目して事後的に最良でなかったとしても、そのみをもって最良執行義務の違反には必ずしもなりません。

## (6) プライバシーポリシー

当社は、「個人情報の保護に関する法律」に基づき、個人情報の適切な保護と利用に関して、次のとおり、プライバシーポリシーを策定し公表いたします。

なお、本プライバシーポリシーは、お客様の個人情報の適正な取扱いを図るため、適宜見直しを行い、継続的な改善に努めます。

### 1) 個人情報に関する取組方針

(1) 当社は、「個人情報の保護に関する法律」をはじめとする個人情報保護に関する関係諸法令、主務大臣のガイドライン及び認定個人情報保護団体の指針並びに本プライバシーポリシーを遵守いたします。

(2) 当社は、業務上必要な範囲で適正かつ適法な方法により、個人情報を取得し個人情報を目的外に利用いたしません。

(3) 当社は、お客様のお問合せや苦情等に迅速・的確に対応いたします。

### 2) 利用目的について

当社は、お客様の同意を得た場合及び法令等により例外として取り扱われる場合を除き、下記の利用目的の達成に必要な範囲内でお客様の個人情報を取得し、利用いたします。

(1) 証券取引法に基づく有価証券・金融商品の勧誘・販売、サービスのご案内を行うため

(2) 適合性の原則等に照らした商品・サービスのご提供の妥当性を判断するため

(3) お客様ご本人であることまたはご本人の代理人であることを確認させていただくため

(4) お客様に対し、お取引結果、お預り残高などのご報告を行うため

(5) お客様とのお取引に関する事務を行うため

(6) 市場調査、ならびにデータ分析やアンケートの実施等による金融商品やサービスの研究や開発のため

(7) 他の事業者等から個人情報を含む業務の全部または一部について委託された場合等において、委託された当該業務を適切に遂行するため

(8) その他、お客様とのお取引を適切かつ円滑に履行するため

### 3) 個人データの正確性の確保について

当社は、利用目的の達成に必要な範囲内において、個人データが正確かつ最新の内容に保たれるように努めます。

### 4) 安全管理措置について

当社は、お客様より取得した個人データの漏洩等を防止するために、必要かつ適切な安全管理措置を実施するとともに、役職員に対する適切な監督を行ってまいります。

### 5) 個人データの第三者提供について

当社は、法令等により許される場合を除き、あらかじめお客様から同意を得ることなく、お客様の個人データを第三者へ開示・提供いたしません。

### 6) 個人データの委託について

当社は、利用目的の達成に必要な範囲内において、お客様より取得した個人データの取扱いにつきまして、

金融分野における個人情報保護に関するガイドライン（平成16年金融庁告示第67号。以下、「金融庁ガイドライン」といいます。）等で定める内容を織込んだ契約を締結の上、外部委託することがございます。また、委託に際しまして、再委託先への監督も含め、委託先に対する必要かつ適切な監督を行います。

7) 開示請求等手続について

当社は、お客様にかかる保有個人データに関しまして、ご本人またはその代理人より、開示、訂正・追加・削除、利用停止・消去、第三者提供停止等のお申出があった場合（以下、「開示請求等」といいます。）には、ご本人またはその代理人の本人確認をさせていただいた上で、法令等に基づき開示等を要しないとされている場合を除き、合理的期間及び妥当な範囲内で書面により回答させていただきます。

(1) 開示請求等の対象となる保有個人データの項目

氏名、住所、電話番号、生年月日、勤務先（勤務先名または職業・電話番号）、取引残高（口座番号、残高）、取引の履歴に関する情報 等

(2) 開示請求等手続きの窓口

当社の各営業部署

(3) ご提出いただくもの

1. 当社所定の「個人情報の開示等請求書」
2. 本人確認のための書類（運転免許証やパスポート等の写し）
3. 代理権授与の確認ができる委任状（代理人によるご依頼の場合。なお、代理権授与が当社にて確認できるまでは、ご回答いたしかねますのでご了承ください。）

(4) 回答方法

ご本人又はその代理人よりお届けいただいた住所宛に書面にて回答いたします。なお、代理人によるご依頼の場合であっても、ご本人に直接回答することがございますので、予めご了承ください。

(5) 開示請求等に関して取得した個人情報の利用目的

開示請求等により当社が取得した個人情報は、当該手続のための調査、ご本人ならびにその代理人の本人確認、手数料の徴収、及び当該開示請求等に対する回答に利用いたします。

(6) 手数料

調査の内容等によっては、手数料をいただく場合がございます。

8) 機微（センシティブ）情報の取扱いについて

当社は、金融庁ガイドライン等に基づき、人種、信条、門地、本籍地、保健医療または犯罪経歴についての情報その他の特別な非公開情報は、同ガイドラインで認められる場合を除き、取得いたしません。ただし、同ガイドラインで認められる場合で、業務上やむを得ず取得させていただく場合には、証券会社の行為規制等に関する内閣府令等により、適切な業務の運営の確保その他の必要と認められる目的以外の目的のために利用または第三者提供いたしません。

9) 苦情等について

当社は、お客様から個人情報の安全管理措置等の取扱いに関する苦情等のお申し出をお受けした場合、迅速かつ誠実な対応に努めます。苦情等につきましては、当社の下記窓口にお問合せください。

【苦情等窓口】

法務考査部 〒100-8289 東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館  
電話番号 03-5533-6800（平日9時00分～17時00分）

10) 認定個人情報団体について

当社は、金融庁の認定を受けた認定個人情報保護団体である日本証券業協会の協会員です。同協会の証券あっせん・相談センターでは、協会員の個人情報の取扱いについての苦情・相談をお受けしております。

【苦情・相談窓口】

日本証券業協会 証券あっせん・相談センター（電話：03-3667-8008）  
（<http://www.jsda.or.jp/>）またはお近くの証券あっせん・センターの各支部

## 2. 分別保管の状況

(1) 顧客分別金（平成19年3月末現在）

（単位：百万円）

項目	金額
直近差替計算基準日の顧客分別金必要額	30,595
顧客分別金信託額	30,000
期末日現在の顧客分別金必要額	15,748

（注）顧客分別金信託額は、直近の差替計算基準日における顧客分別金必要額を基に算出しております。

(2) 有価証券の分別保管（平成19年3月末現在）

①保護預り等有価証券

有価証券の種類	国内有価証券	外国有価証券
株券	15,475,370 千株	1,655,488 千株
債券	3,931,463 百万円	6,729,306 百万円
受益証券	568,210 百万口	1,724 百万口
新株予約権証券	41 千証券	9,450 千証券
コマーシャル・ペーパー	6,000 百万円	—

（注）国内有価証券（株券）には、市場性のない株式を含んでおります。

②受入代用有価証券

有価証券の種類	数量
株券	169,716 (一) 千株
債券	65,396 (一) 百万円
受益証券	11,337 (一) 百万口

（注）上記括弧内は、受入代用有価証券のうち、顧客分別金の計算対象とされる第三者への再担保差入相当分であり、その時価相当額を顧客分別金として法令に基づき信託することとなっています。  
当社においては顧客分別金の計算対象とされる第三者への再担保差入を行っておりません。

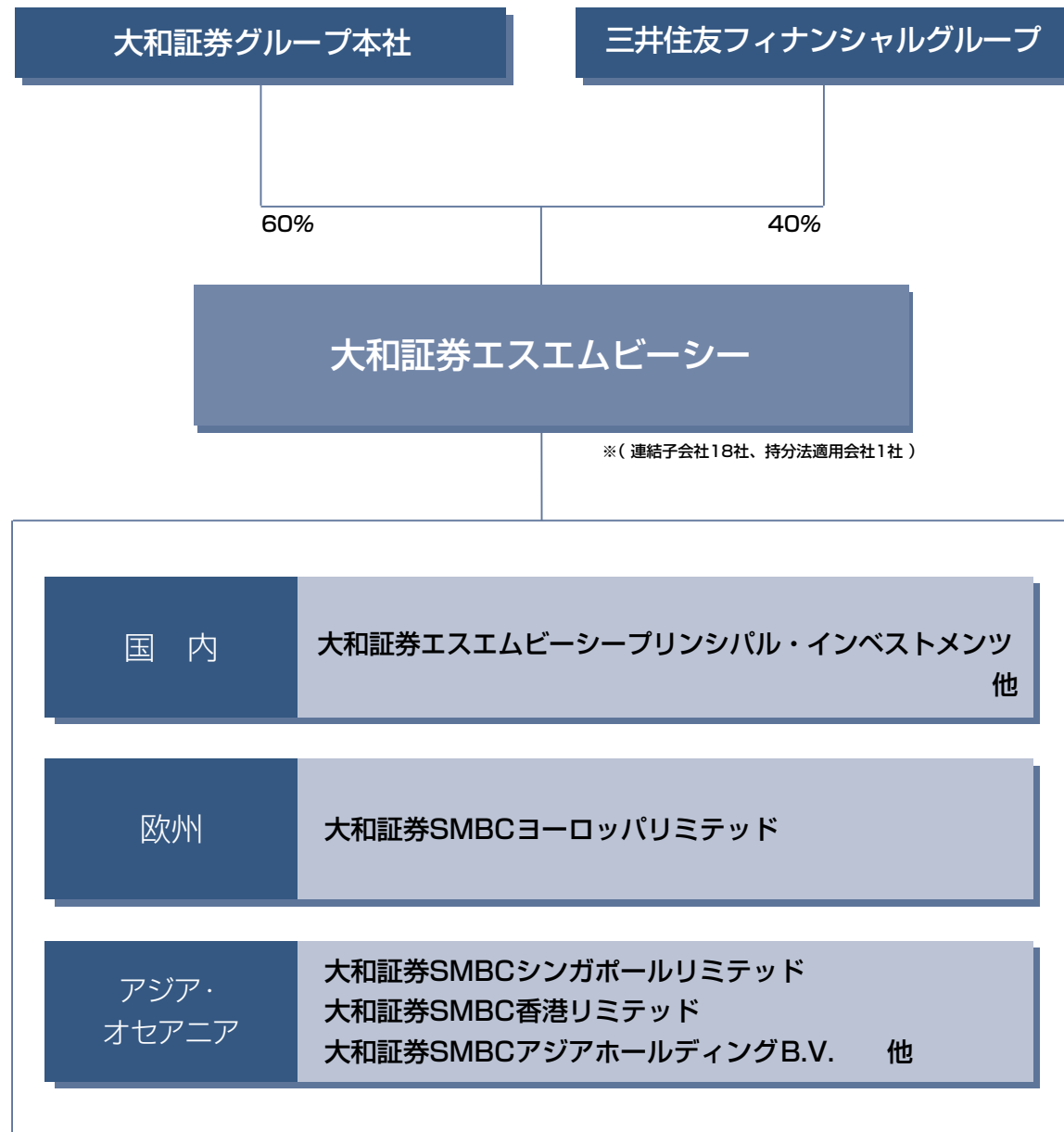
③保管の状況

お客様の有価証券等は、保護預り約款、外国証券取引約款、振替決済口座管理約款と共に、証券取引法第47条及び証券会社の分別保管に関する内閣府令に従って、以下のとおり保管・管理しております。

種類	保管方法
国内株券	特にお申し出のない限り、株式会社証券保管振替機構（以下「機構」といいます。）において混蔵保管します。また、お申し出等により当社にて保管する場合はお客様毎に判別できるように保管しております。
国内債券	機構の振替決済制度にかかる保護預り証券は、株券と同様に機構にて保管します。上記以外の保護預り証券は、特にお申し出のない限り、当社にてお客様の同銘柄の証券と混蔵して保管することがございます。なお、社債等の振替に関する法律に基づく振替決済制度において取り扱う社債等につきましては、弊社が口座管理機関となっており、お客様の決済口座を通して管理しております。
国内証券投資信託受益証券	機構の振替決済制度にかかる保護預り証券は、株券と同様に機構にて保管します。上記以外の保護預り証券は、特にお申し出のない限り、当社又は受託会社にて他のお客様の同銘柄の証券と混蔵して保管することがございます。なお、社債等の振替に関する法律に基づく振替決済制度において取り扱う投資信託受益権につきましては、弊社が口座管理機関となっており、お客様の決済口座を通して管理しております。
その他国内証券	機構の振替決済制度にかかる保護預り証券は、株券と同様に機構にて保管します。その他の保護預り証券は、特にお申し出のない限り、当社にてお客様の同銘柄の証券と混蔵して保管することがございます。
外国証券	国内の取引所取引にかかる外国証券は機構において、外国の有価証券市場等の取引にかかる外国証券は海外保管機関において混蔵して保管しております。

1. 企業集団の構成

当社は、株式会社大和証券グループ本社60%、株式会社三井住友フィナンシャルグループ40%出資のホールセール専門証券会社です。当社の主たる事業は証券業であり、具体的な事業として有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び売買等の委託の媒介、有価証券の引受及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い並びにその他証券業等を営んでおります。当社及び当社の関係会社は、日本をはじめ、世界の主要な金融市場に営業拠点を設置し、グローバルなネットワークにより世界中の顧客の資金調達と運用の双方のニーズに対応して幅広いサービスを提供しております。



2. 主要な子会社等の商号、所在地、資本、事業内容等

(平成19年3月31日現在)

会社名	所在地	資本金	主要事業内容	所有する議決権株数	議決権所有割合
大和証券SMBCヨーロッパリミテッド	イギリス ロンドン市	スターリングポンド 109百万	証券業	千株 109,121	100%
大和証券SMBCアジアホールディングB.V.	オランダ アムステルダム市	ユーロ 177百万	子会社間の 統合・管理	千株 390,803	100%
大和証券SMBC香港リミテッド	香港	香港ドル/100百万 米ドル/68.5百万	証券業	千株 16,850	100% (注1)
大和証券SMBCシンガポールリミテッド	シンガポール シンガポール市	シンガポールドル 42百万	証券業 金融業	千株 42,000	100% (注1)
大和証券SMBCフューチャーズPte Ltd	シンガポール シンガポール市	シンガポールドル 3百万	金融先物 取引業	千株 3,000	100% (注1)
大和証券SMBCオーストラリアリミテッド	オーストラリア メルボルン市	豪ドル 15百万	証券業	千株 30,000	100% (注1)
大和國泰證券股份有限公司	台湾 台北市	台湾ドル 2,000百万	証券業	千株 180,000	90% (注2)
DBP-大和証券SMBCフィリピン,Inc.	フィリピン マニラ市	フィリピンペソ 255百万(注5)	証券業	千株 102,000	60% (注3)(注4)
大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社	東京都千代田区	円 2,000百万	投資業務	千株 70	100%
大和証券SMBCファイナンシャル・プロダクツ(ケイマン) Ltd	英領ケイマン諸島	円 10百万	金融業	株 200	100%
その他 14社	—	—	—	—	—

(注) 1. 間接所有……大和証券SMBCアジアホールディングB.V. ……100%  
 2. 間接所有……大和証券SMBCアジアホールディングB.V. ……90%  
 3. 間接所有……大和証券SMBCアジアホールディングB.V. ……60%  
 4. 60%は、優先株を含んでいない場合の比率(優先株を含んだ比率は73.3%)  
 5. 優先株の資本金を含んだ額