

業務及び財産の状況に関する説明書

【平成23年3月期】

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

目 次

I	当社の概況及び組織に関する事項	
1.	商号	1
2.	登録年月日(登録番号)	1
3.	沿革及び経営の組織	1
4.	株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合	3
5.	役員の氏名又は名称	3
6.	政令で定める使用人の氏名	3
7.	業務の種別	4
8.	本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地	5
9.	他にを行っている事業の種類	5
10.	金融商品取引業等に関する内閣府令第7条第3号イ及び第4号から第9号までに掲げる事項のうち、行っている業務	5
11.	指定紛争解決機関の商号又は名称並びに加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称	6
12.	会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号	6
13.	加入する投資者保護基金の名称	6
14.	苦情処理措置及び紛争解決措置の内容	6
II	業務の状況に関する事項	
1.	当期の業務の概要	7
2.	業務の状況を示す指標	9
III	財産の状況に関する事項	
1.	経理の状況	11
2.	借入金の主要な借入先及び借入金額	17
3.	保有する有価証券(トレーディング商品に係るものを除く)の取得価額、時価及び評価損益	17
4.	デリバティブ取引(トレーディング商品に係るものを除く)の契約価額、時価及び評価損益	18
5.	財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無	18
IV	管理の状況	
1.	内部管理の状況の概要	19
2.	分別管理及び区分管理の状況	19
V	連結子会社等の状況に関する事項	21

I 当社の概況及び組織に関する事項

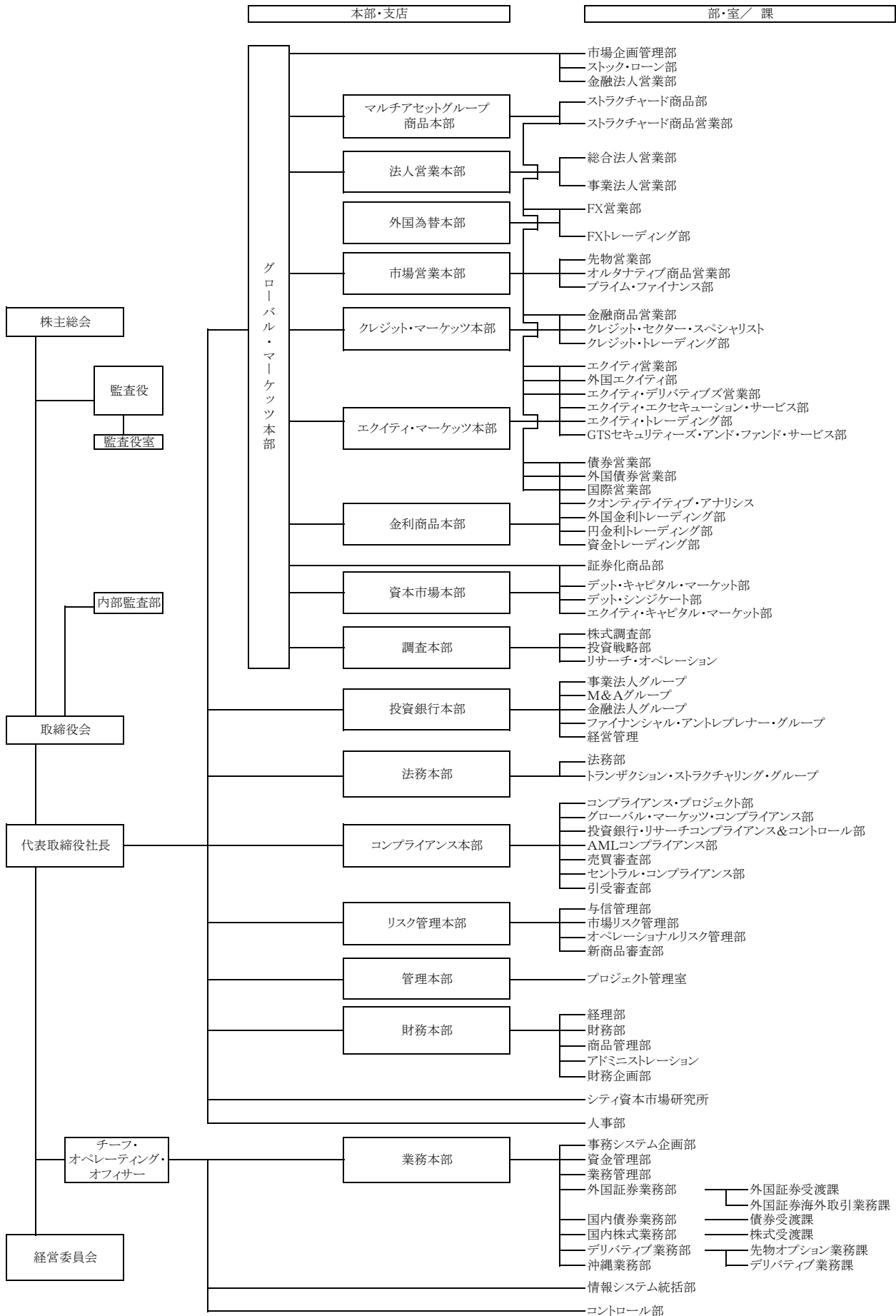
1. 商 号 シティグループ証券株式会社
2. 登録年月日 平成 19 年 9 月 30 日
(登録番号) (関東財務局長(金商)第 130号)
3. 沿革及び経営の組織

(1) 会社の沿革

年	沿 革
1972 年	・ スミス・バーニー東京駐在員事務所を開設
1977 年	・ ソロモン・ブラザーズ・アジア・リミテッドを香港に設立
1980 年	・ ソロモン・ブラザーズ・アジア・インターナショナル東京駐在員事務所を開設 ・ スミス・バーニー証券会社東京支店に昇格
1982 年	・ ソロモン・ブラザーズ・アジア証券会社東京支店開設の認可を取得 ・ 同東京支店での営業を開始し、同時に香港での業務を全て東京へ移管
1987 年	・ 大阪証券取引所遠隔地会員資格を開始
1988 年	・ 東京証券取引所正会員としての取引を開始 ・ 大阪証券取引所遠隔地会員として先物取引を開始
1989 年	・ 日本国債の引受シンジケート団の常任幹事となる ・ 大阪証券取引所遠隔地会員としてオプション取引を開始 ・ 東京金融先物取引所清算会員として取引を開始 ・ 名古屋証券取引所特別参加者として取引を開始
1991 年	・ 大阪証券取引所正会員として大阪支店での業務を開始
1997 年	・ ソロモン・ブラザーズ・アジア・リミテッド東京支店(英領ケイマン諸島法人)として業務を開始
1998 年	・ ソロモン・ブラザーズ・アジア証券会社はスミス・バーニー証券会社東京支店の営業の全てを譲受け、ソロモン・スミス・バーニー証券会社に社名変更
1999 年	・ 日興証券株式会社のインベストメント・バンキング部門、ホールセール部門、リサーチ部門の営業を譲受け、社名を日興ソロモン・スミス・バーニー証券会社に変更 ・ 名古屋支店の営業を開始 ・ 名古屋証券取引所正会員としての取引を開始
2003 年	・ 日興シティグループ証券会社に社名変更 ・ 日興シティグループ証券準備株式会社を子会社として設立 ・ 日興シティグループ証券準備株式会社は日興シティグループ証券会社(英領ケイマン諸島法人)の営業の全てを譲受け、日興シティグループ証券株式会社に名称変更
2004 年	・ 日興シティグループ証券株式会社(日本法人)として営業開始 ・ 名古屋支店を廃止 ・ ジャスダック証券取引所参加者として取引を開始
2007 年	・ 新丸の内ビルディングに本社を移転
2008 年	・ 日興シティホールディングス株式会社設立 (シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社と株式会社日興コーディアルグループの合併が完了) ・ 名古屋支店の営業を再開
2009 年	・ シティグループ・インクによる日興コーディアル証券株式会社の株式会社三井住友銀行への売却により、日興シティグループ証券株式会社はシティグループ証券株式会社に社名変更 ・ 国内の株式・債券引受業務を含む一部の事業を株式会社三井住友銀行に譲渡
2010 年	・ 大阪支店を廃止 ・ 名古屋支店を廃止 ・ 大阪証券取引所FX取引会員として取引を開始

(2) 経営の組織

平成23年7月1現在



4. 株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合 平成23年3月31日現在

氏名又は名称	保有株式数	割合
シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社	1,959,420株	51.00%
シティグループ・ジャパン・トレジャリーズ合同会社	1,882,580株	49.00%
計 2 名	3,842,000株	100.00%

(注) シティグループ・ジャパン・トレジャリーズ株式会社は、平成22年6月にシティグループ・ジャパン・トレジャリーズ合同会社に組織変更及び商号変更いたしました。

5. 役員の氏名又は名称

平成23年7月1日現在

役職名	氏名又は名称	代表権の有無	常勤・非常勤の別
取締役会長	東 俊 太 郎	無	常 勤
取締役副会長	藤 田 勉	無	常 勤
代表取締役社長	ブライアン・マッカピン	有	常 勤
取締役副社長	神 保 裕 一	無	常 勤
取締役	山 原 明 子	無	常 勤
取締役	ダレン・バックリー	無	非常勤
取締役	井 上 直 樹	無	非常勤
監査役	林 原 行 雄	無	非常勤

(注) 神保裕一氏は平成23年4月1日付で取締役副社長に就任いたしました。

6. 政令で定める使用人の氏名

(1) 金融商品取引業に関し、法令等を遵守させるための指導に関する業務を統括する者の氏名

平成23年7月1日現在

氏名	役職名
神 保 裕 一	取締役副社長 常務執行役員 投資銀行本部長
山 原 明 子	取締役 常務執行役員 法務本部長
木 嶋 謙 吾	常務執行役員 コンプライアンス本部長 内部管理統括責任者
アリソン・バーチ	常務執行役員 チーフ・オペレーティング・オフィサー 内部管理統括補助責任者
ウ・チャン・ジュ	常務執行役員 資本市場本部長
奥 山 史	常務執行役員 市場営業本部長
関 川 祐 司	常務執行役員 法人営業本部長
ロバート・イツオ・ナカムラ	常務執行役員 マルチアセットグループ本部長
アラン・ベルディクト	常務執行役員 金利商品本部長
成 田 譲	常務執行役員 外国為替本部長
ケビン・グリーン	常務執行役員 管理本部長兼市場企画管理部長
佐 藤 晴 彦	常務執行役員 市場リスク管理部長
下 井 尚 則	常務執行役員 調査本部長
ナレッシュ・ナラヤン	常務執行役員 クレジット・マーケット本部長
マーク・ハート	常務執行役員 財務本部長
リチャード・ヘイズ	常務執行役員 エクイティ・マーケット本部長
馬 嶋 華 子	コンプライアンス本部 ディレクター 内部管理統括補助責任者
小 林 保 之	コンプライアンス本部 ディレクター 内部管理統括補助責任者

(2) 投資助言業務又は投資運用業に関し、助言又は運用を行う部門を統括する者の氏名

該当事項はありません。

(3) 投資助言・代理業に関し、金融商品取引法第29条の2第1項第6号の営業所又は事務所の業務を統括する者の氏名

該当事項はありません。

7. 業務の種別

(1) 第1種金融商品取引業

- ① 金融商品取引法(以下「法」という。)第28条第1項第1号に掲げる行為に係る以下の業務
 - イ 有価証券の売買(デリバティブ取引に該当するものを除く。以下同じ。)、市場デリバティブ取引又は外国市場デリバティブ取引(有価証券の売買にあつては、法第2条第8項第10号に掲げるものを除く。)
 - ロ 有価証券の売買、市場デリバティブ取引又は外国市場デリバティブ取引の媒介、取次ぎ(有価証券等清算取次ぎを除く。)又は代理(有価証券の売買の媒介、取次ぎ又は代理にあつては、法第2条第8項第10号に掲げるものを除く。)
 - ハ 次に掲げる取引の委託の媒介、取次ぎ又は代理
 - ・ 取引所金融商品市場における有価証券の売買又は市場デリバティブ取引
 - ・ 外国金融商品市場(取引所金融商品市場に類似する市場で外国に所在するものをいう。)における有価証券の売買又は外国市場デリバティブ取引
 - ニ 有価証券の売出し又は特定投資家向け売付け勧誘等
 - ホ 有価証券の募集若しくは売出しの取扱い又は私募若しくは特定投資家向け売付け勧誘等の取扱い
- ② 法第28条第1項第2号に掲げる行為に係る業務
店頭デリバティブ取引又はその媒介、取次ぎ(有価証券等清算取次ぎを除く。)若しくは代理
- ③ 法第28条第1項第3号イに掲げる行為に係る業務
有価証券の元引受けであつて、損失の危険の管理の必要性の高いものとして政令で定めるもの
- ④ 法第28条第1項第3号ロに掲げる行為に係る業務
有価証券の元引受けであつて、法第28条第1項第3号イに掲げる以外のもの
- ⑤ 法第28条第1項第3号ハに掲げる行為に係る業務
有価証券の引受けのうち有価証券の元引受け以外のもの
- ⑥ 有価証券等管理業務

(2) 第2種金融商品取引業(有価証券等清算取次ぎを除く。)

(3) 金融商品取引業に付随する業務

(法第35条第1項各号に掲げる業務のうち、当社が業務を行っているもの)

- ① 有価証券の貸借又はその媒介若しくは代理
- ② 信用取引に付随する金銭の貸付け
- ③ 保護預り有価証券を担保とする金銭の貸付け
- ④ 有価証券に関する顧客の代理
- ⑤ 受益証券に係る収益金、償還金又は解約金の支払いに係る代理
- ⑥ 投資有価証券又は外国投資有価証券に係る金銭の分配、払戻金又は残余財産の分配に係る代理
- ⑦ 累積投資契約の締結
- ⑧ 有価証券に関連する情報の提供又は助言
- ⑨ 他の金融商品取引業者等の代理
- ⑩ 他の事業者の事業の譲渡、合併、会社の分割、株式交換若しくは株式移転に関する相談に応じ、又はこれらに関し仲介を行うこと
- ⑪ 他の事業者の経営に関する相談に応じること
- ⑫ 通貨その他デリバティブ取引に関連する資産として政令で定めるものの売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理
- ⑬ 譲渡性預金その他金銭債権(有価証券に該当するものを除く。)の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理

8. 本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地

平成23年7月1日現在

名 称	所 在 地
本 店	〒100-6520 東京都千代田区丸の内1丁目5番1号
大 阪 支 店	〒556-0011 大阪府大阪市浪速区難波中2丁目10番70号

(注) 大阪支店については、平成23年3月22日に設置いたしました。

9. 他に行っている事業の種類

(1) 届出業務(法第35条第2項)

- ① 商品の価格その他の指標に係る変動、市場間の格差等を利用して行う取引として内閣府令で定めるものに係る業務(商品取引所法第2条第16項に規定する商品市場における取引等に係る業務を除く。)
- ② 貸金業法第2条第1項に規定する貸金業その他金銭の貸付け又は金銭の貸借の媒介に係る業務
- ③ 貸出参加契約(金融機関等貸出債権に係る権利義務関係を移転させずに、原貸出債権に係る経済的利益及び損失の危険を原債権者から第三者に移転させる契約をいう。)の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ④ 債務の保証の媒介に係る業務
- ⑤ 物品賃貸業
- ⑥ 他の事業者の業務に関する電子計算機のプログラムの作成又は販売を行う業務及び計算受託業務
- ⑦ 算定割当量の取得若しくは譲渡に関する契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理を行う業務
- ⑧ 算定割当量に関するデリバティブ取引又はその媒介、取次ぎ若しくは代理を行う業務
- ⑨ その行う業務に係る顧客に対し他の事業者のあっせん又は紹介を行う業務
- ⑩ 銀行代理業

(2) 承認業務(法第35条第4項)

- ① GTSによるカストディ業務に係る媒介等に係る業務、ファンド・サービス業務に係る媒介等に係る業務、及び外国預託証券に係る預託銀行業務の媒介等に係る業務
- ② LNG(液化天然ガス)現物売買取引の媒介業務

(注) GTSとは、Global Transaction Servicesの略称で、海外カストディ業務に係る媒介等に係る業務とセキュリティ・レンディングに係る媒介、並びにファンド・サービス業務に係る媒介等に係る業務、及び外国預託証券に係る預託機関業務の媒介等に係る業務を行う部署です。

10. 金融商品取引業等に関する内閣府令第7条第3号イ及び第4号から第9号までに掲げる事項のうち、行っている業務

- ① 有価証券関連業
- ② 不動産信託受益権等売買等業務

11. 指定紛争解決機関の商号又は名称並びに加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称（平成23年4月1日現在）

指定紛争解決機関 : 特定非営利活動法人証券・金融商品あっせん相談センター（以下、「FINMAC」）
（第1種金融商品取引業）

金融商品取引業協会 : 日本証券業協会
社団法人金融先物取引業協会

対象事業者となる
認定投資者保護団体 : FINMAC（第2種金融商品取引業）

（注1）第1種金融商品取引業に関して、法第37条の7第1項第1号イの規定に基づき、指定第1種紛争解決機関であるFINMACとの間で特定第1種金融商品取引業務に係る手続実施基本契約を締結しております。（平成23年4月1日付）

（注2）第2種金融商品取引業に関して、認定投資者保護団体であるFINMACに第2種金融商品取引業に係る紛争等解決事業に関する利用登録を行っております。（平成22年11月19日付）

12. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号

東京証券取引所
大阪証券取引所
名古屋証券取引所
TOKYO AIM取引所
東京金融取引所

13. 加入する投資者保護基金の名称

日本投資者保護基金

14. 法第37条の7第1項第1号ロ、第2号ロ、第3号ロ又は第4号ロに定める業務に関する苦情処理措置及び紛争解決措置の内容（平成23年4月1日現在）

(1) 第1種金融商品取引業

該当事項はありません。

なお、法37条の7第1項第1号イの規定に基づき、指定第1種紛争解決機関であるFINMACとの間で特定第1種金融商品取引業務に係る手続実施基本契約を締結しております。

(2) 第2種金融商品取引業

法37条の7第1項第2号ロに規定する苦情処理措置及び紛争解決措置として、社団法人金融先物取引業協会（FINMACに業務委託）を利用する又はFINMACを直接利用する等の措置を講じております。

(3) 投資助言・代理業

該当事項はありません。

(4) 投資運用業

該当事項はありません。

II 業務の状況に関する事項

1. 当期の業務の概要

当期の日本株市場は欧州財政問題の深刻化を始めとして、米国・中国の景気減速懸念や円高傾向などにより、株価は下落基調が継続していましたが、2010年末以降、米国の追加金融緩和による円高傾向への歯止めにより、株価は2011年3月上旬まで緩やかな上昇を辿りました。しかし、3月11日に発生した東日本大震災及び福島第1原子力発電所の深刻な事故や電力供給不足が投資家のリスク回避の姿勢を強め、結局当期末の日経平均株価は9,755円、TOPIXは869となりました。

一方、金利は欧州財政問題に対する懸念等から、安全資産とされる日本や米国の国債に資金が流入し、2010年後半まで低下基調(価格は上昇)を辿っていました。その後、米国の追加金融緩和や米政府の減税延長が好感したことにより、米国長期金利が上昇し、それが国内長期金利の上昇(価格は下落)要因となりました。しかし、東日本大震災発生後は株式市場から債券市場に資金が流入する一方、震災復興財源としての国債増発に対する警戒感もあり、結局期末の長期金利は1.255%となりました。

当期の営業収益は前期比57.6%減の356億円、営業収益から金融費用を差し引いた純営業収益は前期比62.2%減の291億円となりました。また、販売費・一般管理費は前期比8.7%減の598億円となったことから、当期の営業損失は306億円、営業外損益項目を加減した経常損失は297億円となりました。これに特別損益項目や法人税等を加味した結果、当期純損失は289億円となりました。各科目別の内容は以下の通りです。

(1) 受入手数料

受入手数料は、前期比3.3%増の657億円となりました。科目別の特徴は以下の通りです。

① 委託手数料

委託手数料は前期比4.5%減の136億円となりました。公開買付代理人の手数料を含めた株券委託手数料は前期比4.8%減の134億円となりました。また、国債先物や上場投資信託等の委託手数料は合計で1億円となっております。

② 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料

引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は、前期比88.4%減の7億円となりました。2009年10月1日付けで当社の国内の株式・債券引受業務を含む一部の事業を譲渡したことに伴い、大幅に減少しております。

③ 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前期比57.9%減の4億円となりました。

④ その他の受入手数料

その他の受入手数料は、前期比22.5%増の508億円となりました。主に海外の関連会社からの受入手数料やM&Aアドバイザーフィー等を計上しております。

(2) トレーディング損益

トレーディング損益は、市場環境の悪化に伴い前期比496億円減の383億円の損失となりました。株券等トレーディング損益は191億円の損失、債券・為替等トレーディング損益は191億円の損失となりました。

(3) 金融収支

金融収益82億円から金融費用65億円を差し引いた金融収支は17億円となりました。金融収益には、主にトレーディング商品として保有する有価証券に係る配当金や債券利子、有価証券の貸借取引に係る収益等を計上しており、金融費用には、主に金融機関からの借入金に対する利息、有価証券の貸借取引や現先取引に関する費用等を計上しております。

(4) 販売費・一般管理費

販売費・一般管理費は、前年同期比8.7%減の598億円となりました。主に、人員減に伴う人件費の減少のほか、取引関係費及び事務費が減少いたしました。

(5) 営業外損益

営業外損益は、8億円の収益となりました。主に外貨建て資産負債から発生した為替差益となります。

(6) 特別損益

特別利益は、金融商品取引責任準備金戻入6億円を計上しております。また、特別損失は事業再編損失、固定資産除却損及び有価証券評価減の合計19億円を計上しております。

(7) 法人税等

税引前当期純損失310億円に対し、法人税、住民税及び事業税は1億円のマイナス、法人税等調整額は18億円のマイナスとなりました。

2. 業務の状況を示す指標

(1) 経営成績等の推移

(単位:百万円)

	平成21年3月期	平成22年3月期	平成23年3月期
資本金	96,307	96,307	96,307
発行済株式数	3,842 千株	3,842 千株	3,842 千株
営業収益	78,048	84,169	35,663
(受入手数料)	72,040	63,650	65,720
((委託手数料))	20,749	14,277	13,629
((引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料))	11,102	6,766	784
((募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料))	102	1,105	465
((その他の受入手数料))	40,085	41,500	50,841
(トレーディング損益)	△22,577	11,305	△38,351
((株券等))	2,512	1,111	△19,180
((債券等))	△27,773	14,014	△18,385
((その他))	2,683	△3,820	△785
(金融収益)	28,585	9,213	8,294
金融費用	19,423	7,156	6,514
純営業収益	58,625	77,012	29,149
経常利益(△損失)	△15,978	11,783	△29,785
当期純利益(△損失)	△10,975	17,972	△28,994

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

(単位:百万円)

	平成21年3月期	平成22年3月期	平成23年3月期
委 託	18,958,673	13,273,592	12,348,571
自 己	9,540,439	8,546,339	9,428,222
合 計	28,499,112	21,819,931	21,776,793

② 有価証券の引受け及び売出し並びに特定投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の募集、売出し及び私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況

(単位:百万円)

区分	引受高	売出高	特定投資家 向け売付け 勧誘等の 総額	募集の 取扱高	売出しの 取扱高	私募の 取扱高	特定投資家 向け売付け 勧誘等の 取扱高	
平成 21 年 3 月 期	株 券	69,715	74,339	—	—	—	324	
	債 券	国債証券	—	—	—	—	—	—
		地方債証券	532,034	—	—	487,020	—	3,000
		特殊債券	1,868,994	282,648	—	1,165,380	—	—
		社債券	2,903,560	—	—	2,657,617	—	9,450
	合 計	5,304,588	282,648	—	4,310,017	—	12,450	
	受 益 証 券	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他	—	—	—	—	—	10,474	—	
平成 22 年 3 月 期	株 券	92,614	91,548	—	29,107	75	2,000	
	債 券	国債証券	—	—	—	—	—	—
		地方債証券	319,359	—	—	330,888	—	2,600
		特殊債券	376,563	—	—	325,670	—	10,000
		社債券	826,800	—	—	838,597	—	—
	合 計	1,522,722	—	—	1,495,151	—	12,600	
	受 益 証 券	—	—	—	—	—	—	—
そ の 他	—	—	—	—	—	2,310	—	
平成 23 年 3 月 期	株 券	4,784	—	—	17,705	—	—	
	債 券	国債証券	—	—	—	—	—	—
		地方債証券	2,000	—	—	1,900	—	—
		特殊債券	33,000	—	—	43,900	—	—
		社債券	170,600	—	—	221,300	—	300
	合 計	205,600	—	—	267,100	—	300	
	受 益 証 券	—	—	—	—	—	7,222	—
そ の 他	—	—	—	—	—	—	—	

(3) その他業務の状況

(単位:百万円)

	平成21年3月期	平成22年3月期	平成23年3月期
貸 金 業 (貸付金期末残高)	12,393	12,393	—

(注) 上記以外に行っている法第35条第2項に掲げる業務及び同条第4項の承認を受けた業務に関しては、財務上の重要性が乏しいことから、記載を省略しています。

(4) 自己資本規制比率の状況

(単位:百万円)

	平成21年3月期	平成22年3月期	平成23年3月期
自己資本規制比率 (A / B × 100)	411.0%	520.8%	350.6%
固定化されていない自己資本 (A)	326,618	353,632	263,093
リ ス ク 相 当 額 (B)	79,457	67,899	75,021
市場リスク相当額	32,481	28,362	33,466
取引先リスク相当額	26,305	24,397	25,394
基礎的リスク相当額	20,671	15,140	16,161

(5) 使用人の総数及び外務員の総数

	平成21年3月期	平成22年3月期	平成23年3月期
使 用 人	1,215人	782人	725人
(うち外務員)	(634人)	(459人)	(436人)

III 財産の状況に関する事項

1. 経理の状況

(1) 貸借対照表

(単位:百万円)

科 目	前 期 (平成22年3月31日 現 在)	当 期 (平成23年3月31日 現 在)	対前期増減
(資 産 の 部)			
流 動 資 産	3,599,676	3,350,283	△ 249,393
現 金 ・ 預 金	46,909	214,478	167,568
預 託 金	6,262	10,860	4,598
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	1,922,016	1,302,557	△ 619,458
商 品 有 価 証 券 等	1,803,383	1,173,258	△ 630,125
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	118,632	129,298	10,666
約 定 見 返 勘 定	-	35,529	35,529
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	1,515,765	1,646,463	130,697
借 入 有 価 証 券 担 保 金	326,892	579,255	252,363
現 先 取 引 貸 付 金	1,188,873	1,067,208	△ 121,665
立 替 金	589	1,171	582
短 期 差 入 保 証 金	78,822	117,189	38,366
支 払 差 金 勘 定	894	-	△ 894
短 期 貸 付 金	12,393	-	△ 12,393
未 収 入 金	2,474	2,160	△ 314
未 収 収 益	3,506	15,366	11,860
繰 延 税 金 資 産	9,077	3,845	△ 5,231
そ の 他 の 流 動 資 産	988	671	△ 317
貸 倒 引 当 金	△ 24	△ 11	12
固 定 資 産	22,674	27,996	5,321
有 形 固 定 資 産	56	1	△ 55
建 物	14	-	△ 14
器 具 ・ 備 品	42	1	△ 40
無 形 固 定 資 産	3,045	2,083	△ 961
ソ フ ト ウ ェ ア	2,298	1,621	△ 676
そ の 他	747	461	△ 285
投 資 そ の 他 の 資 産	19,572	25,910	6,338
投 資 有 価 証 券	1,625	1,545	△ 79
長 期 貸 付 金	2,863	2,842	△ 20
長 期 差 入 保 証 金	2,056	1,492	△ 564
長 期 前 払 費 用	13	2	△ 11
繰 延 税 金 資 産	12,546	20,019	7,472
そ の 他	467	9	△ 458
資 産 合 計	3,622,351	3,378,279	△ 244,072

(単位:百万円)

科 目	前 期 (平成22年3月31日 現 在)	当 期 (平成23年3月31日 現 在)	対前期増減
(負 債 の 部)			
流 動 負 債	3,232,380	3,092,311	△ 140,069
トレーディング商品	980,103	1,044,847	64,744
商品有価証券等	818,290	804,709	△ 13,581
デリバティブ取引	161,812	240,138	78,326
約定見返勘定	28,927	-	△ 28,927
信用取引負債	16,084	5,512	△ 10,572
信用取引貸証券受入金	16,084	5,512	△ 10,572
有価証券担保借入金	1,419,607	1,031,597	△ 388,009
有価証券貸借取引受入金	227,451	39,597	△ 187,854
現先取引借入金	1,192,156	992,000	△ 200,155
預り金	4,461	3,371	△ 1,089
受入保証金	73,678	73,347	△ 331
受取差金勘定	-	2,345	2,345
一年以内償還社債	1,000	50,500	49,500
短期借入金	694,000	865,800	171,800
未払金	1,502	1,377	△ 125
未払法人税等	111	117	5
未払費用	6,475	7,578	1,102
賞与引当金	2,633	1,573	△ 1,059
事業再編引当金	434	-	△ 434
その他の流動負債	3,361	4,342	981
固 定 負 債	179,089	105,278	△ 73,811
社 債	101,550	49,550	△ 52,000
長期借入金	70,000	48,100	△ 21,900
退職給付引当金	4,362	4,135	△ 227
その他の固定負債	3,177	3,492	315
特別法上の準備金	2,335	1,663	△ 671
金融商品取引責任準備金	2,335	1,663	△ 671
負 債 合 計	3,413,806	3,199,253	△ 214,552
(純 資 産 の 部)			
株 主 資 本	209,754	180,759	△ 28,994
資 本 金	96,307	96,307	-
資 本 剰 余 金	96,641	96,641	-
資 本 準 備 金	96,641	96,641	-
利 益 剰 余 金	16,804	△ 12,189	△ 28,994
その他利益剰余金	16,804	△ 12,189	△ 28,994
繰越利益剰余金	16,804	△ 12,189	△ 28,994
評価・換算差額等	△ 1,209	△ 1,734	△ 525
繰延ヘッジ損益	△ 1,209	△ 1,734	△ 525
純 資 産 合 計	208,545	179,025	△ 29,520
負 債 ・ 純 資 産 合 計	3,622,351	3,378,279	△ 244,072

(2) 損益計算書

(単位:百万円)

科 目	前 期 (自平成21年4月 1日 至平成22年3月31日)	当 期 (自平成22年4月 1日 至平成23年3月31日)	対前期増減
営 業 収 益	84,169	35,663	△ 48,505
受 入 手 数 料	63,650	65,720	2,069
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	11,305	△ 38,351	△ 49,657
金 融 収 益	9,213	8,294	△ 918
金 融 費 用	7,156	6,514	△ 642
純 営 業 収 益	77,012	29,149	△ 47,863
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	65,546	59,821	△ 5,724
取 引 関 係 費	20,348	18,950	△ 1,397
人 件 費	25,106	22,244	△ 2,862
不 動 産 関 係 費	9,925	9,048	△ 876
事 務 費	7,370	5,935	△ 1,435
減 価 償 却 費	945	788	△ 157
租 税 公 課	1,048	683	△ 364
貸 倒 引 当 金 繰 入	-	1,268	1,268
そ の 他	801	902	100
営 業 利 益 (△ 損 失)	11,466	△ 30,672	△ 42,138
営 業 外 収 益	494	926	432
営 業 外 費 用	176	39	△ 137
経 常 利 益 (△ 損 失)	11,783	△ 29,785	△ 41,569
特 別 利 益	21,242	671	△ 20,571
金融商品取引責任準備金戻入	23	671	648
事 業 分 割 益	21,219	-	△ 21,219
特 別 損 失	768	1,951	1,182
固 定 資 産 除 却 損	96	379	283
事 業 再 編 損 失	672	1,491	819
有 価 証 券 評 価 減	-	79	79
税引前当期純利益(△損失)	32,257	△ 31,065	△ 63,323
法人税、住民税及び事業税	9,724	△ 190	△ 9,914
法 人 税 等 調 整 額	4,561	△ 1,880	△ 6,441
当 期 純 利 益 (△ 損 失)	17,972	△ 28,994	△ 46,967

(3) 株主資本等変動計算書

平成22年3月期(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

(単位:百万円)

	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	繰延ヘッジ損益	
		資本準備金	その他 利益剰余金 繰越 利益剰余金			
前期末残高	96,307	96,641	△ 1,167	191,781	△ 1,549	190,232
当期変動額						
当期純利益(△損失)	-	-	17,972	17,972	-	17,972
株主資本以外の項目 の事業年度中 の変動額(純額)	-	-	-	-	340	340
当期変動額合計	-	-	17,972	17,972	340	18,313
当期末残高	96,307	96,641	16,804	209,754	△ 1,209	208,545

平成23年3月期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

(単位:百万円)

	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	繰延ヘッジ損益	
		資本準備金	その他 利益剰余金 繰越 利益剰余金			
前期末残高	96,307	96,641	16,804	209,754	△ 1,209	208,545
当期変動額						
当期純利益(△損失)	-	-	△ 28,994	△ 28,994	-	△ 28,994
株主資本以外の項目 の事業年度中 の変動額(純額)	-	-	-	-	△ 525	△ 525
当期変動額合計	-	-	△ 28,994	△ 28,994	△ 525	△ 29,520
当期末残高	96,307	96,641	△ 12,189	180,759	△ 1,734	179,025

(4) 注記

① 貸借対照表に関する注記

1) 担保に供している資産及び担保に係る債務

(平成22年3月期)

(単位:百万円)

担保に供している資産		担保権によって担保されている債務	
種 類	期末帳簿価額	内 容	期末残高
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	31,093	短 期 借 入 金	50,000
借 入 有 価 証 券	19,374		

この他に、短期借入有価証券の担保としてトレーディング商品21,514百万円及び借入有価証券288百万円、先物取引証拠金等の代用有価証券としてトレーディング商品2,068百万円、東京証券取引所及び日本国債清算機関等に対して、トレーディング商品15,409百万円及び借入有価証券3,658百万円を差し入れております。

(平成23年3月期)

・ 担保に供している資産

トレーディング商品 510,911百万円

(注) 上記のほか、短期借入金の担保として借入有価証券255,478百万円、短期借入有価証券の担保としてトレーディング商品1,245百万円及び借入有価証券424百万円、先物取引証拠金等の代用有価証券としてトレーディング商品28,976百万円及び借入有価証券11,373百万円、大阪証券取引所及び日本国債清算機関等に対して、トレーディング商品14,660百万円及び借入有価証券14,595百万円を差し入れております。

・ 担保に係る債務

短期借入金 750,800百万円

(※) 当事業年度より、記載方法を変更しております。

	平成22年3月期	平成23年3月期
2) 有形固定資産の減価償却累計額	0百万円	0百万円
3) 関係会社に対する金銭債権及び金銭債務		
・ 短期金銭債権	185百万円	442百万円
・ 短期金銭債務	536,457百万円	15,432百万円
・ 長期金銭債務	15,300百万円	-

② 損益計算書に関する注記

関係会社との取引高

・ 営業収益	5,751百万円	-
・ 営業費用	548百万円	187百万円

③ 株主資本等変動計算書に関する注記

1) 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(平成22年3月期)

(単位:株)

	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
発行済株式	3,842,000	-	-	3,842,000
普通株式	3,842,000	-	-	3,842,000

(平成23年3月期)

(単位:株)

	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
発行済株式	3,842,000	-	-	3,842,000
普通株式	3,842,000	-	-	3,842,000

2. 借入金の主要な借入先及び借入金額

(単位:百万円)

	平成22年3月期		平成23年3月期	
	借入先の氏名又は名称	借入金額	借入先の氏名又は名称	借入金額
短期借入金	シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社	516,000	日本銀行	750,800
	セントラル短資株式会社 (コールマネー)	50,000	住友信託銀行株式会社	35,000
	住友信託銀行株式会社	35,000	株式会社整理回収機構 (コールマネー)	28,000
	シティグループ・ジャパン・トレジャリーズ株式会社	20,400	シティグループ・ジャパン・トレジャリーズ合同会社	15,300
	株式会社みずほコーポレート銀行	20,000	シティグループ・フィナンシャル・プロダクツ・インク	14,700
長期借入金	シティグループ・ジャパン・トレジャリーズ株式会社	15,300	シティグループ・フィナンシャル・プロダクツ・インク	19,600
	シティグループ・フィナンシャル・プロダクツ・インク	14,700	株式会社静岡銀行	8,000
	中央三井信託銀行株式会社	10,000		
	株式会社あおぞら銀行	5,000		
	住友信託銀行株式会社	5,000		

(注) シティグループ・ジャパン・トレジャリーズ株式会社は、平成22年6月にシティグループ・ジャパン・トレジャリーズ合同会社に組織変更及び商号変更いたしました。

3. 保有する有価証券(トレーディング商品に係るものを除く)の取得価額、時価及び評価損益

(単位:百万円)

	平成22年3月期			平成23年3月期		
	貸借対照表計上額	時価	評価損益	貸借対照表計上額	時価	評価損益
流動資産	-	-	-	-	-	-
株式	-	-	-	-	-	-
債券	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-
固定資産	1,625	-	-	1,545	-	-
株式	1,625	-	-	1,545	-	-
債券	-	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-

4. デリバティブ取引(トレーディング商品に係るものを除く。)の契約価額、時価及び評価損益

(単位:百万円)

取引の種類	平成22年3月期			平成23年3月期		
	契約価額	時価	評価損益	契約価額	時価	評価損益
長期現金担保付債券貸借取引に係る金利スワップ取引	28,000	(2,038)	△ 2,038	28,000	(2,924)	△ 2,924
外貨建現金担保付債券貸借取引に係る為替予約取引	1,037	12	12	21,658	(817)	△ 817
株価連動報酬制度に係る先渡契約	1,391	(1,180)	△ 1,180	494	(420)	△ 420
株価連動報酬制度に係る組み込みデリバティブ	1,238	1,075	1,075	415	346	346

5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無

当社は計算書類及びその附属明細書について、会社法第436条第2項第1号に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受け、適正意見の監査報告書を受領しております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となりました。

IV. 管理の状況

1. 内部管理の状況の概要

当社は内部管理を統括する部門として法務本部及びコンプライアンス本部を設置し、前者の管理下に法務部を、後者の管理下にグローバル・マーケット・コンプライアンス部、投資銀行・リサーチコンプライアンス&コントロール部、セントラル・コンプライアンス部、AMLコンプライアンス部、売買審査部、引受審査部及びコンプライアンス・プロジェクト部を配置しております。

法務部は、一般法務及び証券取引等に係る各種法令・諸規則等を役職員に遵守させ、又は当該事項に関し役職員への助言等を行います。

また、コンプライアンス本部において、内部者取引、取引価格及び取引形態等の審査等関連諸規則等に基づく指導・監督を行い、証券の取引及び勧誘等に係る各種法令・諸規則等を役職員に遵守させ、又は当該事項に関する役職員への助言等を行います。更に、適宜、社員に対してコンプライアンス・セミナーを開催するなど、社員教育に努めております。

2. 分別管理及び区分管理の状況

当社は顧客から預託を受けた金銭及び有価証券を、弊社の固有財産と分別して確実かつ整然と保管・管理しております。従って、万が一当社が破綻した場合においても、預託を受けた金銭、有価証券は確実に顧客のもとに返還されることとなっております。期末日現在の分別して保管される金銭(顧客分別金)又は有価証券の数量あるいは金額及び主な有価証券の種類別保管状況は以下の通りです。

(1) 顧客分別金信託の状況

(単位:百万円)

項 目	平成22年3月31日現在の金額	平成23年3月31日現在の金額
直近差替計算基準日の顧客分別金必要額	3,683	8,318
顧客分別金信託額	5,248	10,845
期末日現在の顧客分別金必要額	4,878	3,916

(注) 平成23年3月31日現在の金額のうち、有価証券関連店頭デリバティブ取引に係る分別金信託の状況は、直近差替計算基準日の顧客分別金必要額は0円、顧客分別金信託額は997百万円、期末日現在の顧客分別金必要額は0円であります。

(2) 有価証券の分別管理の状況

① 保護預り等有価証券

有価証券の種類	平成22年3月31日現在		平成23年3月31日現在	
	国内証券	外国証券	国内証券	外国証券
株 券	4,957,910 千株	8,984,408 千株	4,021,840 千株	8,983,985 千株
債 券	1,816,556 百万円	1,812,607 百万円	970,850 百万円	1,514,051 百万円
受 益 証 券	62 百万口	- 百万口	36 百万口	- 百万口
新株引受権証書	- 枚	100 枚	- 枚	75 枚

② 受入保証金代用有価証券

有価証券の種類	平成22年3月31日現在	平成23年3月31日現在
株 券	13,906 千株	5,682 千株
債 券	500 百万円	600 百万円
受 益 証 券	- 百万口	- 百万口
そ の 他	-	-

③ 管理の状況

有価証券の種類	保管機関および分別方法
国内取引所上場転換社債型新株予約権付社債券、投資証券、受益証券及び出資証券	原則として、証券保管振替機構(以下「機構」。機構から委託を受けたものを含む。)において、帳簿等により当社の固有財産である有価証券その他の顧客有価証券以外の有価証券(以下「固有有価証券等。’)と顧客有価証券とを区分管理し、混蔵して保管しております。顧客有価証券については、当社の帳簿等により各顧客の持分が直ちに判別できるよう管理しております。ただし、顧客の申し出等により機構へ再委託しない国内上場証券については、日本証券代行株式会社等外部保管場所において、固有有価証券等の保管場所と明確に区分し、顧客有価証券についてどの顧客の有価証券であるかが直ちに判別できる状態で保管しております。顧客有価証券について、顧客の指示により転換社債型新株予約権付社債券の新株予約権の行使(転換請求を含む。)等のため、発行会社(株主名簿管理人を含む。)へ提供したものであるについては、当該銘柄、数量及び提供先が委任顧客毎に直ちに把握できるよう当社の帳簿等により適宜管理しております。
国内上場外国有価証券	原則として、機構において、帳簿等により固有有価証券等と顧客有価証券とを区分し、管理又は混蔵して保管しております。顧客有価証券については、当社の帳簿等により各顧客の持分が直ちに判別できるよう管理しております。
振替法に基づく振替決済制度において取り扱う社債、株式等	国債については、振替法の規定に基づき、日本銀行において、固有有価証券等と顧客有価証券の口座を明確に区分し、顧客有価証券については、当社の振替口座簿により、各顧客の持分を直ちに判別できる状態で管理しております。社債、株式等(上記国債を除く。)については、振替法の規定に基づき、機構において、固有有価証券等と顧客有価証券の口座を明確に区分し、顧客有価証券については、当社の振替口座簿により、各顧客の持分を直ちに判断できる状態で管理しております。
転換社債型新株予約権付社債券、振替決済制度において取り扱う有価証券以外の国内債券及び新株予約権証券等	原則として、日本証券代行株式会社等外部保管場所において、固有有価証券等と顧客有価証券の保管場所を明確に区分し、顧客有価証券に係る各顧客の持分が当社の帳簿等により直ちに判別できる状態で保管しております。ただし、大券で発行された証券など、単一券面を自己と顧客とが共有することとされており、固有有価証券等部分と顧客有価証券部分について明確に保管場所の区分ができないものについては、当社の帳簿等により、その保管場所を明らかにするとともに、固有有価証券等部分と顧客有価証券等とを区分し、顧客有価証券に係る各顧客の持分が直ちに判別できるよう管理しております。
投資信託受益証券	原則として、機構において混蔵して保管しております。この場合において、固有有価証券等と顧客有価証券の保管場所を明確に区分させ、顧客有価証券に係る各顧客の持分については、当社の帳簿等により直ちに判別できるよう管理しております。ただし、単一券面を自己と顧客とが共有することとなった場合など、固有有価証券等部分と顧客有価証券部分について明確な保管場所の区分ができないものについては、当社の帳簿等により、その保管場所を明らかにするとともに、固有有価証券等部分と顧客有価証券等とを区分し、顧客有価証券に係る各顧客の持分が直ちに判別できるよう管理しております。
海外の保管機関で管理されている有価証券	別表のとおり海外の保管機関において、口座区分などの方法により、固有有価証券等と顧客有価証券とを区分させ、顧客有価証券に係る各顧客の持分は、当社の帳簿等により直ちに判別できる状態で保管しております。ただし、保管機関において顧客有価証券に係る持分が判別できる状態で保管させることができない場合には、当社の帳簿等により、固有有価証券等と顧客有価証券等とを区分し、顧客有価証券に係る各顧客の持分が直ちに判別できるよう管理しております。

[海外カストディの概要]

保管機関名	設立国	寄託証券の種類	口座区分の有無及び分別方法
ユーロクリア	ベルギー	オーストリア国債、イタリア国債等	保管機関に自己勘定口座と顧客勘定口座が各々開設されており、顧客勘定については混蔵保管
シティグループ・グローバル・マーケット・インク	米国	米国株式、カナダ株式、米国債券、カナダ債券等	保管機関に自己勘定口座と顧客勘定口座が各々開設されており、顧客勘定についても個別管理
シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッド	英国	英国債券等	
シティグループ・グローバル・マーケット・ユーケー・エクイティ・リミテッド	英国	英国株式等	
シティグループ・グローバル・マーケット・アジア・リミテッド	香港	香港株式等	

(3) 金融商品取引法第43条の3の規定に基づく区分管理の状況

該当事項はありません。

V. 連結子会社等の状況に関する事項

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)第2条第3号に規定する子会社及び同条第7号に規定する関連会社に該当するものではありません。

以 上