

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23年4月1日
(第75期Ⅰ)	至	平成23年6月30日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第75期第1四半期（自平成23年4月1日 至平成23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75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】	4
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】	4
第3 【提出会社の状況】	11
1 【株式等の状況】	11
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】	27
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	28

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23年8月5日
【四半期会計期間】	第75期第1四半期 (自 平成23年4月1日 至 平成23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1丁目9番1号
【電話番号】	03(5555)1111
【事務連絡者氏名】	財務部長 阪 上 光
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区丸の内1丁目9番1号
【電話番号】	03(5555)1111
【事務連絡者氏名】	財務部長 阪 上 光
【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1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3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74期 第 1 四半期 連結累計期間	第75期 第 1 四半期 連結累計期間	第74期
会計期間	自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 6 月30日	自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 6 月30日	自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日
営業収益 (百万円)	94, 151	113, 625	403, 042
純営業収益 (百万円)	71, 613	91, 083	318, 564
経常損失 (△) (百万円)	△8, 187	△803	△32, 602
四半期(当期)純損失 (△) (百万円)	△1, 191	△9, 434	△37, 331
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	△34, 450	△37, 843	△45, 049
純資産額 (百万円)	961, 298	880, 022	921, 398
総資産額 (百万円)	16, 209, 379	16, 282, 850	16, 842, 411
1 株当たり四半期(当期)純損失 金額 (△) (円)	△0. 68	△5. 61	△21. 90
潜在株式調整後 1 株当たり 四半期(当期)純利益金額 (円)	—	—	—
自己資本比率 (%)	5. 4	4. 9	5. 0

- (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 第74期第 1 四半期連結累計期間の四半期包括利益の算定にあたり、「包括利益の表示に関する会計基準」(企業会計基準第25号 平成22年 6 月30日)を適用し、遡及処理しております。
- 4 1 株当たり四半期(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。
- 5 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。

また、重要な関係会社についても異動はありません。

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末後において、第74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、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。

(5) グループ戦略が奏功しないリスク

当社グループは、有価証券関連業務を中核に投資・金融サービスを行うグループ会社群によって構成されており、これらグループ会社が連携することで付加価値の高い投資・金融サービスを提供し、グループ全体の企業価値を最大化することを目指しております。しかしながら、①国内外の経済・金融情勢が一層悪化した場合、②競争環境の変化により、当社グループの期待する収益を得られない場合、③当社グループ内外との事業提携・合併関係、業務委託関係が変動あるいは解消した場合、及び④法制度の大幅な変更があった場合をはじめとする様々な要因により、上記のグループ戦略に変更が生じる場合や、グループ会社間の業務、その他の連携が十分に機能しない場合には、グループ戦略が功を奏しない可能性や想定していた成果をもたらさない可能性があり、その場合、当社グループの事業、財政状態及び経営戦略に悪影響を及ぼす可能性があります。

なお、グループ戦略の一貫として、当社は平成23年7月29日に開催された当社執行役会において、当社グループの証券業務の中核をなす連結子会社である大和証券株式会社（以下、「大和証券」という。）及び大和証券キャピタル・マーケットズ株式会社（以下、「大和証券キャピタル・マーケットズ」という。）が平成24年4月1日付で経営統合を行うことを内容とする基本合意書を締結することを承認し、同日、大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットズは基本合意書を締結しております。

(6) 業績の変動性に伴うリスク

当社グループのコア事業である有価証券関連業務をはじめ、その他の主要業務であるアセット・マネジメント業務、投資業務は、お客様との取引から得られる手数料、トレーディング損益、営業投資有価証券関連損益等が大幅に変動するという特性を持っております。当社グループでは業績の安定性を向上させるべく、リテール部門における預り資産の拡大やグローバル・マーケットズ部門やグローバル・インベストメント・バンキング部門の収益構造の多様化、アセット・マネジメント部門における契約資産残高の拡大、市場リスクや信用リスクをはじめとする各種リスクの管理強化、経費管理の徹底等の努力を行っておりますが、これらの施策は有価証券関連業務に伴う業績の変動性をカバーすることを保証するものではなく、とりわけ経済・金融情勢が著しく悪化した場合には、当社グループの業績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

また、上記に記載した大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットズの経営統合が行われた場合には、かかる経営統合は、当社グループの業績に一時的に悪影響を及ぼす可能性があります。

なお、当社グループの過去3連結会計年度における連結業績の推移は次のとおりです。

(百万円)

回次	第72期	第73期	第74期
決算年月	平成21年 3 月	平成22年 3 月	平成23年 3 月
営業収益	413,936	537,915	403,042
純営業収益	199,544	458,105	318,564
経常利益又は経常損失(△)	△141,150	102,917	△32,602
当期純利益又は当期純損失(△)	△85,039	43,429	△37,331

2 【経営上の重要な契約等】

当第1四半期連結会計期間末後の平成23年7月29日、当社は、当社グループの証券業務の中核をなす連結子会社である大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットが経営統合を行うことを内容とする基本合意書を締結することを承認し、同日、両社は基本合意書を締結しております。詳細は、「第4 経理の状況 1 四半期連結財務諸表」の「重要な後発事象」をご参照ください。

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1,136億円（前年同四半期比20.7%増）となりました。トレーディング損益が262億円（同144.7%増）と堅調であったものの、エクイティ・ファイナンスの減少などにより、受入手数料は総額で550億円（同1.9%減）となりました。金融収支は48億円（同37.9%増）、純営業収益は910億円（同27.2%増）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費175億円（同0.8%増）、人件費422億円（同12.8%増）、不動産関係費112億円（同0.1%減）などにより、合計で940億円（同7.0%増）となりました。

この結果、8億円の経常損失（前年同四半期は81億円の経常損失）となりました。

特別利益に投資有価証券売却益4億円、特別損失に投資有価証券評価損23億円を計上したことなどにより、特別損益は純額で20億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94億円の四半期純損失（前年同四半期は11億円の四半期純損失）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	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	計		
純営業収益	45,593	16,718	5,552	9,648	1,262	78,774	7,084	85,858
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) 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。

[リテール部門]

株券等の委託手数料が減少したものの、株式投資信託の販売による募集手数料が業績を下支えし、純営業収益は455億円（前年同四半期比1.0%減）となりました。一方、販売費・一般管理費の減少により経常利益は124億円（同7.8%増）となっております。

[グローバル・マーケット部門]

純営業収益は167億円（同136.8%増）となったものの、経常利益は128億円の損失（前年同四半期は192億円の損失）となっております。

[グローバル・インベストメント・バンキング部門]

震災の影響により一部エクイティ・ファイナンスの中止や延期があったことから引受け額が減少し、純営業収益は55億円（同23.2%減）となりました。経常利益は58億円の損失（前年同四半期は35億円の損失）となっております。

[アセット・マネジメント部門]

資金流入が堅調に推移したことから運用資産の期中平均残高が増加し、信託報酬が増加しました。その結果、純営業収益は96億円（同6.6%増）、経常利益は40億円（同8.9%増）となりました。

[投資部門]

純営業収益は12億円（前年同四半期は6億円の損失）、経常利益は4億円（前年同四半期は26億円の損失）となりました。

[その他]

純営業収益は70億円（同16.1%増）、経常利益は11億円の損失（前年同四半期は4億円の損失）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16兆2,828億円（前連結会計年度末比5,595億円減）となりました。内訳は流動資産が15兆7,586億円（同5,527億円減）であり、このうちトレーディング商品が7兆5,647億円（同7,942億円増）、有価証券担保貸付金が5兆7,468億円（同1兆5,810億円減）となっております。固定資産は5,241億円（同67億円減）となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は15兆4,028億円（同5,181億円減）となりました。内訳は流動負債が13兆4,197億円（同5,193億円減）であり、このうちトレーディング商品が5兆278億円（同2,109億円増）、有価証券担保借入金が5兆295億円（同3,093億円減）、短期借入金が1兆2,588億円（同1兆4,016億円減）となっております。固定負債は1兆9,800億円（同12億円増）であり、このうち社債が1兆3,503億円（同162億円増）、長期借入金が5,777億円（同148億円減）となっております。

純資産合計は8,800億円（同413億円減）となりました。株主資本については、「(6)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95億円（同136億円減）、少数株主持分は748億円（同82億円減）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65億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) 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、中国など新興国の高い成長に牽引されて、堅調に推移しています。平成23年4－6月期の中国の実質GDP成長率は前年同期比9.5%増となり、順調に経済成長を続けていることが確認されました。他方、世界経済の成長ペースには減速感も見られ、先行きに対して不確実性が強まる状況となりました。この背景として、欧州財政問題の拡大懸念、新興国でのインフレ圧力の高まり、米国経済の減速懸念などが指摘されています。また、平成23年3月11日に発生した東日本大震災によりグローバル・サプライチェーン（供給網）が影響を受けたことで、一部製造業に生産活動の停滞がみられました。

欧州経済は、好調なドイツが牽引して底堅く推移しています。しかし、欧州財政問題が拡大するのではないかと懸念が高まり、金融市場での信用不安が広がりました。平成23年4月、ポルトガル政府は、同国の資金繰りが深刻な状況に陥るとの見方が強まったため、欧州連合（EU）及び国際通貨基金（IMF）に金融支援を要請しました。ギリシャでは、平成23年6月、財政再建に取り組むための大連立構想が失敗に終わったため、債務再編の可能性が高まりました。その後、ギリシャ政府は内閣改造を実施し、財政赤字削減のための緊縮財政法案が議会で可決されたことにより、債務再編の可能性の高まりは一旦沈静化に向かうとみられましたが、その後も緊縮財政政策に反対するデモが起こるなどギリシャ国内の混乱が続いたことなどから、欧州財政問題の先行きに対する不安が残る状況となりました。

高い経済成長率を維持している中国など新興国の経済では、インフレ圧力の高まりが警戒されています。新興各国は、インフレ抑制のために金融引き締め姿勢を継続していますが、物価上昇率が高止まりしている国が多く、引き締めの効果が十分に現れていない状況となっています。インフレの高進は、家計の購買力を低下させて消費に悪影響を及ぼす一方、行き過ぎた金融引き締め政策は、経済成長を腰折れさせるリスクがあると考えられています。そのため、新興各国においては、過熱気味の経済をいかにソフトランディングさせるかという点が今後の課題となっています。なお、インフレに対する懸念は先進国においても生じ始めており、平成23年4月、欧州中央銀行（ECB）は約2年ぶりとなる利上げに踏み切りました。

米国においては、雇用環境の低迷、不動産市場の弱含み、ガソリン価格の高騰による消費者マインドの悪化などを背景に、景気減速の懸念が強まりました。米国連邦準備制度理事会（FRB）は、米国経済の失速に対応するために導入した金融緩和策である「量的緩和策第2弾（QE2）」を、平成23年6月末に終了しました。しかしFRBは、景気を下支えするため緩和的な金融政策スタンスを今後も当面維持するものとみられています。米国の景気減速懸念や金融緩和策の継続に加えて、同国の財政問題の先行きに対する不透明感から、為替市場ではドル安が進行しました。

<日本の状況>

日本経済は、平成23年3月11日に発生した東日本大震災によって大きく影響を受けましたが、製造業を中心に震災からの復旧が進展したことで、持ち直しの動きが徐々に現れてきています。平成23年6月の日銀短観は、企業の業況判断の先行きが改善に転じており、経済が回復軌道に復するとの見方を裏付けるものとなりました。ただし、電力の供給不足問題、不安定な政治情勢、円高、海外経済の減速などの懸念材料により、日本経済の先行きに対する不透明感が払拭されない状況が続いています。

生産活動は、東日本大震災によるサプライチェーンの寸断や計画停電の実施など供給面の制約を受けて、震災後に大きく低下しました。その結果、製品の出荷が滞ったため、輸出は大幅に減少し、貿易収支は赤字へ転落しました。しかし、企業の生産ラインの修復活動が前倒しで進み、供給面での制約が改善に向かったことで、鉱工業生産は4月から増加へ転じています。企業の生産活動は着実に回復していますが、今後の下振れリスクとして、電力の供給不足が危惧されています。この背景には、政府の要請に基づく浜岡原子力発電所の運転停止問題、定期検査を終了した原子力発電所の再稼働の可否の問題などがあります。ただし、電力会社による電力供給能力の増強努力や企業及び家計の節電の努力によって、当面、電力問題は生産活動の大きな制約にならないと考えられています。

東日本大震災による大規模な被害からの復旧・復興活動が急がれる中、日本の混迷した政治情勢がこれを遅らせているとの懸念が高まりました。平成23年6月、菅内閣に対する内閣不信任決議案は否決されたものの、政局の混迷による内政の停滞により、東日本大震災復興基本法が成立したのは震災から3ヶ月以上経ってからでした。また、平成23年度第2次補正予算の編成は予定よりも遅れ、予算規模も2兆円程度と小規模なものに留まりました。

金融面については、東日本大震災が金融市場にも大きな動揺をもたらしましたが、金融システム全体を麻痺させるような事態にはなりません。日本銀行は、震災への対応として、平成23年4月の政策委員会・金融政策決定会合において、被災地の金融機関を支援するための資金供給制度を導入することを決定しました。平成23年6月の政策委員会・金融政策決定会合では、日本経済の成長基盤を強化するために、「成長基盤強化を支援するための資金供給における出資等に関する特則」を制定しました。平成23年6月末の金融市場は、日経平均株価が9,816円9銭（同年3月末比60円99銭高）、10年国債利回りが1.130%（同0.125ポイントの低下）、為替は1ドル80円42銭（同2円42銭の円高）となりました。欧州財政問題の再燃や海外経済の減速懸念などを背景に為替が円高に振れたことが、日本経済回復の障害になるとの警戒感が高まりました。

(6) 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、コールマネー等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達方法があり、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、特に平成20年度の後半以降は、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、手元流動性の積み増しを実行しております。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います。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		2,190
	その他の短期借入金		4,984
	コマーシャル・ペーパー		4,141
	1年内償還予定の社債		1,624
	短期無担保調達資金合計		
流動性ポートフォリオ等合計		現金・預金	10,760
		国債・政府保証債等	1,612
	流動性ポートフォリオ		12,373
		その他の債券	7,831
		上場株式等	3,205
		その他	760
	補完的流動性ポートフォリオ		11,796
	流動性ポートフォリオ等合計		

(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1兆2,373億円であります。また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は2兆4,170億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の186.8%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、必要に応じて当社からグループ各社に対して機動的に資金を配分・供給でき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。

なお、国内外の証券子会社等（大和証券、大和証券キャピタル・マーケット等）については、業務継続のために必要な流動性ポートフォリオ等を確保した上で、各社の事業特性を考慮して、当社グループにとって最適な資金調達が行えるようコントロールする体制としております。

<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及び大和証券キャピタル・マーケット（傘下の海外現地法人も勘案）においては、さらに個別のコンティンジェンシー・プランを制定し、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。

また、当社グループは、緊急時の資金調達手段の確保のため、複数の金融機関とコミットメント・ライン契約を締結しており、当第1四半期連結会計期間末現在の未使用コミットメント・ライン契約の総額は930億円となっております。

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131億円減少し、8,335億円となりました。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、四半期純損失を94億円計上した結果、前年度末比145億円減の3,811億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ14億円減少し、256億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 現在発行数(株) (平成23年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成23年8月5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	—	—

(注) 「提出日現在発行数」には、平成23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 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23年4月1日～ 平成23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23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23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) 普通株式 35,836,000	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,710,487,000	1,708,857	—
単元未満株式	普通株式 3,055,772	—	—
発行済株式総数	1,749,378,772	—	—
総株主の議決権	—	1,708,857	—

- (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1,630,000株(議決権1,630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34,789,000株(議決権34,789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953株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成23年6月30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 1丁目9番1号	35,836,000	—	35,836,000	2.05
計	—	35,836,000	—	35,836,000	2.05

- (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1,630,000株(議決権1,630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23年4月1日から平成23年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成23年4月1日から平成23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 (平成23年 3 月31日)	当第1 四半期連結会計期間 (平成23年 6 月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,025,239	972,104
預託金	241,697	221,135
受取手形及び売掛金	11,538	10,589
有価証券	84,435	489,538
トレーディング商品	6,770,478	7,564,726
商品有価証券等	4,549,799	5,174,940
デリバティブ取引	2,220,679	2,389,785
約定見返勘定	102,010	—
営業投資有価証券	219,523	201,153
投資損失引当金	△41,962	△41,670
営業貸付金	72,090	88,094
仕掛品	506	744
信用取引資産	147,847	146,177
信用取引貸付金	114,479	127,526
信用取引借証券担保金	33,368	18,651
有価証券担保貸付金	7,327,845	5,746,838
借入有価証券担保金	7,326,791	5,743,569
現先取引貸付金	1,054	3,268
立替金	13,577	16,062
短期貸付金	5,051	37,198
未収収益	34,153	21,136
繰延税金資産	10,590	6,479
その他の流動資産	287,106	278,682
貸倒引当金	△300	△335
流動資産計	16,311,431	15,758,657
固定資産		
有形固定資産	133,226	133,120
無形固定資産	135,680	131,420
のれん	26,659	25,233
その他	109,020	106,187
投資その他の資産	262,073	259,652
投資有価証券	188,856	188,277
長期貸付金	10,530	10,296
長期差入保証金	23,941	23,626
繰延税金資産	23,217	21,905
その他	※1 16,438	※1 16,459
貸倒引当金	※1 △910	※1 △912
固定資産計	530,980	524,193
資産合計	16,842,411	16,282,850

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成23年 3 月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成23年 6 月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	5,869	4,240
トレーディング商品	4,816,854	5,027,829
商品有価証券等	3,012,792	3,034,701
デリバティブ取引	1,804,062	1,993,127
約定見返勘定	—	681,146
信用取引負債	61,397	66,085
信用取引借入金	4,774	5,454
信用取引貸証券受入金	56,622	60,631
有価証券担保借入金	5,338,881	5,029,514
有価証券貸借取引受入金	5,213,298	4,941,632
現先取引借入金	125,583	87,882
預り金	149,427	151,859
受入保証金	249,362	253,657
短期借入金	2,660,492	1,258,846
コマーシャル・ペーパー	395,195	414,134
1年内償還予定の社債	155,056	162,495
未払法人税等	2,241	2,795
繰延税金負債	1,012	1,025
賞与引当金	23,152	10,299
その他の流動負債	80,197	355,816
流動負債計	13,939,141	13,419,744
固定負債		
社債	1,334,141	1,350,364
長期借入金	592,640	577,784
繰延税金負債	631	192
退職給付引当金	29,948	30,203
訴訟損失引当金	503	822
偶発損失引当金	960	661
負ののれん	17,121	15,980
その他の固定負債	2,902	4,050
固定負債計	1,978,849	1,980,061
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,022	3,022
特別法上の準備金計	3,022	3,022
負債合計	15,921,013	15,402,828

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成23年 3 月31日)	当第 1 四半期連結会計期間 (平成23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	230,632	230,632
利益剰余金	395,751	381,176
自己株式	△27,054	△25,650
株主資本合計	846,725	833,555
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	23,135	9,504
繰延ヘッジ損益	85	99
為替換算調整勘定	△36,013	△42,595
その他の包括利益累計額合計	△12,793	△32,991
新株予約権	4,385	4,603
少数株主持分	83,080	74,856
純資産合計	921,398	880,022
負債・純資産合計	16,842,411	16,282,850

(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 (自 平成22年4月1日 至 平成22年6月30日)	当第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)
営業収益		
受入手数料	56,106	55,060
委託手数料	13,323	10,515
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	4,658	3,832
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	9,155	13,394
その他の受入手数料	28,969	27,318
トレーディング損益	10,724	26,244
株券等トレーディング損益	△15,315	△8,479
債券・為替等トレーディング損益	26,039	34,724
営業投資有価証券関連損益	△1,924	1,251
金融収益	17,516	20,076
その他の営業収益	11,729	10,992
営業収益計	94,151	113,625
金融費用	13,993	15,217
その他の営業費用	8,544	7,325
純営業収益	71,613	91,083
販売費・一般管理費		
取引関係費	17,376	17,514
人件費	※1 37,483	※1 42,268
不動産関係費	11,290	11,273
事務費	6,714	6,954
減価償却費	9,753	10,153
租税公課	1,967	2,136
貸倒引当金繰入れ	15	33
その他	3,258	3,685
販売費・一般管理費計	87,859	94,021
営業損失(△)	△16,245	△2,938
営業外収益		
受取利息	53	40
受取配当金	1,731	753
負ののれん償却額	1,141	1,141
為替差益	4,081	—
持分法による投資利益	491	474
その他	1,018	1,247
営業外収益計	8,517	3,656
営業外費用		
支払利息	33	14
有価証券運用損	265	—
為替差損	—	1,248
その他	159	259
営業外費用計	458	1,522
経常損失(△)	△8,187	△803

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年6月30日)	当第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)
特別利益		
投資有価証券売却益	1,162	427
貸倒引当金戻入額	614	—
特別利益計	1,776	427
特別損失		
固定資産除売却損	13	29
投資有価証券売却損	1	97
投資有価証券評価損	56	2,353
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	603	—
その他	456	—
特別損失計	1,131	2,480
税金等調整前四半期純損失 (△)	△7,542	△2,856
法人税、住民税及び事業税	599	1,764
法人税等調整額	△6,042	4,507
法人税等合計	△5,443	6,271
少数株主損益調整前四半期純損失 (△)	△2,099	△9,127
少数株主利益又は少数株主損失 (△)	△907	306
四半期純損失 (△)	△1,191	△9,434

【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 (自 平成22年4月1日 至 平成22年6月30日)	当第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)
少数株主損益調整前四半期純損失 (△)	△2,099	△9,127
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△19,999	△22,193
繰延ヘッジ損益	216	14
為替換算調整勘定	△12,595	△6,626
持分法適用会社に対する持分相当額	27	90
その他の包括利益合計	△32,351	△28,715
四半期包括利益	△34,450	△37,843
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	△29,231	△29,630
少数株主に係る四半期包括利益	△5,218	△8,213

【会計方針の変更等】

当第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)
(会計方針の変更) 当第1四半期連結会計期間より、「1株当たり当期純利益に関する会計基準」(企業会計基準第2号 平成22年6月30日)及び「1株当たり当期純利益に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第4号 平成22年6月30日)を適用しております。 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定にあたり、一定期間の勤務後に権利が確定するストック・オプションについて、権利の行使により払い込まれると仮定した場合の入金額に、ストック・オプションの公正な評価額のうち、将来提供されるサービスに係る分を含める方法に変更しております。 なお、前第1四半期連結累計期間及び当第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開示しておりません。

【追加情報】

当第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)
(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準) 当第1四半期連結会計期間の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。 なお、当第1四半期連結累計期間より、四半期連結損益計算書における従来の「その他の売上高」は「その他の営業収益」、「売上原価」は「その他の営業費用」に勘定科目をそれぞれ変更しております。

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

前連結会計年度 (平成23年 3 月31日)	当第 1 四半期連結会計期間 (平成23年 6 月30日)																								
※1 貸倒引当金10,687百万円は、債権額と相殺して表示しております。	※1 貸倒引当金10,706百万円は、債権額と相殺して表示しております。																								
2 保証債務	2 保証債務																								
<table><tr><th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr><tr><td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,675</td></tr><tr><td>その他</td><td>債務</td><td>1,384</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>3,059</td></tr></table>	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	1,675	その他	債務	1,384	合計		3,059	<table><tr><th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr><tr><td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,488</td></tr><tr><td>その他</td><td>債務</td><td>1,374</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>2,862</td></tr></table>	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	1,488	その他	債務	1,374	合計		2,862
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																							
従業員	借入金	1,675																							
その他	債務	1,384																							
合計		3,059																							
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																							
従業員	借入金	1,488																							
その他	債務	1,374																							
合計		2,862																							

(四半期連結損益計算書関係)

前第1四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年6月30日)	当第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 人件費には、賞与引当金繰入額6,526百万円が含まれております。	※1 人件費には、賞与引当金繰入額10,017百万円が含まれております。

(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 (自 平成22年4月1日 至 平成22年6月30日)	当第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)
減価償却費	10,799百万円	10,653百万円
のれんの償却額	286	718
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22年4月1日 至 平成22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 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年5月19日 取締役会	普通株式	利益剰余金	13,987	8	平成22年3月31日	平成22年6月7日

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末後となるもの

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 (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

(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末後となるもの

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22年4月1日 至 平成22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 (注) 1	合計
	リテール 部門	グローバ ル・マー ケッツ部 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	35,393	6,500	8,558	14,875	△573	64,754	2,779	67,533
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	10,666	558	△1,333	△5,825	△113	3,952	3,319	7,272
計	46,059	7,059	7,225	9,049	△687	68,706	6,098	74,805
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(△))	11,536	△19,295	△3,545	3,738	△2,658	△10,223	△446	△10,669

(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	△10,223
「その他」の区分の損失(△)	△446
セグメント間取引消去	△10
のれん及び負ののれんの償却額	854
未実現損益の調整額	766
その他の調整額	871
四半期連結損益計算書の経常損失(△)	△8,187

Ⅱ 当第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 (注) 1	合計
	リテール 部門	グローバ ル・マー ケッツ部 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	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

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成23年 3 月31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 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	—	—	—
社債	100	98	△1
その他	—	—	—
計	100	98	△1

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 対照表計上額	差額
株券	99,795	141,499	41,703
債券	9,701	9,704	2
国債・地方債等	—	—	—
社債	5,553	5,553	—
その他	4,148	4,151	2
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	45,760	47,173	1,412
その他	123,549	121,562	△1,986
計	278,807	319,939	41,132

(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3,667百万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23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 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	—	—	—
社債	16,571	16,843	271
その他	62,741	62,693	△47
計	79,313	79,536	223

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 対照表計上額	差額
株券	98,687	118,940	20,252
債券	335,619	335,575	△43
国債・地方債等	272,636	272,684	48
社債	39,914	39,815	△99
その他	23,069	23,076	7
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	46,542	48,388	1,845
その他	129,141	127,001	△2,139
計	609,990	629,905	19,914

(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2,282百万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23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	4,580,458	394,028	5,441,001	396,975
為替予約取引	878,225	20,461	1,635,048	41,333
先物・先渡取引	1,270,552	11,103	191,717	5,816
スワップ取引	53,605,445	1,777,083	52,302,110	1,325,955
その他	1,330,902	33,065	1,293,787	33,981
リスクリザーブ	—	△15,063	—	—

当第1四半期連結会計期間末(平成23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	4,828,409	366,593	5,771,427	383,211
為替予約取引	1,273,776	22,190	1,466,942	35,012
先物・先渡取引	759,289	9,345	949,249	4,702
スワップ取引	61,957,877	1,966,634	61,133,720	1,533,127
その他	1,491,433	39,420	1,311,628	37,014
リスクリザーブ	—	△14,412	—	—

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純損失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 (自 平成22年4月1日 至 平成22年6月30日)	当第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株当たり四半期純損失金額	△0.68円	△5.61円
(算定上の基礎)		
四半期純損失金額(百万円)	△1,191	△9,434
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損失金額(百万円)	△1,191	△9,434
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,741,271	1,680,490

(注) 1 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、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)

当第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)

(グループ内組織再編について)

当社は、平成23年7月29日開催の執行役会において、当社子会社である大和証券株式会社（以下「大和証券」）及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社（以下「大和証券キャピタル・マーケット」）が平成24年4月1日に統合することに関する基本合意書を締結することを承認いたしました。

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、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 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（予定）

(3) 企業結合の法的形式

合併

(4) 取引の目的を含む取引の概要

当社グループでは、収支構造の抜本的改善による「強靱な経営基盤の確立」のため、現在、安定収益拡大、本社機能集約化による人員再配置及び各種販売費・一般管理費削減等により、中期的に収支の改善を目指しています。

その中で、今般大和証券と大和証券キャピタル・マーケットを統合することで、①更なる組織運営の効率化、②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。

具体的な統合の方法及び条件等の詳細は今後検討の上決定いたします。

2 実施する会計処理の概要

「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する予定であります。

2 【その他】

(剰余金の配当)

平成23年5月17日開催の取締役会において、平成23年3月期の期末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23年6月6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104百万円が含まれております。

2 平成23年3月31日現在の株主名簿に記載または記録された株主また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23年 8 月 5 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23年4月1日から平成24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23年4月1日から平成23年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成23年4月1日から平成23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23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。

