

業務及び財産の状況に関する説明書

【平成30年12月期】

この説明書は、金融商品取引法第46条の4の規定に基づき、全ての営業所若しくは事務所に備え置いて公衆の縦覧に供するため、又はインターネット等で公表するために作成したものです。

ナティクシス日本証券株式会社

目次

I. 当社の概況及び組織に関する事項	3
1. 商号	3
2. 登録年月日（登録番号）	3
3. 沿革及び経営の組織	3
4. 株式の保有数の上位 10 位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合.....	3
5. 役員 の氏名又は名称	4
6. 政令で定める使用人の氏名	4
7. 業務の種別	5
8. 本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地.....	5
9. 苦情処理及び紛争解決の体制	6
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.....	6
11. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号.....	6
12. 加入する投資者保護基金の名称	6
II. 業務の状況に関する事項	7
1. 当期の業務の概要	7
2. 業務の状況を示す指標	8
III. 財産の状況に関する事項	11
1. 経理の状況	11
2. 借入金の主要な借入先及び借入金額	15
3. 保有する有価証券の取得価額、時価及び評価損益.....	15
4. デリバティブ取引の契約価額、時価及び評価損益.....	16
5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無.....	17
IV. 管理の状況	18
1. 内部管理の状況の概要	18
2. 分別管理等の状況	19
V. 連結子会社等の状況に関する事項	21
1. 当社及びその子会社等の集団の構成	21
2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等 .	21

I. 当社の概況及び組織に関する事項

1. 商号

ナティクシス日本証券株式会社

2. 登録年月日（登録番号）

平成 23 年 4 月 22 日（関東財務局長（金商）第 2527 号）

3. 沿革及び経営の組織

(1) 会社の沿革

年 月	沿 革
平成 5 年 5 月	ケス・デ・デポ東京駐在員事務所開設
平成 9 年 3 月	シー・ディー・シーマルシェ東京駐在員事務所開設
平成 10 年 5 月	シー・ディー・シーマルシェ証券会社東京支店として証券業免許取得
平成 10 年 10 月	営業開始
平成 13 年 1 月	シーディーシー・イクシス・キャピタル・マーケット（証券会社）に商号変更
平成 16 年 11 月	IXIS Corporate & Investment Bank（証券会社）に商号変更
平成 19 年 12 月	IXIS Corporate & Investment Bank（証券会社）からの事業譲渡によりナティクシス（名称：ナティクシス証券会社）として営業開始
平成 23 年 6 月	ナティクシス（名称：ナティクシス証券会社）からの事業譲渡によりナティクシス日本証券株式会社として営業開始

(2) 経営の組織

22 ページの会社組織図をご参照ください

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
	株	%
1. ナティクシス	390,000	100.00
2.		
3.		
4.		
5.		
6.		
その他（ 名）		
計 1 名	390,000	100.00

5. 役員の名又は名称

役職名	氏名又は名称	代表権の有無	常勤・非常勤の別
代表取締役社長	ローラン・デュプス	有	常勤
取締役	アラン・ガロワ	無	非常勤
取締役	エマニュエル・ルフオー	無	非常勤
取締役	メジュディ・ジェメル	無	常勤
監査役	池田 宗人	無	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
亀井 俊介	コンプライアンス部長

(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

氏 名	役 職 名
該当ありません	

7. 業務の種類別

(1) 金融商品取引業（金融商品取引法第2条第8項）

第1種金融商品取引業

金融商品取引法第28条第1項第1号に掲げる行為に係る業務

同法第28条第1項第2号に掲げる行為に係る業務

同法第28条第1項第3号イからハに掲げる行為に係る業務

有価証券等管理業務

第2種金融商品取引業

(2) 金融商品取引業付随業務（金融商品取引法第35条第1項）

当社は付随業務として以下の業務を行っております。

- ・有価証券の貸借またはその媒介もしくは代理業務
- ・有価証券に関する顧客の代理業務
- ・有価証券に関連する情報の提供または助言業務
- ・他の事業者の経営に関する相談に応じる業務
- ・通貨の売買またはその媒介、取次ぎもしくは代理業務
- ・譲渡性預金、その他金銭債権の売買又はその媒介、取次もしくは代理
- ・その他金融商品取引業に付随する業務

(3) その他（金融商品取引法第35条第2項）

当社は届出業務として以下の業務を行っております。

- ・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

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	〒106-0032 東京都港区六本木一丁目4番5号 アークヒルズサウスタワー

9. 苦情処理及び紛争解決の体制

第一種金融商品取引業

金融商品取引法第 37 条の 7 第 1 項第 1 号イに規定する苦情処理措置及び紛争解決措置として、特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター（以下、「FINMAC」という。）との間で特定第一種金融商品取引業務に係る手続実施基本契約を締結する措置

第二種金融商品取引業

金融商品取引法第 37 条の 7 第 1 項第 2 号ロに規定する苦情処理措置及び紛争解決措置として一般社団法人第二種金融商品取引業協会（「FINMAC」に業務委託）を利用する措置

貸金業

貸金業法第 2 条第 1 項に規定する業務につき、貸金業法第 12 条の 2 の 2 第 1 項第 1 号に基づく措置として、指定紛争解決機関である日本貸金業協会との間で、紛争解決業務等に係る手続実施基本契約を締結する措置を取っております。

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
- 一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

11. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号

- 株式会社東京証券取引所
- 株式会社大阪取引所

12. 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

平成23年6月1日にナティクス証券会社東京支店より営業譲渡を受けて開業以来、9期目の決算となります。当期の業務といたしましては、以下の業務に経営資源を配分し営業基盤を固めるべく努力して参りました。

1) 欧州債券商品関連業務

公社債の売買等における媒介業務

2) 株式トレーディングおよびファイナンス業務

株式先物と現物との価格差に着目した裁定取引及び株券貸借取引など

3) 株式関連商品関連業務

本邦及び海外の投資家に、現物株式及び指標を基にした仕組み商品を提供すること及び自己の計算で行う売買

4) 国債等レポ・現先取引

日本国債・外国国債等のレポ取引および現先取引

5) 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等

債券の募集・売出し・特定投資家向け売付けの取扱い

当期の営業収益は100億8千4百万円でした。その内訳は受入手数料が27億2千3百万円、トレーディング損失が86億7千4百万円、金融収益が160億3千5百万円でした。

純営業収益は、40億1千5百万円となり、対前年比で、約20億円の減少となりました。これは、主にナティクス本店からの、その他の受入手数料が減少したこと、またトレーディングに係る損益、すなわちトレーディング損益、金融収益及び金融費用の合計額が減少したためです。

一方、販売費及び一般管理費は、48億9千6百万円となっております。このうち取引関係費が5億7千5百万円、人件費が19億1千2百万円、不動産関係費が4億8千2百万円、事務費が13億5千万円、租税公課が2億4千7百万円を占めております。

税引前当期純損失は9億7百万円、当期純損失は8億5百万円となりました。

また、平成30年12月末現在の自己資本規制比率は457.7%となっております。

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)

	平成 30 年 12 月期	平成 29 年 12 月期	平成 28 年 12 月期
資本金	13,900	13,900	13,900
発行済株式総数 (株数)	390,000	390,000	360,000
営業収益	10,084	12,659	7,231
受入手数料	2,723	3,460	2,568
委託手数料	378	388	155
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	142	76	30
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱い手数料	-	-	-
その他の受入手数料	2,202	2,994	2,382
トレーディング損益	△8,674	△9,288	△7,027
株券等	△8,670	△9,284	△7,028
債券等	0	△4	-
その他	△3	-	-
金融収益	16,035	18,487	11,690
金融費用	6,069	6,649	3,535
純営業収益	4,015	6,009	3,696
経常損益	△877	1,393	△573
当期純損益	△805	1,300	△726

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

(単位：百万円)

	平成 30 年 12 月期	平成 29 年 12 月期	平成 28 年 12 月期
自 己	3,707,772	2,643,119	992,177
委 託	1,192,043	731,340	240,271
計	4,899,815	3,374,459	1,232,448

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	特定投資家向け売付け勧誘等の総額	募集の取扱高	売出しの取扱高	私募の取扱高	特定投資家向け売付け勧誘等の取扱高
平成30年12月期	株券	-	-	-	-	-	-
	国債証券	-	/	-	-	/	-
	地方債証券	-	/	-	-	/	-
	特殊債券	-	-	-	-	-	-
	社債券	51,527	-	-	1,500	-	6,407
	受益証券	/	/	/	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-	-
	合 計	51,527	-	-	1,500	-	6,407
平成29年12月期	株券	-	-	-	-	-	-
	国債証券	-	/	-	-	/	-
	地方債証券	-	/	-	-	/	-
	特殊債券	-	-	-	-	-	-
	社債券	26,615	-	-	20,100	-	3,515
	受益証券	/	/	/	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-	-
	合 計	26,615	-	-	20,100	-	3,515
平成28年12月期	株券	-	-	-	-	-	-
	国債証券	-	/	-	-	/	-
	地方債証券	-	/	-	-	/	-
	特殊債券	-	-	-	-	-	-
	社債券	8,700	-	-	8,700	35,521	-
	受益証券	/	/	/	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-	-
	合 計	8,700	-	-	8,700	35,521	-

- (3) その他業務の状況
特記事項はありません。

- (4) 自己資本規制比率の状況

(単位：％、百万円)

	平成30年12月期	平成29年12月期	平成28年12月期
自己資本規制比率 (A) / (B) × 100	457.7	440.2	367.2
固定化されていない 自己資本 (A)	16,460	17,214	14,921
リスク相当額 (B)	3,596	3,910	4,063
市場リスク相当額	326	1,328	1,680
取引先リスク相当額	1,128	559	714
基礎的リスク相当額	2,141	2,021	1,668

- (5) 使用人の総数及び外務員の総数

(単位：名)

	平成30年12月期	平成29年12月期	平成28年12月期
使用人	78	78	79
(うち外務員)	33	27	30

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)

資産の部	平成30年12月31日 現在	平成29年12月31日 現在
流動資産	2,415,646	1,960,735
現金及び預金	19,402	45,456
預託金	551	-
トレーディング商品	93,887	487,801
約定見返勘定	106	-
有価証券担保貸付金	2,179,132	1,398,675
短期差入保証金	41,471	7,415
支払差金勘定	-	11,649
短期貸付金	75,000	-
未収還付法人税	1,392	-
前払費用	51	23
未収入金	1,516	4,558
未収収益	3,133	5,153
固定資産	1,217	1,268
有形固定資産	473	522
無形固定資産	-	-
投資等	744	745
繰延資産	-	-
資産合計	2,416,863	1,962,003
負債の部		
流動負債	2,398,932	1,943,315
トレーディング商品	57,557	13,107
約定見返勘定	-	6
有価証券担保借入金	2,131,062	1,912,625
預り金	71	42
有価証券等受入未了勘定	2,422	-
受入保証金	-	5,210
受取差金勘定	13,738	-
短期借入金	188,642	5,331
未払金	1,203	2,958
未払費用	3,709	3,467
未払法人税等	52	78
賞与引当金	470	458
リース債務	1	1
その他	-	-
固定負債	201	182
退職給付引当金	200	180
長期リース債務	0	2
その他の固定負債	0	-
金融商品取引責任準備金	98	68
負債合計	2,399,232	1,943,566
純資産の部		
株主資本	17,631	18,436
資本金	13,900	13,900
資本剰余金	4,100	4,100
利益剰余金	△ 368	436
純資産合計	17,631	18,436
負債・純資産合計	2,416,863	1,962,003

(2) 損益計算書

(単位：百万円)

	自平成30年1月1日 至平成30年12月31日	自平成29年1月1日 至平成29年12月31日
営業収益	10,084	12,659
受入手数料	2,723	3,460
トレーディング損益	△ 8,674	△ 9,288
金融収益	16,035	18,487
金融費用	6,069	6,649
純営業収益	4,015	6,009
販売費・一般管理費	4,896	4,630
取引関係費	575	463
人件費	1,912	2,007
不動産関係費	482	536
事務費	1,350	1,073
減価償却費	67	42
租税公課	247	259
その他	260	247
営業利益(△は営業損失)	△ 880	1,379
営業外収益	9	13
為替差益	-	5
雑収入	9	8
営業外費用	5	-
為替差損	5	-
雑損失	-	-
経常利益(△は経常損失)	△ 877	1,393
特別損失	29	86
固定資産除却損	-	-
金融商品取引責任準備金繰入れ	29	33
本社移転費用	-	53
税引前当期純利益(△は税引前当期純損失)	△ 907	1,306
法人税、住民税及び事業税	3	6
過年度法人税還付額	105	-
当期純利益(△は当期純損失)	△ 805	1,300

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

自平成29年1月1日 至平成29年12月31日

	株主資本							純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		株主資本合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
平成29年 1月1日残高	13,900	4,100	-	4,100	△ 2,363	△ 2,363	15,636	15,636
事業年度中 の変動額								
新株の発行	750	750	-	750	-	-	1,500	1,500
減資	△ 750	△ 750	1,500	750	-	-	-	-
欠損填補	-	-	△ 1,500	△ 1,500	1,500	1,500	-	-
当期純利益	-	-	-	-	1,300	1,300	1,300	1,300
事業年度中 の変動額合計	-	-	-	-	2,800	2,800	2,800	2,800
平成29年 12月31日残高	13,900	4,100	-	4,100	436	436	18,436	18,436

自平成30年1月1日 至平成30年12月31日

	株主資本							純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		株主資本合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
平成30年 1月1日残高	13,900	4,100	-	4,100	436	436	18,436	18,436
事業年度中 の変動額								
当期純損失 (△)	-	-	-	-	△ 805	△ 805	△ 805	△ 805
事業年度中 の変動額合計	-	-	-	-	△ 805	△ 805	△ 805	△ 805
平成30年 12月31日残高	13,900	4,100	-	4,100	△ 368	△ 368	17,631	17,631

(4) 注記

① 貸借対照表に関する注記

1) 差し入れている有価証券等の時価額

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	174,503 百万円	374,167 百万円
現先取引で売却した有価証券	1,806,531	1,402,022
取引証拠金代用有価証券	-	27,593
清算基金代用有価証券	-	7,856
その他担保として差し入れた有価証券	75,937	61,494

2) 差し入れを受けている有価証券等の時価額

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
消費貸借契約により借り入れた有価証券	1,703,537 百万円	785,201 百万円
現先取引により買い付けた有価証券	202,655	125,997

3) 有形固定資産の減価償却累計額

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
	134 百万円	76 百万円

4) 関係会社に対する金銭債権および金銭債務

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
短期金銭債権	423,972 百万円	137,929 百万円
短期金銭債務	2,101,726	1,709,754

5) 特別法上の準備金

金融商品取引法の規定に基づく準備金を計上しております。準備金の計上を規定した法令の条項は、金融商品取引法第 46 条の 5 及び金融商品取引業等に関する内閣府令第 175 条です。

② 損益計算書に関する注記

1) 関係会社との取引高

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
営業取引による取引高		
受入手数料	2,339 百万円	3,397 百万円
トレーディング損益	△26,232	26,055
金融収益	△3,357	476
金融費用	1,672	3,169
販売費・一般管理費	1,362	1,072
営業取引以外の取引による取引高	- 百万円	- 百万円

③ 株主資本等変動計算書に関する注記

当期事業年度末における発行済株式総数

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
普通株式	390,000 株	390,000 株

2. 借入金の主要な借入先及び借入金額

	<u>平成 30 年 12 月 31 日現在</u>	<u>平成 29 年 12 月 31 日現在</u>
借入先の氏名または名称		
ナティクス	188,642 百万円	5,331 百万円

3. 保有する有価証券の取得価額、時価及び評価損益

(単位：百万円)

	平成 30 年 12 月期			平成 29 年 12 月期		
	取得価額	時 価	評価損益	取得価額	時 価	評価損益
1. 流動資産	-	-	-	-	-	-
(1) 株券	-	-	-	-	-	-
(2) 債券	-	-	-	-	-	-
(3) その他	-	-	-	-	-	-
2. 固定資産	-	-	-	-	-	-
(1) 株券	-	-	-	-	-	-
(2) 債券	-	-	-	-	-	-
(3) その他	-	-	-	-	-	-
合 計	-	-	-	-	-	-

(注) 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。

4. デリバティブ取引の契約価額、時価及び評価損益

(1) 先物取引・オプション取引の状況

① 株式

(単位：百万円)

	平成 30 年 12 月期			平成 29 年 12 月期		
	契約価額	時 価	評価損益	契約価額	時 価	評価損益
1. 株価指数先物取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
2. 株価指数 オプション取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
① コール	-	-	-	-	-	-
② プット	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
① コール	-	-	-	-	-	-
② プット	-	-	-	-	-	-

(注) 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。

② 債券

(単位：百万円)

	平成 30 年 12 月期			平成 29 年 12 月期		
	契約価額	時 価	評価損益	契約価額	時 価	評価損益
1. 債券先物取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
2. 債券オプション取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
① コール	-	-	-	-	-	-
② プット	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
① コール	-	-	-	-	-	-
② プット	-	-	-	-	-	-

(注) 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。

(2) 有価証券店頭デリバティブ取引の状況

(単位：百万円)

	平成 30 年 12 月期			平成 29 年 12 月期		
	契約 価額	時価	評価 損益	契約 価額	時価	評価 損益
1. 有価証券先渡取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
2. 有価証券店頭指数等先渡取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
3. 有価証券店頭オプション取引	-	-	-	-	-	-
(1) 売建	-	-	-	-	-	-
① コール	-	-	-	-	-	-
② プット	-	-	-	-	-	-
(2) 買建	-	-	-	-	-	-
① コール	-	-	-	-	-	-
② プット	-	-	-	-	-	-
4. 有価証券店頭指数等 スワップ取引	-	-	-	-	-	-

(注) 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。

5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無

(平成 29 年 12 月期)

当社は、「Ⅲ. 財産の状況に関する事項 1. 経理の状況」に掲げた貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書について、会社法第 436 条第 2 項の規定に基づき、監査法人 A&A パートナーズの監査を受けております。

(平成 30 年 12 月期)

当社は、「Ⅲ. 財産の状況に関する事項 1. 経理の状況」に掲げた貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書について、会社法第 436 条第 2 項の規定に基づき、PwC あらた有限責任監査法人の監査を受けております。

IV. 管理の状況

1. 内部管理の状況の概要

当社の内部管理体制の概要は以下の通りです。

内部管理統括責任者	内部管理体勢整備の責任者として、当社の業務が適正に運営、遂行される様、当社代表取締役の補佐及び牽制する役割を負う。
コンプライアンス部	法令遵守体制の構築・運営 主務官庁、業界団体との渉外 法定報告（コンプライアンス部以外の部署が所管する法定報告を除く） 登録関連業務 営業部門に関わるコンプライアンス体制の構築、指導 コンプライアンスに関する研修の立案・実施 業務監査（パーマナント・コントロール）
リスク管理部	与信枠の設定管理 与信リスクの管理 市場リスクの管理 オペレーショナル・リスクの管理
法務部	業務関連契約書の作成、管理 法務リスクの管理
業務部	当社取扱商品の取引管理等に係る事項 顧客の審査実施サポート・登録等に係る事項 本邦及び近隣諸国のスタティック・データ管理等に係る事項 本邦顧客への時価評価提供等に係る事項 近隣他拠点の取引サポートに係る事項 顧客及び取引先の口座管理・受渡し・決済の管理 取引所及び関連決済機関との決済・清算 証券・金銭の移動及び残高の管理 法定帳簿及び社内帳票の作成、管理 業務関連対外報告
クライアントサービス部	クライアントサービスに係る事項
経理部	会計業務 経費の支払、出納業務 予算管理業務 経理関連法定帳簿の作成、管理 経理関連定例法定報告の作成、提出 会計監査の対応 国内基準のリスク管理 日々のトレーディング及び営業収益の計算 時価評価算定基準の設定ならびに管理

情報管理部	コンピューター・システムの設営、管理 営繕・購買管理（IT 関連）
人事部	人事管理 職員研修管理 人事関連法定報告の作成、提出
総務部	営繕・購買管理 ファシリティマネジメント及び総務関連ベンダー管理 庶務業務 防火防災計画、緊急災害時の備品のとりまとめ
内部監査部	内部監査計画の策定及び同計画に基づく内部監査の実施・報告に関する業務 内部監査における指摘事項に関する改善状況のフォローアップに関する業務 その他内部監査に関連する業務

2. 分別管理等の状況

(1) 金融商品取引法第 43 条の 2 の規定に基づく分別管理の状況

① 顧客分別金信託の状況

(単位：百万円)

項 目	平成 30 年 12 月 31 日 現在の金額	平成 29 年 12 月 31 日 現在の金額
直近差替計算基準日の 顧客分別金必要額	-	-
期末日現在の顧客分別金信託額	551	-
期末日現在の 顧客分別金必要額	-	-

② 有価証券の分別管理の状況

イ 保護預り等有価証券

有価証券の種類		平成 30 年 12 月 31 日現在		平成 29 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	- 千株	- 千株	- 千株	- 千株
債券	額面金額	- 百万円	59,810 百万円	- 百万円	64,584 百万円
受益証券	口数	- 百万口	- 百万口	- 百万口	- 百万口
その他	額面金額	- 百万円	- 百万円	- 百万円	- 百万円

ロ 受入保証金代用有価証券

有価証券の種類		平成 30 年 12 月 31 日現在	平成 29 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	6,800 百万円	- 百万円
受益証券	口数	- 百万口	- 百万口
その他	額面金額	- 百万円	- 百万円

ハ 管理の状況

お客様よりお預かりしている有価証券は、当社の証券取引約款および外国証券取引口座約款に基づいて以下の保管形態で「分別保管」しています。

有価証券区分	当社の保管形態
国内株式	原則として、株式会社証券保管振替機構で管理しています。
国内受益証券	
外国債券	海外の保管機関において、混蔵して保管しています（現地保管機関の国内の諸法令及び慣行並びに現地保管機関の諸規則等に従って管理しています）。

③ 対象有価証券関連店頭デリバティブ取引等に係る分別管理の状況

該当事項はありません。

(2) 金融商品取引法第43条の2の2の規定に基づく区分管理の状況

① 商品顧客区分管理信託の状況

該当事項はありません。

② 有価証券等の区分管理の状況

イ 有価証券等の種類ごとの数量等

該当事項はありません。

ロ 管理の状況

該当事項はありません。

(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

該当事項はありません。

② 法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況

該当事項はありません。

V. 連結子会社等の状況に関する事項

1. 当社及びその子会社等の集団の構成

該当事項はありません。

2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等

商号又は名称	本店所在地	資本金	事業内容	当社及び子会社等の保有する議決権の数	子会社等の総株主の議決権に占める当該保有する議決権の数の割合
該当事項はありません。		百万円		口	%

以 上

(会社組織図)

ナティクス日本証券株式会社
平成30年12月31日

