

2020年6月4日

株主各位

東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
株式会社東京金融取引所
代表取締役社長 木下 信行

第16回定時株主総会招集ご通知

拝啓 平素は格別のご高配を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、株式会社東京金融取引所 第16回定時株主総会を下記により開催いたしますので、ご通知申し上げます。

なお、株主の皆様におかれましては、新型コロナウイルスの感染拡大防止及び株主の皆様の安全確保の観点から本年はご来場を自粛いただくこともご検討くださいますようお願いいたします。本総会は、書面により議決権を行使することができますので、お手数ながら後記の株主総会参考書類をご検討くださいます。同封の議決権行使書用紙に賛否をご表示いただき、2020年6月24日（水曜日）営業時間終了時（午後5時15分）までに到着するよう、折り返しご送付くださいますようお願い申し上げます。

敬具

記

1. 日 時 2020年6月25日（木曜日） 午前10時
2. 場 所 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号 鉄鋼ビルディング8階
株式会社東京金融取引所 TFXプラザ
3. 株主総会の目的事項
報告事項 第16期（2019年4月1日から2020年3月31日まで）
事業報告及び計算書類報告の件
決議事項
第1号議案 剰余金の処分の件
第2号議案 取締役1名選任の件
第3号議案 監査役1名選任の件
第4号議案 退任監査役に対する退職慰労金贈呈の件

以上

-
1. ご出欠の確認のため、別紙1の出欠届に必要な事項をご記入のうえ、2020年6月17日（水）までにFAXにてご返送ください。
 2. 当日ご出席の際は、お手数ながら別紙2の議決権行使書用紙を会場受付にご提出くださいますようお願い申し上げます。
 3. 株主総会参考書類、事業報告及び計算書類に記載すべき事項を修正する必要がある場合は、修正後の事項をインターネット上の当社ウェブサイト（<https://www.tfx.co.jp/>）に掲載させていただきます。
 4. 当日、役員は、節電対策の一環として軽装でご対応させていただきますので、ご了承賜りますようお願い申し上げます。
 5. また新型コロナウイルス感染拡大防止の観点から、当社役員はマスクを着用いたします。株主の皆様におかれましてもマスク着用にてご来場いただきますようお願いいたします。

事業報告

(2019年 4月 1日 から
2020年 3月 31日 まで)

1. 会社の現況に関する事項

(1) 事業の経過およびその成果

- ① 取引所為替証拠金取引（くりっく365）の取引数量は、本年度第4四半期は新型コロナウイルスの感染拡大に伴う相場変動により一時的に取引が急増したものの、それまでの低調なボラティリティによる取引低迷を回復することができず、前期を8.4%下回る28,378千枚となりました。
- ② 取引所株価指数証拠金取引（くりっく株365）の取引数量は、世界的な株高に加え、マーケットメイカーの価格提供や流動性供給等の改善に伴う取引活性化や、年度終盤の新型コロナウイルスの感染拡大に伴う相場の乱高下により、取引が急増し、前期を159.2%上回る13,175千枚となりました。
- ③ ユーロ円3ヵ月金利先物の取引数量は、日本銀行のイールドカーブ・コントロール等の下で、金利の低位安定が継続。年度終盤には、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う更なる金利低下もあったものの、ユーロ円3ヵ月金利先物の取引は伸びず、過去最低の707千枚（前期比43.5%減）となりました。
- ④ 以上による2019年度の全商品取引数量は、前期を13.3%上回る42,262千枚です。
- ⑤ 営業収益は、前期比5百万円（0.07%）増の66億24百万円です。
営業費用は、前期比4億38百万円（6.4%）増の72億93百万円です。このなかには、事務所縮小等に伴う一時的費用3億95百万円が含まれています。
- ⑥ 営業損益は、前期比4億33百万円悪化し6億69百万円の赤字です。
内訳は、金利先物等取引が9億29百万円の赤字、証拠金取引（くりっく365とくりっく株365）は2億60百万円の黒字です。
- ⑦ 営業外収益は、定期預金の受取利息等により8百万円です。
営業外費用は10百万円です。
- ⑧ 経常損益は、前期比5億12百万円悪化し6億71百万円の赤字です。
- ⑨ 特別損失は、金利・証拠金統合システムおよび償却未済の共用資産の減損処理により7億92百万円となりました。
- ⑩ 以上の結果、税引前当期純損益は14億63百万円の赤字となり、法人税等3百万円及び繰延税金資産の取り崩しによる法人税等調整額94百万円を控除すると当期純損益は15億61百万円の赤字です。

(2) 設備投資の状況

2019年度の設備投資は、次世代金利／証拠金統合システム開発等により総額で4億36百万円です。

(3) 資金調達の状況

該当事項はありません。

(4) 財産および損益の状況の推移

(単位：千円)

区 分	第13期 (2016年度)	第14期 (2017年度)	第15期 (2018年度)	第16期 (2019年度)
営業収益	8,647,061	6,690,589	6,619,134	6,624,322
営業費用	8,073,406	6,746,571	6,854,750	7,293,745
営業利益又は 営業損失(△)	573,655	△55,981	△235,616	△669,423
営業外収益	88,674	256,829	85,469	8,426
営業外費用	4,166	5,634	9,240	10,671
経常利益又は 経常利損失(△)	658,163	195,213	△159,387	△671,668
特別利益	—	—	—	—
特別損失	—	—	—	792,287
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失(△)	658,163	195,213	△159,387	△1,463,955
法人税、住民税及び事業税	93,647	43,958	4,834	3,800
法人税等調整額	49,766	44,363	113,047	94,218
当期純利益又は 当期純損失(△)	514,748	106,890	△277,268	△1,561,973
総 資 産(注)	479,783,876	512,279,212	532,342,238	561,096,474
純 資 産	21,852,430	21,439,853	21,305,980	19,614,593

(注) 総資産には、取引参加者および清算参加者から現金で預託された取引証拠金、信託金、清算預託金を負債と両建てで計上(5,394億96百万円)。

有価証券で預託されたこれらのものは資産・負債に含まず(423億93百万円(時価))。

(5) 主要な事業内容 (2020年3月31日現在)

金融商品取引法に基づき、以下の事業を行っております。

- ① 金融商品取引所として、金融商品市場の開設および市場施設の提供、相場の公表その他金融商品市場開設に係る業務
- ② 金融商品取引清算機関として、本取引所の開設する市場で行われた市場デリバティブ取引についての金融商品債務引受業務
- ③ 自主規制機関として、市場の公正性、透明性および信頼性を確保するために行う、取引内容の審査および取引参加者への考査等の業務

上場商品および取引参加者数は、以下のとおりです。

[上場商品]

- ① 金利先物等取引
 - a. ユーロ円3ヵ月金利先物
 - b. ユーロ円3ヵ月金利先物オプション取引
- ② 取引所為替証拠金取引 (くりっく365)
- ③ 取引所株価指数証拠金取引 (くりっく株365)

[取引参加者数]

- ① 金利先物等取引参加者 42社
(うち、金利先物等清算参加者 30社、休止取引参加者 (休止清算参加者) 12社)
- ② 為替証拠金取引参加者 (証拠金清算参加者) 21社
(うち、マーケットメイカー 6社)
- ③ 株価指数証拠金取引参加者 (証拠金清算参加者) 15社
(うち、マーケットメイカー 2社)

(6) 主要な営業所 (2020年3月31日現在)

本店 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

(7) 従業員の状況 (2020年3月31日現在)

区分	従業員数	(前年度末比増減)
男性	62名	(-3名)
女性	16名	(+2名)
合計	78名	(-1名)

(注) 従業員数には、契約・派遣社員5名は含まれておりません。

(8) 主要な借入先の状況（2020年3月31日現在）

該当事項はありません。

(9) 対処すべき課題

<2020年度業務計画より抜粋>

本年度は新中期経営計画の初年度として、既存市場での商品拡充等を迅速かつ的確に行うとともに、中期経営計画の中間レビュー（2022年夏）に向け新規事業の開発に鋭意取り組むこととする。

① リテール事業

CFDの拡充、外国投資家の開拓等により証拠金取引の活性化を図る。加えて、金融機関に向けた新たな金融商品の開発やサービス提供の検討を進める。

② ホールセール事業

金利先物等取引について、金利指標改革やリスク管理の高度化ニーズに対応し、商品や制度の改定を進める。

一方で、信用リスクの管理手段の提供や、クリアリング事業の拡充等、新たな柱となり得る事業の検討を進める。

③ システム

システムの安定稼働を維持するとともに、次回のシステム更改において、開発の柔軟性と開発コスト削減の両立を図ることが可能なシステムの開発戦略について検討する。

具体策には以下の方策を推進する。

① リテール事業

a. CFDの拡充

- ・ 株価指数リセット付商品の上場（2020年10月）
～ 既存株価指数商品の上場廃止（2021年3月）
- ・ 金ETF・原油ETF証拠金取引の上場（2020年10月）
- ・ NYダウ証拠金取引の小口化（2020年10月）

b. 海外投資家の開拓

- ・ 台湾からの取引ルートの確立
- ・ 取次事業者との現地共同マーケティングの実施

c. FXクリアリング事業の開始

- ・ FXクリアリングシステム開発の着実な遂行
- ・ FXクリアリング事業の内容の確定と取扱いの開始

d. 金融機関への部品提供

- ・ 金融商品（外貨預金・投資信託等）組成における証拠金取引の利用の提案や地域金融機関等へのサービス提供を検討
- ・ 非インターバンク向けFX市場の創設検討

② ホールセール事業

- ・ 金利先物等取引の商品の再検討
- ・ 金利先物等取引に係る清算参加者破綻時の損失負担制度の改定
- ・ 顧客ニーズを調査し、クリアリング事業のNDF等への拡張の可能性を検討
- ・ 新たな信用リスク管理手段の提供に関し、広範な関係者と協議し、フィージビリティスタディを推進

③ システム

- ・ 2019年に更改したシステムの開発について総括し、課題抽出および次回のシステム更改に向けた対策を検討
- ・ 海外事業者や異業種の事業者との連携による、システム開発、販売、共同利用の可能性を検討

2. 会社の株式に関する事項（2020年3月31日現在）

- (1) 発行可能株式総数 3,400,000株
- (2) 発行済株式の総数 862,750株
- (3) 株主数 80名
- (4) 大株主

株主名	持株数(株)	持株比率(%)
株式会社三菱UFJ銀行	43,130	4.99
株式会社三井住友銀行	43,060	4.99
三菱UFJ信託銀行株式会社	41,320	4.78
株式会社みずほ銀行	32,400	3.75
三井住友信託銀行株式会社	31,320	3.63
大和証券株式会社	30,660	3.55
みずほ証券株式会社	26,937	3.12
ゴールドマン・サックス証券株式会社	26,320	3.05
信金中央金庫	20,660	2.39
農林中央金庫	20,660	2.39
みずほ信託銀行株式会社	20,660	2.39
株式会社横浜銀行	20,660	2.39

3. 会社の新株予約権等に関する事項（2020年3月31日現在）

該当事項はありません。

4. 会社役員に関する事項

(1) 取締役および監査役の状況（2020年3月31日現在）

地位	氏名	担当および重要な兼職の状況
代表取締役社長	木下 信行	最高経営責任者（CEO） 経営全般、総務部、財務部、市場監視部、内部監査室 新規事業開発室
代表取締役専務	廣田 拓夫	最高リスク管理責任者（CRO）、最高情報責任者（CIO） ホールセール事業部、リテール開発部、 リテール事業部、清算決済部、システム部、 自主規制事務局、コンプライアンス・リスク管理室、 海外業務室、FXクリアリング準備室
取締役	今井 敬	日本製鉄株式会社 社友・名誉会長 日本生命保険相互会社 社外監査役 日本テレビホールディングス株式会社 社外取締役
取締役	宍戸 善一	一橋大学大学院法学研究科教授 宍戸善一法律事務所 弁護士 横河電機株式会社 社外監査役
取締役	萩原 攻太郎	株式会社三井住友銀行常務執行役員 兼株式会社三井住友フィナンシャルグループ常務執行役員 株式会社全銀電子債権ネットワーク 社外取締役
取締役	平川 純子	シティニューワ法律事務所 パートナー 弁護士 住友林業株式会社 社外取締役 日立建機株式会社 社外取締役
常勤監査役	福知 眞	
監査役	小野 行雄	企業会計基準委員会 シニア・アドバイザー 小野行雄公認会計士事務所 公認会計士
監査役	須藤 英章	東京富士法律事務所 パートナー 弁護士 ハナマルキ株式会社 監査役 医療法人鉄蕉会（亀田総合病院） 理事 エリーパワー株式会社 監査役 城南信用金庫 監事

- (注) 1. 取締役 今井 敬、宍戸 善一、萩原 攻太郎、平川 純子の4氏は、社外取締役であります。
2. 監査役 小野 行雄、須藤 英章の両氏は、社外監査役であります。
3. 2019年度中の取締役及び監査役の異動は以下のとおりです。

① 就任

取締役 宍戸 善一、萩原 攻太郎の両氏及び監査役 小野 行雄、
須藤 英章の両氏は、2019年6月20日開催の定時株主総会において新たに選任され、就任しました。

② 退任

取締役 小原 隆二、奥野 正寛、津原 周作、吉留 真の4氏及び監査役 境崎 敏之、前田 重行の両氏は、2019年6月20日開催の定時株主総会終結の時をもって任期満了により退任しました。

4. 取締役 宍戸 善一氏は、2020年3月31日付で、一橋大学大学院法学研究科教授を退官し、同年4月1日付で、武蔵野大学法学部教授に就任しました。

(2) 取締役および監査役の定額報酬の額

区 分	支払人員	支払総額
取 締 役 (うち社外取締役)	8名 (5名)	112,422千円 (23,247千円)
監 査 役 (うち社外監査役)	5名 (4名)	29,557千円 (11,097千円)

- (注) 1. 支払総額は、2019年度の実支払額であります。
 2. 株主総会の決議による報酬限度額は以下のとおりであります。
 (2011年6月22日開催定時株主総会決議)
 取締役 年額200百万円以内
 (2010年6月26日開催定時株主総会決議)
 監査役 年額35百万円以内
 3. 上記の支払人員には2019年6月20日をもって退任した取締役3名及び監査役2名を含んでおります。

5. 会計監査人に関する事項

会計監査人は有限責任あずさ監査法人であります。

6. 取締役の職務の執行が法令および定款に適合することを確保するための体制その他業務の適正を確保するための体制の整備についての決議の内容

本取引所は、会社法第362条第4項第6号および第5項、ならびに会社法施行規則第100条第1項および第3項の規定に従い、以下のとおり「内部統制システムの構築に関する基本方針」を決議(2006年5月)しております。

(1) 取締役の職務の執行が法令および定款に適合することを確保するための体制について

- ① 本取引所は、経営理念および行動規範において、法令および定款の遵守を経営の最重要事項と位置付けており、これを堅持する。
- ② 取締役および執行役員(以下「取締役等」という。)は、取締役会決議、その他の意思決定に関して、善管注意義務、忠実義務の法的義務をもってこれを履行する。
- ③ 取締役は、取締役会や経営上の重要会議において、相互にその職務執行を監視する。また、取締役等は監査役および会計監査人により、随時監査を受ける。
- ④ 取締役等は、反社会的勢力等の排除を徹底する。

(2) 取締役の職務の執行に係る情報の保存および管理に関する体制について

本取引所は、取締役等の職務の執行に係る以下の文書（電磁的記録を含む。以下同じ。）その他の重要な情報を、文書取扱規程等に基づき、適切に保存し管理する。

- ① 株主総会議事録と関連資料
- ② 取締役会議事録と関連資料
- ③ 稟議書
- ④ その他経営方針の決定に関する重要会議の記録および資料

(3) 損失の危機の管理に関する規程その他の体制について

- ① 本取引所は、損失の危機（以下「リスク」という。）の管理を経営の最重要事項と位置付ける。
- ② 取締役会は、リスク管理の基本方針を制定するとともに、重要事項について決議する。また、リスク管理委員会、最高リスク管理責任者を設置し、定期的な報告を求める。
- ③ 各部門は、リスク管理の基本方針に基づき、担当する業務に係るリスクの管理に関する規程・事務マニュアル・その他内規を制定し、当該規程等に基づき管理する。コンプライアンス・リスク管理室は、リスク管理の統括実務を行う。
- ④ 内部監査室は、各部門の日常的なリスク管理状況の監査を実施し、その結果を適宜取締役会に報告する。
- ⑤ 自主規制委員会が自主規制業務に関する事項を決定し、業務執行機関からの独立性を確保する。
- ⑥ 災害等のリスクが顕在化した場合は、緊急時事業継続計画に基づき、可能な限り業務を継続する。また、業務中断時にも、迅速かつ効率的な復旧を図る。
- ⑦ システム障害、システムの不正利用およびサイバー攻撃等が生じた場合は、迅速な解決および再発防止を図る。

(4) 取締役の職務の執行が効率的に行われることを確保するための体制について

- ① 担当役員制度および執行役員制度を導入し、決裁規程、緊急時対応マニュアル等に基づき、各取締役および各執行役員の責任および権限の明確化を図り、職務執行が効率的に行われる体制とする。
- ② 取締役会を構成する取締役のうち、複数名を社外取締役とし、取締役の職務執行の透明性・妥当性を確保する。

(5) 使用人の職務の執行が法令および定款に適合することを確保するための体制について

- ① コンプライアンス体制
コンプライアンス・リスク管理室は、コンプライアンス体制の推進に係る実務を所管し、使用人の職務執行の適法性の確保を図る。
- ② 内部通報制度の構築

内部通報制度に基づき、社内および外部に通報窓口を設け、不正行為等の早期発見と是正を図る。

③ 監査

職務執行の適法性・妥当性・効率性等を確保するため、使用人は、監査役および内部監査室により、随時監査を受ける。

④ 反社会的勢力等の排除

反社会的勢力等への対応に係る規程を社内に周知し、反社会的勢力等の排除の徹底を図る。

(6) 監査役がその職務を補助すべき使用人を置くことを求めた場合における当該使用人に関する事項について

監査役の職務を補助すべき使用人の設置は、監査役により求められた場合にこれを行う。

(7) 監査役職務を補助すべき使用人の取締役からの独立性に関する事項について

監査役職務を補助すべき使用人を設置する場合には、その独立性に留意する。

(8) 監査役職務を補助すべき使用人に対する指示の実効性の確保に関する事項について

監査役職務を補助すべき使用人を設置する場合には、当該使用人の異動、評価などに関して、事前に監査役の意見を聞いてこれを行う。

(9) 取締役および使用人が監査役に報告をするための体制その他の監査役への報告に関する体制について

① 監査役は、取締役会等の重要会議に出席し、取締役等は、当該重要会議において、随時その担当する業務の執行状況について報告を行う。

② 取締役等および使用人は、法令等に違反する、又は違反する恐れのある場合や、会社に著しい損害が発生、又は発生する恐れがあると考えられる場合は、速やかに監査役に報告を行う。

③ コンプライアンス・リスク管理室長は、行動規範に基づき法令違反に関する報告を受けた場合は、速やかに監査役に報告を行う。

(10) 監査役に報告をした者が当該報告をしたことを理由として不利な取扱いを受けないことを確保するための体制について

監査役に報告をした役職員に対しては、内部通報制度に準じ、当該報告をしたことを理由として不利な取扱いを行わない。

(11) 監査役職務の執行について生ずる費用の前払又は償還の手続その他の当該職務の執行について生ずる費用又は債務の処理に係る方針に関する事項について

監査役がその職務の執行について生じる費用の前払いまたは償還等を請求した場合は、職務の執行に必要でないと認められる場合を除き、これに応じる。

(12) その他監査役の監査が実効的に行われることを確保するための体制について

- ① 代表取締役は、本取引所の事業活動に関し、監査役と定期的に意見交換を行う。
- ② 監査役会を構成する監査役のうち、半数以上を社外監査役とし、監査の透明性・実効性を確保する。
- ③ 監査役は、監査の実施にあたり必要と認めるときは、会計監査人等の外部専門家を自らの判断で活用する。
- ④ 内部監査部門は、内部監査の実施状況および結果について、監査役に随時報告する。

7. 上記6の体制の運用状況の概要

「内部統制システムの構築に関する基本方針」に従い、具体的な取り組みを行うとともに、必要に応じて見直すことにより、その実効性を向上させています。(2020年3月見直し実施)
また、取締役及び使用人を対象に、行動規範の浸透、コンプライアンスの理解と意識の向上を図るため、定期的に研修を実施しています。

(本事業報告中の表示数値未満の端数の取扱いは、切り捨てとしております。)

計 算 書 類

(2019年4月1日～2020年3月31日)

1. 貸借対照表
2. 損益計算書
3. 株主資本等変動計算書
4. 個別注記表

2019年度貸借対照表

(2020年3月31日)

(単位：千円)

科目	金額	科目	金額
(資産の部)		(負債の部)	
I 流動資産	18,065,539	I 流動負債	1,384,018
現金及び預金	6,832,394	営業未払金	1,027,590
営業未収入金	1,580,830	未払金	170,685
有価証券	9,600,000	未払法人税等	34,558
未収入金	12,217	未払消費税等	97,260
前払費用	39,815	預り金	15,463
その他	281	賞与引当金	38,461
II 固定資産	543,030,935	II 固定負債	540,097,862
1 有形固定資産	492,669	役員退職慰労引当金	108,530
器具及び備品	492,669	退職給付引当金	493,298
2 無形固定資産	2,912,448	取引参加者預り金	539,496,034
ソフトウェア	2,911,206	預り取引証拠金	516,854,691
その他	1,242	預り信認金	418,000
3 投資その他の資産	129,782	預り清算預託金	22,223,343
差入保証金	50,479		
長期前払費用	79,303	負債合計	541,481,880
4 取引参加者預り資産	539,496,034	(純資産の部)	
取引証拠金特定資産	516,854,691	株主資本	19,614,593
信認金特定資産	418,000	I 資本金	5,844,650
清算預託金特定資産	22,223,343	II 資本剰余金	6,045,950
		資本準備金	6,045,950
		III 利益剰余金	7,723,993
		その他利益剰余金	7,723,993
		金利先物等違約損失積立金	800,000
		証拠金取引違約損失積立金	1,800,000
		繰越利益剰余金	5,123,993
		純資産合計	19,614,593
資産合計	561,096,474	負債及び純資産合計	561,096,474

(記載金額は、千円未満を切り捨てて表示しております。)

2019年度損益計算書
(2019年4月1日～2020年3月31日)

(単位：千円)

科 目	金 額
営 業 収 益	6,624,322
基本手数料	134,700
定率手数料	6,007,761
システム設備関係収入	162,450
その他の市場利用手数料	27,079
資格取得料等	12,000
情報提供料	251,224
資金管理運用収入	29,106
営 業 費 用	7,293,745
販売費及び一般管理費	7,293,745
営 業 損 失	669,423
営 業 外 収 益	8,426
受取利息	4,482
雑収入	3,943
営 業 外 費 用	10,671
雑損失	10,671
経 常 損 失	671,668
特 別 損 失	792,287
減損損失	792,287
税 引 前 当 期 純 損 失	1,463,955
法人税、住民税及び事業税	3,800
法人税等調整額	94,218
当 期 純 損 失	1,561,973

(記載金額は、千円未満を切り捨てて表示しております。)

株主資本等変動計算書
(2019年4月1日～2020年3月31日)

(単位: 千円)

	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	資本剰余金 合計	その他利益剰余金			利益剰余金 合計		
				金利先物等 違約損失積立 金	証拠金 違約損失積立 金	繰越利益 剰余金			
2019年4月1日残高	5,844,650	6,045,950	6,045,950	800,000	2,000,000	6,615,380	9,415,380	21,305,980	21,305,980
事業年度中の変動額									
剰余金の配当	-	-	-	-	-	△129,412	△129,412	△129,412	△129,412
違約損失積立金の取崩	-	-	-	-	△200,000	200,000	-	-	-
当期純損失	-	-	-	-	-	△1,561,973	△1,561,973	△1,561,973	△1,561,973
株主資本以外の項目の 事業年度中の変動額(純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	△200,000	△1,491,386	△1,691,386	△1,691,386	△1,691,386
2020年3月31日残高	5,844,650	6,045,950	6,045,950	800,000	1,800,000	5,123,993	7,723,993	19,614,593	19,614,593

(記載金額は、千円未満を切り捨てて表示しております。)

個 別 注 記 表

1. 重要な会計方針に係る事項

(1) 固定資産の減価償却の方法

- ①有形固定資産 定額法を採用しております。
- ②無形固定資産 自社利用ソフトウェア…社内における利用可能期間（5年以内）に基づく定額法を採用しております。
- ③長期前払費用 均等償却によっております。
なお、償却期間については、法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

(2) 引当金の計上基準

①貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

なお、当事業年度については繰入額はありません。

②役員賞与引当金

役員に対する賞与の支給に備えるため、翌事業年度の支給見込額のうち当事業年度に負担すべき金額を計上しております。

なお、当期については繰入額はありません。

③賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、翌事業年度の支給見込額のうち当事業年度に負担すべき金額を計上しております。

④役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、会社規程に基づく期末要支給額を計上しております。

⑤退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職給付会計に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第25号）に定める簡便法に基づき会社規程による期末自己都合要支給額を計上しております。

また、執行役員部分については、執行役員の退職慰労金の支給に備えるため、会社規程に基づく期末要支給額を計上しております。

(3) 消費税等の処理方法

税抜方式を採用しております。

2. 会計上の見積りの変更に関する注記

2019年11月21日開催の取締役会において、事務所スペースの一部削減を決議したことから、一部の内部造作について耐用年数の見直しを行っております。

この変更により、従来の方法と比べて、当事業年度の減価償却費が233,968千円増加し、営業損失、経常損失及び税引前当期純損失が同額増加しております。

3. 貸借対照表に関する注記

(1) 有形固定資産の減価償却累計額 237,084千円

(2) 取引参加者預り資産及び取引参加者預り金

当社では、取引参加者及び清算参加者の債務不履行により当社及び委託者等が被るリスクを担保するため、各取引参加者及び清算参加者より取引証拠金、信認金及び清算預託金（清算預託金は清算参加者のみ）の預託を受け、他の資産と区分して管理しており、貸借対照表上、その目的ごとに区分して表示しております。

(3) 担保受入金融資産の時価評価額

貸借対照表上に計上していない代用有価証券の時価は以下のとおりであります。

取引証拠金代用有価証券	29,195,294千円
信認金代用有価証券	935,825千円
清算預託金代用有価証券	13,161,934千円

上記の代用有価証券は、金融商品取引の契約不履行の発生時において処分権を有するものであります。

4. 株主資本等変動計算書に関する注記

(1) 当事業年度の末日における発行済株式の数

普通株式 862,750 株

(2) 配当金の支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力 発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	129,412	150	2019年 3月31日	2019年 6月21日

(3) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

上記の事項については、次のとおり決議を予定しております。

決議予定	株式の種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力 発生日
2020年6月25日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	43,137	50	2020年 3月31日	2020年 6月26日

5. 金融商品に関する注記

(1) 金融商品の状況に関する事項

当社は、資金運用規程を設け、資金運用を行っております。

運用対象は、銀行預金および有価証券とし、適切なリスク管理体制の下で運用し、定期的に取り締役会に運用状況を報告しております。取引参加者から預託されている取引証拠金、清算預託金、信託金は当社固有の預金口座と分別して信用度の高い金融機関の預金により保管、管理しております。

営業未収入金に係る顧客の信用リスクは、当社が定めるリスク管理の基本方針に基づき、顧客の財務状況等を定期的に把握、管理し、リスクの低減を図っております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計 上額 (※)	時価 (※)	差額
① 現金及び預金	6,832,394	6,832,394	—
② 営業未収入金	1,580,830	1,580,830	—
③ 有価証券	9,600,000	9,600,000	—
④ 取引証拠金特定資産	516,854,691	516,854,691	—
⑤ 信認金特定資産	418,000	418,000	—
⑥ 清算預託金特定資産	22,223,343	22,223,343	—
⑦ 営業未払金	(1,027,590)	(1,027,590)	—
⑧ 預り取引証拠金	(516,854,691)	(516,854,691)	—
⑨ 預り信認金	(418,000)	(418,000)	—
⑩ 預り清算預託金	(22,223,343)	(22,223,343)	—

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

① 現金及び預金、② 営業未収入金、③ 有価証券、⑦ 営業未払金

これらは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。

④ 取引証拠金特定資産、⑧ 預り取引証拠金

これらは返還又は目的使用に備えて現金及び預金として保管しているものであり、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。

⑤ 信認金特定資産、⑨ 預り信認金

これらは返還又は目的使用に備えて現金及び預金として保管しているものであり、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。

⑥ 清算預託金特定資産、⑩ 預り清算預託金

これらは返還又は目的使用に備えて現金及び預金として保管しているものであり、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。

6. 税効果会計に関する注記

繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(繰延税金資産)

	千円
役員退職慰労引当金	33,231
退職給付引当金	151,047
賞与引当金	11,776
減損損失	242,598
未払事業税	10,969
税務上の繰越欠損金	478,894
その他	153,881
繰延税金資産小計	1,082,400
評価性引当額	△1,082,400
繰延税金資産合計	-

7. 1株当たり情報に関する注記

1株当たり純資産額	22,734円96銭
1株当たり当期純損失	1,810円45銭

株式会社東京金融取引所
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小倉 加奈子 ㊞

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 高瀬 雄一郎 ㊞

監査意見

当監査法人は、会社法第436条第2項第1号の規定に基づき、株式会社東京金融取引所の2019年4月1日から2020年3月31日までの第16期事業年度の計算書類、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書及び個別注記表並びにその附属明細書（以下「計算書類等」という。）について監査を行った。

当監査法人は、上記の計算書類等が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、当該計算書類等に係る期間の財産及び損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った監査の基準における当監査法人の責任は、「計算書類等の監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

計算書類等に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して計算書類等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計算書類等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。

計算書類等を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき計算書類等を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

計算書類等の監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての計算書類等に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から計算書類等に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、計算書類等の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 計算書類等の監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として計算書類等を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において計算書類等の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する計算書類等の注記事項が適切でない場合は、計算書類等に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 計算書類等の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた計算書類等の表示、構成及び内容、並びに計算書類等が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

監 査 報 告 書

当監査役会は、2019年4月1日から2020年3月31日までの第16期事業年度の取締役の職務の執行に関して、各監査役が作成した監査報告書に基づき、審議の上、本監査報告書を作成し、以下のとおり報告いたします。

1. 監査役及び監査役会の監査の方法及びその内容

- (1) 監査役会は、監査の方針、職務の分担等を定め、各監査役から監査の実施状況及び結果について報告を受けるほか、取締役等及び会計監査人からその職務の執行状況について報告を受け、必要に応じて説明を求めました。
- (2) 各監査役は、監査役会が定めた監査役監査の基準に準拠し、監査の方針、職務の分担等に従い、取締役、内部監査部門その他の使用人等と意思疎通を図り、情報の収集及び監査の環境の整備に努めるとともに、以下の方法で監査を実施しました。
 - ①取締役会その他重要な会議に出席し、取締役及び使用人等からその職務の執行状況について報告を受け、必要に応じて説明を求め、重要な決裁書類等を閲覧し、業務及び財産の状況を調査いたしました。
 - ②事業報告に記載されている取締役の職務の執行が法令及び定款に適合することを確保するための体制その他株式会社の業務の適正を確保するために必要なものとして会社法施行規則第100条第1項及び第3項に定める体制の整備に関する取締役会決議の内容及び当該決議に基づき整備されている体制（内部統制システム）について、取締役及び使用人等からその構築及び運用の状況について報告を受け、必要に応じて説明を求め、意見を表明いたしました。
 - ③会計監査人が独立の立場を保持し、かつ、適正な監査を実施しているかを監視及び検証するとともに、会計監査人からその職務の執行状況について報告を受け、必要に応じて説明を求めました。また、会計監査人から「職務の遂行が適正に行われることを確保するための体制」を「監査に関する品質管理基準」（平成17年10月28日企業会計審議会）等に従って整備している旨の通知を受け、必要に応じて説明を求めました。

以上の方法に基づき、当該事業年度に係る事業報告並びに計算書類（貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書及び個別注記表）及びその附属明細書について検討いたしました。

2. 監査の結果

(1) 事業報告等の監査結果

- ①事業報告は、法令及び定款に従い、会社の状況を正しく示しているものと認めます。
- ②取締役の職務の執行に関する不正の行為又は法令若しくは定款に違反する重大な事実はありません。
- ③内部統制システムに関する取締役会決議の内容は相当であると認めます。また、当該内部統制システムに関する事業報告の記載内容及び取締役の職務の執行についても、指摘すべき事項はありません。

(2) 計算書類及びその附属明細書の監査結果

会計監査人有限責任あずさ監査法人の監査の方法及び結果は相当であると認めます。

2020年5月29日
株式会社東京金融取引所 監査役会

常勤監査役 福知 眞 ⑩

監査役 須藤 英章 ⑩

監査役 小野 行雄 ⑩

(注) 監査役須藤英章及び監査役小野行雄は、会社法第2条第16号及び第335条第3項に定める社外監査役であります。

株式会社東京金融取引所

定時株主総会会場ご案内図



【会 場】 株式会社東京金融取引所 T F X プラザ
東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号 鉄鋼ビルディング 8 階
電話番号 03(4578)2400 (代)

【交 通】

- ・ JR 東京駅 徒歩約 2 分
- ・ 地下鉄 東京駅 徒歩約 6 分
- ・ 地下鉄 大手町駅 徒歩約 2 分
- ・ 地下鉄 日本橋駅 徒歩約 3 分

【照会先】 株式会社東京金融取引所 総務部
電話番号 03(4578)2402