

# 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4月1日  |
| (第76期Ⅰ) | 至 | 平成24年6月30日 |

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第76期第1四半期（自平成24年4月1日 至平成24年6月30日）

# 四 半 期 報 告 書

- 1 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。
- 2 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1四半期 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】 .....                 | 3  |
| 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】 ..... | 3  |
| 第3 【提出会社の状況】 .....                   | 10 |
| 1 【株式等の状況】 .....                     | 10 |
| 2 【役員の状況】 .....                      | 12 |
| 第4 【経理の状況】 .....                     | 13 |
| 1 【四半期連結財務諸表】 .....                  | 14 |
| 2 【その他】 .....                        | 28 |
| 第二部 【提出会社の保証会社等の情報】 .....            | 29 |

## 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24年8月13日                                                                                                 |
| 【四半期会計期間】  | 第76期第1四半期<br>(自 平成24年4月1日 至 平成24年6月30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<br>(東京都中央区日本橋兜町2番1号)<br>株式会社大阪証券取引所<br>(大阪市中央区北浜一丁目8番16号)<br>株式会社名古屋証券取引所<br>(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<br>第 1 四半期<br>連結累計期間         | 第76期<br>第 1 四半期<br>連結累計期間         | 第75期                              |
|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 会計期間                                | 自 平成23年 4 月 1 日<br>至 平成23年 6 月30日 | 自 平成24年 4 月 1 日<br>至 平成24年 6 月30日 | 自 平成23年 4 月 1 日<br>至 平成24年 3 月31日 |
| 営業収益 (百万円)                          | 113,625                           | 113,897                           | 422,374                           |
| 純営業収益 (百万円)                         | 91,083                            | 87,003                            | 336,016                           |
| 経常利益又は経常損失 (△) (百万円)                | △803                              | 8,534                             | △12,200                           |
| 四半期純利益又は四半期(当期)純損失 (△) (百万円)        | △9,434                            | 2,678                             | △39,434                           |
| 四半期包括利益又は包括利益 (百万円)                 | △37,843                           | △26,499                           | △52,579                           |
| 純資産額 (百万円)                          | 880,022                           | 921,695                           | 951,702                           |
| 総資産額 (百万円)                          | 16,282,850                        | 17,827,368                        | 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) | △5.61                             | 1.58                              | △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)        | —                                 | 1.58                              | —                                 |
| 自己資本比率 (%)                          | 4.9                               | 4.2                               | 4.1                               |

- (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1四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1四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・マーケット株式会社は、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・マーケット、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1四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ありません。

### 2 【経営上の重要な契約等】

当第1四半期連結累計期間において、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1四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1四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は1,138億円（前年同四半期比0.2%増）となりました。トレーディング損益が243億円（同7.0%減）、受入手数料は総額で480億円（同12.7%減）となりました。金融収支は42億円（同11.9%減）、純営業収益は870億円（同4.5%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費169億円（同3.3%減）、人件費370億円（同12.3%減）、不動産関係費101億円（同10.4%減）などにより、合計で827億円（同12.0%減）となりました。

この結果、85億円の経常利益（前年同四半期は8億円の経常損失）となりました。

特別利益に投資有価証券売却益1億円、特別損失に投資有価証券評価損4億円を計上したことなどにより、特別損益は純額で3億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1四半期連結累計期間は26億円の四半期純利益（前年同四半期は94億円の四半期純損失）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         | 39,468  | 21,759   | 11,063        | 5,333 | 77,625 | 5,286  | 82,911 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 6,762   | △8,675   | 4,826         | 4,430 | 7,344  | △1,024 | 6,319  |

（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 当第1四半期連結累計期間より、大和証券と大和証券キャピタル・マーケットズの統合に伴い、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・マーケットズ部門」「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1四半期連結累計期間のセグメント情報を、当第1四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]

厳しい市場環境を受けて投資家のリスク回避の動きが大きく影響し、エクイティ・投信関連収益が振るわなかったものの、ホールセールとの会社統合効果もあり、債券関連収益が増加し、純営業収益は394億円、経常利益は67億円となりました。

#### [ホールセール部門]

欧州財政問題の再燃により市場環境が悪化したこと、発行市場がエクイティを中心に低調になったことなどから、純営業収益は217億円、86億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110億円、経常利益は48億円となりました。

#### [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53億円、経常利益は44億円となりました。

#### [その他]

純営業収益は52億円、10億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1四半期連結会計期間末の総資産は17兆8,273億円（前連結会計年度末比1兆966億円減）となりました。内訳は流動資産が17兆1,325億円（同1兆845億円減）であり、このうちトレーディング商品が8兆5,087億円（同3,682億円減）、有価証券担保貸付金が4兆5,215億円（同1兆2,136億円減）となっております。固定資産は6,947億円（同120億円減）となっております。

#### <負債の部・純資産の部>

負債合計は16兆9,056億円（同1兆666億円減）となりました。内訳は流動負債が14兆9,588億円（同1兆447億円減）であり、このうちトレーディング商品が5兆68億円（同9,464億円減）、有価証券担保借入金が6兆2,024億円（同1,340億円増）、短期借入金が1兆4,723億円（同3,218億円減）、銀行業における預金が1兆3,016億円（同1,317億円増）となっております。固定負債は1兆9,442億円（同218億円減）であり、このうち社債が1兆2,957億円（同132億円増）、長期借入金が5,890億円（同342億円減）となっております。

純資産合計は9,216億円（同300億円減）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175億円（同57億円減）、少数株主持分は1,602億円（同35億円減）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123億円減少しております。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第1四半期連結累計期間において、事業上及び財務上の対処すべき課題について、重要な変更及び新たに生じた事項はありません。

(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1四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、当第1四半期連結累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634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1四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、欧州財政問題の再燃や新興国の成長鈍化によって、減速が続きました。欧州財政問題に起因して国際金融市場の緊張が高まったため、世界的に株価調整が起こり、財政不安を抱えている欧州諸国の国債利回りが上昇しました。新興国経済では、輸出や国内生産の伸び率の鈍化によって、景気減速傾向が明らかになりました。また、投資家のリスク回避的な動きが広がったことに加え、世界経済の減速に伴って資源需要が縮小するとの観測が高まる中で商品市場から投機資金が流出したため、資源価格は下落しました。他方、相対的に安全な金融資産と評価された米国、ドイツ、英国、日本などの国債市場には資金流入が加速して、国債利回りは低下しました。

欧州では、財政問題の再燃、金融システム不安、失業率の悪化など厳しい経済状況が続いています。欧州財政問題が再び悪化した背景には、ギリシャ総選挙後の政治的混迷、スペインの銀行問題の深刻化などがあります。ギリシャは、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、いずれの党も連立政権を樹立できないという事態に陥りました。この政治的混迷を受けて、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、同年6月に実施された再選挙で、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一旦和らぎました。スペインでは、平成24年5月下旬、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、政府に公的資金による支援を申請しました。他方、スペイン政府は国内の銀行問題の自力での解決は困難と判断し、同年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。こうしたスペインの銀行問題の深刻化は、欧州財政問題の先行き不透明感を高める要因となりました。



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回復を続けてきましたが、平成24年4－6月期には景気減速傾向が示されました。住宅市場は低迷が続いていますが、下げ止まり傾向にある住宅価格や家計のバランスシート調整の進展など、一部に改善の兆しが見られます。他方、雇用者数の増加ペースが大きく鈍化して、賃金の伸びも低下しました。さらに、これまで堅調に推移してきた米国の個人消費にも減速の兆しが見え始め、個人消費の先行きに対して慎重な見方が増えることとなりました。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、追加的に資金を拠出することなく、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、FRBは景気回復を支えるために今後も非常に緩和的な金融政策スタンスを継続し、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。

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や国内生産の伸び率低下を背景に、経済の成長ペースが鈍化しています。新興国の懸念材料であった高インフレは、資源価格の調整を受けて、多くの国で沈静化し始めました。国内の景気を下支えするため、新興国では金融緩和政策を強化する国が増えています。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てから、平成24年5月まで7回連続で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月には利下げに踏み切りました。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。ただし、新興国の金融緩和政策の効果は限定的なものに留まっているため、今後も追加的な金融緩和が必要だとの指摘もあります。また、インド、ブラジルなど新興国の中には、欧州財政問題に起因する投資家のリスク回避的な動きによって国内から投資資金が流出し、為替レートが大幅に下落する国がありました。

## ＜日本の状況＞

日本経済は緩やかに改善しています。海外経済の減速や円高の進行によって輸出は伸び悩んでいますが、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、内需主導で景気回復が続きました。東日本大震災後の原子力発電所事故を受けて、定期検査を終了した原子力発電所の再稼働を見送る動きが相次ぎ、平成24年5月上旬には、日本の全ての原子力発電所が停止しました。それにより、日本の電力供給に不足が生じて、経済活動に大きな悪影響が出るとの懸念が高まりましたが、火力発電所による代替、企業の自家発電設備の導入、一部の原子力発電所の再稼働決定などによって、その懸念は後退しています。ただし、平成23年度末時点と比較すると、海外経済の減速、円高の進行、エコカー補助金終了後に予想される自動車の販売減少と生産低下など、日本経済の先行き不透明感が幾分増しています。

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。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4－6月期も増加基調を維持していますが、平成24年5月以降、エコカー補助金とタイの大洪水からの復旧による生産押し上げ効果がほぼ一巡したため、生産活動は踊り場的な局面となっています。輸出は、海外経済の減速や円高の進行によって、おおむね横ばいで推移しています。景気の回復基調にある米国向けが堅調に推移する一方で、景気が悪化している欧州向けが低迷し、中国やアジア新興国向けも鈍化しました。輸入は、資源価格の調整によって平成24年4月以降に増勢が鈍化しました。ただし、資源価格の水準が依然として高く、代替燃料の輸入も増加しているため、輸入は引き続き高い水準で推移しています。輸出の伸び悩み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。

金融面については、日本銀行は平成24年4月に「資産買入等の基金」を5兆円増額させて、金融緩和を強化させました。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一定の効果を生んでいることなどが指摘されています。株価は、欧州財政問題の再燃によって国際金融市場が動揺したことを受けて、平成24年4－6月期に大きく下落しました。為替市場では、海外投資家がリスク回避の姿勢を強めて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、円高が進みました。さらに、欧州財政問題の先行き不透明感から、ユーロを売って円を買う動きが加速したため、平成24年5月下旬に1ユーロ100円を割り込みました。また、相対的に安全な金融資産と評価された日本国債にも投資資金が流入して、日本の国債利回りは低下傾向を強めました。平成24年6月末の日経平均株価は9,006円78銭（同年3月末比1,076円78銭安）、10年国債利回りは0.830%（同0.155ポイントの低下）、為替は1ドル79円61銭（同2円56銭の円高）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、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1四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   |           | 3,058  |
|               | その他の短期借入金     |           | 3,328  |
|               | コマーシャル・ペーパー   |           | 2,749  |
|               | 1年内償還予定の社債    |           | 1,587  |
|               |               |           | 10,724 |
| 流動性ポートフォリオ等合計 |               | 現金・預金     | 14,190 |
|               |               | 国債・政府保証債等 | 1,462  |
|               | 流動性ポートフォリオ    |           | 15,653 |
|               |               | その他の債券    | 5,585  |
|               |               | 上場株式等     | 1,143  |
|               |               | その他       | 300    |
|               | 補完的流動性ポートフォリオ |           | 7,029  |
|               |               |           | 22,682 |

(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1四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1兆5,653億円であります。また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は2兆2,682億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の211.5%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1四半期連結会計期間末の株主資本は、前年度末比9億円減少し、8,004億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,780億円となりました。利益剰余金は配当金支払いにより51億円減少したほか、四半期純利益を26億円計上した結果、前年度末比24億円減の3,435億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ15億円減少し、211億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1四半期会計期間末<br>現在発行数(株)<br>(平成24年6月30日) | 提出日現在<br>発行数(株)<br>(平成24年8月13日) | 上場金融商品取引所<br>名又は登録認可金融<br>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<br>大阪証券取引所<br>名古屋証券取引所<br>各市場第一部 | 単元株式数は1,000株で<br>あります。 |
| 計    | 1,749,378,772                          | 1,749,378,772                   | —                                        | —                      |

(注) 「提出日現在発行数」には、平成24年8月1日からこの四半期報告書提出日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれておりません。

##### (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<br>総数増減数<br>(千株) | 発行済株式<br>総数残高<br>(千株) | 資本金増減額<br>(百万円) | 資本金残高<br>(百万円) | 資本準備金<br>増減額<br>(百万円) | 資本準備金<br>残高<br>(百万円) |
|--------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------|----------------|-----------------------|----------------------|
| 平成24年4月1日～<br>平成24年6月30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1四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1四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3月31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6月30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)<br>普通株式 35,770,000 | —         | —  |
| 完全議決権株式(その他)   | 普通株式 1,710,627,000          | 1,708,513 | —  |
| 単元未満株式         | 普通株式 2,981,772              | —         | —  |
| 発行済株式総数        | 1,749,378,772               | —         | —  |
| 総株主の議決権        | —                           | 1,708,513 | —  |

- (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として自己の名義で保有している株式2,114,000株(議決権2,114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23,681,000株(議決権23,681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328株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成24年6月30日現在

| 所有者の氏名<br>又は名称                 | 所有者の住所                | 自己名義<br>所有株式数<br>(株) | 他人名義<br>所有株式数<br>(株) | 所有株式数<br>の合計<br>(株) | 発行済株式<br>総数に対する<br>所有株式数<br>の割合(%) |
|--------------------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|---------------------|------------------------------------|
| (自己保有株式)<br>株式会社大和証券<br>グループ本社 | 東京都千代田区丸の内<br>一丁目9番1号 | 35,770,000           | —                    | 35,770,000          | 2.04                               |
| 計                              | —                     | 35,770,000           | —                    | 35,770,000          | 2.04                               |

- (注) 上記のほか、当社の子会社が有価証券関連業務として自己の名義で保有している株式が2,114,000株(議決権2,114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の提出日後、当第1四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1四半期連結会計期間（平成24年4月1日から平成24年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成24年4月1日から平成24年6月30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<br>(平成24年 3 月31 日) | 当第 1 四半期連結会計期間<br>(平成24年 6 月30 日) |
|------------|----------------------------|-----------------------------------|
| 資産の部       |                            |                                   |
| 流動資産       |                            |                                   |
| 現金・預金      | 1,050,468                  | 1,205,151                         |
| 預託金        | 204,477                    | 200,865                           |
| 受取手形及び売掛金  | 13,135                     | 14,447                            |
| 有価証券       | 1,474,395                  | 1,876,952                         |
| トレーディング商品  | 8,876,950                  | 8,508,703                         |
| 商品有価証券等    | 6,148,294                  | 5,757,763                         |
| デリバティブ取引   | 2,728,655                  | 2,750,940                         |
| 約定見返勘定     | 139,096                    | 102,647                           |
| 営業投資有価証券   | 174,304                    | 150,372                           |
| 投資損失引当金    | △36,127                    | △37,317                           |
| 営業貸付金      | 108,932                    | 108,728                           |
| 仕掛品        | 612                        | 697                               |
| 信用取引資産     | 120,870                    | 147,264                           |
| 信用取引貸付金    | 106,975                    | 124,746                           |
| 信用取引借証券担保金 | 13,894                     | 22,518                            |
| 有価証券担保貸付金  | 5,735,192                  | 4,521,512                         |
| 借入有価証券担保金  | 5,729,144                  | 4,511,757                         |
| 現先取引貸付金    | 6,047                      | 9,755                             |
| 立替金        | 15,014                     | 10,124                            |
| 短期貸付金      | 858                        | 10,658                            |
| 未収収益       | 26,912                     | 22,829                            |
| 繰延税金資産     | 6,186                      | 7,942                             |
| その他の流動資産   | 307,738                    | 282,569                           |
| 貸倒引当金      | △1,858                     | △1,575                            |
| 流動資産計      | 18,217,159                 | 17,132,575                        |
| 固定資産       |                            |                                   |
| 有形固定資産     | 394,415                    | 395,591                           |
| 無形固定資産     | 102,887                    | 96,998                            |
| のれん        | 20,992                     | 19,496                            |
| その他        | 81,895                     | 77,502                            |
| 投資その他の資産   | 209,574                    | 202,202                           |
| 投資有価証券     | 159,096                    | 156,832                           |
| 長期貸付金      | 9,732                      | 9,634                             |
| 長期差入保証金    | 23,292                     | 21,972                            |
| 繰延税金資産     | 8,242                      | 4,753                             |
| その他        | ※1 10,090                  | ※1 10,133                         |
| 貸倒引当金      | ※1 △879                    | ※1 △1,123                         |
| 固定資産計      | 706,878                    | 694,792                           |
| 資産合計       | 18,924,038                 | 17,827,368                        |

(単位：百万円)

|             | 前連結会計年度<br>(平成24年 3 月31日) | 当第 1 四半期連結会計期間<br>(平成24年 6 月30日) |
|-------------|---------------------------|----------------------------------|
| 負債の部        |                           |                                  |
| 流動負債        |                           |                                  |
| 支払手形及び買掛金   | 4,412                     | 3,340                            |
| トレーディング商品   | 5,953,279                 | 5,006,822                        |
| 商品有価証券等     | 3,570,153                 | 2,615,745                        |
| デリバティブ取引    | 2,383,126                 | 2,391,077                        |
| 信用取引負債      | 52,756                    | 47,067                           |
| 信用取引借入金     | 3,109                     | 2,572                            |
| 信用取引貸証券受入金  | 49,646                    | 44,494                           |
| 有価証券担保借入金   | 6,068,380                 | 6,202,416                        |
| 有価証券貸借取引受入金 | 5,257,835                 | 5,358,327                        |
| 現先取引借入金     | 810,545                   | 844,088                          |
| 銀行業における預金   | 1,169,916                 | 1,301,670                        |
| 預り金         | 125,731                   | 149,257                          |
| 受入保証金       | 226,143                   | 229,943                          |
| 短期借入金       | 1,794,254                 | 1,472,367                        |
| コマーシャル・ペーパー | 275,191                   | 274,976                          |
| 1年内償還予定の社債  | 215,309                   | 158,771                          |
| 未払法人税等      | 5,822                     | 1,433                            |
| 繰延税金負債      | 970                       | 447                              |
| 賞与引当金       | 20,461                    | 9,457                            |
| その他の流動負債    | 91,015                    | 100,901                          |
| 流動負債計       | 16,003,646                | 14,958,872                       |
| 固定負債        |                           |                                  |
| 社債          | 1,282,479                 | 1,295,767                        |
| 長期借入金       | 623,297                   | 589,096                          |
| 繰延税金負債      | 2,591                     | 2,285                            |
| 退職給付引当金     | 29,983                    | 30,174                           |
| 訴訟損失引当金     | 298                       | 139                              |
| 負ののれん       | 12,555                    | 11,414                           |
| その他の固定負債    | 14,916                    | 15,354                           |
| 固定負債計       | 1,966,123                 | 1,944,232                        |
| 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                | 16,905,672                       |

(単位：百万円)

|               | 前連結会計年度<br>(平成24年 3 月31日) | 当第 1 四半期連結会計期間<br>(平成24年 6 月30日) |
|---------------|---------------------------|----------------------------------|
| 純資産の部         |                           |                                  |
| 株主資本          |                           |                                  |
| 資本金           | 247,397                   | 247,397                          |
| 資本剰余金         | 230,655                   | 230,658                          |
| 利益剰余金         | 345,983                   | 343,520                          |
| 自己株式          | △22,681                   | △21,139                          |
| 株主資本合計        | 801,353                   | 800,437                          |
| 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                    | 17,594                           |
| 繰延ヘッジ損益       | △1,676                    | △9,229                           |
| 為替換算調整勘定      | △40,517                   | △52,868                          |
| その他の包括利益累計額合計 | △18,855                   | △44,504                          |
| 新株予約権         | 5,429                     | 5,522                            |
| 少数株主持分        | 163,774                   | 160,240                          |
| 純資産合計         | 951,702                   | 921,695                          |
| 負債・純資産合計      | 18,924,038                | 17,827,368                       |

(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1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

|                            | 前第1四半期連結累計期間<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成23年6月30日) | 当第1四半期連結累計期間<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成24年6月30日) |
|----------------------------|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 営業収益                       |                                               |                                               |
| 受入手数料                      | 55,060                                        | 48,045                                        |
| 委託手数料                      | 10,515                                        | 8,832                                         |
| 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料  | 3,832                                         | 3,328                                         |
| 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料 | 13,394                                        | 9,612                                         |
| その他の受入手数料                  | 27,318                                        | 26,272                                        |
| トレーディング損益                  | 26,244                                        | 24,395                                        |
| 株券等トレーディング損益               | △8,479                                        | △9,351                                        |
| 債券・為替等トレーディング損益            | 34,724                                        | 33,746                                        |
| 営業投資有価証券関連損益               | 1,251                                         | 4,899                                         |
| 金融収益                       | 20,076                                        | 20,948                                        |
| その他の営業収益                   | 10,992                                        | 15,608                                        |
| 営業収益計                      | 113,625                                       | 113,897                                       |
| 金融費用                       | 15,217                                        | 16,670                                        |
| その他の営業費用                   | 7,325                                         | 10,224                                        |
| 純営業収益                      | 91,083                                        | 87,003                                        |
| 販売費・一般管理費                  |                                               |                                               |
| 取引関係費                      | 17,514                                        | 16,928                                        |
| 人件費                        | ※1 42,268                                     | ※1 37,062                                     |
| 不動産関係費                     | 11,273                                        | 10,101                                        |
| 事務費                        | 6,954                                         | 6,149                                         |
| 減価償却費                      | 10,153                                        | 7,802                                         |
| 租税公課                       | 2,136                                         | 1,426                                         |
| 貸倒引当金繰入れ                   | 33                                            | 76                                            |
| その他                        | 3,685                                         | 3,206                                         |
| 販売費・一般管理費計                 | 94,021                                        | 82,756                                        |
| 営業利益又は営業損失（△）              | △2,938                                        | 4,246                                         |
| 営業外収益                      |                                               |                                               |
| 受取利息                       | 40                                            | 12                                            |
| 受取配当金                      | 753                                           | 1,155                                         |
| 負ののれん償却額                   | 1,141                                         | 1,141                                         |
| 持分法による投資利益                 | 474                                           | 548                                           |
| その他                        | 1,247                                         | 2,636                                         |
| 営業外収益計                     | 3,656                                         | 5,494                                         |
| 営業外費用                      |                                               |                                               |
| 支払利息                       | 14                                            | 520                                           |
| 為替差損                       | 1,248                                         | 308                                           |
| その他                        | 259                                           | 377                                           |
| 営業外費用計                     | 1,522                                         | 1,206                                         |
| 経常利益又は経常損失（△）              | △803                                          | 8,534                                         |

(単位：百万円)

|                                      | 前第 1 四半期連結累計期間<br>(自 平成23年 4 月 1 日<br>至 平成23年 6 月30日) | 当第 1 四半期連結累計期間<br>(自 平成24年 4 月 1 日<br>至 平成24年 6 月30日) |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 特別利益                                 |                                                       |                                                       |
| 投資有価証券売却益                            | 427                                                   | 136                                                   |
| 特別利益計                                | 427                                                   | 136                                                   |
| 特別損失                                 |                                                       |                                                       |
| 固定資産除売却損                             | 29                                                    | 17                                                    |
| 投資有価証券売却損                            | 97                                                    | —                                                     |
| 投資有価証券評価損                            | 2,353                                                 | 428                                                   |
| 特別損失計                                | 2,480                                                 | 445                                                   |
| 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 (△)       | △2,856                                                | 8,225                                                 |
| 法人税、住民税及び事業税                         | 1,764                                                 | 930                                                   |
| 法人税等調整額                              | 4,507                                                 | 3,036                                                 |
| 法人税等合計                               | 6,271                                                 | 3,967                                                 |
| 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 (△) | △9,127                                                | 4,258                                                 |
| 少数株主利益                               | 306                                                   | 1,579                                                 |
| 四半期純利益又は四半期純損失 (△)                   | △9,434                                                | 2,678                                                 |

【四半期連結包括利益計算書】  
【第1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

|                                         | 前第1四半期連結累計期間<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成23年6月30日) | 当第1四半期連結累計期間<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成24年6月30日) |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 少数株主損益調整前四半期純利益又は少数株主損益<br>調整前四半期純損失(△) | △9,127                                        | 4,258                                         |
| その他の包括利益                                |                                               |                                               |
| その他有価証券評価差額金                            | △22,193                                       | △10,866                                       |
| 繰延ヘッジ損益                                 | 14                                            | △7,553                                        |
| 為替換算調整勘定                                | △6,626                                        | △12,415                                       |
| 持分法適用会社に対する持分相当額                        | 90                                            | 77                                            |
| その他の包括利益合計                              | △28,715                                       | △30,758                                       |
| 四半期包括利益                                 | △37,843                                       | △26,499                                       |
| (内訳)                                    |                                               |                                               |
| 親会社株主に係る四半期包括利益                         | △29,630                                       | △22,970                                       |
| 少数株主に係る四半期包括利益                          | △8,213                                        | △3,529                                        |

【連結の範囲又は持分法適用の範囲の変更】

|                                                                       |
|-----------------------------------------------------------------------|
| 当第 1 四半期連結累計期間<br>(自 平成24年 4 月 1 日<br>至 平成24年 6 月30日)                 |
| <p>連結の範囲の重要な変更</p> <p>当第 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。</p> |

【会計方針の変更等】

|                                                                                                                                                                                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 当第 1 四半期連結累計期間<br>(自 平成24年 4 月 1 日<br>至 平成24年 6 月30日)                                                                                                                                |
| <p>(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)</p> <p>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、当第 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。</p> <p>なお、この変更による損益への影響は軽微であります。</p> |

【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<br>(平成24年3月31日) | 当第1四半期連結会計期間<br>(平成24年6月30日) |
|--------------|-------------------------|------------------------------|
| 投資その他の資産・その他 | 8,702百万円                | 8,778百万円                     |

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<br>(平成24年3月31日) | 当第1四半期連結会計期間<br>(平成24年6月30日) |
|----------|-------------------------|------------------------------|
| 従業員(借入金) | 1,256百万円                | 1,159百万円                     |
| その他(債務)  | 1,372                   | 1,300                        |
| 計        | 2,629                   | 2,460                        |

(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1四半期連結累計期間<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成23年6月30日) | 当第1四半期連結累計期間<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成24年6月30日) |
|--|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------|
|  | 10,017百万円                                     | 7,096百万円                                      |

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

当第1四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1四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1四半期連結累計期間<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成23年6月30日) | 当第1四半期連結累計期間<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成24年6月30日) |
|-----------|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 減価償却費     | 10,653百万円                                     | 9,816百万円                                      |
| のれんの償却額   | 718                                           | 625                                           |
| 負ののれんの償却額 | △1,141                                        | △1,141                                        |



(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年6月30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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 平成23年5月17日<br>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 |

(注) 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 基準日が当第1四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1四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1四半期連結累計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年6月30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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 平成24年5月15日<br>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 |

(注) 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 基準日が当第1四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1四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1四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年6月30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<br>(注) 1 | 合計     |
|------------------------------------|------------|---------------------------|--------------------------------------------|---------------------------|-------|--------|--------------|--------|
|                                    | リテール<br>部門 | グローバ<br>ル・マー<br>ケッツ部<br>門 | グローバ<br>ル・イン<br>ベストメ<br>ント・バ<br>ンキング<br>部門 | アセッ<br>ト・マネ<br>ジメント<br>部門 | 投資部門  | 計      |              |        |
| 純営業収益                              |            |                           |                                            |                           |       |        |              |        |
| 外部顧客への純営業収益                        | 36,289     | 24,491                    | 6,252                                      | 15,204                    | 1,771 | 84,010 | △342         | 83,667 |
| セグメント間の内部純営業収益又は振替高                | 9,303      | △7,773                    | △700                                       | △5,556                    | △509  | △5,236 | 7,427        | 2,191  |
| 計                                  | 45,593     | 16,718                    | 5,552                                      | 9,648                     | 1,262 | 78,774 | 7,084        | 85,858 |
| 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(△)) | 12,442     | △12,835                   | △5,820                                     | 4,071                     | 402   | △1,739 | △1,168       | △2,907 |

(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           | △1,739 |
| 「その他」の区分の損失(△)     | △1,168 |
| セグメント間取引消去         | 9      |
| のれん及び負ののれんの償却額     | 1,064  |
| 未実現損益の調整額          | 1,188  |
| その他の調整額            | △158   |
| 四半期連結損益計算書の経常損失(△) | △803   |

Ⅱ 当第1四半期連結累計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年6月30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<br>(注) 1 | 合計     |
|------------------------------------|------------|--------------|-----------------------|-------|--------|--------------|--------|
|                                    | リテール<br>部門 | ホールセー<br>ル部門 | アセット・<br>マネジメン<br>ト部門 | 投資部門  | 計      |              |        |
| 純営業収益                              |            |              |                       |       |        |              |        |
| 外部顧客への純営業収益                        | 34,089     | 8,743        | 15,889                | 5,342 | 64,064 | 2,323        | 66,388 |
| セグメント間の内部純営業収益又は振替高                | 5,379      | 13,016       | △4,826                | △8    | 13,560 | 2,962        | 16,522 |
| 計                                  | 39,468     | 21,759       | 11,063                | 5,333 | 77,625 | 5,286        | 82,911 |
| 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(△)) | 6,762      | △8,675       | 4,826                 | 4,430 | 7,344  | △1,024       | 6,319  |

(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        | 7,344  |
| 「その他」の区分の損失(△)  | △1,024 |
| セグメント間取引消去      | △1     |
| のれん及び負ののれんの償却額  | 1,077  |
| 未実現損益の調整額       | 247    |
| その他の調整額         | 891    |
| 四半期連結損益計算書の経常利益 | 8,534  |

3 報告セグメントの変更等に関する事項

当第1四半期連結累計期間より、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1四半期連結累計期間のセグメント情報を、当第1四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1四半期連結累計期間のセグメント情報を、前第1四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。

(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<br>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<br>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<br>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1四半期連結会計期間末(平成24年6月30日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

| 種類      | 四半期連結貸借<br>対照表計上額 | 時価      | 差額     |
|---------|-------------------|---------|--------|
| 国債・地方債等 | 211,060           | 215,053 | 3,993  |
| 社債      | 148,310           | 150,330 | 2,019  |
| その他     | 256,079           | 253,664 | △2,414 |
| 計       | 615,450           | 619,048 | 3,597  |

2 その他有価証券

(単位：百万円)

| 種類                            | 取得原価      | 四半期連結貸借<br>対照表計上額 | 差額     |
|-------------------------------|-----------|-------------------|--------|
| 株券                            | 84,299    | 97,122            | 12,822 |
| 債券                            | 1,199,666 | 1,217,445         | 17,779 |
| 国債・地方債等                       | 983,080   | 1,000,005         | 16,924 |
| 社債                            | 146,299   | 147,237           | 937    |
| その他                           | 70,286    | 70,203            | △83    |
| 投資事業有限責任組合及び<br>それに類する組合等への出資 | 26,336    | 26,803            | 467    |
| その他                           | 93,314    | 92,570            | △743   |
| 計                             | 1,403,616 | 1,433,942         | 30,326 |

(注) その他有価証券で時価のあるものにつき、当第1四半期連結累計期間において428百万円(うち、株券428百万円)の減損処理を行っております。

(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1四半期連結会計期間末(平成24年6月30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 | 4,818,040  | 361,345   | 5,731,914  | 377,871   |
| 為替予約取引  | 1,400,928  | 27,036    | 1,559,209  | 38,311    |
| 先物・先渡取引 | 541,737    | 11,325    | 657,659    | 5,039     |
| スワップ取引  | 54,299,771 | 2,315,035 | 52,506,781 | 1,928,545 |
| その他     | 1,835,865  | 48,431    | 1,842,365  | 41,308    |
| リスクリザーブ | —          | △12,233   | —          | —         |

(企業結合等関係)

グループ内組織再編について

当社の主要子会社である大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年2月20日に合併契約を締結し、平成24年4月1日に大和証券株式会社を吸収合併存続会社、大和証券キャピタル・マーケット株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併を行い、大和証券キャピタル・マーケット株式会社は解散しました。

二社の統合に関する取引の概要は次のとおりであります。

(1) 結合当事企業の名称及びその事業の内容、企業結合日、企業結合の法的形式、結合後企業の名称、取引の目的を含む取引の概要

① 結合当事企業の名称及びその事業の内容

|           |                     |                     |
|-----------|---------------------|---------------------|
| 結合当事企業の名称 | 大和証券株式会社            | 大和証券キャピタル・マーケット株式会社 |
| 事業の内容     | 有価証券関連業<br>投資助言・代理業 | 有価証券関連業             |

② 企業結合日

平成24年4月1日

③ 企業結合の法的形式

大和証券株式会社を存続会社とし、大和証券キャピタル・マーケット株式会社を消滅会社とする吸収合併

④ 統合後企業の名称

大和証券株式会社

⑤ 取引の目的を含む取引の概要

大和証券株式会社と大和証券キャピタル・マーケット株式会社を合併の方法により統合することで、(i) 更なる組織運営の効率化、(ii) 多様化する顧客ニーズの対応力強化、を図り「強靱な経営基盤の確立」を一層磐石なものとすることを目的とします。

(2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成20年12月26日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

(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1四半期連結累計期間<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成23年6月30日) | 当第1四半期連結累計期間<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成24年6月30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(△)                                            | △5.61円                                        | 1.58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)                                                | △9,434                                        | 2,678                                         |
| 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)                                         | △9,434                                        | 2,678                                         |
| 普通株式の期中平均株式数(千株)                                                          | 1,680,490                                     | 1,691,761                                     |
| (2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額                                                  | —                                             | 1.58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(千株)                                                               | —                                             | 4,127                                         |
| 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 | —                                             | —                                             |

- (注) 1 前第1四半期連結累計期間にかかる潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については潜在株式が存在するものの、1株当たり四半期純損失であるため、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について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)

該当事項はありません。

## 2 【その他】

(剰余金の配当)

平成24年5月15日開催の取締役会において、平成24年3月31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6月4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71百万円が含まれております。
- 2 平成24年3月31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24年 8 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1四半期連結会計期間(平成24年4月1日から平成24年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成24年4月1日から平成24年6月30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6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する第1四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。

