

四 半 期 報 告 書

(金融商品取引法第24条の4の7第1項に基づく報告書)

事業年度	自	平成24年10月1日
(第76期Ⅲ)	至	平成24年12月31日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第76期第3四半期（自平成24年10月1日 至平成24年12月31日）

四 半 期 報 告 書

- 本書は金融商品取引法第24条の4の7第1項に基づく四半期報告書を同法第27条の30の2に規定する開示用電子情報処理組織(EDINET)を使用し提出したデータに目次及び頁を付して出力・印刷したものであります。
- 本書には、上記の方法により提出した四半期報告書に添付された四半期レビュー報告書を末尾に綴じ込んでおります。

株式会社 大和証券グループ本社

目 次

頁

第76期第3四半期 四半期報告書

【表紙】	1
第一部 【企業情報】	2
第1 【企業の概況】	2
1 【主要な経営指標等の推移】	2
2 【事業の内容】	2
第2 【事業の状況】	3
1 【事業等のリスク】	3
2 【経営上の重要な契約等】	5
3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】	5
第3 【提出会社の状況】	12
1 【株式等の状況】	12
2 【役員の状況】	13
第4 【経理の状況】	14
1 【四半期連結財務諸表】	15
2 【その他】	29
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	30

四半期レビュー報告書

【表紙】

【提出書類】	四半期報告書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条の4の7第1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年2月13日
【四半期会計期間】	第76期第3四半期 (自 平成24年10月1日 至 平成24年12月31日)
【会社名】	株式会社大和証券グループ本社
【英訳名】	Daiwa Securities Group Inc.
【代表者の役職氏名】	執行役社長 日比野 隆 司
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03(5555)1111
【事務連絡者氏名】	財務部長 佐 藤 英 二
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03(5555)1111
【事務連絡者氏名】	財務部長 佐 藤 英 二
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号) 株式会社大阪証券取引所 (大阪市中央区北浜一丁目8番16号) 株式会社名古屋証券取引所 (名古屋市中区栄三丁目8番20号)

第一部 【企業情報】

第 1 【企業の概況】

1 【主要な経営指標等の推移】

回次	第75期 第 3 四半期 連結累計期間	第76期 第 3 四半期 連結累計期間	第75期
会計期間	自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年12月31日	自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年12月31日	自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日
営業収益 (百万円)	309,025	352,574	422,374
純営業収益 (百万円)	245,048	271,694	336,016
経常利益又は経常損失 (△) (百万円)	△21,883	35,100	△12,200
四半期純利益又は四半期(当期)純損失 (△) (百万円)	△50,355	24,136	△39,434
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	△109,582	58,716	△52,579
純資産額 (百万円)	806,065	999,454	951,702
総資産額 (百万円)	17,220,452	17,475,300	18,924,038
1株当たり四半期純利益金額又は四半期(当期)純損失金額 (△) (円)	△29.91	14.24	△23.41
潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)純利益金額 (円)	—	14.21	—
自己資本比率 (%)	4.2	4.7	4.1

回次	第75期 第 3 四半期 連結会計期間	第76期 第 3 四半期 連結会計期間
会計期間	自 平成23年10月 1 日 至 平成23年12月31日	自 平成24年10月 1 日 至 平成24年12月31日
1株当たり四半期純利益金額又は四半期純損失金額 (△) (円)	△12.79	8.29

- (注) 1 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。
- 2 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。
- 3 1株当たり四半期純利益金額又は四半期(当期)純損失金額の算定における期末株式数及び期中平均株式数については、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式を四半期連結貸借対照表において自己株式として表示していることから、当該株式の数を控除しております。
- 4 第75期及び第75期第3 四半期連結累計期間の潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)純利益金額については、潜在株式は存在するものの、1株当たり四半期(当期)純損失を計上しているため記載しておりません。

2 【事業の内容】

当第3 四半期連結累計期間において、当社グループ（当社及び当社の関係会社）が営む事業の内容に重要な変更はありません。

なお、大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケッツ株式会社は、平成24年4月1日付けで、大和証券株式会社を吸収合併存続会社とする吸収合併を行いました。これにより大和証券株式会社はリテール部門及びホールセール部門（グローバル・マーケッツ、グローバル・インベストメント・バンキング）を包含することとなりました。

第2 【事業の状況】

1 【事業等のリスク】

当第3四半期連結累計期間開始日以降、当四半期報告書提出日までの間において、第75期有価証券報告書に記載した事業等のリスクについて重要な変更があった事項は次のとおりであります。

なお、文中の将来に関する事項は、当四半期報告書提出日現在において当社グループが判断したものであります。

(1) 世界の景気、経済情勢、金融市場の変動に関するリスク

世界経済は、欧州債務危機問題に対するECBによる支援策等により一時の危機的状況は脱したとみられるものの、その先行きは依然として不透明な状況です。再び、信用不安や財政問題が発生した場合には、世界的な金融危機や経済危機に発展する可能性も否定できません。

また、米国において、減税の期限切れと政府支出の削減がほぼ同時に訪れる、いわゆる「財政の崖」への懸念に対して不透明感が十分に払拭されておらず、さらに中国においても、外需の低迷や不動産バブル抑制策等により、経済成長の鈍化が長引く恐れがあります。これらの要因等による景気減速の懸念が払拭されていないため、引き続き世界的な景気の下振れリスクが存在しています。

このような状況の下、世界の景気や経済情勢が停滞若しくは悪化した場合、又は日本を取り巻く経済環境に悪影響を及ぼす事象が発生した場合には、日本においても、企業業績の悪化、株価の下落、為替・金利の変動等により様々なリスクが顕在化することが想定されます。

このような事態は、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

(2) 外的要因によるリスク

当社グループのコア事業である有価証券関連業務は、マーケットに急激な変動を生じさせる予測不可能な出来事の発生により大きな影響を受ける傾向があります。例えば、平成13年9月に発生した米国同時多発テロや、平成23年3月に発生した東日本大震災がもたらした社会・経済・金融等の混乱・危機的状況は、いずれも当社グループの業績に重大な影響を及ぼしました。

このように、戦争・テロ行為、地震・津波・洪水等の自然災害、新型インフルエンザの大流行や情報・通信システム・電力供給といったインフラストラクチャーの障害等の外的要因は、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(3) 競争状況に伴うリスク

株式の売買委託手数料率の自由化をはじめ、ファイアーウォール規制の見直し等、一連の大幅な規制緩和を契機として、当社グループのコア事業である有価証券関連業務における競争は、厳しいものとなっています。参入規制がほぼ撤廃されて、銀行その他の証券会社以外の国内外の金融グループは、幅広い金融商品・サービスの提供を行うことにより、顧客基盤及び店舗ネットワークを構築・強化しております。

当社グループは、これら国内外の金融グループに対して、競合する事業における価格やサービス面等の点で十分な競争力を発揮できるという保証はなく、これが発揮できない場合には、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

(18) 規制等に関するリスク

当社グループの各社は、その業務の種類に応じて業法による規制を受けております。グループの主たる証券会社である大和証券をはじめ、大和証券投資信託委託、大和住銀投信投資顧問、大和企業投資等が、金融商品取引業者として金融商品取引法等の規制を受けているほか、大和ネクスト銀行が銀行法等の規制を受けております。特に、子会社である証券会社及び銀行には、平成21年6月1日に施行された金融商品取引法及び銀行法の改正においてファイアーウォール規制の見直しが行われたことに伴い、利益相反による弊害防止の実効性を確保する観点から、お客様の利益が不当に害されることがないように、適正な情報管理と内部管理体制の整備が求められております。

また、大和証券は貸金業等の兼業業務に関して関係法令上の規制にも服しております。さらに、当社グループは金融商品取引法の定めにより、親法人等・子法人等が関与する行為の弊害防止のため、当該関係を利用した一定の取引の制限や、親法人・子法人間での情報授受や利用の制限等を受けており、また、当社は、一部のグループ各社の主要株主として、監督当局が公益又は投資家保護のために必要かつ適当であると認めるときは報告・資料提出命令を受ける等一定の規制を受ける可能性があります。一方、海外の子会社には現地の法制上、証券会社や金融機関としての規制を受けるものもあります。

なお、平成23年4月1日に施行された金融商品取引法等の一部を改正する法律における一定の金融商品取引業者に対する連結規制・監督の導入により、当社は、特別金融商品取引業者である大和証券の最終指定親会社として監督当局の連結規制・監督の対象となっております。また、当社グループは「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」における「指定親会社グループ」に該当するとともに、大和ネクスト銀行の銀行営業免許取得に伴い、「金融コングロマリット監督指針」における「事実上の持株会社グループ」に該当することとなり、連結自己資本の適切性を含む一定の事項について連結ベースでの監督を受けております。

加えて、G20（金融・世界経済に関する首脳会合）主導の下、各種金融規制・監督の強化が包括的に進む中、これらの国際的な金融規制や各国独自の金融規制が当社グループの事業に影響を及ぼす可能性があります。

上記のように、当社グループの事業の多くは行政及び自主規制団体による監督・規制やグローバルな金融規制のもとにあり、将来における法規・規程、政策、規制の変更が当社グループの事業活動や経営体制、さらには当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(19) 法令遵守に関するリスク

当社グループは、グループ全体の内部統制機能を強化し、より充実した内部管理体制の構築に努めるとともに、役職員に対する教育・研修等を通じ、インサイダー取引規制を含め法令遵守の徹底に注力しております。しかしながら、事業を進めていく上で、その執行過程に関与する役職員の故意又は過失により法令違反行為が発生する可能性は排除し得ず、周到な隠蔽行為を伴った意図的な違法行為等については、長期間にわたって発覚しない可能性もあるため、当社グループの業績に悪影響を与えるような規模の損害賠償を取引先等から求められる可能性があります。

さらに、役職員の不正行為のみならず、法人としての当社又はグループ会社に法令違反その他の問題が認められた場合には、監督当局から課徴金の納付命令、業務の制限又は停止等の処分・命令を受ける可能性があります。また、当社グループは情報管理の徹底や「個人情報保護に関する法律」への対応については万全の体制を敷いていると認識しておりますが、過失や不正行為等により当社グループの保有する顧客情報等各種の情報が外部に流出した場合、当社グループの信用の失墜、クレームや損害賠償請求、監督官庁からの処分等を受ける可能性があります。

当社グループの事業は、お客様からの信用に基づく部分が大きいとため、法令遵守上の問題が発生し当社グループに対する社会的信用が低下した場合には、お客様との取引が減少し、当社グループの業績に悪影響を及ぼす事態が生じる可能性もあります。

このほか「(18)規制等に関するリスク」に記載のとおり、当社はグループ各社の一部との関係において金融商品取引法等に定める主要株主に該当することから、当社自身又はその役員に一定の重大な法令違反等が認められた場合には、当社が「主要株主でなくなるための措置」その他必要な措置をとるよう命令を受ける等、有価証券関連業務をコア事業とする当社グループの事業、財政状態及び経営成績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

2 【経営上の重要な契約等】

当第3四半期連結会計期間において、経営上の重要な契約等の決定又は締結等はありません。

3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

本項における将来に関する事項は、別段の記載がない限り、当第3四半期連結会計期間の末日現在において当社グループが判断したものであります。

(1) 業績の状況

当第3四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は3,525億円（前年同四半期比14.1%増）となりました。トレーディング損益が776億円（同56.2%増）、受入手数料は総額で1,538億円（同6.0%減）となりました。金融収支は153億円（同6.4%減）、純営業収益は2,716億円（同10.9%増）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費494億円（同5.7%減）、人件費1,124億円（同7.9%減）、不動産関係費289億円（同14.4%減）などにより、合計で2,451億円（同10.6%減）となりました。

この結果、351億円の経常利益（前年同四半期は218億円の経常損失）となりました。

特別利益に投資有価証券売却益17億円、特別損失に事業再編関連費用34億円を計上したことなどにより、特別損益は純額で11億円の損失となりました。これに法人税等及び少数株主利益を加味した結果、当第3四半期連結累計期間は241億円の四半期純利益（前年同四半期は503億円の四半期純損失）となりました。

セグメントの業績は、次のとおりであります。

（単位：百万円）

	報告セグメント					その他	合計
	リテール部門	ホールセール部門	アセット・マネジメント部門	投資部門	計		
純営業収益	122,053	81,388	32,561	9,774	245,777	15,495	261,272
経常利益又は経常損失（△）	23,665	△8,112	13,987	7,253	36,794	△5,751	31,042

(注) 1 上記の純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 第1四半期連結会計期間より、大和証券と大和証券キャピタル・マーケットの統合に伴い、当社グループの報告セグメントの区分方法を変更しております。従来、「リテール部門」「グローバル・マーケット部門」「グローバル・インベストメント・バンキング部門」「アセット・マネジメント部門」「投資部門」の5事業区分としておりましたが、「リテール部門」「ホールセール部門」「アセット・マネジメント部門」「投資部門」の4事業区分に変更しております。また、経営管理上、事業セグメントの損益の測定方法も変更しております。

なお、各事業区分ごとの前年同四半期との比較については、前第3四半期連結累計期間のセグメント情報を、当第3四半期連結累計期間の報告セグメントの区分方法により作成することは実務上困難なため、記載しておりません。

[リテール部門]

株式市況好転を背景にエクイティ収益が拡大したほか、債券、株式投信の販売が好調で、純営業収益は1,220億円、経常利益は236億円となりました。

[ホールセール部門]

株式市場の上昇・売買代金の増加によりエクイティ収益が拡大したほか、外債・仕組債の販売も堅調だったものの黒字転換には至らず、純営業収益は813億円、81億円の経常損失となりました。

[アセット・マネジメント部門]

大和証券オフィス投資法人の連結子会社化が寄与し、純営業収益は325億円、経常利益は139億円となりました。

[投資部門]

投資案件の回収が進んだことなどにより、純営業収益は97億円、経常利益は72億円となりました。

[その他]

純営業収益は154億円、57億円の経常損失となりました。

(2) 財政状態の分析

<資産の部>

当第3四半期連結会計期間末の総資産は17兆4,753億円（前連結会計年度末比1兆4,487億円減）となりました。内訳は流動資産が16兆7,832億円（同1兆4,338億円減）であり、このうちトレーディング商品が8兆2,294億円（同6,474億円減）、有価証券担保貸付金が4兆2,712億円（同1兆4,638億円減）となっております。固定資産は6,920億円（同148億円減）となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は16兆4,758億円（同1兆4,964億円減）となりました。内訳は流動負債が14兆5,688億円（同1兆4,348億円減）であり、このうちトレーディング商品が4兆7,570億円（同1兆1,962億円減）、有価証券担保借入金が5兆8,920億円（同1,763億円減）、銀行業における預金が1兆6,596億円（同4,896億円増）、短期借入金が1兆1,491億円（同6,450億円減）となっております。固定負債は1兆9,044億円（同616億円減）であり、このうち社債が1兆2,516億円（同308億円減）、長期借入金が5,924億円（同308億円減）となっております。

純資産合計は9,994億円（同477億円増）となりました。株主資本については、「(7)資本の財源及び資金の流動性に係る情報 ②株主資本」に記載のとおりであります。その他有価証券評価差額金は450億円（同217億円増）、少数株主持分は1,653億円（同16億円増）となっております。為替換算調整勘定は、前連結会計年度末に比べ123億円増加しております。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当社グループは、平成24年度から平成26年度までを対象期間とするグループ中期経営計画「“Passion for the Best” 2014」を策定しました。「効率経営の追求による黒字転換」を果たすとともに、お客様のニーズにより的確に対応した「良質な収益拡大」を実現することで、外部環境に左右されない強靱な経営基盤を確立します。そして、経営ビジョンとして掲げた『日本に強固な事業基盤を有し、アジアを代表する総合証券グループ』を目指します。

グループ中期経営計画の初年度である平成24年度は、効率経営を追求するとともに、各事業部門のアクションプランを着実に実行することにより、黒字転換を果たします。また、世界的な金融規制強化に対応し、リスク管理態勢を引き続き強化すると共に、資本効率を重視した業務運営を徹底します。

平成24年度の各事業部門の事業計画は、以下のとおりであります。

① リテール部門

- (i) 独自の証銀連携ビジネスモデルの確立
- (ii) 相続をコアとした富裕層向けビジネスの強化
- (iii) ミドル・マーケットへのカバレッジ強化
- (iv) 収益力・生産性向上によるトップラインのレベルアップ

② ホールセール部門

- (i) 日本を含むアジアをコアとするグローバル・ネットワークを活かした投資銀行業務における案件獲得
- (ii) 強固な顧客基盤とマーケット環境を結び付けるタイムリーな商品提供
- (iii) 資本効率を重視し、適切なリスク管理体制に基づく、顧客フローに焦点を定めたビジネス展開

③ アセット・マネジメント部門

- (i) 運用手法・調査分析の高度化
- (ii) 商品組成力の向上及び訴求力のある新商品の開発
- (iii) 販売会社サポートの強化と顧客ニーズに適う情報発信
- (iv) 効率的な組織体制の構築及びリスク管理体制の強化

④ 投資部門

- (i) 既存案件における投資回収の極大化
- (ii) マーケットに即した適切かつタイムリーな新規投資の実行・新規投資ファンドの組成

⑤ IT・シンクタンク部門

- (i) 金融・環境調査等、更なるバリューアップを図り、グループプレゼンスを向上
- (ii) 国内・アジアにおけるコンサルティングサービスを拡充し、新たな収益機会を創出
- (iii) グループシステムの内製化・インターナルクラウド化により、システムコスト削減に貢献

(4) 研究開発活動

該当事項はありません。

(5) 従業員数

提出会社の状況

当第3四半期連結累計期間において、提出会社の従業員数は733人減少し、8人となっております。これは主に、グループ内組織再編に伴い、第1四半期連結会計期間において提出会社に所属していた従業員を大和証券株式会社の所属とし、提出会社の職務を兼務することとなったためであります。なお、大和証券株式会社との兼務者は622人であります。

従業員数は就業人員数であります。また、持ち株会社である提出会社は、当社グループのセグメント情報において「その他」に属しております。

(6) 経営成績に重要な影響を与える要因についての分析

当第3四半期連結累計期間のマクロ経済環境

＜海外の状況＞

世界経済は、欧州経済の悪化等から減速が続きましたが、幾分回復の兆しがみられています。欧州経済は、財政問題を背景とした緊縮財政に伴う内需の停滞により実体経済の悪化が続きましたが、ユーロ圏の景況感の悪化には歯止めがかかりつつあります。新興国経済は、輸出の鈍化による景気減速傾向が続いていましたが、世界的な金融緩和の効果により、徐々に持ち直しつつあります。各国中央銀行が緩和姿勢を強めたことから、平成24年4－6月期に高まっていた欧州の財政不安が、同年7－9月期以降は幾分緩和し、年末にかけては世界的に株価が上昇傾向となりました。また、投資家のリスク回避姿勢にも一定の緩和がみられ、相対的に安全な金融資産として資金の逃避先となっていた米国、ドイツ、英国などの国債市場から資金が流出し、これらの国々の国債利回りの低下に歯止めがかかりました。

欧州では、平成24年4－6月期、財政問題、金融システム不安、失業率の上昇など厳しい経済状況が続いていました。財政問題の発端となったギリシャでは、平成24年5月に実施された総選挙において、財政緊縮策に反対していた野党の急進左派連合（SYRIZA）が議席数を大幅に増加させた結果、ギリシャがユーロ圏から離脱するという危機感が強まり、欧州を中心に国際金融市場は大きく動揺しました。その後、平成24年6月に実施されたギリシャの再選挙で、財政緊縮策を支持する新民主主義党（ND）が第1党を確保して、連立政権の樹立にも成功したため、ギリシャのユーロ圏離脱懸念は和らぎました。同じ時期にスペインでは、大手銀行バンキアが不良債権問題の悪化によって経営に行き詰まり、政府に対し公的資金による支援を申請しましたが、スペイン政府は独力では国内の銀行問題を解決することができないと判断し、平成24年6月下旬にユーロ圏諸国に対して銀行救済のための国際支援を要請しました。こうした金融システム不安に対応するため、欧州中央銀行（ECB）は平成24年7月には利下げを行い、同年9月には新たなユーロ圏国債買入れ策（OMT）を決定しました。また、10月には欧州安定メカニズム（ESM）が発足したこともあり、欧州財政問題に対する懸念は和らぎました。こうした政策対応を背景に、悪化が続いてきたユーロ圏の企業の景況感は、平成24年10－12月期には、改善に向かいつつあります。

米国経済は、底堅い個人消費、民間設備投資の増加、米国連邦準備制度理事会（FRB）による金融緩和政策の効果によって、緩やかな回復を続けています。また、住宅価格は低水準ながら改善傾向にあり、家計のバランスシート調整が進展しました。しかしその一方で、雇用者数の増加ペースが鈍化し、雇用環境の改善は緩やかなものとなっています。FRBは、平成24年6月の連邦公開市場委員会（FOMC）において、オペレーション・ツイスト（短期国債の売却や償還で得た資金によって長期国債を買い入れ、追加的に資金を抛出することなく、長期金利低下による景気回復の効果を期する金融政策手法）と呼ばれる金融緩和策の終了時期を、平成24年6月末から同年12月末まで延長することを決めました。同時に、政策金利を平成26年後半まで据え置く方針を維持しました。さらに平成24年9月には、政策金利を平成27年半ばまで据え置くと決定したことに加え、住宅ローン担保証券（MBS）を毎月400億ドルペースで買い入れる、量的緩和第3弾（QE3）の発動を決定しました。平成24年12月には、オペレーション・ツイストは予定通り終了しましたが、代わりに毎月総額450億ドルの長期国債を買い入れることが決定され、FRBは景気回復を支えるために、非常に緩和的な金融政策スタンスを継続しています。

新興国は、全体的に先進国よりも高い成長率を維持していますが、欧州向け輸出の減速を背景に、経済の成長ペースが鈍化しました。そのため、国内の景気を下支えするため、新興国でも金融緩和策を強化する国が増えました。主要新興国の状況をみると、ブラジルは、平成23年8月の金融政策委員会で利下げを開始し、平成24年10月まで10回にわたる利下げを実施しました。中国は、平成23年12月に預金準備率の引き下げに転じ、平成24年6月、7月には2ヶ月連続での利下げを実施しました。インドは、平成24年1月に現金準備率を引き下げ、同年4月に3年ぶりとなる利下げを行いました。一方、ロシアではインフレ率抑制のため平成24年9月に利上げを行いました。新興国の多くはインフレ率上昇のリスクを抱える中、厳しい政策運営を強いられていますが、積極的な金融緩和が功を奏し、中国等のアジア諸国を中心に持ち直しの兆しがみられています。

<日本の状況>

日本経済は減速が続いています。個人消費の回復と東日本大震災に伴う復興需要が支えとなり、内需は底堅く推移していますが、海外経済の減速による輸出の伸び悩みから、生産活動は減速が続きました。景気動向は、平成24年12月調査の日銀短観では、同年9月に比べて悪化が伝えられましたが、その後年末にかけて、海外経済に改善の兆しが見え始めたことなどから、悪化に歯止めがかかりつつあると見られています。

生産活動は、東日本大震災に伴う復興需要の顕在化、エコカー補助金の効果、タイの大洪水からの復旧需要によって、平成24年4月まで緩やかな回復を続けましたが、平成24年5月以降は、海外経済の減速感が高まったことや、エコカー補助金が終了した影響等から、減少傾向となりました。しかし、平成24年10－12月期には、エコカー補助金終了の影響が一服したこともあり、生産全体としても悪化に歯止めがかかりつつあります。輸出は、海外経済の減速によって、減少傾向が続きました。景気の回復が続く米国向けが堅調に推移する一方で、景気悪化が続く欧州向けや、アジア向けの輸出が減少しました。また、輸入は、資源価格の調整と、国内の企業活動の低迷によって平成24年4月以降、増勢が鈍化しました。ただし、輸入は高い水準での推移が続いており、輸出の減少と高水準の輸入によって、貿易収支は赤字基調が継続しています。個人消費は、消費者マインドや雇用・所得環境の改善、エコカー補助金による平成24年8月までの自動車販売の増加などを追い風にして、回復傾向を示しました。エコカー補助金終了によって、個人消費の減速が懸念されていましたが、平成24年10－12月期も冬物衣料等の季節商材を中心に堅調に推移しています。復興関連の需要は、平成24年に入ってから徐々に顕在化し始め、平成24年10－12月期も増加基調を維持しています。

金融面では、日本銀行が平成24年4月に「資産買入等の基金」を5兆円増額させた後、9月と12月にも10兆円ずつ基金を増額するなど、金融緩和と政策を強化しました。日本の金融システムは安定を維持しており、企業の資金繰りも改善傾向にあります。その背景として、日本の銀行の不良債権比率が低位に留まっていること、欧州の銀行と比べて保有有価証券によるバランスシートの毀損が少ないこと、日本銀行の非常に緩和的な金融政策スタンスが効果を生んでいることなどが指摘されています。株価は、平成24年7－9月期までは、世界的な景気減速による下押し圧力と、金融緩和による上昇圧力から一進一退での推移が続いていましたが、平成24年12月に発足した新政権に対する期待の高まりと、急速な円安進行を受け、平成24年10－12月期には年末に向けて大幅に上昇しました。為替市場では、平成24年7－9月期までは、海外投資家が相対的に安全な通貨と評価された円を買う動きが広がり、円高傾向で推移しましたが、新政権と日本銀行による追加金融緩和への期待から、年末に向けて急速に円安が進行しました。日本国債は相対的に安全な金融資産と評価され、投資資金の流入が続いたため、国債利回りは全体としては低下傾向を示しましたが、年末に向けて「財政の崖」懸念による米国での金利上昇を受けて、わずかに上昇しました。平成24年12月末の日経平均株価は10,395円18銭（同年9月末比1,525円2銭高）、10年国債利回りは0.795%（同0.03ポイントの上昇）、為替は1ドル86円32銭（同8円74銭の円安）となりました。

(7) 資本の財源及び資金の流動性に係る情報

① 流動性の管理

<財務の効率性と安定性の両立>

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、事業の継続に支障を来すことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めております。特に近年においては、世界的金融危機及び信用危機による不測の事態に備え、市場からの資金調達、金融機関からの借入等により、手元流動性の更なる積み増しを行っております。同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

また、当社は、バーゼル委員会が提示した流動性カバレッジ比率に準拠した手法で、流動性管理体制を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、複数のストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを毎日確認しております。これにより、当社グループでは、今後1年間無担保資金調達が行えない場合でも、業務の継続が可能となるよう体制を構築しております。

なお、当第3四半期連結会計期間末における当社グループの短期無担保調達資金及び流動性ポートフォリオの状況は次のとおりです。

(単位：億円)			
短期無担保調達資金合計	銀行等からの短期借入金		2,713
	その他の短期借入金		3,767
	コマーシャル・ペーパー		1,645
	1年内償還予定の社債		2,479
	短期無担保調達資金合計		10,606
流動性ポートフォリオ等合計		現金・預金	13,279
		国債・政府保証債等	937
	流動性ポートフォリオ		14,217
		その他の債券	5,435
		上場株式等	2,418
		その他	380
	補完的流動性ポートフォリオ		8,234
	流動性ポートフォリオ等合計		22,451

(注) 上記には銀行業にかかる資産及び負債は含めておりません。

当第3四半期連結会計期間末における当社グループの流動性ポートフォリオの合計額は1兆4,217億円であります。また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は2兆2,451億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の211.7%に相当します。

<グループ全体の資金管理>

当社グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、当社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。当社は、当社固有のストレス又は市場全体のストレスの発生により新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、短期の無担保調達資金について、当社グループの流動性ポートフォリオが十分に確保されているかをモニタリングしております。また、当社は、必要に応じて当社からグループ各社に対し、機動的な資金の配分・供給を行うと共に、グループ内で資金融通を可能とする体制を整えることで、効率性に基づく一体的な資金調達及び資金管理を行っております。

<資金流動性コンティンジェンシー・プラン>

当社グループは、流動性リスクへの対応の一環として、資金流動性コンティンジェンシー・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社グループは機動的な対応により流動性を確保する体制を整備しております。

当社グループの当該コンティンジェンシー・プランは、グループ全体のストレスを踏まえて策定しており、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

また、金融市場の変動の影響が大きくその資金流動性確保の重要性の高い大和証券、大和ネクスト銀行及び海外証券子会社においては、さらに個別のコンティンジェンシー・プランも制定し、同様に定期的な見直しを行っております。

なお、当社は、子会社のコンティンジェンシー・プランの整備状況について定期的にモニタリングしており、必要に応じて想定すべき危機シナリオを考慮して資金調達プランやコンティンジェンシー・プランそのものの見直しを行い、さらには流動性の積み増しを実行すると同時に資産圧縮を図るといった事前の対策を講じることとしております。

② 株主資本

当社グループが株式や債券、デリバティブ等のトレーディング取引、貸借取引、引受業務、ストラクチャード・ファイナンス、M&A、プリンシパル・インベストメント、証券担保ローン等の有価証券関連業を中心とした幅広い金融サービスを展開するためには、十分な資本を確保する必要があります。また、当社グループは、日本のみならず、海外においても有価証券関連業務を行っており、それぞれの地域において法規制上必要な資本を維持しなければなりません。

当第3四半期連結会計期間末の株主資本は、前年度末比170億円増加し、8,183億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,780億円となっております。利益剰余金は、配当金支払いにより102億円減少したほか、四半期純利益を241億円計上し、前年度末比138億円増の3,598億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ31億円減少し、195億円となっております。

第3 【提出会社の状況】

1 【株式等の状況】

(1) 【株式の総数等】

① 【株式の総数】

種類	発行可能株式総数(株)
普通株式	4,000,000,000
計	4,000,000,000

② 【発行済株式】

種類	第3四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成24年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成25年2月13日)	上場金融商品取引所 名又は登録認可金融 商品取引業協会名	内容
普通株式	1,749,378,772	1,749,378,772	東京証券取引所 大阪証券取引所 名古屋証券取引所 各市場第一部	単元株式数は1,000株で あります。
計	1,749,378,772	1,749,378,772	—	—

(2) 【新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

(3) 【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

(4) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

(5) 【発行済株式総数、資本金等の推移】

年月日	発行済株式 総数増減数 (千株)	発行済株式 総数残高 (千株)	資本金増減額 (百万円)	資本金残高 (百万円)	資本準備金 増減額 (百万円)	資本準備金 残高 (百万円)
平成24年10月1日～ 平成24年12月31日	—	1,749,378	—	247,397	—	226,751

(6) 【大株主の状況】

当四半期会計期間は第3四半期会計期間であるため、記載事項はありません。

(7) 【議決権の状況】

当第3四半期会計期間末日現在の「議決権の状況」については、株主名簿の記載内容が確認できないため、記載することができないことから、直前の基準日（平成24年9月30日）に基づく株主名簿による記載をしております。

① 【発行済株式】

平成24年12月31日現在

区分	株式数(株)	議決権の数(個)	内容
無議決権株式	—	—	—
議決権制限株式(自己株式等)	—	—	—
議決権制限株式(その他)	—	—	—
完全議決権株式(自己株式等)	(自己保有株式) 普通株式 35,734,000	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,710,681,000	1,709,422	—
単元未満株式	普通株式 2,963,772	—	—
発行済株式総数	1,749,378,772	—	—
総株主の議決権	—	1,709,422	—

- (注) 1 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、株式会社証券保管振替機構名義の株式3,000株(議決権3個)が含まれております。
- 2 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、当社の子会社が有価証券関連業務等として自己の名義で保有している株式1,259,000株(議決権1,259個)が含まれております。
- なお、当該株式は議決権の数から除いております。
- 3 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式18,237,000株(議決権18,237個)が含まれております。
- 4 「単元未満株式」欄の株式数には、当社所有の自己株式788株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成24年12月31日現在

所有者の氏名 又は名称	所有者の住所	自己名義 所有株式数 (株)	他人名義 所有株式数 (株)	所有株式数 の合計 (株)	発行済株式 総数に対する 所有株式数 の割合(%)
(自己保有株式) 株式会社大和証券 グループ本社	東京都千代田区丸の内 一丁目9番1号	35,734,000	—	35,734,000	2.04
計	—	35,734,000	—	35,734,000	2.04

- (注) 上記のほか、当社の子会社が有価証券関連業務等として自己の名義で保有している株式が1,259,000株(議決権1,259個)あります。
- なお、当該株式数は上記「①発行済株式」の「完全議決権株式(その他)」欄の株式数に含めております。

2 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当第3四半期累計期間における役員の異動は、次のとおりであります。

(1) 取締役の状況

該当事項はありません。

(2) 執行役の状況

該当事項はありません。

第4 【経理の状況】

1 四半期連結財務諸表の作成方法について

当社の四半期連結財務諸表は、「四半期連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（平成19年内閣府令第64号）並びに同規則第61条及び第82条の規定に基づき、当企業集団の主たる事業である有価証券関連業を営む会社の財務諸表に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」（昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則）に準拠して作成しております。

2 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3四半期連結会計期間（平成24年10月1日から平成24年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成24年4月1日から平成24年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による四半期レビューを受けております。

1 【四半期連結財務諸表】
(1) 【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成24年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,050,468	994,070
預託金	204,477	209,659
受取手形及び売掛金	13,135	10,969
有価証券	1,474,395	2,378,887
トレーディング商品	8,876,950	8,229,497
商品有価証券等	6,148,294	5,504,639
デリバティブ取引	2,728,655	2,724,857
約定見返勘定	139,096	—
営業投資有価証券	174,304	169,915
投資損失引当金	△36,127	△37,230
営業貸付金	108,932	136,631
仕掛品	612	869
信用取引資産	120,870	115,209
信用取引貸付金	106,975	100,464
信用取引借証券担保金	13,894	14,745
有価証券担保貸付金	5,735,192	4,271,293
借入有価証券担保金	5,729,144	4,267,149
現先取引貸付金	6,047	4,144
立替金	15,014	13,769
短期貸付金	858	1,150
未収収益	26,912	28,856
繰延税金資産	6,186	8,004
その他の流動資産	307,738	252,987
貸倒引当金	△1,858	△1,252
流動資産計	18,217,159	16,783,289
固定資産		
有形固定資産	394,415	395,958
無形固定資産	102,887	91,133
のれん	20,992	20,035
その他	81,895	71,097
投資その他の資産	209,574	204,919
投資有価証券	159,096	166,997
長期貸付金	9,732	5,111
長期差入保証金	23,292	21,023
繰延税金資産	8,242	3,738
その他	※1 10,090	※1 9,138
貸倒引当金	※1 △879	※1 △1,090
固定資産計	706,878	692,010
資産合計	18,924,038	17,475,300

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成24年12月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	4,412	2,781
トレーディング商品	5,953,279	4,757,018
商品有価証券等	3,570,153	2,374,511
デリバティブ取引	2,383,126	2,382,506
約定見返勘定	—	172,069
信用取引負債	52,756	52,829
信用取引借入金	3,109	1,679
信用取引貸証券受入金	49,646	51,149
有価証券担保借入金	6,068,380	5,892,068
有価証券貸借取引受入金	5,257,835	5,456,937
現先取引借入金	810,545	435,131
銀行業における預金	1,169,916	1,659,611
預り金	125,731	154,442
受入保証金	226,143	223,741
短期借入金	1,794,254	1,149,192
コマーシャル・ペーパー	275,191	164,540
1年内償還予定の社債	215,309	247,959
未払法人税等	5,822	1,008
繰延税金負債	970	5,721
賞与引当金	20,461	15,887
その他の流動負債	91,015	69,959
流動負債計	16,003,646	14,568,831
固定負債		
社債	1,282,479	1,251,641
長期借入金	623,297	592,451
繰延税金負債	2,591	5,098
退職給付引当金	29,983	31,228
訴訟損失引当金	298	130
負ののれん	12,555	9,131
その他の固定負債	14,916	14,764
固定負債計	1,966,123	1,904,446
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	2,566	2,566
特別法上の準備金計	2,566	2,566
負債合計	17,972,336	16,475,845

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成24年12月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,655	230,656
利益剰余金	345,983	359,874
自己株式	△22,681	△19,548
株主資本合計	801,353	818,379
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	23,338	45,074
繰延ヘッジ損益	△1,676	△6,949
為替換算調整勘定	△40,517	△28,201
その他の包括利益累計額合計	△18,855	9,922
新株予約権	5,429	5,778
少数株主持分	163,774	165,374
純資産合計	951,702	999,454
負債・純資産合計	18,924,038	17,475,300

(2) 【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】
【四半期連結損益計算書】
【第3四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
営業収益		
受入手数料	163,767	153,899
委託手数料	28,967	28,295
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	16,710	18,152
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	36,782	30,258
その他の受入手数料	81,307	77,193
トレーディング損益	49,712	77,645
株券等トレーディング損益	△19,040	15,465
債券・為替等トレーディング損益	68,753	62,180
営業投資有価証券関連損益	4,614	8,900
金融収益	60,852	67,493
その他の営業収益	30,078	44,635
営業収益計	309,025	352,574
金融費用	44,484	52,166
その他の営業費用	19,492	28,713
純営業収益	245,048	271,694
販売費・一般管理費		
取引関係費	52,441	49,456
人件費	※1 122,078	※1 112,460
不動産関係費	33,851	28,979
事務費	20,307	17,401
減価償却費	30,268	23,455
租税公課	5,038	4,142
貸倒引当金繰入れ	8	—
その他	10,107	9,207
販売費・一般管理費計	274,103	245,102
営業利益又は営業損失 (△)	△29,054	26,592
営業外収益		
受取利息	111	89
受取配当金	1,589	2,217
負ののれん償却額	3,424	3,424
持分法による投資利益	1,023	1,370
その他	2,850	4,114
営業外収益計	8,998	11,216
営業外費用		
支払利息	52	1,262
為替差損	1,209	649
その他	565	796
営業外費用計	1,828	2,707
経常利益又は経常損失 (△)	△21,883	35,100

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
特別利益		
投資有価証券売却益	1,330	1,752
負ののれん発生益	—	1,351
特別利益計	1,330	3,104
特別損失		
固定資産除売却損	6,975	121
投資有価証券売却損	265	—
減損損失	757	—
投資有価証券評価損	2,514	612
事業再編関連費用	3,245	3,498
その他	658	—
特別損失計	14,416	4,232
税金等調整前四半期純利益又は税金等調整前四半期純損失 (△)	△34,969	33,972
法人税、住民税及び事業税	4,969	3,257
法人税等調整額	10,767	2,692
法人税等合計	15,736	5,949
少数株主損益調整前四半期純利益又は少数株主損益調整前四半期純損失 (△)	△50,705	28,022
少数株主利益又は少数株主損失 (△)	△350	3,886
四半期純利益又は四半期純損失 (△)	△50,355	24,136

【四半期連結包括利益計算書】
【第3四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
少数株主損益調整前四半期純利益又は少数株主損益 調整前四半期純損失 (△)	△50,705	28,022
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△34,960	23,566
繰延ヘッジ損益	△1,691	△5,255
為替換算調整勘定	△22,192	12,430
持分法適用会社に対する持分相当額	△33	△47
その他の包括利益合計	△58,877	30,693
四半期包括利益	△109,582	58,716
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	△97,369	52,914
少数株主に係る四半期包括利益	△12,213	5,802

【連結の範囲又は持分法適用の範囲の変更】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
(連結の範囲の重要な変更) 第1四半期連結会計期間より、合併に伴い1社を連結の範囲から除外しております。

【会計方針の変更等】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社及び一部の国内連結子会社は、法人税法の改正に伴い、第1四半期連結会計期間より平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による損益への影響は軽微であります。

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

※1 資産の金額から直接控除している貸倒引当金の額

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成24年12月31日)
投資その他の資産・その他	8,702百万円	8,699百万円

2 保証債務

被保証者（被保証債務の内容）は以下のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成24年12月31日)
従業員(借入金)	1,256百万円	991百万円
その他(債務)	1,372	1,486
計	2,629	2,477

(四半期連結損益計算書関係)

※1 人件費に含まれている賞与引当金繰入額

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
	14,676百万円	14,283百万円

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

当第3四半期連結累計期間に係る四半期連結キャッシュ・フロー計算書は作成しておりません。なお、第3四半期連結累計期間に係る減価償却費(のれんを除く無形固定資産に係る償却費を含む。)、のれん及び負ののれんの償却額は、次のとおりであります。

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
減価償却費	31,781百万円	28,823百万円
のれんの償却額	2,074	1,932
負ののれんの償却額	△3,424	△3,424

(株主資本等関係)

前第3四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年5月17日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,140	3	平成23年3月31日	平成23年6月6日
平成23年10月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,140	3	平成23年9月30日	平成23年12月1日

(注) 1 平成23年5月17日取締役会決議の配当金の総額には、日本マスタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する104百万円が含まれております。

2 平成23年10月28日取締役会決議の配当金の総額には、日本マスタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する88百万円が含まれております。

2 基準日が当第3四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第3四半期連結会計期間の末日後となるもの
該当事項はありません。

当第3四半期連結累計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年5月15日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,140	3	平成24年3月31日	平成24年6月4日
平成24年11月2日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,140	3	平成24年9月30日	平成24年12月3日

(注) 1 平成24年5月15日取締役会決議の配当金の総額には、日本マスタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する71百万円が含まれております。

2 平成24年11月2日取締役会決議の配当金の総額には、日本マスタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する54百万円が含まれております。

2 基準日が当第3四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第3四半期連結会計期間の末日後となるもの
該当事項はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

I 前第3四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)

1 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	報告セグメント						その他 (注) 1	合計
	リテール部門	グローバル・マーケティング部門	グローバル・インベストメント・バンキング部門	アセット・マネジメント部門	投資部門	計		
純営業収益								
外部顧客への純営業収益	100,820	31,850	21,906	43,824	5,974	204,375	3,259	207,635
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	25,298	239	△2,203	△15,525	△1,934	5,874	21,025	26,900
計	126,119	32,090	19,702	28,298	4,039	210,250	24,284	234,535
セグメント利益又はセグメント損失(△) (経常利益又は経常損失(△))	26,096	△51,138	△12,987	11,414	1,360	△25,254	△1,100	△26,354

(注) 1 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントであり、子会社の統合・管理、情報サービス、事務代行及び不動産賃貸等の事業が含まれております。

2 上記の純営業収益は、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 報告セグメントの利益又は損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額及び当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益又は損失(△)	金額
報告セグメント計	△25,254
「その他」の区分の損失(△)	△1,100
セグメント間取引消去	△370
のれん及び負ののれんの償却額	3,193
未実現損益の調整額	3,002
その他の調整額	△1,354
四半期連結損益計算書の経常損失(△)	△21,883

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

(重要な負ののれん発生益)

該当事項はありません。

Ⅱ 当第3四半期連結累計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)

1 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他 (注) 1	合計
	リテール 部門	ホールセー ル部門	アセット・ マネジメン ト部門	投資部門	計		
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	105,666	65,001	46,998	9,844	227,510	5,756	233,267
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	16,386	16,386	△14,437	△70	18,266	9,738	28,004
計	122,053	81,388	32,561	9,774	245,777	15,495	261,272
セグメント利益又はセグメント損失(△) (経常利益又は経常損失(△))	23,665	△8,112	13,987	7,253	36,794	△5,751	31,042

(注) 1 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントであり、子会社の統合・管理、銀行、情報サービス、事務代行及び不動産賃貸等の事業が含まれております。

2 上記の純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 報告セグメントの利益又は損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額及び当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益又は損失(△)	金額
報告セグメント計	36,794
「その他」の区分の損失(△)	△5,751
セグメント間取引消去	△868
のれん及び負ののれんの償却額	3,191
未実現損益の調整額	1,072
その他の調整額	663
四半期連結損益計算書の経常利益	35,100

3 報告セグメントの変更等に関する事項

第1四半期連結会計期間より、大和証券と大和証券キャピタル・マーケットの統合に伴い、当社グループの報告セグメントの区分方法を変更しております。従来、「リテール部門」「グローバル・マーケット部門」「グローバル・インベストメント・バンキング部門」「アセット・マネジメント部門」「投資部門」の5事業区分としておりましたが、「リテール部門」「ホールセール部門」「アセット・マネジメント部門」「投資部門」の4事業区分に変更しております。また、経営管理上、事業セグメントの損益の測定方法も変更しております。

なお、前第3四半期連結累計期間のセグメント情報を、当第3四半期連結累計期間の報告セグメントの区分方法により作成すること及び、当第3四半期連結累計期間のセグメント情報を、前第3四半期連結累計期間の報告セグメントの区分方法により作成することは実務上困難なため、当該情報については開示を行っておりません。

4 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

(重要な負ののれん発生益)

大和証券オフィス投資法人が発行する投資口を追加取得したことに伴い、負ののれん発生益を1,351百万円計上しております。なお、当社グループは負ののれん発生益を報告セグメントごとに配分しておりません。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成24年3月31日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	211,088	211,534	445
社債	96,228	97,031	802
その他	256,371	255,508	△862
計	563,688	564,074	385

2 その他有価証券

(単位：百万円)

種類	取得原価	連結貸借 対照表計上額	差額
株券	88,566	118,212	29,646
債券	874,696	880,227	5,531
国債・地方債等	649,355	654,560	5,204
社債	182,701	183,333	632
その他	42,639	42,334	△305
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	33,026	35,323	2,297
その他	78,633	79,745	1,111
計	1,074,922	1,113,509	38,586

(注) その他有価証券で時価のあるものにつき、当連結会計年度において4,323百万円(うち、株券2,196百万円、その他2,127百万円)の減損処理を行っております。

当第3四半期連結会計期間末(平成24年12月31日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	第3四半期連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	—	—	—
社債	—	—	—
その他	2,007	2,007	0
計	2,007	2,007	0

2 その他有価証券

(単位：百万円)

種類	取得原価	第3四半期連結貸借 対照表計上額	差額
株券	85,442	124,853	39,411
債券	2,296,457	2,323,574	27,117
国債・地方債等	1,632,707	1,658,515	25,807
社債	254,281	254,504	222
その他	409,467	410,554	1,087
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	30,463	31,304	840
その他	103,419	107,077	3,658
計	2,515,782	2,586,809	71,026

(注) 1 その他有価証券で時価のあるものにつき、当第3四半期連結累計期間において599百万円(うち、株券599百万円)の減損処理を行っております。

2 満期保有目的の債券の一部について信用状態の著しい悪化により、当第3四半期連結累計期間において1,079百万円の償却を行い、償却後の価額(2,420百万円)によって「満期保有目的の債券」から「その他有価証券」に保有目的を変更しております。

また、運用方針の変更により「満期保有目的の債券」611,097百万円の保有目的を変更し「その他有価証券」に区分しております。

(デリバティブ取引関係)

前連結会計年度末(平成24年3月31日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	5,154,560	424,841	6,236,620	422,228
為替予約取引	1,961,398	75,819	2,272,091	102,231
先物・先渡取引	605,479	8,480	413,854	4,331
スワップ取引	59,398,711	2,189,167	59,792,437	1,817,732
その他	1,613,465	41,996	1,720,652	36,601
リスクリザーブ	—	△11,649	—	—

当第3四半期連結会計期間末(平成24年12月31日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	4,118,156	399,540	5,064,130	370,284
為替予約取引	1,264,996	55,976	1,377,263	74,453
先物・先渡取引	1,155,523	9,894	1,346,293	18,915
スワップ取引	48,182,879	2,227,004	48,104,585	1,879,919
その他	2,280,680	42,716	2,237,165	38,934
リスクリザーブ	—	△10,273	—	—

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純利益金額又は四半期純損失金額(△)及び算定上の基礎並びに潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年12月31日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額又は四半期純損失金額(△)	△29.91円	14.24円
(算定上の基礎)		
四半期純利益金額又は四半期純損失金額(△)(百万円)	△50,355	24,136
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—	—
普通株式に係る四半期純利益金額又は四半期純損失金額(△)(百万円)	△50,355	24,136
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,683,333	1,694,448
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	—	14.21円
(算定上の基礎)		
四半期純利益調整額(百万円)	—	—
普通株式増加数(株)	—	4,110
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定に含めなかった潜在株式で、前連結会計年度末から重要な変動があったものの概要	潜在株式の種類 新株予約権方式によるストック・オプション 潜在株式の数 2011年7月発行新株予約権 1,211千株 第8回新株予約権 5,855千株	—

- (注) 1 前第3四半期連結累計期間の潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については、潜在株式は存在するものの、1株当たり四半期純損失を計上しているため記載しておりません。
- 2 普通株式の期中平均株式数については、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式を四半期連結貸借対照表において自己株式として表示していることから、当該株式の数を控除しております。

(重要な後発事象)

新株予約権の無償発行について

- (1) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成24年6月27日開催の株主総会及び平成25年2月1日開催の執行役会において決議されたものであります。

	2013年2月発行新株予約権
新株予約権の数(個)	831
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式
新株予約権の目的となる株式の数(株)	831,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1
新株予約権の行使期間	平成25年2月12日から平成44年6月30日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社関係会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成44年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
付与日	平成25年2月12日

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額568円を加算した資本組入額は285円となります。

- (2) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成24年6月27日開催の株主総会及び平成25年2月1日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第9回新株予約権
新株予約権の数(個)	6,333
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式
新株予約権の目的となる株式の数(株)	6,333,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり598
新株予約権の行使期間	平成29年7月1日から平成34年6月26日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 598 資本組入額 299
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権付与契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
付与日	平成25年2月12日

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格598円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額193円を加算した資本組入額は396円となります。

2 【その他】

(剰余金の配当)

平成24年11月2日開催の取締役会において、平成24年9月30日を基準日とする剰余金の配当に関して次のとおり決議いたしました。

①配当金の総額 5,140百万円

②1株当たりの金額 3円00銭

③支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成24年12月3日

(注) 1 配当金の総額には、日本マスタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する54百万円が含まれております。

2 平成24年9月30日現在の株主名簿に記録された株主又は登録質権者に対し支払いを行っております。

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

平成25年 2 月13日

株式会社大和証券グループ本社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員 公認会計士 森 公 高 印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員 公認会計士 貞 廣 篤 典 印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員 公認会計士 内 田 和 男 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、「経理の状況」に掲げられている株式会社大和証券グループ本社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの連結会計年度の第3四半期連結会計期間(平成24年10月1日から平成24年12月31日まで)及び第3四半期連結累計期間(平成24年4月1日から平成24年12月31日まで)に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書及び注記について四半期レビューを行った。

四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して四半期連結財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない四半期連結財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した四半期レビューに基づいて、独立の立場から四半期連結財務諸表に対する結論を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に準拠して四半期レビューを行った。

四半期レビューにおいては、主として経営者、財務及び会計に関する事項に責任を有する者等に対して実施される質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続が実施される。四半期レビュー手続は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して実施される年度の財務諸表の監査に比べて限定された手続である。

当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

監査人の結論

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社の平成24年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する第3四半期連結累計期間の経営成績を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は、四半期レビュー報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(四半期報告書提出会社)が別途保管しております。
2. 四半期連結財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

