

# 業務及び財産の 状況に関する 説明書

バークレイズ証券株式会社



2020年12月期

# 1 当社の概況及び組織に関する事項

## 1. 商号

パークレイズ証券株式会社

## 2. 登録年月日(登録番号)

金融商品取引業: 2007年9月30日(関東財務局長(金商)第143号)

## 3. 沿革及び経営の組織

### (1) 会社の沿革

| 年月         | 沿革   |
|------------|--|
| 2005年11月8日 | パークレイズ・バンク・ピーエルシーの全額出資子会社(間接的)であるパークレイズ・キャピタル・ジャパン・セキュリティーズ・ホールディングス・リミテッドの全額出資子会社として、日本の法律(商法)に基づき、日本において証券業等を行うことを目的として設立される。  |
| 2006年1月13日 | 証券取引法(当時)に基づき、証券業の登録を受ける。<br>日本投資者保護基金へ加入する。   |
| 2006年3月3日  | 金融先物取引法(当時)に基づき、金融先物取引業の登録を受ける。  |
| 2006年3月16日 | 貸金業の規制等に関する法律(現、貸金業法)に基づき、貸金業の登録を受ける。  |
| 2006年4月30日 | パークレイズ・キャピタル・ジャパン・リミテッド東京支店(パークレイズ・キャピタル証券会社)の全ての営業を譲り受ける。   |
| 2006年5月1日  | 東京証券取引所の総合取引参加者となる。<br>大阪証券取引所の現物取引参加者及び先物取引等参加者となる。<br>ジャスダック証券取引所の取引参加者となる。<br>東京金融先物取引所(現、東京金融取引所)の取引参加者(非清算参加者)となる。<br>会社の商号をパークレイズ証券準備株式会社から、パークレイズ・キャピタル証券株式会社へと商号変更し、従業員251名を以って東京本店(大手町)において営業を開始する。 |
| 2007年9月30日 | 金融商品取引法(以下、「法」という。)施行に伴い、第1種及び第2種金融商品取引業者としてのみなし登録を行う。   |
| 2010年3月15日 | 本店を東京都港区に移転する。   |
| 2012年6月18日 | 商号をパークレイズ・キャピタル証券株式会社からパークレイズ証券株式会社へと変更する。   |

### (2) 経営の組織

別表「パークレイズ証券株式会社 組織図」をご参照下さい。

## 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

| 氏名又は名称                                       | 保有株式数      | 割合   |
|--|------------|------|
| 1. パークレイズ・キャピタル・ジャパン・セキュリティーズ・ホールディングス・リミテッド | 1,542,114株 | 100% |
| 計 1名   | 1,542,114株 | 100% |

## 5. 役員の氏名

| 役職名                     | 氏名                | 代表権の有無 | 常勤・非常勤の別 |
|-------------------------|-------------------|--------|----------|
| 代表取締役社長                 | 木曾 健太郎            | 有      | 常勤       |
| 代表取締役チーフ・オペレーティング・オフィサー | 森原 恒輔             | 有      | 常勤       |
| 取締役                     | 宮本 知彦             | 無      | 常勤       |
| 取締役                     | クリストファー・コリン・フラナガン | 無      | 非常勤      |
| 監査役                     | 石川 晃三             | 無      | 常勤       |
| 監査役                     | スティーヴン・カレンダー      | 無      | 非常勤      |

## 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(法令、法令に基づく行政官庁の処分又は定款その他の規則をいう。)を遵守させるための指導に関する業務を統括する者(部長、次長、課長その他いかなる名称を有する者であるかどうかを問わず、当該業務を統括する者の権限を代行し得る地位にある者を含む。)の氏名

| 氏名    | 役職名         |
|-------|-------------|
| 日向 理元 | コンプライアンス部部长 |

- (2) 投資助言業務(金融商品取引法(以下「法」という。)第 28 条第 6 項に規定する投資助言業務をいう。)又は投資運用業(同条第 4 項に規定する投資運用業をいう。)に関し、助言又は運用(その指図を含む。)を行う部門を統括する者(金融商品の価値等(法第 2 条第 8 項第 11 号ロに規定する金融商品の価値等をいう。)の分析に基づく投資判断を行う者を含む。)の氏名

該当はありません。

- (3) 投資助言・代理業(法第 28 条第 3 項に規定する投資助言・代理業をいう。)に関し、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(部長、次長、課長その他いかなる名称を有する者であるかどうかを問わず、当該業務を統括する者の権限を代行し得る地位にある者を含む。)の氏名

該当はありません。

## 7. 業務の種類

### 金融商品取引業(金融商品取引法(以下、「法」)第2条第8項)

#### (1) 第一種金融商品取引業

- ① 法第28条第1項第1号に掲げる行為に係る業務
- ② 法第28条第1項第1号の2に掲げる行為に係る業務
- ③ 法第28条第1項第2号に掲げる行為に係る業務  
(但し、店頭デリバティブ取引についての法第2条第8項第5号に掲げる行為については該当なし)
- ④ 法第28条第1項第3号イに掲げる行為に係る業務
- ⑤ 法第28条第1項第3号ロに掲げる行為に係る業務
- ⑥ 法第28条第1項第3号ハに掲げる行為に係る業務
- ⑦ 法第28条第1項第5号に掲げる行為に係る業務

#### (2) 第二種金融商品取引業

### 付随業務(法第35条第1項)

- ① 有価証券の貸借業務
- ② 信用取引に付随する金銭の貸付け
- ③ 顧客から保護預りを行っている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業務(有価証券に関する常任代理業務を含む。)
- 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業務
- ⑥ 投資証券等に係る金銭の分配、払戻金若しくは残余財産の分配又は利息若しくは償還金の支払に係る代理業務
- 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業務
- ⑨ 他の金融商品取引業者等の業務の代理
- 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又は仲介に係る業務
- ⑪ 他の事業者の経営に関する相談に係る業務
- ⑫ 通貨その他デリバティブ取引に関連する資産の売買等業務
- ⑬ 譲渡性預金その他金銭債権の売買等業務

## 8. 本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地

| 名称 | 所在地                           |
|----|-------------------------------|
| 本店 | 〒106-6131<br>東京都港区六本木六丁目10番1号 |

## 9. 他に行っている事業の種類

### 届出業務(法第35条第2項)

- ① 商品先物取引法第2条第21項第1号に規定する商品市場における取引等に係る業務
- ② 商品先物取引法第2条第13項に規定する外国商品市場取引の媒介及び代理を行う業務
- ③ 商品先物取引法第2条第14項に規定する店頭商品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に係る業務(ただし、自己の計算で行う取引については、国内商品市場の相場を利用する店頭商品デリバティブ取引に限る。加えて、国内商品市場の相場を利用する店頭商品デリバティブ取引については、取次ぎは行わない。)
- ④ 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
- ⑤ 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
- ⑥ 匿名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
- ⑦ 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
- ⑧ 物品賃貸業
- ⑨ 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

- ⑩ 算定割当量の取得若しくは譲渡に関する契約の締結(デリバティブ取引を含む。)の媒介、取次ぎ若しくは代理を行う業務
- ⑪ 債務の保証又は引受けに係る契約の締結の媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ⑫ 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

#### 承認業務(法第 35 条第 4 項)

- ① 国外の商品先物取引所における取引の代理を行う業務
- ② 貴金属の貸借取引の媒介及び代理を行う業務
- ③ 関連会社等の業務の遂行のための業務
- ④ 商品現物取引の媒介業務

## 10. 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

日本証券業協会、金融先物取引業協会、第二種金融商品取引業協会  
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

## 11. 苦情処理及び紛争解決の体制

- (1) 第一種金融商品取引業  
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との間で手続実施基本契約を締結しています。
- (2) 第二種金融商品取引業  
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への利用登録を行っています。
- (3) 貸金業  
日本貸金業協会との間で手続実施基本契約を締結しています。

## 12. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所／その他取引所の名称又は商号

東京証券取引所、大阪取引所、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

## II 業務の状況に関する事項

### 1. 当期の業務の概要

当期の営業収益は前期と比べ受入手数料が 8 億円、金融収益が 9 億円それぞれ増加しましたが、トレーディング損失が 18 億円増加したことにより、前期比ほぼ横ばいの 555 億円となりました。なお、トレーディング損益における株券等の損失は、デリバティブ取引と組み合わせたヘッジポジションに起因するものです。金融費用が前期比 11 億円減少したことにより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 11 億円増加の 472 億円となりました。販売費・一般管理費は、取引関係費が 6 億円増加しましたが、事務費が 12 億円減少したこと等により、全体では前期比 4 億円減少の 337 億円となり、その結果、営業利益は前期比 15 億円増加の 134 億円となりました。特別損失として 29 億円の金融商品取引責任準備金繰入れ、18 億円の法人税等を計上したこと等により、当期純利益は 86 億円となりました。

なお、当社は 2018 年 12 月期より決算日を 3 月 31 日から 12 月 31 日に変更いたしました。決算期変更の経過期間となる 2018 年 12 月期は 2018 年 4 月 1 日から 2018 年 12 月 31 日までの 9 ヶ月間となります。

### 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)

|           | 2020 年<br>12 月期 | 2019 年<br>12 月期 | 2018 年<br>12 月期 |
|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 資本金       | 32,945          | 32,945          | 32,945          |
| 発行済株式総数   | 1,542,114 株     | 1,542,114 株     | 1,542,114 株     |
| 営業収益      | 55,527          | 55,552          | 39,163          |
| 受入手数料     | 45,651          | 44,802          | 29,836          |
| トレーディング損益 | △48,839         | △46,992         | △27,614         |
| 金融収益      | 58,715          | 57,742          | 36,941          |
| 金融費用      | 8,300           | 9,431           | 7,668           |
| 純営業収益     | 47,227          | 46,121          | 31,494          |
| 販売費・一般管理費 | 33,777          | 34,235          | 27,122          |
| 営業利益      | 13,449          | 11,885          | 4,372           |
| 経常利益      | 13,456          | 11,904          | 4,376           |
| 特別利益      | -               | 5               | 842             |
| 特別損失      | 2,957           | 2,809           | -               |
| 税引前当期純利益  | 10,498          | 9,100           | 5,218           |
| 法人税等      | 1,841           | △1,652          | 337             |
| 当期純利益     | 8,657           | 10,752          | 4,880           |

① 受入手数料の内訳

(単位: 百万円)

|                           | 2020年<br>12月期 | 2019年<br>12月期 | 2018年<br>12月期 |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 受入手数料                     | 45,651        | 44,802        | 29,836        |
| 委託手数料                     | 477           | 431           | 433           |
| 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料 | 636           | 953           | 768           |
| その他の受入手数料                 | 44,537        | 43,418        | 28,634        |
| 株券                        | 17,209        | 20,695        | 13,466        |
| 債券                        | 15,248        | 9,941         | 7,663         |
| 受益証券                      | 32            | 27            | 24            |
| その他                       | 12,045        | 12,754        | 7,479         |
| (うち国際取引に関する日本法人等への収益分配金等) | 8,944         | 8,484         | 6,312         |
| (うち M&A 関係収益)             | 2,878         | 3,506         | 1,000         |

② トレーディング損益の内訳

(単位: 百万円)

|           | 2020年<br>12月期 | 2019年<br>12月期 | 2018年<br>12月期 |
|-----------|---------------|---------------|---------------|
| トレーディング損益 | △48,839       | △46,992       | △27,614       |
| 株券等       | △49,969       | △47,376       | △27,604       |
| 債券等       | 1,127         | 367           | △11           |
| その他       | 2             | 16            | 1             |

(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)

|    | 2020年<br>12月期 | 2019年<br>12月期 | 2018年<br>12月期 |
|----|---------------|---------------|---------------|
| 自己 | 1,008,693     | 454,546       | 528,804       |
| 委託 | 191,991,012   | 155,596,470   | 121,135,090   |
| 計  | 192,999,705   | 156,051,016   | 121,663,894   |

- ② 有価証券の引受け及び売出し並びに特定機関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<br>向け売付け<br>勧誘等の<br>総額 | 募集の<br>取扱高   | 売出しの<br>取扱高 | 私募の<br>取扱高     | 特定投資家<br>向け売付け<br>勧誘等の<br>取扱高 |
|-----------|----------------|----------|------------------------------|--------------|-------------|----------------|-------------------------------|
| 2020年12月期 |                |          |                              |              |             |                |                               |
| 株券        | -              | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| 国債証券      | -              | /        | -                            | -            | /           | -              | -                             |
| 地方債証券     | 106,254        | /        | -                            | -            | /           | -              | -                             |
| 特殊債券      | 142,700        | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| 社債券       | 4,200          | -        | -                            | -            | -           | 189,978        | -                             |
| 受益証券      | /              | /        | /                            | 1,621        | -           | 276,425        | -                             |
| その他       | -              | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| <b>合計</b> | <b>253,154</b> | <b>-</b> | <b>-</b>                     | <b>1,621</b> | <b>-</b>    | <b>466,403</b> | <b>-</b>                      |
| 2019年12月期 |                |          |                              |              |             |                |                               |
| 株券        | -              | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| 国債証券      | -              | /        | -                            | -            | /           | -              | -                             |
| 地方債証券     | 91,224         | /        | -                            | -            | /           | -              | -                             |
| 特殊債券      | 255,000        | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| 社債券       | 8,240          | -        | -                            | -            | -           | 161,135        | -                             |
| 受益証券      | /              | /        | /                            | -            | -           | 205,306        | -                             |
| その他       | -              | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| <b>合計</b> | <b>354,464</b> | <b>-</b> | <b>-</b>                     | <b>-</b>     | <b>-</b>    | <b>366,441</b> | <b>-</b>                      |
| 2018年12月期 |                |          |                              |              |             |                |                               |
| 株券        | -              | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| 国債証券      | -              | /        | -                            | -            | /           | -              | -                             |
| 地方債証券     | 63,456         | /        | -                            | -            | /           | -              | -                             |
| 特殊債券      | 152,600        | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| 社債券       | 121,400        | -        | -                            | -            | -           | 161,452        | -                             |
| 受益証券      | /              | /        | /                            | -            | -           | 154,806        | -                             |
| その他       | -              | -        | -                            | -            | -           | -              | -                             |
| <b>合計</b> | <b>337,456</b> | <b>-</b> | <b>-</b>                     | <b>-</b>     | <b>-</b>    | <b>316,258</b> | <b>-</b>                      |

- (3) その他業務の状況

該当事項はありません。



(4) 自己資本規制比率の状況

(単位: %、百万円)

|                   | 2020年12月期 | 2019年12月期 | 2018年12月期 |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| 自己資本規制比率(A/B×100) | 429.6%    | 386.9%    | 290.8%    |
| 固定化されていない自己資本(A)  | 84,281    | 83,160    | 69,374    |
| リスク相当額(B)         | 19,618    | 21,492    | 23,854    |
| 市場リスク相当額          | 4,160     | 4,224     | 4,225     |
| 取引先リスク相当額         | 5,483     | 6,993     | 8,350     |
| 基礎的リスク相当額         | 9,974     | 10,274    | 11,279    |
| 暗号資産等による控除額       | -         | -         | -         |

(5) 使用人の総数及び外務員の総数

(単位: 名)

|       | 2020年12月期 | 2019年12月期 | 2018年12月期 |
|-------|-----------|-----------|-----------|
| 使用人   | 413       | 421       | 442       |
| うち外務員 | 150       | 152       | 156       |

### 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            | 資産の部                  |                       |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
|               | 当期                    | 前期                    |
|               | 2020年<br>12月31日<br>現在 | 2019年<br>12月31日<br>現在 |
| <b>流動資産</b>   | <b>4,831,333</b>      | <b>5,966,994</b>      |
| 現金・預金         | 24,755                | 89,499                |
| 預託金           | 412                   | 207                   |
| トレーディング商品     | 1,732,893             | 1,693,059             |
| 信用取引資産        | 3,734                 | 3,873                 |
| 有価証券担保貸付金     | 2,991,331             | 4,118,900             |
| 立替金           | 29                    | 9                     |
| 短期差入保証金       | 54,573                | 36,846                |
| 有価証券等引渡未了勘定   | 8                     | -                     |
| 未収還付法人税等      | 7,657                 | 8,188                 |
| 未収収益          | 13,986                | 13,880                |
| その他流動資産       | 1,950                 | 2,528                 |
| <b>固定資産</b>   | <b>1,921</b>          | <b>1,821</b>          |
| 投資その他の資産      |                       |                       |
| 投資有価証券        | 228                   | 218                   |
| 関係会社株式        | 513                   | 513                   |
| 長期差入保証金       | 142                   | 146                   |
| 前払年金費用        | 1,037                 | 942                   |
| <b>資産の部合計</b> | <b>4,833,255</b>      | <b>5,968,815</b>      |

| 科目                | 負債の部                  |                       |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | 当期                    | 前期                    |
|                   | 2020年<br>12月31日<br>現在 | 2019年<br>12月31日<br>現在 |
| <b>流動負債</b>       | <b>4,707,684</b>      | <b>5,856,678</b>      |
| トレーディング商品         | 183,479               | 136,950               |
| 約定見返勘定            | 17,900                | 18,803                |
| 信用取引負債            | 3,909                 | 3,734                 |
| 有価証券担保借入金         | 4,061,100             | 5,392,509             |
| 預り金               | 429                   | 685                   |
| 受入保証金             | 1,750                 | 3,374                 |
| 有価証券等受入未了勘定       | 9                     | 21                    |
| 受取差金勘定            | 37                    | 9                     |
| 短期借入金             | 428,268               | 291,183               |
| 未払費用              | 7,419                 | 5,475                 |
| 賞与引当金             | 2,152                 | 2,188                 |
| その他流動負債           | 1,226                 | 1,744                 |
| <b>固定負債</b>       | <b>60,004</b>         | <b>47,728</b>         |
| 長期借入金             | 57,800                | 46,000                |
| 繰延税金負債            | 659                   | 268                   |
| 退職給付引当金           | 1,544                 | 1,459                 |
| <b>特別法上の準備金</b>   | <b>15,727</b>         | <b>12,769</b>         |
| 金融商品取引責任準備金       | 15,727                | 12,769                |
| <b>負債合計</b>       | <b>4,783,416</b>      | <b>5,917,176</b>      |
| <b>純資産の部</b>      |                       |                       |
| <b>株主資本</b>       | <b>49,839</b>         | <b>51,639</b>         |
| 資本金               | 32,945                | 32,945                |
| 資本剰余金             | 8,236                 | 7,262                 |
| 利益剰余金             | 8,658                 | 11,432                |
| <b>評価・換算差額等</b>   | <b>Δ0</b>             | <b>Δ0</b>             |
| その他の有価証券評価差額金     | Δ0                    | Δ0                    |
| <b>純資産合計</b>      | <b>49,839</b>         | <b>51,639</b>         |
| <b>負債・純資産の部合計</b> | <b>4,833,255</b>      | <b>5,968,815</b>      |

## (2) 損益計算書

(単位: 百万円)

| 科目        | 当期                                     | 前期                                     |
|-----------|--|--|
|           | 自 2020 年 1 月 1 日<br>至 2020 年 12 月 31 日 | 自 2019 年 1 月 1 日<br>至 2019 年 12 月 31 日 |
| 受入手数料     | 45,651                                 | 44,802                                 |
| トレーディング損益 | △48,839                                | △46,992                                |
| 金融収益      | 58,715                                 | 57,742                                 |
| 営業収益      | 55,527                                 | 55,552                                 |
| 金融費用      | 8,300                                  | 9,431                                  |
| 純営業収益     | 47,227                                 | 46,121                                 |
| 販売費・一般管理費 | 33,777                                 | 34,235                                 |
| 営業利益      | 13,449                                 | 11,885                                 |
| 営業外収益     | 14                                     | 19                                     |
| 営業外費用     | 7                                      | -                                      |
| 経常利益      | 13,456                                 | 11,904                                 |
| 特別利益      | -                                      | 5                                      |
| 特別損失      | 2,957                                  | 2,809                                  |
| 税引前当期純利益  | 10,498                                 | 9,100                                  |
| 法人税等      | 1,841                                  | △1,652                                 |
| 当期純利益     | 8,657                                  | 10,752                                 |

## (3) 株主資本等変動計算書

2020年12月期(自2020年1月1日至2020年12月31日)

(単位:百万円)

| 科目                  | 株主資本   |           |                  |              |  |            |              | 純資産<br>合計 |
|---------------------|--------|-----------|------------------|--------------|--|------------|--------------|-----------|
|                     | 資本剰余金  |           |                  | 利益剰余金        |  | 株主資本<br>合計 | 評価・換算<br>差額等 |           |
|                     | 資本金    | 資本<br>準備金 | その他<br>資本<br>剰余金 | その他利益<br>剰余金 |  |            |              |           |
|                     |        |           |                  | 繰越利益<br>剰余金  |  |            |              |           |
| 2020年1月1日残高         | 32,945 | 7,262     | -                | 11,432       |  | 51,639     | Δ0           | 51,639    |
| 当期変動額               |        |           |                  |              |  |            |              |           |
| 剰余金の配当              | -      | -         | -                | Δ10,457      |  | Δ10,457    | -            | Δ10,457   |
| 資本準備金の積立            | -      | 973       | -                | Δ973         |  | -          | -            | -         |
| 当期純利益               | -      | -         | -                | 8,657        |  | 8,657      | -            | 8,657     |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額 | -      | -         | -                | -            |  | -          | Δ0           | Δ0        |
| 当期変動額合計             | -      | 973       | -                | Δ2,773       |  | Δ1,799     | Δ0           | Δ1,799    |
| 2020年12月31日残高       | 32,945 | 8,236     | -                | 8,658        |  | 49,839     | Δ0           | 49,839    |

2019年12月期(自2019年1月1日至2019年12月31日)

(単位:百万円)

| 科目                  | 株主資本   |           |                  |              |  |            |              | 純資産<br>合計 |
|---------------------|--------|-----------|------------------|--------------|--|------------|--------------|-----------|
|                     | 資本剰余金  |           |                  | 利益剰余金        |  | 株主資本<br>合計 | 評価・換算<br>差額等 |           |
|                     | 資本金    | 資本<br>準備金 | その他<br>資本<br>剰余金 | その他利益<br>剰余金 |  |            |              |           |
|                     |        |           |                  | 繰越利益<br>剰余金  |  |            |              |           |
| 2019年1月1日残高         | 32,945 | 6,774     | -                | 6,046        |  | 45,765     | Δ0           | 45,765    |
| 当期変動額               |        |           |                  |              |  |            |              |           |
| 剰余金の配当              | -      | -         | -                | Δ4,879       |  | Δ4,879     | -            | Δ4,879    |
| 資本準備金の積立            | -      | 487       | -                | Δ487         |  | -          | -            | -         |
| 当期純利益               | -      | -         | -                | 10,752       |  | 10,752     | -            | 10,752    |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額 | -      | -         | -                | -            |  | -          | Δ0           | Δ0        |
| 当期変動額合計             | -      | 487       | -                | 5,385        |  | 5,873      | Δ0           | 5,873     |
| 2019年12月31日残高       | 32,945 | 7,262     | -                | 11,432       |  | 51,639     | Δ0           | 51,639    |

## (4) 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

## 担保に供している資産

(単位: 百万円)

|                 | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|-----------------|-----------|-----------|
| 商品有価証券及び借入有価証券等 | 261,589   | 154,830   |

## 担保に係る債務

(単位: 百万円)

|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|------------|-----------|-----------|
| 金融機関からの借入金 | 417,268   | 266,883   |

## ② 差入れている有価証券等の時価額

(単位: 百万円)

|                    | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------------------|-----------|-----------|
| 信用取引貸証券            | 3,813     | 3,758     |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 2,742,396 | 2,874,817 |
| 現先取引で売却した有価証券      | 1,766,734 | 3,167,557 |
| 差入保証金代用有価証券        | 3,603     | 7,176     |
| その他担保として差し入れた有価証券  | 1,007,128 | 864,964   |

## ③ 差入れを受けている有価証券等の時価額

(単位: 百万円)

|                    | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------------------|-----------|-----------|
| 信用取引借証券            | 3,813     | 3,758     |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 1,897,047 | 1,692,732 |
| 現先取引で買い付けた有価証券     | 1,754,444 | 3,197,871 |
| 受入保証金代用有価証券        | 3,603     | 7,176     |
| その他担保として受け入れた有価証券  | 621,926   | 660,588   |

## ④ 関係会社に対する金銭債権及び金銭債務

(単位: 百万円)

|        | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------|-----------|-----------|
| 短期金銭債権 | 496,310   | 1,004,055 |
| 短期金銭債務 | 2,470,576 | 2,920,259 |
| 長期金銭債務 | 17,800    | 7,500     |

## ⑤ その他の注記 - 当座貸越契約及びコミットメントライン契約

(単位: 百万円)

|                       | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|-----------------------|-----------|-----------|
| 当座貸越契約及びコミットメントラインの総額 | 13,100    | 13,100    |
| 借入実行残高                | -         | -         |
| 差引額(借入未実行残高)          | 13,100    | 13,100    |

(5) 損益計算書に関する注記  
関係会社との取引高

(単位: 百万円)

|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|------------|-----------|-----------|
| 営業取引による取引高 |           |           |
| 営業収益       | 43,124    | △166,470  |
| 金融費用       | 865       | 1,482     |
| 販売費・一般管理費  | 385       | 538       |

(6) 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

(単位: 株)

|            | 株式の種類     |           |
|------------|-----------|-----------|
|            | 普通株式      |           |
|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
| 当事業年度期首株式数 | 1,542,114 | 1,542,114 |
| 当期増加株式数    | -         | -         |
| 当期減少株式数    | -         | -         |
| 当事業年度末株式数  | 1,542,114 | 1,542,114 |

② 剰余金の配当に関する事項

2020年12月期

| 決議                   | 株式の種類 | 配当金の総額    | 1株当たり配当額 | 効力発生日      |
|----------------------|-------|-----------|----------|------------|
| 2020年6月24日<br>臨時株主総会 | 普通株式  | 10,457百万円 | 6,781円   | 2020年6月25日 |

2019年12月期

| 決議                   | 株式の種類 | 配当金の総額   | 1株当たり配当額 | 効力発生日      |
|----------------------|-------|----------|----------|------------|
| 2019年3月27日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 4,879百万円 | 3,164円   | 2019年3月28日 |

## 2. 借入金の主要な借入先及び借入金額

(単位: 百万円)

| 借入先の氏名又は名称   | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------------|-----------|-----------|
| 日本銀行         | 5,000     | 5,000     |
| パークレイズ銀行東京支店 | 433,068   | 282,683   |
| 金融機関         | 48,000    | 49,500    |

## 3. 保有する有価証券(トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く。)の取得価額、時価及び評価損益

### (1) その他有価証券で時価のあるもの

(単位: 百万円)

|                      | 2020年12月期 |          |           | 2019年12月期 |          |           |
|----------------------|-----------|----------|-----------|-----------|----------|-----------|
|                      | 取得価額      | 貸借対照表計上額 | 評価損益      | 取得価額      | 貸借対照表計上額 | 評価損益      |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (1) 株券               | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (2) 債券               | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (3) その他              | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 0         | 0        | Δ0        | 0         | 0        | Δ0        |
| (1) 株券               | 0         | 0        | Δ0        | 0         | 0        | Δ0        |
| (2) 債券               | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (3) その他              | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| <b>合計</b>            | <b>0</b>  | <b>0</b> | <b>Δ0</b> | <b>0</b>  | <b>0</b> | <b>Δ0</b> |

### (2) 時価評価されていない主な有価証券の内容等

(単位: 百万円)

|               | 2020年12月期  | 2019年12月期  |
|---------------|------------|------------|
|               | 貸借対照表計上額   | 貸借対照表計上額   |
| 子会社株式及び関連会社株式 | 513        | 513        |
| その他有価証券       | 228        | 218        |
| (1) 非上場株式     | 216        | 216        |
| (2) その他       | 11         | 1          |
| <b>合計</b>     | <b>742</b> | <b>732</b> |

#### 4. デリバティブ取引(トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。)の契約価額、時価及び評価損益

(1) 先物取引・オプション取引の状況

① 株券

トレーディング目的以外の先物取引及びオプション取引はありません。

② 債券

トレーディング目的以外の先物取引及びオプション取引はありません。

(2) 有価証券店頭デリバティブ取引の状況

トレーディング目的以外の先物取引及びオプション取引はありません。

#### 5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無

貸借対照表(関連する注記を含む。)、損益計算書(関連する注記を含む。)、株主資本等変動計算書(関連する注記を含む。)について会社法第 436 条第 2 項第 1 号の規定に基づき、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。



## IV 管理の状況に関する事項

### 1. 内部管理の状況の概要

当社は、法令等遵守及び内部管理態勢の確立・整備に係る事柄を経営の最重要課題の一つとして位置付けて業務を推進しております。内部管理部門が法令等遵守態勢の充実及びリスク管理を行うとともに、営業単位毎に設置した営業責任者及び内部管理責任者が法令諸規則等の遵守の徹底を図っております。また、内部監査部は、リスク評価等に基づく監査計画を策定し、独立した立場で、業務執行状況や内部管理態勢（顧客からの苦情への対応方法を含む）の適切性等を検証、評価しております。

なお、顧客からの苦情につきましては、金融 ADR 制度も踏まえつつ、法令諸規則及び社内規程等に則り関係部署と連携してその事実と責任を明確にし、顧客の立場を尊重し、迅速、誠実、公平かつ適正な解決に努めて参ります。当社では営業を監督する部門が苦情対応の全般の統括および対応方針を決定し、当該方針に基づいて関係部署を指導監督するとともに、進捗状況を管理しております。

| 組織の名称 | 事務分掌        | 業務内容  |
|-------|-------------|---|
| 業務本部  | ミドルオフィス業務   | <ul style="list-style-type: none"><li>債券取引等に係わるミドル・オフィス業務、その他これに附帯する事項</li><li>OTC デリバティブ取引とストラクチャードプロダクト等に係るミドル・オフィス業務、その他これに附帯する事項</li><li>金融商品取引に係るミドル・オフィス業務、その他これに附帯する事項</li><li>上場派生商品の売買及び取引に係わるミドル・オフィス業務、その他これに附帯する事項</li><li>証券貸借取引に係るミドル・オフィス業務、その他これに附帯する事項</li></ul> |
|       | シェアードサービス業務 | <ul style="list-style-type: none"><li>流動性資金に関する資金管理の他、ファンディングに関連するキャッシュ・マネージメント業務</li><li>当局若しくは自主規制機関等への各種報告書の作成及び提出、その他これに附帯する事項</li><li>取引残高報告書その他残高証明書等の顧客への送付、その他これに附帯する事項</li><li>分別管理に関する業務、その他これに附帯する事項</li><li>金融商品取引法に定める高速取引行為者の国内における代理人にかかる業務</li></ul>              |
|       | コア・オペレーションズ | <ul style="list-style-type: none"><li>国内株式の売買取引（国内市場の外国株式を含む）に係る取引所及び顧客との決済、株券貸借取引に係る信用取引に係る決済及び担保金の管理等に関する事項、その他これに附帯する事項</li><li>債券の売買及び貸借取引の決済、債券貸借取引に係る現金担保、代用担保の管理、BOJ RTGS 決済等に係る事項、その他これに附帯する事項</li><li>株式の配当金等の受払い、コーポレートアクション、債券の元利金等の受払いに関する事項、その他これに附帯する事項</li></ul>   |

| 組織の名称                 | 事務分掌                 | 業務内容   |
|-----------------------|----------------------|--|
| 経理本部                  | 経理                   | <ul style="list-style-type: none"> <li>会計処理、自己資本の管理、税務及び財務業務、その他これに附帯する事項</li> </ul>   |
|                       | 商品管理                 | <ul style="list-style-type: none"> <li>損益の管理(フロント・オフィス及びバック・オフィス部門で入力・記帳する損益の照合、ストップ・ロス枠の監視等)に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>  |
|                       | 税務                   | <ul style="list-style-type: none"> <li>税務申告書の作成に関する業務</li> <li>税務当局等対応</li> <li>繰延税金資産等の計算業務全般、その他税務に関する業務主管</li> </ul>  |
|                       | 財務                   | <ul style="list-style-type: none"> <li>流動性リスク、保有資産、限度枠等の指標のモニタリング、その他これに附帯する事項</li> </ul>  |
|                       | 会計規制方針               | <ul style="list-style-type: none"> <li>日本会計基準・国際会計基準・バーゼル規制等に係る複雑な処理・取組等に関する助言・承認業務及び自社方針の制定・新規則等の影響調査、その他これに附帯する事項</li> </ul>   |
| コンプライアンス部             | コンプライアンス             | <ul style="list-style-type: none"> <li>法令遵守の重要性を周知・徹底するための社内規程策定</li> <li>従業員への助言及び研修</li> <li>売買審査</li> <li>金融当局・自主規制団体・取引所涉外、外務員等資格登録に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>          |
| 法務部                   | 法務                   | <ul style="list-style-type: none"> <li>法務に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>  |
| マーケット・リスク・アンド・コントロール部 | マーケット・リスク・アンド・コントロール | <ul style="list-style-type: none"> <li>市場部門における業務に係る適切かつ効率的な管理態勢の整備・構築、遂行及び維持に関する事項</li> </ul>   |
| 取引管理部                 | 取引管理                 | <ul style="list-style-type: none"> <li>取引約定処理(取引入力・訂正とその管理)を中心とした営業部門及びトレーディング部門に対するサポート業務並びにこれに附随する事項</li> </ul>  |
| 信用リスク管理部              | 信用リスク管理              | <ul style="list-style-type: none"> <li>顧客の信用リスク管理に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>  |
| 市場リスク管理部              | 市場リスク管理              | <ul style="list-style-type: none"> <li>債券や株式等のトレーディングに係るポートフォリオの市場リスク管理に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>  |
| オペレーショナル・リスク管理部       | オペレーショナル・リスク管理       | <ul style="list-style-type: none"> <li>オペレーショナル・リスクの管理の枠組みを通じて、オペレーショナル・リスクの特定、計測及び軽減に関し、独立した立場で助言・支援を行う業務、その他これに附随する事項</li> </ul>   |
| サイバー・情報セキュリティ部        | サイバー・情報セキュリティ        | <ul style="list-style-type: none"> <li>情報資産の機密性、完全性、及び可用性を保護・維持する為の管理に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>  |
| 新商品サービス部              | 新商品サービス              | <ul style="list-style-type: none"> <li>日本に関係する New Products Services (NPS) 承認プロセスについて、日本の関係者がプロセスに関与し、レビューを行っているか、また、その結果が NPS 承認プロセスに反映されるように管理する</li> </ul>                  |
| 委託業務管理部               | 委託業務管理               | <ul style="list-style-type: none"> <li>業務委託(外部委託に相当しない物品・サービスの調達を含む。)先の選定、管理に関する事項、その他これに附帯する事項</li> </ul>   |
| 事業継続管理部               | 事業継続管理               | <ul style="list-style-type: none"> <li>業務に影響又は脅威を及ぼす又は及ぼす可能性がある危機等の管理に関する事項、それに附帯する事項</li> </ul>   |
| 業務企画部                 | 業務企画                 | <ul style="list-style-type: none"> <li>国内外の規制要件への対応及びバークレイズの戦略に従って必要な対応、その他これに付帯する事項。国内外規制変更等に適切に対応するための情報収集、商品横断的な分析や部門間のコーディネーション等、必要なプロセスやリスク管理の枠組みの構築に係るサポート業務。</li> </ul> |
| チーフ・コントロール・オフィス部      | チーフ・コントロール           | <ul style="list-style-type: none"> <li>グローバルで運用されているチーフ・コントロール・オフィスの枠組みに基づく管理態勢に関する事項</li> </ul>   |
| 内部監査部                 | 内部監査                 | <ul style="list-style-type: none"> <li>内部監査に関する事項等、その他これに附帯する事項</li> </ul>   |
| インフォメーション・テクノロジー本部    | インフォメーション・テクノロジー     | <ul style="list-style-type: none"> <li>コンピューター関連業務(システム開発、保守管理、データの保管管理、電算処理等)</li> <li>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</li> </ul>                                 |

## 2. 分別管理の状況

### (1) 顧客分別金信託の状況

(単位: 百万円)

|                    | 2020年12月31日現在 | 2019年12月31日現在 |
|--------------------|---------------|---------------|
| 直近差替計算基準日の顧客分別金必要額 | 30            | 58            |
| 顧客分別金信託額           | 400           | 200           |
| 期末日現在の顧客分別金必要額     | 2             | 248           |

### (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 |      | 2020年12月31日現在 |             | 2019年12月31日現在 |             |
|---------|------|---------------|-------------|---------------|-------------|
|         |      | 国内証券          | 外国証券        | 国内証券          | 外国証券        |
| 株券      | 株数   | 235,475 千株    | - 千株        | 189,053 千株    | - 千株        |
| 債券      | 額面金額 | 91,523 百万円    | 397,524 百万円 | 113,795 百万円   | 259,831 百万円 |
| 受益証券    | 口数   | 580,718 百万口   | - 百万口       | 485,907 百万口   | - 百万口       |
| 新株引受権証書 | 数量   | 84,957 枚      | - 枚         | 12,776 枚      | - 枚         |
| 信託受益権   | 口数   | - 百万口         | - 百万口       | - 百万口         | - 百万口       |

#### ② 受入保証金代用有価証券

| 有価証券の種類 |      | 2020年12月31日現在 | 2019年12月31日現在 |
|---------|------|---------------|---------------|
|         |      | 数量            | 数量            |
| 株券      | 株数   | - 千株          | - 千株          |
| 債券      | 額面金額 | - 百万円         | - 百万円         |
| 受益証券    | 口数   | - 百万口         | - 百万口         |
| その他     | 数量   | -             | -             |

#### ③ 管理の状況

(有価証券の保管方法)

当社は、顧客との取引に関して顧客から預託を受けた有価証券及び顧客の計算に属する有価証券(以下「顧客有価証券」という。)について、次の各号に定める方法により確実にかつ整然と保管する。定めた方法による保管が不可能な有価証券については、評価額を顧客分別金必要額に加算する。

##### A. 国内の取引所金融商品市場に上場されている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

- 国内の取引所金融商品市場に上場されている転換社債型新株予約権付社債券(転換社債券を含む。以下同じ。)、投資証券、受益証券及び出資証券(以下「国内上場証券」という。)については、原則として、証券保管振替機構(以下「機構」という。機構から委託を受けたものを含む。以下同じ。)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」という。)と顧客有価証券とを区分管理し、混合して保管する。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する。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における鉄庫において、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する。やむを得ず当社内金庫にて保管することとなった場合は、固有有価証券等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する。
- 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。以下同じ。)へ提供したものについては、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する。

## B. 国内上場外国有価証券

国内上場外国有価証券については、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、管理又は混合して保管する。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する。

## C. 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

- a. 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明できる状態で管理する。譲渡担保口にて管理されている残高については、固有有価証券等と顧客有価証券との区分および顧客有価証券の場合における各顧客の持分を当社の振替口座簿により各顧客の持分を直ちに判明できる状態で管理する。
- b. 社債、株式等(a.に規定する国債を除く)については、振替法の規定に基づき、機構又は株式会社だいがう証券ビジネスにおいて、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明できる状態で管理する。

注：「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」には、現在、社債、国債、地方債、投資法人債、相互会社の社債、特定社債、特別法人債、投資信託又は外国投資信託の受益権、貸付信託の受益権、特定目的信託の受益権、受益証券発行信託の受益権、株式、新株予約権、新株予約権付社債、投資口、優先出資、新投資口予約権、新優先出資の引受権、転換特定社債、新優先出資引受権付特定社債が該当する。

## D. 転換社債型新株予約券付社債券及びC.に規定する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における鉄庫において、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管理する。やむを得ず当社内金庫にて保管することとなった場合は、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管理する。

## E. 投資信託受益証券

原則として、株式会社だいがう証券ビジネスにおいて保管する。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する。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、固有有価証券分と顧客有価証券分とを区分し、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する。

## F. 海外の保管機関で保管されている有価証券

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管理すること。ただし、当該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、固有有価証券分と顧客有価証券分とを区分し、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する。

### 海外カストディの概要

| 保管機関名       | 設立国     | 預託証券の種類 | 口座区分の有無及び分別方法 |
|-------------|---------|---------|---------------|
| クリアストリームバンク | ルクセンブルグ | ユーロ債券等  | 自己・顧客口座を区分管理  |

### (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

#### ① 法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況

該当取引はありません。

#### ② 法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況

該当取引はありません。

## V 特別金融商品取引業者及びその子法人等の概況に関する事項

### 1. 特別金融商品取引業者の商号

パークレイズ証券株式会社

### 2. 特別金融商品取引業者の登録年月日(登録番号)

金融商品取引業者登録: 2007年9月30日(関東財務局長(金商)第143号)

### 3. 特別金融商品取引業者の届出日

2011年4月14日

### 4. 主要な事業の内容及び組織の構成

当社は金融商品取引業を、当社の子会社(1社)はウェルス業務に関するサービスの提供を行っております。

### 5. 子会社等に関する事項

(2020年12月31日現在)

| 商号又は名称               | 本店又は主たる事務所の所在地   | 資本金の額      | 事業の内容             | 特別金融商品取引業者の議決権保有割合 | 特別金融商品取引業者及び他の子法人等の議決権保有割合 |
|----------------------|------------------|------------|-------------------|--------------------|----------------------------|
| パークレイズ・ウェルス・サービス株式会社 | 東京都港区六本木六丁目10番1号 | 7,485,001円 | ウェルス業務に関するサービスの提供 | 100%               | 100%                       |

## VI 特別金融商品取引業者及びその子法人等の業務の状況に関する事項

### 1. 当期の業務の概要

当期の営業収益は前期と比べ受入手数料が8億円、金融収益が9億円それぞれ増加しましたが、トレーディング損失が18億円増加したことにより、前期比ほぼ横ばいの556億円となりました。なお、トレーディング損益における株券等の損失は、デリバティブ取引と組み合わせたヘッジポジションに起因するものです。金融費用が前期比11億円減少したことにより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11億円増加の473億円となりました。販売費・一般管理費は、取引関係費が6億円増加しましたが、事務費が12億円減少したこと等により、全体では前期比4億円減少の339億円となり、その結果、営業利益は前期比15億円増加の134億円となりました。特別損失として29億円の金融商品取引責任準備金繰入れ、18億円の法人税等を計上したこと等により、当期純利益は86億円となりました。

なお、当社は2018年12月期より決算日を3月31日から12月31日に変更いたしました。決算期変更の経過期間となる2018年12月期は2018年4月1日から2018年12月31日までの9ヶ月間となります。

### 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)

|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 | 2018年12月期 |
|------------|-----------|-----------|-----------|
| 営業収益       | 55,665    | 55,679    | 39,290    |
| 純営業収益      | 47,365    | 46,247    | 31,622    |
| 経常利益       | 13,463    | 11,935    | 4,382     |
| 当期純利益      | 8,663     | 10,742    | 5,189     |
| 純資産額       | 50,148    | 51,921    | 46,031    |
| 総資産額       | 4,833,620 | 5,969,145 | 5,816,182 |
| 連結自己資本規制比率 | 432.3%    | 389.6%    | 294.1%    |



## VII 特別金融商品取引業者及びその子法人等の財産の状況に関する事項

### 1. 経理の状況

#### (1) 連結貸借対照表

(単位: 百万円)

| 資産の部          |                       |                       | 負債の部               |                       |                       |
|---------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------|
| 科目            | 当期                    | 前期                    | 科目                 | 当期                    | 前期                    |
|               | 2020年<br>12月31日<br>現在 | 2019年<br>12月31日<br>現在 |                    | 2020年<br>12月31日<br>現在 | 2019年<br>12月31日<br>現在 |
| <b>流動資産</b>   | <b>4,832,137</b>      | <b>5,967,791</b>      | <b>流動負債</b>        | <b>4,707,714</b>      | <b>5,856,718</b>      |
| 現金・預金         | 25,516                | 90,445                | トレーディング商品          | 183,479               | 136,950               |
| 預託金           | 412                   | 207                   | 約定見返勘定             | 17,900                | 18,803                |
| トレーディング商品     | 1,732,893             | 1,693,059             | 信用取引負債             | 3,909                 | 3,734                 |
| 信用取引資産        | 3,734                 | 3,873                 | 有価証券担保借入金          | 4,061,100             | 5,392,509             |
| 有価証券担保貸付金     | 2,991,331             | 4,118,900             | 預り金                | 430                   | 685                   |
| 立替金           | 29                    | 9                     | 受入保証金              | 1,750                 | 3,374                 |
| 短期差入保証金       | 54,573                | 36,846                | 有価証券等受入未了勘定        | 9                     | 21                    |
| 有価証券等引渡未了勘定   | 8                     | -                     | 受取差金勘定             | 37                    | 9                     |
| 未収還付法人税等      | 7,672                 | 8,156                 | 短期借入金              | 428,268               | 291,183               |
| 未収収益          | 13,986                | 13,880                | 未払費用               | 7,419                 | 5,475                 |
| その他流動資産       | 1,978                 | 2,411                 | 賞与引当金              | 2,152                 | 2,188                 |
|               |                       |                       | その他流動負債            | 1,255                 | 1,784                 |
| <b>固定資産</b>   | <b>1,483</b>          | <b>1,353</b>          | <b>固定負債</b>        | <b>60,031</b>         | <b>47,735</b>         |
| 投資その他の資産      |                       |                       | 長期借入金              | 57,800                | 46,000                |
| 投資有価証券        | 228                   | 218                   | 繰延税金負債             | 686                   | 275                   |
| 長期差入保証金       | 142                   | 146                   | 退職給付引当金            | 1,544                 | 1,459                 |
| 前払年金費用        | 1,112                 | 988                   | <b>特別法上の準備金</b>    | <b>15,727</b>         | <b>12,769</b>         |
|               |                       |                       | 金融商品取引責任準備金        | 15,727                | 12,769                |
|               |                       |                       | <b>負債合計</b>        | <b>4,783,472</b>      | <b>5,917,223</b>      |
|               |                       |                       |                    |                       |                       |
|               |                       |                       | 純資産の部              |                       |                       |
|               |                       |                       | <b>株主資本</b>        | <b>50,095</b>         | <b>51,889</b>         |
|               |                       |                       | 資本金                | 32,945                | 32,945                |
|               |                       |                       | 資本剰余金              | 8,236                 | 7,262                 |
|               |                       |                       | 利益剰余金              | 8,914                 | 11,681                |
|               |                       |                       | <b>その他の包括利益累計額</b> | <b>52</b>             | <b>32</b>             |
|               |                       |                       | その他有価証券評価差額金       | Δ0                    | Δ0                    |
|               |                       |                       | 退職給付に係る調整累計額       | 52                    | 32                    |
|               |                       |                       | <b>純資産合計</b>       | <b>50,148</b>         | <b>51,921</b>         |
| <b>資産の部合計</b> | <b>4,833,620</b>      | <b>5,969,145</b>      | <b>負債・純資産の部合計</b>  | <b>4,833,620</b>      | <b>5,969,145</b>      |

## (2) 連結損益計算書及び連結包括利益計算書

## ① 連結損益計算書

(単位: 百万円)

| 科目           | 当期                                     | 前期                                     |
|--------------|--|--|
|              | 自 2020 年 1 月 1 日<br>至 2020 年 12 月 31 日 | 自 2019 年 1 月 1 日<br>至 2019 年 12 月 31 日 |
| 受入手数料        | 45,789                                 | 44,929                                 |
| トレーディング損益    | △48,839                                | △46,992                                |
| 金融収益         | 58,715                                 | 57,742                                 |
| 営業収益         | 55,665                                 | 55,679                                 |
| 金融費用         | 8,300                                  | 9,431                                  |
| 純営業収益        | 47,365                                 | 46,247                                 |
| 販売費・一般管理費    | 33,909                                 | 34,339                                 |
| 営業利益         | 13,456                                 | 11,908                                 |
| 営業外収益        | 14                                     | 26                                     |
| 営業外費用        | 7                                      | -                                      |
| 経常利益         | 13,463                                 | 11,935                                 |
| 特別利益         | -                                      | 5                                      |
| 特別損失         | 2,957                                  | 2,809                                  |
| 税引前当期純利益     | 10,506                                 | 9,131                                  |
| 法人税等         | 1,842                                  | △1,611                                 |
| <b>当期純利益</b> | <b>8,663</b>                           | <b>10,742</b>                          |

## ② 連結包括利益計算書

(単位: 百万円)

| 科目           | 当期                                     | 前期                                     |
|--------------|--|--|
|              | 自 2020 年 1 月 1 日<br>至 2020 年 12 月 31 日 | 自 2019 年 1 月 1 日<br>至 2019 年 12 月 31 日 |
| 当期純利益        | 8,663                                  | 10,742                                 |
| その他の包括利益     | 20                                     | 25                                     |
| その他有価証券評価差額金 | △0                                     | △0                                     |
| 退職給付に係る調整額   | 20                                     | 25                                     |
| <b>包括利益</b>  | <b>8,683</b>                           | <b>10,768</b>                          |



## (3) 連結株主資本等変動計算書

2020年12月期(自2020年1月1日至2020年12月31日)

(単位:百万円)

| 科目                  | 株主資本   |       |          |          |         | 株主資本合計  |
|---------------------|--------|-------|----------|----------|---------|---------|
|                     | 資本剰余金  |       |          | 利益剰余金    |         |         |
|                     | 資本金    | 資本準備金 | その他資本剰余金 | その他利益剰余金 | 繰越利益剰余金 |         |
| 2020年1月1日残高         | 32,945 | 7,262 | -        | 11,681   |         | 51,889  |
| 当期変動額               |        |       |          |          |         |         |
| 剰余金の配当              | -      | -     | -        | △10,457  |         | △10,457 |
| 資本準備金の積立            | -      | 973   | -        | △973     |         | -       |
| 当期純利益               | -      | -     | -        | 8,663    |         | 8,663   |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額 | -      | -     | -        | -        |         | -       |
| 当期変動額合計             | -      | 973   | -        | △2,767   |         | △1,793  |
| 2020年12月31日残高       | 32,945 | 8,236 | -        | 8,914    |         | 50,095  |

(単位:百万円)

| 科目                  | その他の包括利益累計額      |                  |                   | 純資産合計   |
|---------------------|------------------|------------------|-------------------|---------|
|                     | その他有価証券<br>評価差額金 | 退職給付に係る<br>調整累計額 | その他の包括利益<br>累計額合計 |         |
| 2020年1月1日残高         | △0               | 32               | 32                | 51,921  |
| 当期変動額               |                  |                  |                   |         |
| 剰余金の配当              | -                | -                | -                 | △10,457 |
| 資本準備金の積立            | -                | -                | -                 | -       |
| 当期純利益               | -                | -                | -                 | 8,663   |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額 | △0               | 20               | 20                | 20      |
| 当期変動額合計             | △0               | 20               | 20                | △1,773  |
| 2020年12月31日残高       | △0               | 52               | 52                | 50,148  |

2019年12月期(自2019年1月1日至2019年12月31日)

(単位:百万円)

| 科目                  | 株主資本   |       |          |          | 株主資本合計 |
|---------------------|--------|-------|----------|----------|--------|
|                     | 資本剰余金  |       |          | 利益剰余金    |        |
|                     | 資本金    | 資本準備金 | その他資本剰余金 | その他利益剰余金 |        |
|                     |        |       |          | 繰越利益剰余金  |        |
| 2019年1月1日残高         | 32,945 | 6,774 | -        | 6,306    | 46,025 |
| 当期変動額               |        |       |          |          |        |
| 剰余金の配当              | -      | -     | -        | △4,879   | △4,879 |
| 資本準備金の積立            | -      | 487   | -        | △487     | -      |
| 当期純利益               | -      | -     | -        | 10,742   | 10,742 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額 | -      | -     | -        | -        | -      |
| 当期変動額合計             | -      | 487   | -        | 5,375    | 5,863  |
| 2019年12月31日残高       | 32,945 | 7,262 | -        | 11,681   | 51,889 |

(単位:百万円)

| 科目                  | その他の包括利益累計額      |                  |                   | 純資産合計  |
|---------------------|------------------|------------------|-------------------|--------|
|                     | その他有価証券<br>評価差額金 | 退職給付に係る<br>調整累計額 | その他の包括利益<br>累計額合計 |        |
| 2019年1月1日残高         | △0               | 6                | 6                 | 46,031 |
| 当期変動額               |                  |                  |                   |        |
| 剰余金の配当              | -                | -                | -                 | △4,879 |
| 資本準備金の積立            | -                | -                | -                 | -      |
| 当期純利益               | -                | -                | -                 | 10,742 |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額 | △0               | 25               | 25                | 25     |
| 当期変動額合計             | △0               | 25               | 25                | 5,889  |
| 2019年12月31日残高       | △0               | 32               | 32                | 51,921 |

(4) 連結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

担保に供している資産

(単位: 百万円)

|                 | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|-----------------|-----------|-----------|
| 商品有価証券及び借入有価証券等 | 261,589   | 154,830   |

担保に係る債務

(単位: 百万円)

|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|------------|-----------|-----------|
| 金融機関からの借入金 | 417,268   | 266,883   |

② 差入れている有価証券等の時価額

(単位: 百万円)

|                    | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------------------|-----------|-----------|
| 信用取引貸証券            | 3,813     | 3,758     |
| 消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 2,742,396 | 2,874,817 |
| 現先取引で売却した有価証券      | 1,766,734 | 3,167,557 |
| 差入保証金代用有価証券        | 3,603     | 7,176     |
| その他担保として差し入れた有価証券  | 1,007,128 | 864,964   |

③ 差入れを受けている有価証券等の時価額

(単位: 百万円)

|                    | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------------------|-----------|-----------|
| 信用取引借証券            | 3,813     | 3,758     |
| 消費貸借契約により借り入れた有価証券 | 1,897,047 | 1,692,732 |
| 現先取引で買い付けた有価証券     | 1,754,444 | 3,197,871 |
| 受入保証金代用有価証券        | 3,603     | 7,176     |
| その他担保として受け入れた有価証券  | 621,926   | 660,588   |

④ 関係会社に対する金銭債権及び金銭債務

(単位: 百万円)

|        | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------|-----------|-----------|
| 短期金銭債権 | 496,884   | 1,003,996 |
| 短期金銭債務 | 2,470,576 | 2,920,259 |
| 長期金銭債務 | 17,800    | 7,500     |

⑤ その他の注記 - 当座貸越契約及びコミットメントライン契約

(単位: 百万円)

|                       | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|-----------------------|-----------|-----------|
| 当座貸越契約及びコミットメントラインの総額 | 13,100    | 13,100    |
| 借入実行残高                | -         | -         |
| 差引額(借入未実行残高)          | 13,100    | 13,100    |

(5) 連結損益計算書に関する注記  
関係会社との取引高

(単位: 百万円)

|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|------------|-----------|-----------|
| 営業取引による取引高 |           |           |
| 営業収益       | 43,117    | △166,488  |
| 金融費用       | 865       | 1,482     |
| 販売費・一般管理費  | 385       | 538       |

(6) 連結包括利益計算書に関する注記

(単位: 百万円)

|                        | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|------------------------|-----------|-----------|
| その他の包括利益に係る組替調整額及び税効果額 |           |           |
| その他有価証券評価差額金           |           |           |
| 当期発生額                  | △0        | △0        |
| 組替調整額                  | -         | -         |
| 税効果調整前                 | △0        | △0        |
| 税効果額                   | 0         | 0         |
| その他有価証券評価差額金           | △0        | △0        |
| 退職給付に係る調整額             |           |           |
| 当期発生額                  | 34        | 76        |
| 組替調整額                  | △5        | △39       |
| 税効果調整前                 | 28        | 36        |
| 税効果額                   | △8        | △11       |
| 退職給付に係る調整額             | 20        | 25        |
| <b>その他の包括利益合計</b>      | <b>20</b> | <b>25</b> |

(7) 連結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

(単位: 株)

|            | 株式の種類     |           |
|------------|-----------|-----------|
|            | 普通株式      |           |
|            | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
| 当事業年度期首株式数 | 1,542,114 | 1,542,114 |
| 当期増加株式数    | -         | -         |
| 当期減少株式数    | -         | -         |
| 当事業年度末株式数  | 1,542,114 | 1,542,114 |

② 剰余金の配当に関する事項

2020年12月期

| 決議                   | 株式の種類 | 配当金の総額    | 1株当たり配当額 | 効力発生日      |
|----------------------|-------|-----------|----------|------------|
| 2020年6月24日<br>臨時株主総会 | 普通株式  | 10,457百万円 | 6,781円   | 2020年6月25日 |

2019年12月期

| 決議                   | 株式の種類 | 配当金の総額   | 1株当たり配当額 | 効力発生日      |
|----------------------|-------|----------|----------|------------|
| 2019年3月27日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 4,879百万円 | 3,164円   | 2019年3月28日 |

## 2. 借入金の主要な借入先及び借入金額

(単位: 百万円)

| 借入先の氏名又は名称   | 2020年12月期 | 2019年12月期 |
|--------------|-----------|-----------|
| 日本銀行         | 5,000     | 5,000     |
| パークレイズ銀行東京支店 | 433,068   | 282,683   |
| 金融機関         | 48,000    | 49,500    |

## 3. 保有する有価証券(トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く。)の取得価額、時価及び評価損益

### (1) その他有価証券で時価のあるもの

(単位: 百万円)

|                        | 2020年12月期 |          |           | 2019年12月期 |          |           |
|------------------------|-----------|----------|-----------|-----------|----------|-----------|
|                        | 取得価額      | 貸借対照表計上額 | 評価損益      | 取得価額      | 貸借対照表計上額 | 評価損益      |
| 連結貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (1) 株券                 | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (2) 債券                 | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (3) その他                | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| 連結貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 0         | 0        | △0        | 0         | 0        | △0        |
| (1) 株券                 | 0         | 0        | △0        | 0         | 0        | △0        |
| (2) 債券                 | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| (3) その他                | -         | -        | -         | -         | -        | -         |
| <b>合計</b>              | <b>0</b>  | <b>0</b> | <b>△0</b> | <b>0</b>  | <b>0</b> | <b>△0</b> |

### (2) 時価評価されていない主な有価証券の内容等

(単位: 百万円)

|           | 2020年12月期  | 2019年12月期  |
|-----------|------------|------------|
|           | 貸借対照表計上額   | 貸借対照表計上額   |
| その他有価証券   | 228        | 218        |
| (1) 非上場株式 | 216        | 216        |
| (2) その他   | 11         | 1          |
| <b>合計</b> | <b>228</b> | <b>218</b> |

## 4. デリバティブ取引(トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。)の契約価額、時価及び評価損益

### (1) 先物取引・オプション取引の状況

#### ① 株券

トレーディング目的以外の先物取引及びオプション取引はありません。

#### ② 債券

トレーディング目的以外の先物取引及びオプション取引はありません。

### (2) 有価証券店頭デリバティブ取引の状況

トレーディング目的以外の先物取引及びオプション取引はありません。

## 5. 経営の健全性の状況

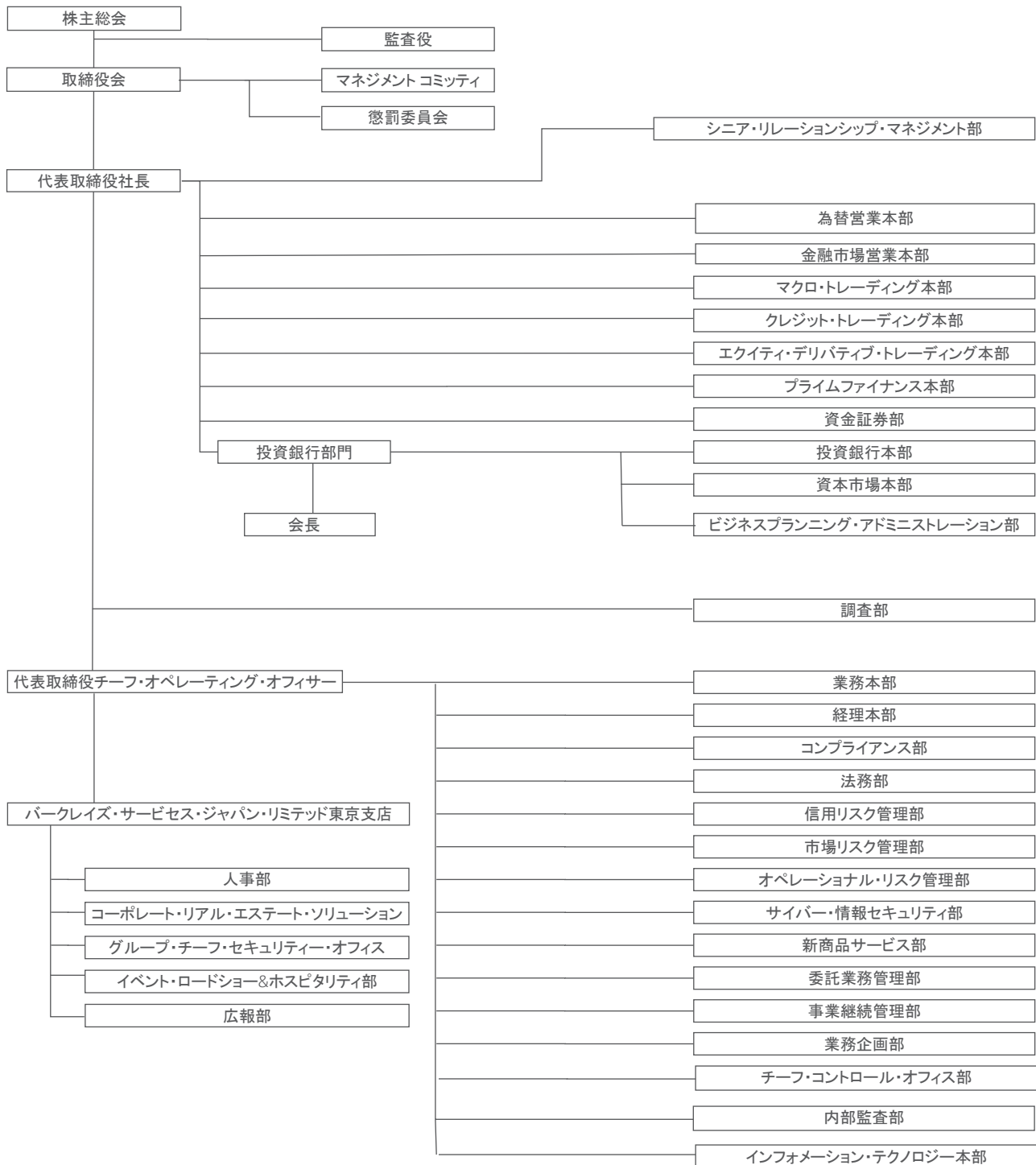
(単位: %、百万円)

|                     | 2020年12月期 | 2019年12月期 | 2018年12月期 |
|---------------------|-----------|-----------|-----------|
| 連結自己資本規制比率(A/B×100) | 432.3%    | 389.6%    | 294.1%    |
| 固定化されていない自己資本(A)    | 84,996    | 83,877    | 70,246    |
| リスク相当額(B)           | 19,657    | 21,525    | 23,881    |
| 市場リスク相当額            | 4,160     | 4,224     | 4,225     |
| 取引先リスク相当額           | 5,489     | 6,985     | 8,350     |
| 基礎的リスク相当額           | 10,007    | 10,315    | 11,306    |
| 暗号資産等による控除額         | -         | -         | -         |

# 別表

## パークレイズ証券株式会社 組織図

2020年12月31日



以上

