

【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】 平成30年11月13日

【四半期会計期間】 第107期第2四半期
(自 平成30年7月1日 至 平成30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三丁目6番2号
(注) 平成31年1月1日から本店は下記に移転する予定であります。
本店の所在の場所 東京都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】 執行役員 財務企画部長 大野 哲嗣

【最寄りの連絡場所】 東京都中央区日本橋三丁目6番2号

【電話番号】 03(3517)8100(代表)

【事務連絡者氏名】 執行役員 財務企画部長 大野 哲嗣

【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106期 第2四半期 連結累計期間	第107期 第2四半期 連結累計期間	第106期
会計期間		自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日	自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日	自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
営業収益	(百万円)	39,831	35,842	85,261
純営業収益	(百万円)	38,704	34,714	82,919
経常利益	(百万円)	8,246	3,985	20,939
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	16,962	3,060	25,397
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	17,759	2,381	27,436
純資産額	(百万円)	171,427	171,095	174,849
総資産額	(百万円)	823,976	987,218	964,533
1株当たり四半期 (当期)純利益	(円)	64.81	11.85	97.27
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	64.78	11.84	97.18
自己資本比率	(%)	20.6	17.1	17.9
営業活動による キャッシュ・フロー	(百万円)	12,446	39,708	19,332
投資活動による キャッシュ・フロー	(百万円)	2,930	8,014	588
財務活動による キャッシュ・フロー	(百万円)	1,727	13,209	1,617
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高	(百万円)	85,600	54,481	89,204

回次		第106期 第2四半期 連結会計期間	第107期 第2四半期 連結会計期間
会計期間		自 平成29年7月1日 至 平成29年9月30日	自 平成30年7月1日 至 平成30年9月30日
1株当たり四半期純利益	(円)	14.38	5.83

- (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 第106期連結会計年度末において、企業結合に係る暫定的な会計処理の確定を行っており、第106期第2四半期連結累計期間及び第106期第2四半期連結会計期間の関連する主要な経営指標等について、暫定的な会計処理の確定の内容を反映させております。
- 4 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を第1四半期連結会計期間の期首から適用しており、前第2四半期連結累計期間及び前連結会計年度に係る主要な経営指標等については、当該会計基準等を遡って適用した後の指標等となっております。

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25社及び関連会社10社により構成されることとなりました。

新規子会社

第1四半期連結会計期間において、以下の2社が新たに子会社に加わりました。

- ・十六TT証券設立準備株式会社
- ・東海東京インキュベーション投資事業有限責任組合

新規関連会社

第1四半期連結会計期間において、以下の会社が新たに関連会社に加わりました。

- ・株式会社お金のデザイン

連結の範囲から除外した会社

当第2四半期連結会計期間において、以下の会社を連結範囲から除外いたしました。

- ・TTI中部ベンチャー1号投資事業有限責任組合

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、事業等のリスクに重要な変更及び新たに発生した事項はありません。

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。

なお、平成29年3月15日に行われた株式会社ETERNALとの企業結合について前第2四半期連結会計期間に暫定的な会計処理を行っていましたが、前連結会計年度末に確定したため、前年同四半期連結累計期間との比較・分析にあたっては、暫定的な会計処理の確定による見直し後の金額を用いております。

また、「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を第1四半期連結会計期間の期首から適用しており、財政状態の状況については、当該会計基準等を遡って適用した後の数値で前連結会計年度との比較・分析を行っております。

(1) 財政状態及び経営成績の状況

当社グループの財政状態及び経営成績の状況は、次のとおりであります。

《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226億85百万円増加(前連結会計年度末比、以下(1)において同じ。)し9,872億18百万円となりました。このうち流動資産は164億55百万円増加し9,185億59百万円となりました。主な要因は、有価証券担保貸付金が567億66百万円増加し3,458億84百万円となる一方、現金及び預金が344億93百万円減少し561億1百万円となり、トレーディング商品(資産)が238億26百万円減少し3,642億73百万円となりました。

また、固定資産は、投資有価証券が42億82百万円増加し452億52百万円となったことから62億29百万円増加し686億59百万円となりました。

当第2四半期連結会計期間末の負債合計は264億38百万円増加し8,161億22百万円となりました。このうち流動負債は286億7百万円増加し7,331億14百万円となりました。主な要因は、トレーディング商品(負債)が275億12百万円増加し3,092億21百万円となり、短期借入金が114億64百万円増加し902億16百万円となる一方、約定見返勘定(負債)が219億52百万円減少となりました。

また、固定負債は、社債が12億58百万円増加し174億58百万円となる一方、長期借入金が34億66百万円減少し614億40百万円となったことから21億74百万円減少し823億89百万円となりました。

当第2四半期連結会計期間末の利益剰余金は31億39百万円減少し1,056億21百万円となり、純資産合計は37億53百万円減少し1,710億95百万円となりました。

《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 平成29年4月1日 至 平成29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	7,782	10	198	-	7,991
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	236	200	-	-	437
募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	1	34	3,579	-	3,614
その他の受入手数料	79	9	2,198	2,048	4,335
合計	8,098	255	5,976	2,048	16,378

当第2四半期連結累計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30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	5,698	17	178	-	5,895
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	329	188	-	-	518
募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	10	44	3,335	-	3,389
その他の受入手数料	46	7	2,342	2,536	4,933
合計	6,085	258	5,856	2,536	14,736

当第2四半期連結累計期間の受入手数料の合計は10.0%減少(前年同期増減率、以下(2)において同じ。)し147億36百万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減少により13.1%減少し20億94百万株、株式委託売買金額は4.8%減少し2兆1,661億円となり、当社グループの株式委託手数料は26.8%減少し56億98百万円の計上となり、委託手数料全体では26.2%減少し58億95百万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39.6%増加し3億29百万円を計上いたしました。また、債券は6.3%減少し1億88百万円の計上となり、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18.5%増加し5億18百万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6.8%減少し33億35百万円の計上となり、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6.2%減少し33億89百万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6.6%増加し23億42百万円を計上いたしました。また、保険手数料収入は34.1%増加し14億61百万円の計上となり、その他の受入手数料全体では13.8%増加し49億33百万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 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)		当第2四半期 連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)	
株券等トレーディング損益 (百万円)		11,554		11,056
債券・為替等トレーディング損益 (百万円)		10,054		7,417
合計		21,608		18,474

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4.3%減少し110億56百万円の利益を計上いたしました。一方、債券・為替等トレーディング損益は26.2%減少し74億17百万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14.5%減少し184億74百万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42.8%増加し26億32百万円を計上いたしました。一方、金融費用は0.2%増加し11億28百万円を計上し、差引の金融収支は109.7%増加し15億3百万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販売費及び一般管理費は、取引関係費は広告宣伝費の減少等により7.9%減少し61億45百万円となり、租税公課は19.3%減少し6億59百万円となる一方、人件費は0.6%増加し150億23百万円、不動産関係費は7.7%増加し36億99百万円、減価償却費は15.3%増加し10億72百万円となりました。この結果、販売費及び一般管理費は0.8%減少し316億48百万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収益は、持分法による投資利益は42.5%減少し4億15百万円となり、受取配当金は12.2%減少し2億66百万円となりました。この結果、営業外収益の合計は29.0%減少し11億3百万円を計上いたしました。また、営業外費用の合計は80.3%増加し1億83百万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、投資有価証券売却益3億5百万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10.0%減少し358億42百万円、純営業収益は10.3%減少し347億14百万円となり、営業利益は54.9%減少し30億66百万円、経常利益は51.7%減少し39億85百万円を計上し、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82.0%減少し30億60百万円を計上いたしました。

(2) 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397億8百万円のキャッシュの支出(前年同期は124億46百万円の収入)となりました。これは主に、税金等調整前四半期純利益が42億17百万円となり、前連結会計年度末に比ベトレーディング商品(資産)が231億89百万円減少、トレーディング商品(負債)が275億12百万円増加したため、それぞれ収入となる一方、信用取引負債が43億61百万円減少、有価証券担保貸付金が567億66百万円増加したため、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80億14百万円のキャッシュの支出(前年同期は29億30百万円の収入)となりました。これは主に、関係会社株式の取得による支出が50億39百万円となったことによるものです。

財務活動によるキャッシュ・フローは132億9百万円のキャッシュの収入(前年同期は17億27百万円の支出)となりました。これは主に、短期借入金の純増額82億14百万円、短期社債の発行・償還の純増額20億円、社債の発行・償還の純増額94億86百万円がそれぞれ収入となる一方、配当金の支払額が62億円の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347億22百万円減少し544億81百万円(前年同期は856億円)となりました。

(3) 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

経営者の視点による当社グループの経営成績等の状況に関する認識及び分析・検討内容は次のとおりであります。

《重要な会計方針及び見積り》

当社グループの四半期連結財務諸表は、わが国において一般に公正妥当と認められている企業会計の基準に基づき作成しております。四半期連結財務諸表の作成にあたり、経営者は会計方針の選択・適用、資産・負債及び収益・費用の報告金額及び開示に影響を与える見積りを行わなければなりません。経営者はこれらの見積りについて過去の実績や状況に応じ合理的に判断しておりますが、実際の結果は見積り特有の不確実性があるため、これらの見積りと異なる場合があります。

当社は特に以下の重要な会計方針及び見積りが、四半期連結財務諸表に大きな影響を及ぼすと考えております。

金融商品の評価

当社グループは、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、時価をもって四半期連結貸借対照表価額とし、評価損益はトレーディング損益として計上しております。時価は、取引所等の市場価格のある有価証券及びデリバティブ取引等については市場価格により算定しております。市場価格のない有価証券及びデリバティブ取引等については主に金利、配当利回り、原証券価格、スワップレート、ボラティリティ、契約期間等を基に算出した現在価値の見積価格により算定しており、異なる前提条件等によった場合には当該時価が変動する可能性があります。

投資有価証券の減損

当社グループは、長期的な取引関係維持のため、特定の取引先の株式を所有しております。これらの株式には価格変動性の高い市場価格のある株式と、価格の決定が困難である市場価格のない株式が含まれております。当社グループは投資価値の下落が一時的ではないと判断した場合、「金融商品に関する会計基準」に基づき減損処理を行っております。市場価格のある株式については、株式の時価が一定期間継続して取得原価を30%以上下回り続けたとき等、下落が一時的ではないと判断します。市場価格のない株式については、1株当たり純資産額が取得原価の50%以下となった場合に減損処理を行います。

将来の市況悪化又は投資先の業績不振により、現在の簿価に反映されていない損失又は簿価の回収不能が生じた場合、減損処理が必要となる可能性があります。

固定資産の減損

収益性の低下により投資額の回収が見込めなくなった固定資産については、一定の条件の下で回収可能性を反映させるように、減損処理を行っております。資産又は資産グループの回収可能価額は、時価から処分費用見込額を控除した正味売却価額と割引後将来キャッシュ・フローとして算定される使用価値のいずれか高い金額であることから、固定資産の減損損失の金額は合理的な仮定及び予測に基づく将来キャッシュ・フローの見積りに依存しております。従って、固定資産の使用を変更した場合、不動産取引相場等が変動した場合及びのれんが認識された取引において取得した事業の状況に変動が生じた場合には、新たに減損損失が発生する可能性があります。

退職給付費用及び債務

従業員(執行役員を除く。)に係る退職給付費用及び債務は、数理計算上で設定される前提条件に基づいて算出されております。これらの前提条件には割引率、退職率、昇給率、直近の統計数値に基づいて算出される死亡率及び年金資産の期待収益率等が含まれております。当社グループの退職年金制度においては、割引率は期末における安全性の高い長期の債券の利回りにより、退職率は直近3年間の実績に基づいております。退職給付債務の算定にあたっては、退職給付見込額の期間帰属方法を給付算定式基準とし、割引率の設定はイールドカーブ等価アプローチによる方法により算出しております。実際の結果が前提条件と異なる場合又は前提条件が変更された場合には、将来の退職給付費用及び退職給付債務が変動する可能性があります。

繰延税金資産

当社グループは、繰延税金資産について回収可能性が高いと考えられる金額へ減額するために評価性引当金を計上しております。評価性引当金の必要性を評価するにあたっては、将来の課税所得の発生及び税務計画を検討いたします。当社グループの主たる事業である金融商品取引業は、業績変動の幅が大きく、長期にわたる課税所得の発生を予測することが困難であります。策定した経営計画の期間以内の一定期間を、将来の課税所得の見積り期間としておりますので、翌事業年度以降の課税所得の発生見積りによって、評価性引当金が増減し、繰延税金資産の調整額が発生する可能性があります。

《当第2四半期連結累計期間の経営成績等の状況に関する認識及び分析・検討内容》

当第2四半期連結累計期間のわが国経済は、度重なる台風や地震等自然災害による影響を受けつつも、概ね拡大基調で推移しました。日銀短観では大企業・製造業の業況判断DIが幾分低下したものの、輸出や鉱工業生産は緩やかな増加傾向を維持し、良好な収益環境を背景に企業の設備投資も増加しています。また雇用環境についても、8月の有効求人倍率は1.63倍、失業率は2.4%と改善が続いています。一方で、8月の消費者物価指数(生鮮食品除く総合指数)は前年比0.9%と、日本銀行の目標とする2%からは未だ乖離しており、金融政策正常化へは依然課題が残っております。

海外経済の拡大基調は続いていますが、米中貿易摩擦に対する懸念等によりその勢いは幾分弱まりつつあります。米国経済は、製造業セクターでやや鈍化がみられますが、雇用・所得環境の改善や税制改革の恩恵が大きく、全体としては消費を中心に堅調に推移しています。欧州経済は、緩やかな拡大方向にはあるものの、各国の政局の不安定さ、貿易摩擦による不確実性等により企業の投資行動は慎重姿勢の傾向を示しております。中国経済は、米国との貿易摩擦の影響で景気減速の度合いが強まりました。

株式市場は、日経平均株価が4月に21,400円台で始まった後、堅調な景気や企業業績への期待等が株価の押し上げ要因となる一方で、トランプ政権の保護貿易主義や中国経済の先行き不透明感、新興国からの資金流出懸念等が上値を抑制したことで、9月中旬までは概ね22,000円台での推移となりました。その後は、米国の強硬的とも言える貿易政策の一部に軟化の兆しが見られたことや、日本株の割安感、為替の円安進行などにより急上昇し、9月末の日経平均は24,100円台で取引を終えました。なお、4～9月の東証1部の1日当たりの平均売買代金は2兆8,286億円となり、前年同期の2兆6,589億円を上回りました。

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0.045%で始まった後、7月下旬まで概ね0.02%から0.06%台での推移となりました。日本銀行が7月の金融政策決定会合で、金融緩和の長期化を示唆する一方、「長期金利の目標誘導水準の柔軟化」を発表した後は、一時0.145%まで上昇。その後は0.1%を挟んだ動きが続き、9月末は0.125%で取引を終えました。

為替市場は、4月に1ドル106円台で始まった後、北朝鮮を巡る緊張緩和や良好な米経済指標を受けた米国の10年物国債利回りの上昇などから7月に一時113円台まで円安ドル高となりました。その後は米トランプ大統領がFRBの利上げを批判したことや米中貿易摩擦激化への懸念が強まったことにより、概ね110円から112円台での推移となりました。9月以降は日米通商協議が波乱なく日程を終えたことや米長期金利が3%台に乗せたことを受けて円安ドル高が進行し、9月末は113円台で取引を終えました。

こうした市場環境の中で当社グループは、経営計画の柱のひとつであり、当社グループの特色である国内アライアンス戦略の一環として、「十六TT証券設立準備株式会社」を設立したほか、多様化・複雑化するお客様のニーズに的確に対応するため、FinTech企業との協業を推し進め、4月におつり投資アプリ「トラノコ」を提供するTORANOTEC株式会社と資本業務提携を実施したほか、6月には口ポアドバイザー「THEO」を展開する株式会社お金のデザインの株式取得により同社を持分法適用関連会社といたしました。また、お客様への情報及び商品提供力強化のため業務提携を行っていた、ベトナムのパオベト証券に対し、7月に出資を行い、同社とのより強固なパートナーシップ構築を図っております。

金融庁より6月に公表された「投資信託の販売会社における比較可能な共通KPI」につきましては、各指標に基づき当社子会社の東海東京証券株式会社及び高木証券株式会社において平成30年3月末時点の実績を公表しております。

なお当社は、平成31年1月、本店を日本橋高島屋三井ビルディングへ移転いたします。今後は、新たな本店を起点として、急速に変化する金融業界においてお客様をはじめとしたステークホルダーの皆さまにご支持いただける「総合金融グループ」を目指してまいります。

《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、数値目標として自己資本利益率(ROE)10%、経常利益300億円、子会社及び関連会社の預かり資産10兆円の指標を掲げております。

(4) 事業上及び財務上の対処すべき課題

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

なお、当社は財務及び事業の方針の決定を支配する者の在り方に関する基本方針(以下、「基本方針」という。)を定めております。その内容等(会社法施行規則第118条第3号に掲げる事項)は以下の通りです。

基本方針の内容の概要

当社は、当社の財務及び事業の方針の決定を支配する者は、当社グループの企業価値の源泉を理解し、当社グループの企業価値ひいては株主共同の利益(以下、「当社グループの企業価値等」という。)を継続的かつ持続的に確保、向上していくことを可能とする者である必要があると考えております。

当社取締役会は、当社取締役会の賛同を得ずに行われる、いわゆる「敵対的買収」であっても、当社グループの企業価値等に資するものであれば、これを一概に否定するものではありません。また、株式会社の支配権の移転を伴う買付提案に応じるかどうかの判断も、最終的には株主の皆様に基づき行われるべきものと考えております。しかしながら、株券等の大量買付行為(において定義する。以下同じ。)の中には、その目的等から見て、対象会社の企業価値等に資さないものも少なくありません。当社グループが構築してきたコーポレートブランド・企業価値ひいては株主共同の利益を確保し、向上させていくためには、当社グループにおける企業価値の源泉を維持するとともに、経営計画を実行していくことが必要不可欠であり、これらが当社の株券等の大量買付行為を行う者により中長期的に確保され、向上させられるのであれば、当社グループの企業価値等は損なわれることとなります。

当社の企業価値の源泉及び基本方針の実現に資する特別な取組みの概要

当社グループにおける企業価値の源泉は、金融商品取引業及びその関連業務において永年にわたり蓄積してきた商品やサービス、金融・資本市場等についての高度な専門知識と豊富な経験及び当社グループをとりまく国内外のあらゆるステークホルダーの皆様との長期的信頼関係であると考えております。当社は、上記のような当社グループの企業価値等を著しく損なう大量買付行為に対しては、必要かつ相当な対抗措置を講ずることにより、当社グループの企業価値等を確保する必要があると考えております。

また、当社は、基本方針の実現に資するための取組みとして、経営計画に基づき具体的施策を実行していくことで、当社グループの企業価値等の向上を図れるものと考えております。更に、基本方針の実現に資する取組みとして、当社はコーポレート・ガバナンスの充実を経営上の重要課題の一つとして位置づけていることからコーポレート・ガバナンスに関する基本方針を定め、継続的に企業価値の向上を図ることを目的として、コーポレート・ガバナンスの強化・充実に努めております。

基本方針に照らして不適切な者によって当社の財務及び事業の方針の決定が支配されることを防止するための
取組み

当社は、平成28年6月29日開催の第104期定時株主総会の終結の時をもって有効期間が満了する「当社株式の
大量買付行為への対応策(買収防衛策)」の更新を同総会に上程し、株主の皆様にご承認いただきました(更新後
の「当社株式の大量買付行為への対応策(買収防衛策)」を、以下、「本プラン」という。)

本プランは、当社が発行者である株券等について、(a)大量買付行為を行おうとする者(以下、「大量買付
者」という。)の株券等保有割合が20%以上となる当該株券等の買付け、(b)大量買付者の株券等所有割合とそ
の特別関係者の株券等所有割合との合計が20%以上となる当該株券等の買付け、(c)当社の他の株主が、大量買
付者の共同保有者に該当し、その結果、当該大量買付者の株券等保有割合が20%以上となるような行為((a)か
ら(c)を総称して、以下、「大量買付行為」という。)を対象といたします。

本プランは、当社グループの企業価値等を確保・向上させることを目的として、当社の株券等の大量買付行
為が行われる場合等に、(a)大量買付者に対し、必要かつ十分な情報の事前提供を要請し、(b)当社経営陣が情
報収集・検討等を行う時間を確保した上で、(c)株主の皆様に対し、当社経営陣の計画や代替案等の提示や、大
量買付者との交渉を行っていくための手続きを定めております。大量買付者が本プランにおいて定められた手
続に従わない等、当社グループの企業価値等を著しく損なうと判断される場合には、当社は、対抗措置とし
て、原則として新株予約権を株主の皆様は無償で割り当てます。

本プランに従って割り当てられる新株予約権(以下、「本新株予約権」という。)には、(a)大量買付者及びそ
の関係者による行使を制限する行使条件、(b)当社が本新株予約権の取得と引換えに大量買付者及びその関係者
以外の株主の皆様当社株式を交付する取得条項等を付すことが予定されておりますが、大量買付者からその
他の財産の交付と引換えに新株予約権を取得することができる旨の条項は、採用しておりません。

本新株予約権の無償割当が実施された場合、かかる行使条件や取得条項により、当該大量買付者及びその関
係者の有する議決権の当社の総議決権に占める割合は、大幅に希釈化される可能性があります。

本プランに定めるルールに従って一連の手続が遂行されたか否か、また当社グループの企業価値等の確保又
は向上のために必要かつ相当な対抗措置を発動するか否かについては、当社取締役会が最終的な判断を行いま
す。その判断の客観性、合理性及び公正性を担保するために、当社取締役会から独立した組織として、独立委
員会を設置しております。

独立委員会は、3名以上の委員により構成され、委員は、社外取締役、実績ある会社経営者、投資銀行業務
に精通する者、当社の事業に精通する者、弁護士、公認会計士もしくは会社法等を主たる研究対象とする研究
者またはこれらに準ずる者等の社外者の中から当社取締役会が選任するものとしております。独立委員会は、
大量買付者、当社の取締役、従業員等に必要に応じて独立委員会への出席及び説明を要求することができ、当
社取締役会からの諮問事項について審議・決議して、当社取締役会に対し勧告を行います。この勧告は公表さ
れるものとし、当社取締役会はかかる勧告を最大限尊重して対抗措置の発動または不発動につき速やかに決議
を行うものとし、

本プランは、対抗措置の発動または不発動を判断する当社取締役会の決議に際して、独立委員会による勧告
手続を経なければならず、かつ当社取締役会は、同勧告を最大限尊重しなければならないものとするにより、
当社取締役会の判断の客観性、公正性及び合理性が確保できるよう設計されております。

更に、大量買付者が本プランに定められた手続を遵守した場合で、当社取締役会が大量買付行為に対する対
抗措置を発動するか否かの判断を行うにあたり、独立委員会から対抗措置発動の可否につき株主総会に諮るべ
きである旨の勧告または独立委員会から対抗措置発動の勧告を受けたときは、当該大量買付行為に対し対抗措
置を発動するか否かについて株主の皆様意思を確認するための株主総会を開催することもできるものとされ
ております。

当社取締役会は、株主総会が開催された場合、対抗措置の発動に関して、当該株主総会における株主の皆様
のご判断に従うものとし、

本プランの合理性(本プランが会社の支配に関する基本方針に沿うものであり、株主共同の利益を損なうものでないこと、会社役員の地位の維持を目的とするものでないこと及びその理由)

本プランは、以下の理由により、上記の基本方針に沿うものであり、当社株主の共同の利益を損なうものではなく、また、当社役員の地位の維持を目的とするものでもないと考えております。

会社の支配に関する基本方針に沿うものであること

本プランは、大量買付者に大量買付に関する必要かつ十分な情報を当社取締役会に事前に提供すること、情報判断のための一定の評価期間が経過した後にのみ大量買付行為を開始することを求め、当社所定のルールを遵守しない大量買付者には対抗措置を講じることとしております。

また、ルールが遵守された場合でも、大量買付行為により当社グループの企業価値等が損なわれると判断される場合は、大量買付者に対し対抗措置を講じることとしていることから、本プランは会社支配に関する基本方針に沿うものであると考えております。

買収防衛策に関する指針の要件等を完全に充足していること

本プランは、経済産業省及び法務省が平成17年5月27日に発表した「企業価値・株主共同の利益の確保又は向上のための買収防衛策に関する指針」の定める三原則(「企業価値・株主共同の利益の確保・向上の原則」、「事前開示・株主意思の原則」、「必要性・相当性確保の原則」)を完全に充足しており、また、株式会社東京証券取引所の定める買収防衛策の導入に係る諸規則の趣旨に合致したものです。なお、本プランは、平成20年6月30日に公表された、経済産業省に設置された企業価値研究会の報告書「近時の諸環境の変化を踏まえた買収防衛策の在り方」の内容も勘案しております。

株主共同の利益を損なうものではないこと

本プランは、株主の皆様が大量買付行為に応じるか否かを判断するために必要な情報や当社取締役会の意見の提供、代替案の提示を受ける機会を確保して、適切な投資判断を行うことを可能とするものであることから、企業価値ひいては株主共同の利益の確保・向上に資するものと考えております。

株主意思を重視し、また、対抗措置の発動について合理的な客観的要件を設定するものであること

本プランについて株主の皆様を適切に反映させる機会を確保するため、第104期定時株主総会において本プランを承認する議案をお諮りし、株主の皆様にご承認いただきました。また、本プランの有効期間の満了前であっても、当社株主総会において、本プランの廃止が決定された場合には、本プランはその時点で廃止されることとなり、その意味で、本プランの更新だけでなく存続についても、株主の皆様のご意向が反映されることとなっております。

また、本プランは、本プランに基づく対抗措置の発動または不発動の判断を株主の皆様が当社取締役会に委ねる前提として、当該対抗措置の発動条件を個別の場合に応じて具体的に設定し、株主の皆様に表示するものです。加えて、当社取締役会は、本プランに従った対抗措置の発動に関する決議に際して、独立委員会から対抗措置発動の可否につき株主総会に諮るべきである旨の勧告または独立委員会から対抗措置発動の勧告を受けたときは、株主総会を開催し、株主の皆様を意思を確認することができることとしております。

したがって、当該発動条件に従った対抗措置の発動は、株主の皆様のご意向が反映されたものとなります。

会社役員の地位の維持を目的とするものでないこと(独立性の高い社外者の判断を重視していること)

本プランは、対抗措置の発動に関する合理的な客観的要件が設定されていること、対抗措置の発動に際しては必ず独立委員会の判断を経ることを要し、当社取締役会は同委員会の勧告を最大限尊重するものであること等、当社取締役会による判断の公正性・客観性が担保される工夫がなされており、当社の会社役員の地位の維持を目的とするものではありません。

デッドハンド型買収防衛策やスローハンド型買収防衛策ではないこと

本プランは、当社取締役会の構成員の過半数を交代させてもなお発動を阻止できない、いわゆるデッドハンド型買収防衛策ではありません。

また、本プランは、当社取締役会の構成員の交代を一度に行うことがないために、その発動を阻止するのに時間がかかる、いわゆるスローハンド型買収防衛策でもありません。

(5) 研究開発活動

該当事項はありません。

(6) 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ありません。

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) (平成30年9月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成30年11月13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	270,582,115	270,582,115	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	270,582,115	270,582,115		

(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10回新株予約権

決議年月日	平成30年9月20日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役2名、執行役員・参事・参与53名、従業員201名及び当社完全子会社の取締役16名、執行役員・参事・参与7名、当社子会社の取締役4名、合計283名
新株予約権の数(個)	1,412(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 1,412,000(注)1
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株あたり687(注)2
新株予約権の行使期間	平成32年10月1日～平成37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 783 資本組入額 392(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(平成30年9月28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)
平成30年7月1日～ 平成30年9月30日		270,582,115		36,000		9,000

(5) 【大株主の状況】

平成30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(%)
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	4.65
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	10,451,800	4.05
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口)	東京都中央区晴海1-8-11	10,234,800	3.96
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	2.82
トヨタファイナンシャルサービス株式会社	愛知県名古屋市中区牛島町6-1	7,280,000	2.82
株式会社横浜銀行 (常任代理人 資産管理サービス信託銀行株式会社)	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	2.72
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	2.17
三井住友信託銀行株式会社 (常任代理人 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)	東京都千代田区丸の内1-4-1 (東京都中央区晴海1-8-11)	4,800,000	1.86
ジェーピー モルガン チェース バンク 385166 (常任代理人 株式会社みずほ銀行 決済営業部)	25 BANK STREET, CANARY WHARF, LONDON, E14 5JP, UNITED KINGDOM (東京都港区港南2-15-1)	4,470,400	1.73
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口5)	東京都中央区晴海1-8-11	4,421,300	1.71
計	-	73,585,394	28.48

(注) 1 上記のほか、当社が所有しております自己株式12,222,607株(発行済株式総数に対する所有株式数の割合4.52%)があります。

- 2 シュロージャー・インベストメント・マネジメント株式会社及びその共同保有者であるシュロージャー・インベストメント・マネージメント・ノースアメリカ・リミテッド、シュロージャー・インベストメント・マネージメント・リミテッド、シュロージャー・インベストメント・マネージメント(ホンコン)リミテッドから当社株式を保有する旨の大量保有報告書の変更報告書が、平成30年9月20日付(報告義務発生日 平成30年9月14日)で関東財務局長に提出されておりますが、当第2四半期会計期間末現在において実質所有株式数の確認が出来ないため、上記「大株主の状況」には含めておりません。

なお、大量保有報告書の変更報告書の内容は次のとおりであります。

氏名又は名称	住所	保有株券等の 数(株)	株券等保有割 合(%)
シュロージャー・インベストメント・マネージメント株式会社	東京都千代田区丸の内1-8-3	7,366,500	2.72
シュロージャー・インベストメント・マネージメント・ノースアメリカ・リミテッド	英国 EC2Y5AU ロンドン ロンドン・ウォール・プレイス1	7,419,214	2.74
シュロージャー・インベストメント・マネージメント・リミテッド	英国 EC2Y5AU ロンドン ロンドン・ウォール・プレイス1	4,870,800	1.80
シュロージャー・インベストメント・マネージメント(ホンコン)リミテッド	香港 クイーンズウェイ 88、ツー・パシフィック・プレイス 33階	473,000	0.17

(6) 【議決権の状況】

【発行済株式】

平成30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 12,222,600		単元株式数100株
完全議決権株式(その他)	普通株式 258,166,700	2,581,667	単元株式数100株
単元未満株式	普通株式 192,815		1単元(100株)未満の株式
発行済株式総数	270,582,115		
総株主の議決権		2,581,667	

(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7株が含まれております。

【自己株式等】

平成30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 3 - 6 - 2	12,222,600		12,222,600	4.52
計		12,222,600		12,222,600	4.52

(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(平成30年7月1日から平成30年9月30日まで)及び第2四半期連結累計期間(平成30年4月1日から平成30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 (平成30年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (平成30年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	90,594	56,101
預託金	45,830	41,630
顧客分別金信託	45,000	40,900
その他の預託金	830	730
トレーディング商品	388,099	364,273
商品有価証券等	384,823	362,043
デリバティブ取引	3,276	2,229
約定見返勘定	-	27,567
信用取引資産	57,297	57,952
信用取引貸付金	52,161	37,127
信用取引借証券担保金	5,135	20,824
有価証券担保貸付金	289,117	345,884
借入有価証券担保金	289,117	27,494
現先取引貸付金	-	318,389
立替金	1,170	386
短期差入保証金	15,411	13,042
短期貸付金	157	243
有価証券	3,000	3,000
未収収益	2,417	2,721
その他	9,058	5,791
貸倒引当金	50	35
流動資産合計	902,103	918,559
固定資産		
有形固定資産	8,127	8,882
無形固定資産	5,486	5,394
投資その他の資産	48,815	54,381
投資有価証券	40,969	45,252
長期差入保証金	3,161	4,554
繰延税金資産	140	51
退職給付に係る資産	3,542	3,579
その他	1,386	1,314
貸倒引当金	385	371
固定資産合計	62,429	68,659
資産合計	964,533	987,218

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成30年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (平成30年9月30日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	281,709	309,221
商品有価証券等	276,368	303,018
デリバティブ取引	5,340	6,202
約定見返勘定	21,952	-
信用取引負債	19,413	15,051
信用取引借入金	17,879	12,348
信用取引貸証券受入金	1,534	2,703
有価証券担保借入金	197,538	204,813
有価証券貸借取引受入金	197,538	23,373
現先取引借入金	-	181,439
預り金	35,794	43,914
受入保証金	12,794	10,474
短期借入金	78,752	90,216
短期社債	12,000	14,000
1年内償還予定の社債	29,594	37,831
未払法人税等	4,090	802
賞与引当金	3,222	2,123
役員賞与引当金	61	18
その他	7,583	4,646
流動負債合計	704,507	733,114
固定負債		
社債	16,200	17,458
長期借入金	64,906	61,440
繰延税金負債	1,716	1,678
役員退職慰労引当金	63	97
退職給付に係る負債	208	198
その他	1,468	1,517
固定負債合計	84,564	82,389
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	611	617
特別法上の準備金合計	611	617
負債合計	789,683	816,122
純資産の部		
株主資本		
資本金	36,000	36,000
資本剰余金	28,958	28,960
利益剰余金	108,761	105,621
自己株式	6,188	6,187
株主資本合計	167,531	164,395
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	2,519	2,165
為替換算調整勘定	168	373
退職給付に係る調整累計額	2,745	2,555
その他の包括利益累計額合計	5,097	4,348
新株予約権	556	607
非支配株主持分	1,664	1,745
純資産合計	174,849	171,095
負債純資産合計	964,533	987,218

(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 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
営業収益		
受入手数料	16,378	14,736
委託手数料	7,991	5,895
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	437	518
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	3,614	3,389
その他の受入手数料	4,335	4,933
トレーディング損益	21,608	18,474
金融収益	1,843	2,632
営業収益計	39,831	35,842
金融費用	1,126	1,128
純営業収益	38,704	34,714
販売費及び一般管理費		
取引関係費	6,670	6,145
人件費	14,937	15,023
不動産関係費	3,434	3,699
事務費	3,963	3,962
減価償却費	930	1,072
租税公課	817	659
その他	1,155	1,085
販売費及び一般管理費合計	31,909	31,648
営業利益	6,795	3,066
営業外収益		
受取配当金	303	266
受取家賃	287	245
持分法による投資利益	721	415
投資事業組合運用益	143	71
その他	96	104
営業外収益合計	1,553	1,103
営業外費用		
投資事業組合運用損	70	75
為替差損	20	55
その他	10	52
営業外費用合計	101	183
経常利益	8,246	3,985

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	525	305
負ののれん発生益	11,160	-
金融商品取引責任準備金戻入	0	-
特別利益合計	11,686	305
特別損失		
減損損失	-	14
関係会社株式売却損	173	-
投資有価証券売却損	0	52
投資有価証券評価損	26	-
金融商品取引責任準備金繰入れ	-	5
特別損失合計	200	73
税金等調整前四半期純利益	19,733	4,217
法人税、住民税及び事業税	5,125	823
法人税等調整額	2,410	263
法人税等合計	2,714	1,087
四半期純利益	17,018	3,129
非支配株主に帰属する四半期純利益	55	69
親会社株主に帰属する四半期純利益	16,962	3,060

【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 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
四半期純利益	17,018	3,129
その他の包括利益		
其他有価証券評価差額金	761	343
為替換算調整勘定	46	206
退職給付に係る調整額	38	176
持分法適用会社に対する持分相当額	65	22
その他の包括利益合計	741	748
四半期包括利益	17,759	2,381
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	17,704	2,312
非支配株主に係る四半期包括利益	55	69

(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 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30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	19,733	4,217
減価償却費	930	1,072
減損損失	-	14
持分法による投資損益(は益)	721	415
のれん償却額	83	123
退職給付に係る負債の増減額(は減少)	20	315
役員退職慰労引当金の増減額(は減少)	12	34
貸倒引当金の増減額(は減少)	3	29
受取利息及び受取配当金	2,147	2,898
支払利息	1,126	1,128
投資有価証券評価損益(は益)	26	-
投資有価証券売却損益(は益)	524	252
負ののれん発生益	11,160	-
顧客分別金信託の増減額(は増加)	2,900	4,100
トレーディング商品(資産)の増減額(は増加)	16,803	23,189
トレーディング商品(負債)の増減額(は減少)	3,119	27,512
信用取引資産の増減額(は増加)	1,094	655
信用取引負債の増減額(は減少)	7,178	4,361
有価証券担保貸付金の増減額(は増加)	32,457	56,766
有価証券担保借入金の増減額(は減少)	45,826	7,274
預り金の増減額(は減少)	8,679	8,190
受入保証金の増減額(は減少)	2,075	2,320
その他の資産の増減額(は増加)	1,095	21,938
その他の負債の増減額(は減少)	5,733	24,881
小計	16,362	37,977
利息及び配当金の受取額	1,963	2,223
利息の支払額	1,140	1,085
法人税等の支払額	4,739	2,870
営業活動によるキャッシュ・フロー	12,446	39,708

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30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	345	1,145
有形固定資産の売却による収入	6	-
無形固定資産の取得による支出	914	595
投資有価証券の取得による支出	624	839
投資有価証券の売却による収入	9,760	1,320
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の取得による支出	3,892	-
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の売却による支出	796	-
関係会社株式の取得による支出	-	5,039
差入保証金の差入による支出	138	1,490
差入保証金の回収による収入	35	94
その他	161	318
投資活動によるキャッシュ・フロー	2,930	8,014
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）	349	8,214
長期借入れによる収入	600	-
長期借入金の返済による支出	873	214
短期社債の発行による収入	24,800	40,500
短期社債の償還による支出	23,600	38,500
社債の発行による収入	18,863	24,827
社債の償還による支出	18,089	15,340
ストックオプションの行使による収入	30	3
自己株式の純増減額（は増加）	0	0
配当金の支払額	3,663	6,200
非支配株主からの払込みによる収入	-	20
非支配株主への配当金の支払額	8	8
その他	135	91
財務活動によるキャッシュ・フロー	1,727	13,209
現金及び現金同等物に係る換算差額	92	208
現金及び現金同等物の増減額（は減少）	13,556	34,722
現金及び現金同等物の期首残高	72,043	89,204
現金及び現金同等物の四半期末残高	1 85,600	1 54,481

【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、平成30年4月に新たに設立した十六TT証券設立準備株式会社及び東海東京インベストメント株式会社が運用し、当社及び同社が全額出資契約する東海東京インキュベーション投資事業有限責任組合を連結の範囲に含めております。また、平成30年6月に新たに株式を取得し関連会社とした株式会社お金のデザインを持分法の適用の範囲に含めております。

当第2四半期連結会計期間において、TTI中部ベンチャー1号投資事業有限責任組合は平成30年8月に清算終了したため連結の範囲から除外しております。

(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)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を第1四半期連結会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

(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 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
現金及び預金	86,266百万円	56,101百万円
預入期間が3ヶ月を超える 定期預金	665	1,619
現金及び現金同等物	85,600	54,481

(株主資本等関係)

前第2四半期連結累計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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
平成29年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	3,663	14.00	平成29年3月31日	平成29年6月30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
平成29年10月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,665	14.00	平成29年9月30日	平成29年11月24日

3 株主資本の著しい変動

該当事項はありません。

当第2四半期連結累計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30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
平成30年6月28日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	6,200	24.00	平成30年3月31日	平成30年6月29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
平成30年10月26日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,100	12.00	平成30年9月30日	平成30年11月22日

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 平成29年4月1日 至 平成29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 平成30年4月1日 至 平成30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(平成30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)
約定見返勘定(負債)	21,952	21,952	-

(注) 金融商品の時価の算定方法
約定見返勘定

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。

当第2四半期連結会計期間末(平成30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)
約定見返勘定(資産)	27,567	27,567	-

(注) 金融商品の時価の算定方法
約定見返勘定

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。

(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(平成30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	債券先物オプション取引			
	売建	-	-	-
	買建	-	-	-
株式	株価指数先物取引			
	売建	8,066	52	52
	買建	798	0	0
	株価指数オプション取引			
	売建	3,237	31	2
	買建	2,134	10	6

当第2四半期連結会計期間末(平成30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	債券先物オプション取引			
	売建	20,940	13	0
	買建	9,000	10	0
株式	株価指数先物取引			
	売建	19,400	976	976
	買建	6,884	96	96
	株価指数オプション取引			
	売建	24,339	448	93
	買建	41,720	407	142

(企業結合等関係)

比較情報における取得原価の当初配分額の重要な見直し

平成29年3月15日に行われた株式会社ETERNALとの企業結合について前第2四半期連結会計期間において暫定的な会計処理を行っていましたが、前連結会計年度末に確定しております。

この暫定的な会計処理の確定に伴い、当第2四半期連結累計期間の四半期連結財務諸表に含まれる比較情報において取得原価の当初配分額に重要な見直しが反映されております。

企業結合日においてその他無形固定資産の評価額に関する情報がなかったため、評価額を0としておりましたが、前連結会計年度に情報を入手し、評価額が1,633百万円と算定されたため見直しを行いました。これに伴い、企業結合日におけるのれんの金額の見直しも行いました。

この結果、前第2四半期連結累計期間の四半期連結損益計算書は、販売費及び一般管理費が1億69百万円増加し、法人税等調整額が69百万円減少したため、営業利益、経常利益及び税金等調整前四半期純利益がそれぞれ1億69百万円減少し、四半期純利益及び親会社株主に帰属する四半期純利益がそれぞれ1億円減少しております。

(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並びに潜在株式調整後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 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益	64円81銭	11円85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)	16,962	3,060
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)	16,962	3,060
普通株式の期中平均株式数(株)	261,730,356	258,357,441
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	64円78銭	11円84銭
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する 四半期純利益調整額(百万円)	-	-
普通株式増加数(株)	105,659	244,813
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) 前第2四半期連結累計期間の1株当たり四半期純利益及び潜在株式調整後1株当たり四半期純利益は、「企業結合等関係」の「比較情報における取得原価の当初配分額の重要な見直し」に記載の見直しが反映された後の金額により算定しております。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

2 【その他】

第107期(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)中間配当について、平成30年10月26日開催の取締役会において、平成30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	3,100百万円
1株当たり中間配当金	12円
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	平成30年11月22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

平成30年11月12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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	鈴木晴久
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	神野敦生
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	平木達也

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平成30年4月1日から平成31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(平成30年7月1日から平成30年9月30日まで)及び第2四半期連結累計期間(平成30年4月1日から平成30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。

四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した四半期レビューに基づいて、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。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。

四半期レビューにおいては、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して実施される質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続が実施される。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。

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。

監査人の結論

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平成30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すべての重要な点において認められなかった。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 上記は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。