

平成 24 年 6 月 5 日

株 主 各 位

東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号
株式会社東京金融取引所
代表取締役社長 太田 省三

第 8 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、本取引所第 8 回定時株主総会を下記により開催いたしますので、ご出席くださいますようご通知申し上げます。

なお、当日ご出席願えない場合は、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、ご押印のうえ、平成 24 年 6 月 19 日（火曜日）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 平成 24 年 6 月 20 日（水曜日） 午前 10 時
2. 場 所 東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号 丸の内パークビルディング 15 階
本取引所 大会議室
(末尾の会場ご案内図をご参照ください)
3. 株主総会の目的事項
報告事項 第 8 期（平成 23 年 4 月 1 日から平成 24 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 役員賞与支給の件

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、平成 24 年 6 月 13 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本取引所ウェブサイト（<http://www.tfx.co.jp>）に掲載させていただきます。
 4. 当日、本取引所役職員は、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。

事業報告

〔平成 23 年 4 月 1 日から
平成 24 年 3 月 31 日まで〕

1. 会社の現況に関する事項

(1) 事業の経過及びその成果

- ① 平成 23 年度の世界経済は、世界金融危機に伴う停滞から順調な回復を遂げていましたが、先進国においては、金融危機の後遺症の影響や景気刺激策の効果の減衰、さらには欧州政府債務問題等により、回復が鈍化しました。一方、回復のけん引役であった新興国においても、物価上昇や金融引締策の継続による内需の鈍化、先進国の景気減速に伴う輸出の減少等により、成長が鈍化しつつあります。

日本経済は、東日本大震災により深刻な打撃を受け、厳しい状況からのスタートとなりました。その後、サプライチェーンの急速な立て直しが図られ、景気は持ち直しに転じましたが、夏以降は急速な円高の進行や欧州政府債務問題等による世界経済の減速が、景気の持ち直しを緩やかなものにしております。

- ② 短期金融市場は、リーマンショック以降の日本銀行の金融緩和方針が継続され、超低金利環境が続きました。

外国為替市場は、欧州政府債務問題を巡って、リスク回避の動きから、総じて円高局面にありましたが、2月の日銀による「中長期的な物価安定の目途」導入を契機に、円安に転じました。

株式市場は、震災による打撃、円高の進行等により低迷しておりましたが、2月に入ると、欧州政府債務問題の落ち着き、日銀の追加緩和等により、期末には、期首の水準を上回る1万円台になりました。

- ③ ユーロ円3ヵ月金利先物は、日本銀行による金融緩和の一段の強化等から、取引数量は更に落ち込み、5,816千枚（前期比49.3%減）でした。

取引所為替証拠金取引（くりっく365）は、年度前半は、8月からのレバレッジ規制強化にかかわらず活況を呈していましたが、1月からの店頭取引への申告分離課税の適用と、店頭取引業者による売値と買値のスプレッドの縮小（為替レート的小数点以下3桁表示）等の影響により、第4四半期の取引数量は激減し、年間では、前年度を下回る121,116千枚（前期比1.9%減）となりました。

取引所株価指数証拠金取引（株365）については、年明けまでは低位で推移したものの、2月以降の株式市況好転と一部取引参加業者の努力により、取引数量は1,042千枚（前期比132.8%増）に増加しました。

この結果、平成23年度の全商品取引数量合計は、前期比5.4%減の128,019千枚でした。

- ④ 以上により、本取引所の営業収益は、前期比 17 億 28 百万円 (15.8%) 減の 92 億 38 百万円となりました。

営業費用は、主に前期に実施したシステム開発の平年化による費用の増加により、前期比 4 億 36 百万円 (6.2%) 増の 74 億 76 百万円となりました。

(営業収益の内訳)

区 分	金 額 (千円)
基 本 手 数 料	52,050
定 率 手 数 料	8,724,607
シ ス テ ム 設 備 関 係 収 入	218,756
資 格 取 得 料 等	2,000
情 報 提 供 料	240,693
合 計	9,238,106

(営業費用の内訳)

区 分	金 額 (千円)
人 件 費	1,602,968
販 売 費	333,032
施 設 関 係 費	5,275,493
事 務 運 営 費	264,758
合 計	7,476,253

- ⑤ この結果、営業利益は、前期比 21 億 65 百万円 (55.1%) 減の 17 億 61 百万円に減少しました。内訳は、金利先物等取引が 12 億 27 百万円の赤字、証拠金取引 (くりっく 365 と株 365) が 29 億 89 百万円の黒字となっております。

営業外収益として預金及び国債の運用収益等があり、経常利益は前期比 21 億 45 百万円 (50.7%) 減の 20 億 86 百万円となりました。

更に、本年度は、固定資産の減損に係る会計基準に基づき、特別損失として、6 億 69 百万円の金利先物等取引システムに係る減損損失を計上することとなりました。

以上により、税引前当期純利益は 14 億 17 百万円 (前期比 64.7% 減)、税引後当期純利益は 8 億 7 百万円 (前期比 64.0% 減) となりました。

(2) 設備投資の状況

平成 23 年度の設備投資は、取引所為替証拠金取引のシステム改良等により、総額で 2 億 32 百万円でした。

(3) 資金調達の状況

該当事項はありません。

(4) 財産及び損益の状況の推移

区 分	第5期 (平成20年度)	第6期 (平成21年度)	第7期 (平成22年度)	第8期 (平成23年度)
営業収益(千円)	8,458,166	8,532,223	10,966,684	9,238,106
営業利益(千円)	2,660,499	2,525,765	3,927,140	1,761,853
経常利益(千円)	2,817,707	2,770,147	4,232,089	2,086,894
当期純利益(千円)	1,444,405	1,728,964	2,242,308	807,122
1株当たり 当期純利益	1,674円18銭	2,004円01銭	2,599円02銭	935円52銭
総資産(注)(千円)	163,134,537	180,674,638	238,807,468	240,840,735
純資産(千円)	20,136,171	21,433,760	23,244,693	23,447,891

- (注) 1 平成23年度においては、固定資産の減損に係る会計基準に基づき、金利先物等取引システムに係る減損損失669百万円を、特別損失として計上しております。
- 2 総資産には、取引参加者及び清算参加者から取引証拠金、信託金、清算預託金として現金で預託されたものが含まれております。なお、当該現金で預託されたものは、負債と両建てで計上しており、平成23年度において、その額は2,165億77百万円で、前期比33億51百万円増加しております。
- 一方、取引参加者及び清算参加者から取引証拠金、信託金、清算預託金として預託された有価証券につきましては、総資産の額には含まれておりません。なお、その額は、436億96百万円(時価)です。

(5) 主要な事業内容(平成24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及び市場施設の提供、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、透明性及び信頼性を確保するために行う、取引内容の審査及び取引参加者への考査等の業務

本取引所の開設する市場における上場商品及び取引参加者数は、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
 - c. 無担保コールオーバーナイト金利先物
 - d. GCレポスポット・ネクスト金利先物
 - e. ユーロ円LIBOR6ヵ月金利先物

(注) GCレポスポット・ネクスト金利先物は、平成24年3月23日夜間取引終了時より取引を停止し、平成24年4月23日をもって上場廃止しております。

- 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（株 365）

〔取引参加者数〕

- ① 金利先物等取引参加者 49 社
（うち、金利先物等清算参加者 46 社）
- ② 為替証拠金取引参加者（為替証拠金清算参加者） 28 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（株価指数証拠金清算参加者） 11 社
（うち、マーケットメイカー 2 社）

(6) 主要な営業所（平成 24 年 3 月 31 日現在）

本店 東京都千代田区丸の内二丁目 6 番 1 号

(7) 従業員の状況（平成 24 年 3 月 31 日現在）

区 分	従業員数	（前期末比増減）	平均年齢	平均勤続年数
男 性	105 名	（+5 名）	36 歳 8 ヶ月	6 年 4 ヶ月
女 性	19 名	（±0 名）	34 歳 5 ヶ月	8 年 2 ヶ月
合計（又は平均）	124 名	（+5 名）	36 歳 4 ヶ月	6 年 8 ヶ月

（注） 従業員に、契約社員及び派遣社員計 3 名は含まれておりません。

(8) 主要な借入先の状況（平成 24 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 <平成 24 年度業務計画>

- ① 平成 23 年度第 4 四半期の収支赤字状況を踏まえ、経費構造の抜本的な見直しにより損益分岐点を引下げて、赤字構造を解消する。
- ② 金利先物等取引の手数料体系を見直し、収入構造を安定化させ、二大事業の一つである金利先物等取引の長期の赤字体質から脱却する。（減損処理の回避）
- ③ 平成 25 年度のシステム更改に向け、一層のコスト削減を図り、効率的な新システムを開発する。
- ④ 営業体制を強化し、責任ある管理体制のもと、効果的な営業活動により、取引数量の確保を図る。
- ⑤ 内部管理態勢の充実及び中長期的な人材の育成強化策を講ずる。

具体的には、平成 24 年度において以下の方策を推進する。

- ① 金利先物等取引
 - a. 手数料体系の見直し
 - b. LIBOR6 カ月金利先物の市場拡大（取引参加者の拡大）
- ② くりっく 365
 - a. 主要通貨ペアへの為替レート 3 桁表示導入によるスプレッドの縮小
 - b. 取次での海外・国内顧客参入促進による流動性向上
- ③ 株 365
 - a. スプレッドの縮小
 - b. 取次での海外・国内顧客参入促進等による流動性向上
- ④ 公正で安定的な市場運営
 - a. 取引所システムの安定稼働
 - b. 内部管理態勢の充実
 - ・業務フローの再点検、内部統制の一層の強化
 - c. 社員研修の充実強化と人事体系の見直しを伴った中長期の人材育成

2. 会社の株式に関する事項（平成 24 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 | 72 名 |
| (4) 大株主 | |

株 主 名	持株数 (株)	持株比率 (%)
株式会社三菱東京 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	4.79
大和証券キャピタル・マーケット株式会社	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
住友信託銀行株式会社	20,660	2.39
信 金 中 央 金 庫	20,660	2.39
農 林 中 央 金 庫	20,660	2.39
株 式 会 社 横 浜 銀 行	20,660	2.39

- (注) 1 大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成 24 年 4 月 1 日をもって大和証券株式会社に吸収合併されております。
- 2 住友信託銀行株式会社は、平成 24 年 4 月 1 日をもって中央三井信託銀行株式会社を吸収合併し、同日付で三井住友信託銀行株式会社に商号変更をしております。なお、中央三井信託銀行株式会社の平成 24 年 3 月 31 日現在の本取引所株式の持株数は、10,660 株です。

3. 会社の新株予約権等に関する事項（平成 24 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) 取締役及び監査役の状況（平成 24 年 3 月 31 日現在）

地 位	氏 名	担当及び重要な兼職の状況
代表取締役社長	太田 省三	最高経営責任者（CEO） コンプライアンス室、内部監査室
代表取締役専務	山 室 誠	最高業務執行責任者（COO） 総務部、経理部、金利市場監視部、証拠金市場監視部、 自主規制事務局
常務取締役	伊 藤 渡	市場部、清算決済部
常務取締役	廣 田 拓夫	最高情報責任者（CIO） システム部、営業部
取 締 役	今 井 敬	新日本製鐵株式會社 社友・名誉会長
取 締 役	貝 塚 啓明	東京大学 名誉教授
取 締 役	平 川 純子	シティニューワ法律事務所 パートナー
取 締 役	矢 野 正敏	株式会社みずほ銀行 取締役副頭取
取 締 役	中 居 英治	バークレイズ・キャピタル証券株式会社 代表取締役社長兼 CEO
常勤監査役	橋 本 長雄	
監 査 役	関 根 攻	長島・大野・常松法律事務所 顧問
監 査 役	藤 江 俊彦	千葉商科大学・同大学院 教授

(注) 1 取締役 今井 敬、貝塚 啓明、平川 純子、矢野 正敏、中居 英治の 5 氏は、社外取締役であります。

2 監査役 関根 攻、藤江 俊彦の両氏は、社外監査役であります。

3 当期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 伊藤 渡、廣田 拓夫、平川 純子、矢野 正敏、中居 英治の 5 氏は、平成 23 年 6 月 22 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。

監査役 関根 攻、藤江 俊彦の両氏は、平成 23 年 6 月 22 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退任及び辞任

取締役 村上 堯、小山田 隆の両氏は、平成 23 年 6 月 22 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、郭 宝樹氏は、平成 23 年 6 月 17 日をもって、辞任いたしました。

監査役 手塚 一男氏は、平成 23 年 6 月 22 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、大村 信明氏は、同日をもって辞任いたしました。

(2) 取締役及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)	12名 (7名)	169,808千円 (33,324千円)
監 査 役 (うち社外監査役)	5名 (4名)	32,276千円 (10,556千円)

(注) 1 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。

(平成 23 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

(平成 20 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

2 上記には、平成 23 年度中に退任または辞任した、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

本取引所の会計監査人は、新日本有限責任監査法人であります。

6. 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、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」を決定しております。

(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、取締役等は監査役監査および会計監査人監査により、臨時監査を受ける。

(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 各部門は、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、リスクの発生予防策・対応策・再発防止策等を整備する。
- ③ 内部監査部門は、各部署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。

(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、緊急時対応策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及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の整備
使用人の職務執行の適法性を確保するため、「コンプライアンス室」を設置し、同室においてコンプライアンスに関する体制の整備を行う。
- ② 内部通報制度の構築
内部通報制度を整備し、使用人に対してその周知を図る。この場合、報告者・相談者の匿名性を保証するとともに、不利益がないことを確保する。
- ③ 内部監査の実施
内部監査部門は、内部監査規則に基づき、使用人の職務執行の適法性・妥当性・効率性等を確保するため、組織横断的に監査を実施する。
- ④ その他
使用人は、監査役監査および会計監査人監査により、随時監査を受ける。

- (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

監査役の職務に対する補助人の設置は、監査役により求められた場合にこれを行う。

- (7) 前号の使用人の取締役からの独立性に関する事項について

(6) における補助人を設置する場合には、その独立性に留意する。

- (8) 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。

- (9) その他監査役の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 監査役および監査役会は、監査役監査を適切に遂行するため、取締役等および使用人との意思疎通を図り、情報の収集および監査の環境の整備に努める。
- 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。

(本事業報告中の表示数値未満の端数の取扱いは、金額及び取引数量については切り捨て、比率その他の数値については四捨五入としております。)

貸借対照表

(平成24年3月31日現在)

(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	1,888,211	I 流動負債	396,873
現金及び預金	882,427	営業未払金	212,657
営業未収入金	614,346	未払金	323
有価証券	90,000	未払消費税等	32,130
未収入金	50,487	前受金	31,792
未収還付法人税等	119,174	預り金	26,569
前払費用	86,639	役員賞与引当金	28,000
繰延税金資産	40,853	賞与引当金	57,117
その他	4,281	その他	8,283
II 固定資産	238,952,523	II 固定負債	216,995,970
1 有形固定資産	1,643,771	役員退職慰労引当金	135,610
建物附属設備	456,042	退職給付引当金	282,627
器具及び備品	1,187,729	取引参加者預り金	216,577,733
2 無形固定資産	2,144,148	取引証拠金	212,629,001
ソフトウェア	2,118,235	信託金	466,000
ソフトウェア仮勘定	17,740	清算預託金	3,482,732
その他	8,172		
3 投資その他の資産	18,586,870	負債合計	217,392,844
投資有価証券	17,137,504	(純資産の部)	
長期預金	500,000	株主資本	23,447,891
差入保証金	716,441	I 資本金	5,844,650
長期貸付金	1,384	II 資本剰余金	6,045,950
長期前払費用	1,002	資本準備金	6,045,950
繰延税金資産	212,587	III 利益剰余金	11,557,290
その他	17,950	その他利益剰余金	11,557,290
4 取引参加者預り資産	216,577,733	金利先物等違約損失積立金	1,994,000
取引証拠金預金	212,629,001	為替証拠金違約損失積立金	1,500,000
信託金預金	466,000	株価指数証拠金違約損失積立金	100,000
清算預託金預金	3,482,732	繰越利益剰余金	7,963,290
		純資産合計	23,447,891
資産合計	240,840,735	負債及び純資産合計	240,840,735

(記載金額は、千円未満を切り捨てて表示しております。)

損益計算書

(平成23年4月1日～平成24年3月31日)

(単位：千円)

科 目	金 額
営 業 収 益	9,238,106
基本手数料	52,050
定率手数料	8,724,607
システム設備関係収入	218,756
資格取得料等	2,000
情報提供料	240,693
営 業 費 用	7,476,253
販売費及び一般管理費	7,476,253
営 業 利 益	1,761,853
営 業 外 収 益	327,651
受取利息	300,961
雑収入	26,690
営 業 外 費 用	2,610
雑損失	2,610
経 常 利 益	2,086,894
特 別 損 失	669,678
減損損失	669,678
税 引 前 当 期 純 利 益	1,417,215
法人税、住民税及び事業税	687,476
法人税等調整額	△ 77,383
当 期 純 利 益	807,122

(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

(平成23年4月1日～平成24年3月31日)

(単位：千円)

株主資本	
資本金	
当期首残高	5,844,650
当期変動額	
当期変動額合計	-
当期末残高	5,844,650
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	6,045,950
当期変動額	
当期変動額合計	-
当期末残高	6,045,950
資本剰余金合計	
当期首残高	6,045,950
当期変動額	
当期変動額合計	-
当期末残高	6,045,950
利益剰余金	
その他利益剰余金	
金利先物等違約損失積立金	
当期首残高	1,994,000
当期変動額	
当期変動額合計	-
当期末残高	1,994,000
為替証拠金違約損失積立金	
当期首残高	936,000
当期変動額	
為替証拠金違約損失積立金の積立	564,000
当期変動額合計	564,000
当期末残高	1,500,000
株価指数証拠金違約損失積立金	
当期首残高	-
当期変動額	
株価指数証拠金違約損失積立金の積立	100,000
当期変動額合計	100,000
当期末残高	100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	8,424,093
当期変動額	
剰余金の配当	△603,925
当期純利益	807,122
為替証拠金違約損失積立金の積立	△564,000
株価指数証拠金違約損失積立金の積立	△100,000
当期変動額合計	△460,802
当期末残高	7,963,290
利益剰余金合計	
当期首残高	11,354,093
当期変動額	
剰余金の配当	△603,925
当期純利益	807,122
為替証拠金違約損失積立金の積立	-
株価指数証拠金違約損失積立金の積立	-
当期変動額合計	203,197
当期末残高	11,557,290
株主資本合計	
当期首残高	23,244,693
当期変動額	
剰余金の配当	△603,925
当期純利益	807,122
当期変動額合計	203,197
当期末残高	23,447,891
純資産合計	
当期首残高	23,244,693
当期変動額	
剰余金の配当	△603,925
当期純利益	807,122
当期変動額合計	203,197
当期末残高	23,447,891

(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) 有価証券の評価基準及び評価方法

満期保有目的の債券 償却原価法(定額法)を採用しております。

(2) 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)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。

(3) 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、当期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、翌期の支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。

③賞与引当金

従業員および執行役員に対する賞与の支給に備えるため、翌期の支給見込額のうち当期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実務指針(会計制度委員会報告第13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。

(4) 消費税等の処理方法

税抜方式を採用しております。

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

2. 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 1,708,073 千円

(2) 取引参加者預り資産及び取引参加者預り金

本取引所では、取引参加者および清算参加者の債務不履行により本取引所および委託者等が被るリスクを担保するため、各取引参加者および清算参加者より取引証拠金、信託金及び清算預託金（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	38,764,086 千円
信託金代用有価証券	519,255 千円
清算預託金代用有価証券	4,413,454 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) 訴訟

平成21年10月30日付取引のくりっく365・南アフリカランド/日本円取引に関して、一部の投資家から当社ほか1社に対して、220,953千円の損害賠償を請求する訴訟が東京地方裁判所に提起され、現在係争中であります。

当社は、当該投資家に対する損害賠償責任はないものと判断しており、その旨訴訟において主張しております。

3. 損益計算書に関する注記

金利先物等取引システムについて、減損損失として 669,678 千円を特別損失に計上しております。

4. 株主資本等変動計算書に関する注記

(1) 当該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
平成23年6月22日 定時株主総会	普通株式	603,925	700	平成23年 3月31日	平成23年 6月23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
平成24年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	431,375	500	平成24年 3月31日	平成24年 6月21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、資金管理基準を設けており、これに基づいて資金運用は銀行預金の他、有価証券については安全性の高い日本国債に限定し、自己資金の範囲内で行っております。なお、当社は、デリバティブ取引を行っておりません。

銀行預金の運用先はいずれも信用度の高い金融機関であるため、相手方の契約不履行に係る信用リスクは、ほとんどないと認識しております。日本国債は満期保有目的にて所有しており、信用リスクは僅少であります。

取引参加者から預託されている取引証拠金、清算預託金、信認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、リスク管理についての方針を定めたリスク管理規程を設けており、これに基づいて顧客の財務状況等を定期的に把握、管理し、リスク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

平成 24 年 3 月 31 日（当期の決算日）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	882,427	882,427	—
②営業未収入金	614,346	614,346	—
③有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券	17,227,504	17,691,029	463,525
④取引証拠金預金	212,629,001	212,629,001	—
⑤信認金預金	466,000	466,000	—
⑥清算預託金預金	3,482,732	3,482,732	—
⑦営業未払金	(212,657)	(212,657)	—
⑧取引証拠金	(212,629,001)	(212,629,001)	—
⑨信認金	(466,000)	(466,000)	—
⑩清算預託金	(3,482,732)	(3,482,732)	—

（※）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、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。

③有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券は取引金融機関から提示された価格によっております。

④取引証拠金預金、⑧取引証拠金

これらは随時行われる返還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信認金預金、⑨信認金

これらは随時行われる返還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清算預託金預金、⑩清算預託金

これらは随時行われる返還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	48,331
退職給付引当金	100,728
賞与引当金	21,710
減損損失	253,758
未払事業税	5,097
その他	89,864
<u>繰延税金資産小計</u>	<u>519,489</u>
評価性引当額	△ 266,048
<u>繰延税金資産合計</u>	<u>253,441</u>

7. 1株当たり情報に関する注記

1株当たり純資産額	27,178円08銭
1株当たり当期純利益	935円52銭

8. 重要な後発事象に関する注記

当社は、平成24年4月26日開催の取締役会において、取引所為替証拠金取引および取引所株価指数証拠金取引システムの安定稼働・処理能力向上等を図るため、当該システムの更改を決議いたしました。投資金額は約2,000,000千円、稼働開始時期は平成25年10月の予定であります。

独立監査人の監査報告書

平成24年5月15日

株式会社東京金融取引所
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 里 村 豊 ㊞
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 阪 中 修 ㊞
業務執行社員

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平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第8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について監査を行った。

計算書類等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企業会計の基準に準拠して計算書類及びその附属明細書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及びその附属明細書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監査に基づいて、独立の立場から計算書類及びその附属明細書に対する意見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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に計算書類及びその附属明細書に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、計算書類及びその附属明細書の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による計算書類及びその附属明細書の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、計算書類及びその附属明細書の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積もりの評価も含め全体としての計算書類及びその附属明細書の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の計算書類及びその附属明細書が、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、当該計算書類及びその附属明細書に係る期間の財産及び損益の状況をすべ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。

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、平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第8期事業年度の取締役の職務の執行に関して、各監査役の監査報告に基づき、審議の結果、監査役全員の一致した意見として、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

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。

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、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。また、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適宜報告を受け、必要に応じて説明を求め、意見を表明いたしました。以上の方法に基づき、当該事業年度に係る事業報告について検討いたしました。

さらに、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体制」を「監査に関する品質管理基準」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計算書類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

- 一 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。
- 二 取締役の職務の執行に関する不正の行為又は法令もしくは定款に違反する重大な事実は認められません。
- 三 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、指摘すべき事項は認められません。

(2) 計算書類及びその附属明細書の監査結果

会計監査人新日本有限責任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。

平成 24 年 5 月 15 日

株式会社 東京金融取引所 監査役会

監査役(常勤) 橋本長雄 ⑩

監査役 関根 攻 ⑩

監査役 藤江俊彦 ⑩

(注) 監査役 関根攻及び監査役 藤江俊彦は、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 大会議室
東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 15階
電話番号 03(4578)2400 (代)

【交 通】 ・JR 東京駅及び丸ノ内線東京駅より徒歩5分
・千代田線二重橋前駅より徒歩2分

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