

【表紙】

【提出書類】 四半期報告書

【根拠条文】 金融商品取引法第24条の4の7第1項

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年11月10日

【四半期会計期間】 第109期第2四半期
(自 2020年7月1日 至 2020年9月30日)

【会社名】 東海東京フィナンシャル・ホールディングス株式会社

【英訳名】 Tokai Tokyo Financial Holdings, Inc.

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 最高経営責任者 石田 建昭

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋二丁目5番1号

【電話番号】 03(3517)8100(代表)

【事務連絡者氏名】 財務企画部長 高橋 順一

【最寄りの連絡場所】 東京都中央区日本橋二丁目5番1号

【電話番号】 03(3517)8100(代表)

【事務連絡者氏名】 財務企画部長 高橋 順一

【縦覧に供する場所】 株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)
株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)

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】

回次		第108期 第2四半期 連結累計期間	第109期 第2四半期 連結累計期間	第108期
会計期間		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 2019年4月1日 至 2020年3月31日
営業収益	(百万円)	28,638	32,298	61,694
純営業収益	(百万円)	27,695	30,921	59,767
経常利益又は経常損失()	(百万円)	2,532	4,025	700
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	644	2,698	2,763
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	234	3,174	547
純資産額	(百万円)	160,813	163,819	160,404
総資産額	(百万円)	1,099,401	1,450,813	1,113,313
1株当たり四半期 (当期)純利益	(円)	2.56	10.87	11.04
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	-	-	-
自己資本比率	(%)	14.3	10.9	14.1
営業活動による キャッシュ・フロー	(百万円)	48,232	2,480	10,945
投資活動による キャッシュ・フロー	(百万円)	11,682	2,846	6,686
財務活動による キャッシュ・フロー	(百万円)	11,931	8,448	18,227
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高	(百万円)	65,116	65,751	63,201

回次		第108期 第2四半期 連結会計期間	第109期 第2四半期 連結会計期間
会計期間		自 2019年7月1日 至 2019年9月30日	自 2020年7月1日 至 2020年9月30日
1株当たり四半期純利益	(円)	1.56	7.45

- (注) 1 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。
- 2 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。
- 3 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益については、希薄化効果を有している潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

2 【事業の内容】

当第2四半期連結累計期間において、当社グループ(当社、子会社及び関連会社)が営む事業の内容について、重要な変更はありません。

また、当第2四半期連結累計期間において、以下の子会社等の異動があったため、当社グループは、当社、子会社27社及び関連会社14社により構成されることとなりました。

新規関連会社

第1四半期連結会計期間において、以下の2社が新たに関連会社に加わりました。

- ・ Hash Dash Holdings株式会社(持分法適用関連会社)
- ・ Hash Dash株式会社(持分法適用関連会社)

第2 【事業の状況】

本文における将来に関する事項は、四半期報告書提出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。その内容にはリスク、不確実性、仮定が含まれており、将来の業績等を保証し又は約束するものではありません。

1 【事業等のリスク】

当第2四半期連結累計期間において、当四半期報告書に記載した事業の状況、経理の状況等に関する事項のうち、経営者が連結会社の財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況に重要な影響を与える可能性があるとして認識している主要なリスクの発生又は前事業年度の有価証券報告書に記載した「事業等のリスク」についての重要な変更はありません。

2 【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】

文中の将来に関する事項は、当四半期連結会計期間の末日現在において判断したものであります。

(1) 経営者の視点による経営成績等の状況に関する分析・検討内容

《市場環境》

当第2四半期連結累計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)のわが国経済においては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動自粛の影響を受け、4～6月期の実質GDP成長率(年率)が前期比28.1%減と過去最大の落ち込みとなりました。また、8月の失業率は3%まで上昇し、雇用環境の悪化が継続している一方、生産や輸出などには持ち直しが見られるなど、グローバルでの経済活動再開の動き等を受けて景気は全般に緩やかな改善に向かっている状況にあります。こうした経済状況の中、8月28日に安倍首相が突然辞任を表明し、それを引き継ぐ形で菅新政権が誕生しましたが、新政権下においても積極的な景気支援策が継続すると見込まれています。

海外においても経済活動自粛の動きが広がる中、米国の4～6月期の実質GDP成長率(年率)が前期比31.4%減となるなど、多くの主要国経済はいずれも過去に例を見ない急減速に見舞われました。しかし、その後は経済活動の段階的な再開や主要国政府・中央銀行による強力な景気支援策などを背景に持ち直しを見せており、7～9月期の成長率は4～6月期から急回復に向かうと見込まれます。今後の見通しに関しては、新型コロナウイルスの感染拡大状況、ワクチンの実用化の時期、政策当局の支援策の持続性などがポイントになると考えられます。

株式市場では、日経平均株価が4月に18,600円台で始まった後、主要国の政策当局が積極的に景気支援策を打ち出すとともに経済活動を段階的に再開したこと、さらには新型コロナウイルス感染症に対抗する新たなワクチンや治療薬への開発期待が高まったことなどから総じて上昇基調を継続、その結果、日経平均株価は6月8日に約3か月ぶりとなる23,000円台まで回復しました。その後は、6月のFOMC(米連邦公開市場委員会)において、米国経済に関する慎重な見通しが強調されたこと、7月下旬以降の決算発表をきっかけに4～6月期の業績悪化が改めて意識されたこと、米国株式市場において9月3日にハイテク株を中心とする大きな株価調整が入ったことを受けて度々売りに押される場面もありましたが、概ね底堅い展開を維持しました。その結果、9月末の日経平均株価は23,100円台で取引を終えました。なお、4～9月の東証1部の1日当たり平均売買代金は2兆5,993億円となり、前年同期の2兆4,139億円をわずかに上回りました。

債券市場は、長期金利の指標である10年物国債利回りが4月にマイナス0.005%で始まった後、新型コロナウイルス感染症に対する警戒感から、安全資産としての買いが相場を支え、4月28日には期中最低のマイナス0.055%まで低下しました。しかし、5月に入ると主要国の段階的な経済活動再開で景気回復期待が高まる中、株高や欧米長期金利の上昇を受けて10年物国債利回りはプラス圏まで反発しました。さらに、第二次補正予算を受けた国債増発に伴う需給悪化懸念から、7月には期中最高のプラス0.055%まで更に金利は上昇しました。その後はゼロ%からプラス0.005%以内での横ばいが続き、9月末はプラス0.015%で取引を終えました。

為替市場では、4月に1ドル107円台で始まった後、FRB(米連邦準備制度理事会)の強力な資金供給策によるドル余剰によってドル売り圧力が強まり、5月には一時106円割れまで下落しました。その後は主要国の段階的な経済活動再開や各国政府・中央銀行による積極的な政策対応を背景に株が急反発するなどリスクオンの動きが強まる中で円安ドル高が進み、6月には期中高値の109円台後半まで上昇しました。しかし、節目の110円手前では戻り売りに押されるとともに、米国の一部地域における新型コロナウイルス感染症の再拡大や株価調整の動き等が嫌気されてドル安円高に転じた結果、9月には期中安値となる104円まで下落、最終的に9月末は105円台で取引を終えました。

《財政状態の状況》

当第2四半期連結会計期間末の総資産は3,374億99百万円増加(前連結会計年度末比、以下《財政状態の状況》において同じ。)し1兆4,508億13百万円となりました。このうち流動資産は3,391億3百万円増加し1兆3,826億45百万円となりました。主な要因は、トレーディング商品(資産)が1,477億59百万円増加し5,701億11百万円となり、信用取引資産が239億89百万円増加し1,232億57百万円となり、有価証券担保貸付金が1,588億63百万円増加し5,007億32百万円となりました。

また、固定資産は、投資有価証券が6億21百万円減少し444億26百万円となったことなどから16億4百万円減少し681億67百万円となりました。

当第2四半期連結会計期間末の負債合計は3,340億84百万円増加し1兆2,869億93百万円となりました。このうち流動負債は3,369億18百万円増加し1兆1,904億26百万円となりました。主な要因は、トレーディング商品(負債)が1,603億54百万円増加し5,017億70百万円となり、約定見返勘定(負債)が508億7百万円増加し949億10百万円となり、有価証券担保借入金が1,060億79百万円増加し3,176億37百万円となり、短期借入金が174億88百万円増加し1,531億68百万円となりました。

また、固定負債は、社債が21億48百万円減少し113億47百万円となったことなどから27億9百万円減少し960億72百万円となりました。

当第2四半期連結会計期間末の利益剰余金は17億5百万円増加し1,029億81百万円となり、非支配株主持分が16億51百万円増加し50億47百万円となったことなどから、純資産合計は34億14百万円増加し1,638億19百万円となりました。

《経営成績の状況》

(受入手数料)

前第2四半期連結累計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

区分	株券 (百万円)	債券 (百万円)	受益証券 (百万円)	その他 (百万円)	合計 (百万円)
委託手数料	4,436	21	510	-	4,968
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	82	350	-	-	432
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	11	3,131	-	3,145
その他の受入手数料	29	6	2,077	2,615	4,728
合計	4,551	390	5,718	2,615	13,275

当第2四半期連結累計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

区分	株券 (百万円)	債券 (百万円)	受益証券 (百万円)	その他 (百万円)	合計 (百万円)
委託手数料	6,480	13	229	-	6,723
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	290	190	-	-	481
募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	0	4	2,711	-	2,716
その他の受入手数料	34	5	1,715	2,994	4,750
合計	6,805	214	4,657	2,994	14,671

当第2四半期連結累計期間の受入手数料の合計は10.5%増加(前年同期増減率、以下《経営成績の状況》において同じ。)し146億71百万円を計上いたしました。

委託手数料

当社の主要子会社である東海東京証券株式会社の株式委託売買高は、個人投資家の売買の増加により47.2%増加し14億89百万株、株式委託売買金額は57.0%増加し2兆7,704億円となり、当社グループの株式委託手数料は46.1%増加し64億80百万円の計上。委託手数料全体では35.3%増加し67億23百万円を計上いたしました。

引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料

株式は254.4%増加し2億90百万円を計上いたしました。一方、債券は45.6%減少し1億90百万円の計上となり、引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料全体では11.4%増加し4億81百万円を計上いたしました。

募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料

受益証券は、個人向けを中心とする投資信託の販売額が減少したことから13.4%減少し27億11百万円の計上となり、募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料全体では13.6%減少し27億16百万円を計上いたしました。

その他の受入手数料

投資信託の代行手数料は17.4%減少し17億15百万円の計上となり、また、保険手数料収入は緊急事態宣言の発令を踏まえた来店型店舗の一部閉鎖の影響などにより3.7%減少し14億52百万円の計上となる一方、コンサルティング報酬などが増加し、その他の受入手数料全体では0.5%増加し47億50百万円を計上いたしました。

(トレーディング損益)

区分	前第2四半期 連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期 連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
株券等トレーディング損益 (百万円)	7,828	11,141
債券・為替等トレーディング損益 (百万円)	6,041	4,871
合計	13,870	16,012

当第2四半期連結累計期間の株券等トレーディング損益は42.3%増加し111億41百万円の利益の計上となり、外貨建債券や仕組債の売買を中心とした債券・為替等トレーディング損益は19.4%減少し48億71百万円の利益を計上いたしました。この結果、トレーディング損益の合計は15.4%増加し160億12百万円の利益を計上いたしました。

(金融収支)

当第2四半期連結累計期間の金融収益は8.1%増加し16億14百万円を計上いたしました。また、金融費用は46.0%増加し13億77百万円を計上し、差引の金融収支は56.9%減少し2億36百万円の利益を計上いたしました。

(販売費及び一般管理費)

当第2四半期連結累計期間の取引関係費は提携合併証券からの外債販売の取次ぎ量に連動する支払手数料の減少などから15.8%減少し46億94百万円となり、人件費は5.2%減少し134億円となり、事務費は証券子会社の合併によるシステム費用の減少により17.2%減少し32億53百万円となりました。この結果、販売費及び一般管理費は8.9%減少し279億81百万円を計上いたしました。

(営業外損益)

当第2四半期連結累計期間の営業外損益は、前第2四半期連結累計期間に計上していた持分法による投資損失が利益に転じた結果、営業外収益は持分法による投資利益3億45百万円、投資事業組合運用益3億81百万円、受取配当金1億72百万円などを計上し、営業外収益の合計は35.9%増加し12億44百万円を計上いたしました。また、営業外費用は、投資事業組合運用損1億45百万円などを計上し、営業外費用の合計は63.3%減少し1億57百万円を計上いたしました。

(特別損益)

当第2四半期連結累計期間の主な特別利益は、金融商品取引責任準備金戻入1億23百万円を計上し、特別損失は投資有価証券評価損2億20百万円を計上いたしました。

以上の結果、当第2四半期連結累計期間の営業収益は12.8%増加し322億98百万円、純営業収益は11.6%増加し309億21百万円となり、営業利益は29億39百万円(前年同期営業損失30億17百万円)、経常利益は40億25百万円(前年同期経常損失25億32百万円)を計上し、法人税等を差し引いた親会社株主に帰属する四半期純利益は318.5%増加し26億98百万円を計上いたしました。

《キャッシュ・フローの状況》

当第2四半期連結累計期間の営業活動によるキャッシュ・フローは24億80百万円のキャッシュの支出(前年同期は482億32百万円の収入)となりました。これは主に、税金等調整前四半期純利益が39億27百万円となり、前連結会計年度末に比ベトレーディング商品(負債)が1,603億54百万円増加、有価証券担保借入金が1,060億79百万円増加したためそれぞれ収入となる一方、トレーディング商品(資産)が1,485億45百万円増加、有価証券担保貸付金が1,588億63百万円増加したためそれぞれ支出となったことによるものです。

投資活動によるキャッシュ・フローは28億46百万円のキャッシュの支出(前年同期は116億82百万円の支出)となりました。これは主に、短期貸付けによる支出が45億87百万円、短期貸付金の回収による収入が13億92百万円となったことなどによるものです。

財務活動によるキャッシュ・フローは84億48百万円のキャッシュの収入(前年同期は119億31百万円の支出)となりました。これは主に、短期借入金の純増額171億94百万円が収入となる一方、短期社債の発行・償還の純減額50億円、社債の発行・償還の純減額35億69百万円がそれぞれ支出となったことによるものです。

以上の結果、現金及び現金同等物の当第2四半期連結累計期間末の残高は、前連結会計年度末より25億49百万円増加し657億51百万円(前年同期は651億16百万円)となりました。

《経営方針・経営戦略等及び経営上の目標の達成状況を判断するための客観的な指標等》

当社グループは、10月1日に「東海東京フィナンシャル・グループ誕生20周年」を迎え(2000年10月、東京証券株式会社と東海丸万証券株式会社との合併により東海東京証券株式会社(以下、「東海東京証券」。))が誕生いたしました)、コーポレートスローガン「未来をつなぐ、心をむすぶ」を新しく制定しました。当社が進める地方銀行との新しい提携や、あらゆるノウハウの柔軟な連携で未来の金融業界をリードしつつ、お客さまとの信頼の絆を大切にすることにより、引き続きお客さま一人ひとりの心に寄り添ってまいります。

当社グループを取り巻く事業環境は、デジタルライゼーションの進展、フィデューシャリー・デューティーへの対応、働き方改革への取り組み、国内外のマーケットの変調、お客様のニーズの多様化、システムの高度化などに係る高コスト化、また証券ビジネスへの異業種からの参入による競争激化等、目まぐるしく変化していますが、当社グループは中期経営計画「New Age's, Flag Bearer 5 ~新時代の旗手~」(以下、「本経営計画」。)の4年目を迎え、引き続きグレートプラットフォームの機能拡充と生産性革命によって「さらなる経営基盤の強化と成長」を実現するとともに、メガバンク系証券や大手証券に対抗できる金融業界の「第3極」を形成する総合金融グループを目指してまいります。

前述の市場環境の中、本年度は、本経営計画推進のために、グループにおけるデジタルライゼーション戦略の加速・強化を目的として「デジタル戦略グループ」を新設したほか、現提携銀行を含めた地方銀行(第二地方銀行を含む)や通信・流通系企業等に対しても様々なビジネスプラットフォーム機能を幅広く提供し活用いただくために「グレートプラットフォーム事業推進部」を設け、当社グループの戦略機能の更なる高度化と早期実現を図っております。その他、「持続可能な開発目標(SDGs(1))」に対する当社グループ全体での取り組みを推進する体制として「SDGs推進部」を設置しました。当社グループは、国際連合が提唱するSDGsの趣旨に賛同し、その達成に向けた取り組みを推進するため、9月に「SDGs宣言」を制定し、経営理念である「金融機能の担い手として、お客様の資産形成や資本の充実に貢献する」事業活動を通じて常にイノベティブであるとともに、地域・人・地球環境を大切にし、持続可能な社会の実現を目指すことを公表しました。当社グループのSDGsに関わる優先すべき重要課題として、1.健康、2.教育と働き方、3.金融イノベーション、4.地域経済、5.環境保全を掲げ、今後一層取り組みを加速してまいります。

また、グループにおけるマネー・ローンダリング及びテロ資金供与対策を強化する「マネー・ローンダリング統括部」を新設し、リスク管理レベルの向上に努めております。

事業面では、2020年1月に設立、4月に発足した一般社団法人ファイナンシャル・アドバイザー協会へ、東海東京証券が委託正会員として入会しました。顧客本位の業務運営を徹底することで、顧客の信頼を高め、個人の安定的な資産形成にさらに貢献できるよう、同協会に対し継続的に支援を行ってまいります。

また、お客さまへの充実したサービスのご提供を目指しデジタル証券取引サービスの開発を進めており、6月に日本国内でデジタル証券取引所の運営を目指すHash DasH株式会社を子会社として有するHash DasH Holdings株式会社への出資を実施しております。7月には日本の不動産を証券化し、シンガポールのセキュリティ・トークン((2)以下、「ST」。)取引所であるiSTOXへの上場に向けた実証実験を開始しました。また、当社は一般社団法人日本セキュリティトークン協会(任意団体)に、東海東京証券は一般社団法人日本STO協会(自主規制団体)に正会員として加盟し、将来的には日本国内でのST販売も視野に入れております。

これらの当社グループにおけるデジタル戦略への取組やテレワークのためのインフラ整備促進などが、経済産業省と東京証券取引所が共同で主催する中長期的な企業価値の向上や競争力強化に結び付く戦略的IT投資の促進に向けた取組の一環として「攻めのIT経営銘柄」を選定する中で評価され、当社グループが「DX銘柄2020」の「DX注目企業2020」に選定されました。

当社グループの新型コロナウイルス感染症への対応につきましては、お客さま並びに役社員の健康・安全を第一に考え、新型コロナウイルス感染防止を優先した業務運営を心掛けております。5月14日から各地域毎に緊急事態宣言が解除されたことを受け、マスク着用と手の消毒を徹底の上、店頭窓口には飛沫防止スクリーンを設置するなどの感染予防策を講じ、5月18日より順次営業店舗の業務を再開しております。また、密な業務環境を避けるために、社員の時差出勤の推進及びテレワーク勤務等を実施しております。

なお、当第2四半期連結累計期間において、当社グループが定めている経営方針・経営戦略等について重要な変更はありません。中期経営計画においては、最終年度となる来年度の数値目標として自己資本利益率(ROE)10%、経常利益300億円、グループ預かり資産10兆円の指標を掲げております。

(1)SDGs:

「Sustainable Development Goals: 持続可能な開発目標(SDGs)」のことで2015年決定の「我々の世界を変革する: 持続可能な開発のための2030年アジェンダ」という国連文書に盛り込まれた概念。SDGsは2030年を目指す17の目標と169のターゲットから構成されており、企業の役割も重視され、SDGsでは、企業の本業活用が推奨されている。

(2)セキュリティ・トークン:

ブロックチェーン技術等により主に株式、債券、不動産を裏付けとしてデジタル化した証券。

(2) 優先的に対処すべき事業上及び財務上の課題

当第2四半期連結累計期間において、優先的に対処すべき事業上及び財務上の課題について、重要な変更及び新たに生じた事項はありません。

(3) 研究開発活動

該当事項はありません。

(4) 資本の財源及び資金の流動性

当社グループの主たる業務である金融商品取引業は、その業務の性質上、自己の計算により株式及び債券等の有価証券を保有するのに多額の資金を必要とします。

主な資金調達手段としては現先取引等の有担保調達、市中銀行等の金融機関借入、MTN及び短期社債の発行、コールマネー等の方法があり、資金繰り状況に応じた適切な組合せにより資金調達を行っています。

有事の際の資金調達手段として市中銀行と総額430億円のコミットメントライン契約を確保しています。また、リスク管理では関連規程に基づいて日次、週次、月次で資金繰り管理を行っている他、コンティンジェンシー・プランについても4段階の想定シナリオに基づいたリスク管理体制を定めています。

3 【経営上の重要な契約等】

当第2四半期連結会計期間において、経営上の重要な契約等は行われておりません。

第3 【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	972,730,000
計	972,730,000

【発行済株式】

種類	第2四半期会計期間 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10日)	上場金融商品取引所名 又は登録認可金融商品 取引業協会名	内容
普通株式	260,582,115	260,582,115	東京証券取引所 市場第一部 名古屋証券取引所 市場第一部	権利内容になんら限定のない、当社における標準となる株式であります。単元株式数は100株であります。
計	260,582,115	260,582,115		

(2) 【新株予約権等の状況】

【ストックオプション制度の内容】

当第2四半期会計期間において発行した新株予約権は、次のとおりであります。

第12回新株予約権

決議年月日	2020年8月24日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役3名、執行役員・参事・参与42名、従業員204名、当社完全子会社の取締役23名、及び当社子会社の取締役4名、合計276名
新株予約権の数(個)	1,355(注)1
新株予約権の目的となる株式の種類、内容及び数(株)	普通株式 1,355,000(注)1
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株あたり277(注)2
新株予約権の行使期間	2022年10月1日～2027年9月30日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 331 資本組入額 166(注)3
新株予約権の行使の条件	(注)4
新株予約権の譲渡に関する事項	譲渡による新株予約権の取得については、当社の取締役会の決議による承認を要するものとする。
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	(注)6

新株予約権証券の発行時(2020年9月7日)における内容を記載しております。

- (注) 1 新株予約権 1 個当たりの目的である株式の数(以下、「付与株式数」という。)は当社の普通株式1,000株とする。
 なお、新株予約権割当て後、当社が株式分割(当社の普通株式の株式無償割当てを含む。以下、同じ。)又は株式併合を行う場合は、新株予約権のうち当該株式分割又は株式併合の時点で行使されていないものについて、次の算式により付与株式数を調整する。ただし、調整の結果生じる 1 株未満の端数は、これを切り捨てる。

$$\text{調整後付与株式数} = \text{調整前付与株式数} \times \text{分割又は併合の比率}$$

上記のほか、新株予約権割当て後に当社が他社と合併する場合、会社分割を行う場合、資本減少を行う場合、その他これらの場合に準じて付与株式数の調整を必要とする場合には、当社は合理的な範囲で適切に付与株式数の調整を行うことができる。

- 2 新株予約権の行使に際して出資される財産の価額は、新株予約権を行使することにより交付される株式 1 株当たりの金銭の額(以下、「行使価額」という。)に付与株式数を乗じた金額とする。
 新株予約権の割当て後、当社が株式分割又は株式併合を行う場合は、行使価額は、次の算式により調整されるものとし、調整により生じる 1 円未満の端数は切り上げる。

$$\text{調整後行使価額} = \text{調整前行使価額} \times \frac{1}{\text{分割又は併合の比率}}$$

また、当社が当社の普通株式の時価を下回る価額で普通株式の発行又は当社の保有する当社の普通株式の処分(新株予約権の行使及び単元未満株式の買増請求による場合を除く。)を行う場合は、次の算式により行使価額の調整を行い、調整により生じる 1 円未満の端数は切り上げる。

$$\text{調整後行使価額} = \text{調整前行使価額} \times \frac{\text{既発行株式数} + \frac{\text{新規発行株式数} \times \text{1株当たり払込金額}}{\text{1株当たり時価}}}{\text{既発行株式数} + \text{新規発行株式数}}$$

なお、当社の保有する当社の普通株式を処分する場合は、上記の算式において「新規発行株式数」を「処分する当社の普通株式数」に、「1株当たり払込金額」を「1株当たり処分価額」に読み替える。

上記のほか、新株予約権割当て後に当社が他社と合併する場合、会社分割を行う場合、資本減少を行う場合、その他これらの場合に準じて行使価額の調整を必要とする場合には、当社は合理的な範囲で適切に行使価額の調整を行うことができる。

- 3 新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本金の額は、「会社計算規則」第17条第1項に従い算出される資本金等増加限度額の2分の1の金額とし、計算の結果 1 円未満の端数が生じたときはその端数を切り上げる。
 新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本準備金の額は、上記記載の資本金等増加限度額から、上記に定める増加する資本金の額を減じた額とする。

- 4 新株予約権を割当てられた者(以下、「新株予約権者」という。)は、本新株予約権の行使時において、当社又は当社の連結子会社の取締役、執行役員、又は従業員(従業員には当社又は当社の連結子会社から他社への出向者を含む。)たる地位を有することを要する。ただし、任期満了に伴う退任、定年退職並びに当社又は当社の連結子会社の申し入れによる辞任及び退職等正当な理由に基づきかかる地位を喪失した場合はこの限りではない。なお、有期の契約に基づく従業員(契約社員)については、理由の如何を問わず上記ただし書は適用しない。
 新株予約権者は、次の各号の一に該当することとなった場合、当該時点において未行使である本新株予約権を行使することはできないものとする。

イ 当社もしくは当社の連結子会社の株主総会決議による解任、懲戒処分による解雇又は自己都合による辞任・退職の場合。

ロ 禁固以上の刑に処せられた場合。

ハ 破産の申立もしくは民事再生手続開始の申立があった場合、又は差押、仮差押、保全差押もしくは仮処分の申立、もしくは滞納処分を受けた場合。

ニ 本新株予約権の全部又は一部を放棄する旨を申し出た場合。

ホ 「新株予約権割当て契約(付与契約)」(以下、「本契約」という。)の規定に違反した場合。

新株予約権者が死亡時に上記の要件を満たす場合で、本契約の締結後本新株予約権の行使期間満了前に死亡した場合に限り、新株予約権者の相続人は本新株予約権を承継することができるものとし(以下、本新株予約権を承継する新株予約権者の相続人のことを「権利承継者」という。)、権利承継者は、細則に従い、新株予約権者の死亡の日(その日を含む。)から 6 ヶ月間(ただし、権利承継者が権利行使できる期間は、当該 6 ヶ月間と本新株予約権の行使期間が重複する期間に限るものとする。)に限り本新株予約権を行使することができる。ただし、新株予約権者が、当社に対し、相続人による本新株予約権行使を希望しない旨を申し出た場合は、この限りではない。

新株予約権者の相続人が複数である場合には、権利承継者をその相続人のうちの一人に限定することとし、当該権利承継者は、本契約の規定、細則その他の当社の定める条件及び手続に従わなければならない。

権利承継者につき相続が開始された場合、その相続人は本新株予約権を承継しない。

本契約の各条項の適用に関しては、権利承継者を新株予約権者とみなす。

5 新株予約権の取得事由

吸収合併(合併により当社が消滅する場合に限る。)、新設合併、会社分割、株式移転又は株式交換等にかかる契約書(会社分割契約書及び株式移転計画書等を含む。)の定め又はこれらにかかる株主総会決議により、本新株予約権が承継されないこととなった場合、本新株予約権については、当社取締役会が別途定める日に、当社は本新株予約権を無償で取得することができるものとする。

6 当社が他社と吸収合併(合併により当社が消滅する場合に限る。)、新設合併、会社分割その他の組織再編(以下、「組織再編行為」という。ただし、株式移転及び株式交換は除く。)を行う場合において、組織再編行為の効力発生の時点において残存する本新株予約権(以下、「残存新株予約権」という。)の新株予約権者に対し、それぞれの場合につき、「会社法」第236条第1項8号イからホに掲げる会社(以下、「再編対象会社」という。)の新株予約権を以下の条件に基づきそれぞれ交付するものとする。ただし、以下の条件に沿って再編対象会社の新株予約権を交付する旨を吸収合併契約、新設合併契約、吸収分割契約又は新設分割計画において定めた場合に限るものとする。

交付する再編対象会社の新株予約権の数

残存新株予約権の新株予約権者が保有する本新株予約権の数と同一の数をそれぞれ交付するものとする。

新株予約権の目的である再編対象会社の株式の種類

再編対象会社の普通株式とする。

新株予約権の目的である再編対象会社の株式の数

組織再編行為の条件等を勘案のうえ、目的である株式数につき合理的な調整がなされた数(以下、「承継後株式数」という。)とする。ただし、調整により生じる1株未満の端数は切り捨てる。

新株予約権を行使することができる期間

上記「新株予約権の行使期間」に定める本新株予約権を行使することができる期間の開始日と組織再編行為の効力発生日のいずれか遅い日から、上記「新株予約権の行使期間」に定める本新株予約権を行使することができる期間の満了日までとする。

新株予約権の行使により株式を発行する場合における増加する資本金及び資本準備金に関する事項

上記「新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額」に準じて決定する。

新株予約権の行使に際して出資される財産の価額

新株予約権の行使に際して出資される財産の価額は、組織再編行為の条件等を勘案のうえ、上記「新株予約権の行使時の払込金額」に定める行使価額につき合理的な調整がなされた額に、承継後株式数を乗じた額とする。

その他新株予約権の行使の条件並びに新株予約権の取得事由

上記「新株予約権の行使の条件」及び(注)5に準じて決定する。

譲渡による新株予約権の取得の制限

譲渡による新株予約権の取得については、再編対象会社の取締役会の決議による承認を必要とする。

【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、資本金等の推移】

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 (百万円)	資本金残高 (百万円)	資本準備金 増減額 (百万円)	資本準備金 残高 (百万円)
2020年7月1日～ 2020年9月30日		260,582,115		36,000		9,000

(5) 【大株主の状況】

2020年9月30日現在

氏名又は名称	住所	所有株式数 (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(%)
日本マスタートラスト信託銀行株式会社(信託口)	東京都港区浜松町2-11-3	15,294,400	6.16
株式会社三菱UFJ銀行	東京都千代田区丸の内2-7-1	12,016,853	4.84
株式会社日本カストディ銀行(信託口)	東京都中央区晴海1-8-12	9,567,000	3.85
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台3-9	7,283,798	2.93
トヨタファイナンシャルサービス株式会社	愛知県名古屋市西区牛島町6-1	7,280,000	2.93
株式会社横浜銀行 (常任代理人 株式会社日本カストディ銀行)	神奈川県横浜市西区みなとみらい3-1-1 (東京都中央区晴海1-8-12)	7,014,553	2.82
日本生命保険相互会社 (常任代理人 日本マスタートラスト信託銀行株式会社)	東京都千代田区丸の内1-6-6 (東京都港区浜松町2-11-3)	5,611,890	2.26
三井住友信託銀行株式会社 (常任代理人 株式会社日本カストディ銀行)	東京都千代田区丸の内1-4-1 (東京都中央区晴海1-8-12)	4,800,000	1.93
株式会社日本カストディ銀行(信託口5)	東京都中央区晴海1-8-12	4,718,800	1.90
明治安田生命保険相互会社 (常任代理人 株式会社日本カストディ銀行)	東京都千代田区丸の内2-1-1 (東京都中央区晴海1-8-12)	4,406,000	1.77
計	-	77,993,294	31.40

(注) 1 上記のほか、当社が所有しております自己株式12,217,120株(発行済株式総数に対する所有株式数の割合4.69%)があります。

2 株式会社日本カストディ銀行は、JTCホールディングス株式会社、同社傘下の日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社が2020年7月に合併し発足いたしました。

(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)	(自己保有株式) 普通株式 12,217,100		単元株式数100株
完全議決権株式(その他)	普通株式 248,178,000	2,481,780	単元株式数100株
単元未満株式	普通株式 187,015		1単元(100株)未満の株式
発行済株式総数	260,582,115		
総株主の議決権		2,481,780	

(注) 1 「完全議決権株式(その他)」の普通株式には、証券保管振替機構名義の株式が2,000株(議決権20個)含まれております。

2 「単元未満株式」の普通株式には、当社所有の自己株式20株が含まれております。

【自己株式等】

2020年9月30日現在

所有者の氏名 又は名称	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(%)
(自己保有株式) 東海東京フィナンシャル・ ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋 二丁目5番1号	12,217,100		12,217,100	4.69
計		12,217,100		12,217,100	4.69

(注) 上記のほか、株主名簿上は当社名義となっておりますが、実質的に所有していない株式が1,000株(議決権10個)あります。

なお、当該株式は上記「発行済株式」の「完全議決権株式(その他)」の普通株式に含まれております。

2 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当第2四半期累計期間における役員の異動はありません。

第4 【経理の状況】

1 四半期連結財務諸表の作成方法について

当社の四半期連結財務諸表は、「四半期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19年内閣府令第64号)並びに同規則第61条及び第82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)及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)に準拠して作成しております。

2 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、第2四半期連結会計期間(2020年7月1日から2020年9月30日まで)及び第2四半期連結累計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)に係る四半期連結財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより四半期レビューを受けております。

1 【四半期連結財務諸表】

(1) 【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	64,745	67,240
預託金	51,122	53,121
顧客分別金信託	49,300	51,600
その他の預託金	1,821	1,521
トレーディング商品	422,351	570,111
商品有価証券等	407,261	564,143
デリバティブ取引	15,090	5,968
信用取引資産	99,267	123,257
信用取引貸付金	25,777	29,629
信用取引借証券担保金	73,489	93,627
有価証券担保貸付金	341,868	500,732
借入有価証券担保金	31,248	71,985
現先取引貸付金	310,620	428,747
立替金	203	87
短期差入保証金	47,107	52,345
短期貸付金	2,940	6,134
未収収益	2,666	2,622
その他	11,296	7,024
貸倒引当金	27	32
流動資産合計	1,043,541	1,382,645
固定資産		
有形固定資産	12,038	11,482
無形固定資産	5,370	5,259
投資その他の資産	52,362	51,425
投資有価証券	45,047	44,426
長期差入保証金	4,112	3,780
繰延税金資産	252	277
退職給付に係る資産	1,783	1,828
その他	1,527	1,475
貸倒引当金	362	364
固定資産合計	69,772	68,167
資産合計	1,113,313	1,450,813

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	341,416	501,770
商品有価証券等	330,161	493,588
デリバティブ取引	11,255	8,182
約定見返勘定	44,102	94,910
信用取引負債	8,943	11,643
信用取引借入金	6,876	7,666
信用取引貸証券受入金	2,067	3,976
有価証券担保借入金	211,557	317,637
有価証券貸借取引受入金	12,239	3,020
現先取引借入金	199,318	314,617
預り金	46,489	55,542
受入保証金	13,692	13,618
短期借入金	135,680	153,168
短期社債	16,000	11,000
1年内償還予定の社債	21,101	19,680
未払法人税等	695	970
賞与引当金	1,521	1,641
その他	12,305	8,841
流動負債合計	853,507	1,190,426
固定負債		
社債	13,496	11,347
長期借入金	81,909	81,601
繰延税金負債	55	38
役員退職慰労引当金	63	80
退職給付に係る負債	181	173
その他	3,075	2,830
固定負債合計	98,781	96,072
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	619	495
特別法上の準備金合計	619	495
負債合計	952,908	1,286,993
純資産の部		
株主資本		
資本金	36,000	36,000
資本剰余金	24,587	24,587
利益剰余金	101,276	102,981
自己株式	5,292	5,292
株主資本合計	156,572	158,277
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	151	216
為替換算調整勘定	390	597
退職給付に係る調整累計額	500	358
その他の包括利益累計額合計	41	22
新株予約権	478	517
非支配株主持分	3,395	5,047
純資産合計	160,404	163,819
負債純資産合計	1,113,313	1,450,813

(2) 【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】

【四半期連結損益計算書】

【第2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自2020年4月1日 至2020年9月30日)
営業収益		
受入手数料	13,275	14,671
委託手数料	4,968	6,723
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	432	481
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	3,145	2,716
その他の受入手数料	4,728	4,750
トレーディング損益	13,870	16,012
金融収益	1,492	1,614
営業収益計	28,638	32,298
金融費用	943	1,377
純営業収益	27,695	30,921
販売費及び一般管理費		
取引関係費	5,577	4,694
人件費	14,140	13,400
不動産関係費	3,904	3,618
事務費	3,931	3,253
減価償却費	1,488	1,516
租税公課	687	669
貸倒引当金繰入額	-	6
その他	984	822
販売費及び一般管理費合計	30,713	27,981
営業利益又は営業損失()	3,017	2,939
営業外収益		
受取配当金	221	172
受取家賃	231	247
持分法による投資利益	-	345
投資事業組合運用益	183	381
その他	278	96
営業外収益合計	915	1,244
営業外費用		
持分法による投資損失	219	-
投資事業組合運用損	96	145
為替差損	47	8
その他	67	4
営業外費用合計	430	157
経常利益又は経常損失()	2,532	4,025

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
特別利益		
固定資産売却益	96	-
投資有価証券売却益	154	1
持分変動利益	2,054	-
金融商品取引責任準備金戻入	0	123
特別利益合計	2,306	124
特別損失		
固定資産売却損	16	-
減損損失	0	-
投資有価証券売却損	48	2
投資有価証券評価損	1	220
特別損失合計	67	222
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()	293	3,927
法人税、住民税及び事業税	96	679
過年度法人税等	46	-
法人税等調整額	1,022	93
法人税等合計	972	773
四半期純利益	678	3,154
非支配株主に帰属する四半期純利益	33	455
親会社株主に帰属する四半期純利益	644	2,698

【四半期連結包括利益計算書】

【第2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自2020年4月1日 至2020年9月30日)
四半期純利益	678	3,154
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	590	339
為替換算調整勘定	117	207
退職給付に係る調整額	201	128
持分法適用会社に対する持分相当額	3	16
その他の包括利益合計	912	19
四半期包括利益	234	3,174
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	268	2,718
非支配株主に係る四半期包括利益	33	455

(3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (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		
税金等調整前四半期純利益又は税金等調整前四半期純損失()	293	3,927
減価償却費	1,488	1,516
減損損失	0	-
のれん償却額	121	123
持分法による投資損益(は益)	219	345
持分変動損益(は益)	2,054	-
退職給付に係る負債の増減額(は減少)	462	239
役員退職慰労引当金の増減額(は減少)	25	16
受取利息及び受取配当金	1,714	1,787
貸倒引当金の増減額(は減少)	6	6
支払利息	943	1,377
有形固定資産売却損益(は益)	80	-
投資有価証券売却損益(は益)	105	1
投資有価証券評価損益(は益)	1	220
顧客分別金信託の増減額(は増加)	3,193	2,299
トレーディング商品(資産)の増減額(は増加)	177,946	148,545
トレーディング商品(負債)の増減額(は減少)	200,006	160,354
信用取引資産の増減額(は増加)	1,147	23,989
信用取引負債の増減額(は減少)	2,259	2,699
有価証券担保貸付金の増減額(は増加)	133,922	158,863
有価証券担保借入金の増減額(は減少)	69,605	106,079
預り金の増減額(は減少)	1,018	9,091
受入保証金の増減額(は減少)	1,076	74
その他の資産の増減額(は増加)	4,321	380
その他の負債の増減額(は減少)	5,763	47,450
小計	45,246	2,898
利息及び配当金の受取額	1,207	2,015
利息の支払額	1,077	1,223
法人税等の支払額又は還付額(は支払)	2,855	373
営業活動によるキャッシュ・フロー	48,232	2,480

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (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		
有形固定資産の取得による支出	992	97
有形固定資産の売却による収入	215	-
無形固定資産の取得による支出	576	913
投資有価証券の取得による支出	11,586	319
投資有価証券の売却による収入	1,296	1,353
関係会社株式の取得による支出	45	50
差入保証金の差入による支出	127	80
差入保証金の回収による収入	457	412
短期貸付けによる支出	490	4,587
短期貸付金の回収による収入	150	1,392
その他	15	43
投資活動によるキャッシュ・フロー	11,682	2,846
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）	23,492	17,194
長期借入れによる収入	16,100	1,000
長期借入金の返済による支出	2,311	1,010
短期社債の発行による収入	37,000	28,500
短期社債の償還による支出	36,000	33,500
社債の発行による収入	15,936	9,690
社債の償還による支出	20,483	13,259
自己株式の取得による支出	3,440	-
自己株式の純増減額（は増加）	0	0
配当金の支払額	1,033	998
非支配株主からの払込みによる収入	6,324	1,227
非支配株主への配当金の支払額	7	10
その他	523	385
財務活動によるキャッシュ・フロー	11,931	8,448
現金及び現金同等物に係る換算差額	228	571
現金及び現金同等物の増減額（は減少）	24,389	2,549
現金及び現金同等物の期首残高	46,274	63,201
連結の範囲の変更に伴う現金及び現金同等物の増減額（は減少）	5,547	-
現金及び現金同等物の四半期末残高	1 65,116	1 65,751

【注記事項】

(連結の範囲又は持分法適用の範囲の変更)

第1四半期連結会計期間より、2020年6月にHash Dash Holdings株式会社の株式を取得したこと及び重要性が増したことにより同社及び同社の子会社であるHash Dash株式会社を持分法適用の範囲に含めております。

(四半期連結財務諸表の作成にあたり適用した特有の会計処理)

該当事項はありません。

(追加情報)

グループ通算制度への移行

当社及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及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 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及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。

表示方法の変更に関する追加情報

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書)

前第2四半期連結累計期間において、「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に含めておりました「短期貸付けによる支出」および「短期貸付金の回収による収入」は、重要性が増したため、当第2四半期連結累計期間より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前第2四半期連結累計期間の四半期連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前第2四半期連結累計期間の四半期連結キャッシュ・フロー計算書において、「投資活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に表示していた324百万円は、「短期貸付けによる支出」490百万円、「短期貸付金の回収による収入」150百万円、「その他」15百万円として組み替えております。

(四半期連結貸借対照表関係)

該当事項はありません。

(四半期連結損益計算書関係)

該当事項はありません。

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

1 現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
現金及び預金	66,561百万円	67,240百万円
預入期間が3ヶ月を超える 定期預金	1,444	1,488
現金及び現金同等物	65,116	65,751

(株主資本等関係)

前第2四半期連結累計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	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6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,033	4.00	2019年3月31日	2019年6月27日

2 基準日が当第2四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第2四半期連結会計期間の末日後となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	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10月30日 取締役会	普通株式	利益剰余金	993	4.00	2019年9月30日	2019年11月22日

3 株主資本の著しい変動

当社は、2019年5月20日開催の取締役会において、会社法第165条第3項の規定により読み替えて適用される同法第156条の規定に基づき、自己株式の取得を決議し、自己株式10,000,000株(取得価額3,440百万円)の取得を行いました。また、会社法第178条の規定に基づき、2019年8月30日付で10,000,000株の自己株式を消却したことにより、当第2四半期連結会計期間において資本剰余金および自己株式がそれぞれが4,332百万円減少しております。

当第2四半期連結累計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	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6月25日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	993	4.00	2020年3月31日	2020年6月26日

2 基準日が当第2四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第2四半期連結会計期間の末日後となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	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10月30日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,986	8.00	2020年9月30日	2020年11月25日

(注) 1株当たり配当額には20周年記念配当2.00円が含まれております。

3 株主資本の著しい変動

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

前第2四半期連結累計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、セグメント情報については記載していません。

当第2四半期連結累計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、セグメント情報については記載していません。

(金融商品関係)

前連結会計年度末(2020年3月31日)

科目	連結貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1)約定見返勘定(負債)	44,102	44,102	-
(2)有価証券担保借入金	211,557	211,557	-
(3)デリバティブ取引(資産)	18,613	18,613	-

(注)1 金融商品の時価の算定方法

当第2四半期連結会計期間末(注)1に記載しております。

当第2四半期連結会計期間末(2020年9月30日)

金融商品の四半期連結貸借対照表計上額のうち、事業運営において重要なものとなっており、かつ、前連結会計年度の末日に比べて著しい変動が認められるものは以下のとおりであります。

科目	四半期連結 貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1)約定見返勘定(負債)	94,910	94,910	-
(2)有価証券担保借入金	317,637	317,637	-
(3)デリバティブ取引(資産)	7,938	7,938	-

(注)1 金融商品の時価の算定方法

(1)約定見返勘定、(2)有価証券担保借入金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)デリバティブ取引

内規による時価算定基準によっており、主な算定方法は以下のとおりです。

種類	算定方法
株券オプション取引、 株価指数オプション取引、 債券先物オプション取引	主たる金融商品取引所が定める証拠金算定基準値段
為替予約取引	受取金額、支払金額をそれぞれ当該通貨の金利で現在価値に割引き、その日の為替レートで邦貨換算して算出した受取現在価値から支払現在価値を控除した額
株価指数先物取引	主たる金融商品取引所が定める清算指数
金利先物取引	金融商品取引所又は外国金融商品取引所が定める清算価格又はこれに準ずる価格
債券先物取引	主たる金融商品取引所が定める清算値段
株券店頭オプション取引、 特約付株券消費貸借取引、 エクイティスワップ取引	金利、配当利回り、ボラティリティー、原証券価格、取引期間等を基に価格算定モデルにより算出した現在価値
通貨オプション取引	スワップレート、ボラティリティー、コリレーション等を参考に受取又は支払金額の将来価値を算出し、各通貨の金利で現在価値に割引き、その日の為替レートで邦貨換算して算出した受取現在価値から支払現在価値を控除した額
金利スワップ取引、 キャップフロア取引、 通貨スワップ取引、 スワップション取引	スワップレート、ボラティリティー等を参考に受取又は支払金額の将来価値を算出し、各通貨の金利で現在価値に割引き、その日の為替レートで邦貨換算して算出した受取現在価値から支払現在価値を控除した額、ただし、一定の条件の下に金銭の相互支払が発生あるいは消滅するような取引は、受払いネットの金額の確率分布を勘案した将来価値を現在価値に割引く方法で算出した額

(有価証券関係)

有価証券の四半期連結貸借対照表計上額その他の金額は、前連結会計年度の末日と比較して著しい変動がありません。

(デリバティブ取引関係)

前連結会計年度末(2020年3月31日)

対象物の種類	取引の種類	契約額 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
金利	金利先物取引			
	売建	-	-	-
	買建	-	-	-
	債券先物取引			
	売建	23,784	53	53
	買建	27,726	8	8
株式	株価指数オプション取引			
	売建	74,271	3,193	966
	買建	51,538	2,798	967
	株券店頭オプション取引			
	売建	10,785	1,553	657
	買建	37,350	1,561	460

当第2四半期連結会計期間末(2020年9月30日)

トレーディング業務で行うデリバティブ取引は、事業運営において重要なものとなっており、かつ、前連結会計年度の末日に比べて著しい変動が認められるものは以下のとおりであります。

対象物の種類	取引の種類	契約額 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
金利	金利先物取引			
	売建	243,545	35	35
	買建	236,880	46	46
	債券先物取引			
	売建	55,138	30	30
	買建	30,588	52	52
株式	株価指数オプション取引			
	売建	19,008	1,015	93
	買建	17,850	912	56
	株券店頭オプション取引			
	売建	11,067	944	11
	買建	7,261	278	76

(企業結合等関係)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純利益及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
1株当たり四半期純利益	2円56銭	10円87銭
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益(百万円)	644	2,698
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 四半期純利益(百万円)	644	2,698
普通株式の期中平均株式数(株)	251,983,758	248,365,274
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり 四半期純利益の算定に含めなかった潜在株式で、前連結 会計年度末から重要な変動があったものの概要	-	-

(注) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益については、希薄化効果を有している潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

2 【その他】

第109期(2020年4月1日から2021年3月31日まで)中間配当について、2020年10月30日開催の取締役会において、2020年9月30日の最終の株主名簿に記載又は記録された株主又は登録株式質権者に対し、次のとおり中間配当を行うことを決議いたしました。

中間配当金の総額	1,986百万円
1株当たり中間配当金	8円(20周年記念配当2円を含む)
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	2020年11月25日

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

2020年11月9日

東海東京フィナンシャル・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 木村 充 男

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 平 木 達 也

監査人の結論

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、「経理の状況」に掲げられている東海東京フィナンシャル・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第2四半期連結会計期間（2020年7月1日から2020年9月30日まで）及び第2四半期連結累計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書、四半期連結キャッシュ・フロー計算書及び注記について四半期レビューを行った。

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、東海東京フィナンシャル・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第2四半期連結累計期間の経営成績及びキャッシュ・フローの状況を適正に表示していないと信じさせる事項が全ての重要な点において認められなかった。

監査人の結論の根拠

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四半期レビューの基準に準拠して四半期レビューを行った。四半期レビューの基準における当監査法人の責任は、「四半期連結財務諸表の四半期レビュー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、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

四半期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四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して四半期連結財務諸表を作成し適正に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四半期連結財務諸表を作成し適正に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。

四半期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四半期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四半期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。

四半期連結財務諸表の四半期レビューにおける監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した四半期レビューに基づいて、四半期レビュー報告書において独立の立場から四半期連結財務諸表に対する結論を表明することにある。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に従って、四半期レビューの過程を通じて、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。

- ・ 主として経営者、財務及び会計に関する事項に責任を有する者等に対する質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続を実施する。四半期レビュー手続は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して実施される年度の財務諸表の監査に比べて限定された手続である。
- ・ 継続企業の前提に関する事項について、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と判断した場合には、入手した証拠に基づき、四半期連結財務諸表において、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、適正に表示されていないと信じさせる事項が認められないかどうか結論付ける。また、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、四半期レビュー報告書において四半期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四半期連結財務諸表の注記事項が適切でない場合は、四半期連結財務諸表に対して限定付結論又は否定的結論を表明することが求められている。監査人の結論は、四半期レビュー報告書日までに入手した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。
- ・ 四半期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四半期連結財務諸表の作成基準に準拠していないと信じさせる事項が認められないかどうかとともに、関連する注記事項を含めた四半期連結財務諸表の表示、構成及び内容、並びに四半期連結財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示していないと信じさせる事項が認められないかどうかを評価する。
- ・ 四半期連結財務諸表に対する結論を表明するために、会社及び連結子会社の財務情報に関する証拠を入手する。監査人は、四半期連結財務諸表の四半期レビューに関する指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で監査人の結論に対して責任を負う。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した四半期レビューの範囲とその実施時期、四半期レビュー上の重要な発見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 上記は四半期レビュー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(四半期報告書提出会社)が別途保管しております。

2 XBRLデータは四半期レビューの対象には含まれていません。