

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22年10月1日
(第74期Ⅲ)	至	平成22年12月31日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第74期第3四半期（自平成22年10月1日 至平成22年12月31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74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】	3
3 【関係会社の状況】	3
4 【従業員の状況】	3
第2 【事業の状況】	4
1 【事業等のリスク】	4
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 【設備の状況】	11
第4 【提出会社の状況】	12
1 【株式等の状況】	12
2 【株価の推移】	27
3 【役員の状況】	27
第5 【経理の状況】	28
1 【四半期連結財務諸表】	29
2 【その他】	51
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	52

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2月7日
【四半期会計期間】	第74期第3四半期 (自 平成22年10月1日 至 平成22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 鈴木 茂 晴
【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】

連結経営指標等

回次	第73期 前第3四半期 連結累計期間	第74期 当第3四半期 連結累計期間	第73期 前第3四半期 連結会計期間	第74期 当第3四半期 連結会計期間	第73期
会計期間	自 平成21年 4月1日 至 平成21年 12月31日	自 平成22年 4月1日 至 平成22年 12月31日	自 平成21年 10月1日 至 平成21年 12月31日	自 平成22年 10月1日 至 平成22年 12月31日	自 平成21年 4月1日 至 平成22年 3月31日
営業収益 (百万円)	421,365	319,603	183,615	118,214	537,915
純営業収益 (百万円)	360,011	256,566	165,509	96,517	458,105
経常利益又は経常損失 (△) (百万円)	92,756	△2,010	67,891	7,017	102,917
四半期(当期)純利益 又は四半期純損失 (△) (百万円)	46,227	△4,202	26,366	1,182	43,429
純資産額 (百万円)	—	—	938,405	927,158	1,017,528
総資産額 (百万円)	—	—	14,873,191	16,867,587	17,155,345
1株当たり純資産額 (円)	—	—	529.60	502.68	530.27
1株当たり四半期(当期)純利益 金額又は四半期純損失金額 (△) (円)	28.72	△2.45	15.08	0.70	26.41
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額 (円)	28.68	—	15.06	0.70	26.38
自己資本比率 (%)	—	—	6.2	5.0	5.4
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△1,463,205	823,370	—	—	△3,259,900
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△222,563	△104,830	—	—	△237,499
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	2,114,268	△619,070	—	—	3,837,205
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高 (百万円)	—	—	842,463	843,834	753,982
従業員数 (人)	—	—	15,630	15,424	15,450

- (注) 1 従業員数は、就業人員数を表示しております。
- 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。
- 4 第74期第3四半期連結累計期間及び第74期第3四半期連結会計期間の1株当たり純資産額、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潜在株式調整後1株当たり四半期純利益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。

2 【事業の内容】

当第3四半期連結会計期間において、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。

3 【関係会社の状況】

当第3四半期連結会計期間において、重要な関係会社の異動はありません。

4 【従業員の状況】

(1) 連結会社の状況

平成22年12月31日現在

従業員数(人)	15,424
---------	--------

(注) 従業員数には、FA（ファイナンシャルアドバイザー）社員の雇用人員331人を含めております。

(2) 提出会社の状況

平成22年12月31日現在

従業員数(人)	220
---------	-----

(注) 従業員数は、就業人員数を表示しております。

第2 【事業の状況】

1 【事業等のリスク】

当第3四半期連結会計期間において、新たな事業等のリスクの発生はありません。

また、当第3四半期連結会計期間において、前連結会計年度の有価証券報告書及び当連結会計年度の第1四半期報告書に記載した「事業等のリスク」について重要な変更はありません。

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及び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、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) 業績の状況

① 経営成績の分析

当第3四半期連結会計期間の当社グループの営業収益は1,182億円（前年同四半期比35.6%減）となりました。トレーディング損益が316億円（同307.5%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546億円（同18.7%減）となりました。金融収支は12億円（同11.0%減）、純営業収益は965億円（同41.6%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費179億円（同12.3%増）、人件費422億円（同18.9%減）、不動産関係費109億円（同1.1%増）などにより、合計で923億円（同7.4%減）となりました。

この結果、経常利益は70億円（同89.6%減）となりました。

特別利益に投資有価証券売却益21億円を計上したことなどにより、特別損益は純額で23億円となりました。これに法人税等及び少数株主利益を加味した結果、当第3四半期連結会計期間は11億円の四半期純利益（同95.5%減）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	45,416	20,529	7,637	9,177	8,331	91,093	△2,225	88,867
経常利益又は経常損失(△)	10,010	△8,847	△3,465	4,453	6,754	8,905	△2,804	6,100

(注) 上記の純営業収益は営業収益、金融費用、売上原価及び支払手数料(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]

リテール部門は、大和証券を主とするリテール証券業務を営む部門となります。

株券等の委託手数料の減少などから、純営業収益は454億円となりました。一方、販売費・一般管理費の減少により経常利益は100億円となっております。

[グローバル・マーケット部門]

グローバル・マーケット部門は、大和証券キャピタル・マーケット（連結）のうち、株式、債券・為替及びそれらの派生商品のセールスとトレーディングを行う部門となっております。

純営業収益は205億円、経常利益は88億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]

グローバル・インベストメント・バンキング部門は、大和証券キャピタル・マーケット（連結）のうち、有価証券の引受業務、M&Aアドバイザリー業務、ストラクチャード・ファイナンス業務などを行う部門となっております。

エクイティ・ファイナンスの引受け額が大幅に減少したことなどから、純営業収益は76億円となりました。経常利益は34億円の損失となっております。

[アセット・マネジメント部門]

アセット・マネジメント部門は、さまざまな資産を投資対象とした投資信託の設定・運用を行っているほか、国内外の機関投資家に対し年金資産に関する投資助言・運用サービスを行う部門となっております。

運用資産の期中平均残高が増加したことにより、信託報酬が増加しました。その結果、純営業収益は91億円、経常利益は44億円となりました。

[投資部門]

投資部門は、プライベート・エクイティ投資を中心とした投資ビジネスを行う部門となっております。

純営業収益は83億円、経常利益は67億円となりました。

[その他]

その他には、大和証券グループ本社、大和総研グループ、大和プロパティなどにおけるグループサポート事業が含まれております。

純営業収益は22億円の損失、経常利益は28億円の損失となりました。

② 財政状態の分析

＜資産の部＞

当第3四半期連結会計期間末の総資産は16兆8,675億円（前連結会計年度末比2,877億円減）となりました。内訳は流動資産が16兆3,237億円（同3,125億円減）であり、このうちトレーディング商品が7兆4,534億円（同2,009億円減）、有価証券担保貸付金が6兆9,885億円（同788億円減）となっており、固定資産は5,438億円（同247億円増）となっております。

＜負債の部・純資産の部＞

負債合計は15兆9,404億円（同1,973億円減）となりました。内訳は流動負債が14兆208億円（同4,546億円減）であり、このうちトレーディング商品が4兆9,114億円（同137億円減）、有価証券担保借入金が4兆4,604億円（同5,742億円増）、短期借入金が3兆3,128億円（同1兆226億円減）となっております。固定負債は1兆9,157億円（同2,572億円増）であり、このうち社債が1兆2,864億円（同596億円増）、長期借入金が5,771億円（同1,988億円増）となっております。

純資産合計は9,271億円（同903億円減）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71億円（同132億円減）、少数株主持分は798億円（同73億円減）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203億円減少しております。

(2) キャッシュ・フローの状況

当第3四半期連結会計期間において、営業活動によるキャッシュ・フローは、有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額の減少などにより1,002億円の減少（前年同四半期は8,928億円の減少）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、営業譲受による支出の減少などにより894億円の減少（同146億円の増加）となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金の純増減額の増加などにより2,624億円の増加（同1兆2,616億円の増加）となりました。これらに為替変動の影響等を加えた結果、当第3四半期連結会計期間末の現金及び現金同等物の残高は、第2四半期連結会計期間末に比べ709億円増加し、8,438億円となりました。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第3四半期連結会計期間において、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3四半期連結会計期間のマクロ経済環境＞

① 海外の状況

世界経済は、平成22年半ば頃からその回復の勢いが一旦鈍化しましたが、同年10－12月期には再び復調し始めました。米国では、年初より機運の高まっていた過度の金融緩和の正常化を断念し、同年11月には6,000億ドル相当の米長期国債の買い切り等を中心とする新たな量的緩和策が打ち出されました。また、同月の中間選挙で大敗したオバマ政権は、翌12月に個人所得税の減税等を内容とするいわゆるブッシュ減税の延長を含む、新たな経済対策を打ち出しました。実体経済の面では、一旦は弱含んでいた非農業（民間）雇用者数が再び増加ペースを取り戻したほか、株価が上昇する中で小売売上高などにみる個人消費も回復ペースを取り戻しました。中国では、インフレや不動産価格の上昇などに表れた景気の過熱を抑制するため、平成22年以降、預金準備率の引き上げや不動産投資・投機に関する規制強化がなされてきたほか、同年10月及び12月には貸出金利の引き上げが行われるなど、矢継ぎ早に引き締め政策が採られてきました。これにより、平成22年1－3月期に前年同期比11.9%増となっていた中国のGDP成長率は漸減しました。ただし、米国経済の持ち直しを受け、輸出が大幅に増加したことなどもあり、同年10－12月期のGDP成長率は前年同期比9.8%増と同年7－9月期をわずかに上回る水準となり、下げ止まりの兆しを見せました。そのほかアジアなどの新興国各国の経済も力強さを見せました。先進国の金融緩和で増加した流動性の一部が新興国にも流入し、株価や実体経済を押し上げていると言われています。

欧州では、ギリシャをはじめとする国々の財政破綻への懸念に対し、平成22年5月に「欧州安定化メカニズム」が定められるなどの対応策が採られました。また、そのような懸念が高まるなか、ユーロ安が大きく進みました。鉱工業生産等に見る実体経済の動きは同年夏頃にかけて弱含みましたが、ユーロ安により輸出が拡大したドイツ等に牽引され、回復のペースは再び強まってきました。

世界経済が減速する中では、「逃避通貨」として円が買われ、円高が加速してきました。しかし、世界の景気動向が持ち直してきたため、米国などで金利の上昇が見られ始めるとともに、為替は平成22年11月初め頃より、円安方向に進みました。

② 日本の状況

日本経済は、平成21年3月以降、世界経済に牽引され回復の傾向が続いてきましたが、平成22年半ば頃からその回復ペースが鈍化し、景気は「踊り場」にあるといわれるようになりました。世界経済の回復鈍化の中で円高が進行したこともあり、輸出や企業の生産活動が弱含みました。また、エコカー補助金が同年9月上旬で終了したことで、その後の新車販売台数が大幅に減少したほか、同年10月の値上げを受けてたばこの販売本数が減少するなど、経済政策の終了や税制の変更も景気のかく乱要因となりました。同年12月調査の日銀短観では、全規模全産業の業況判断は7四半期ぶりに悪化しました。

平成22年10月には、日本銀行が「包括的な金融緩和政策」として、無担保コールレートの誘導目標を0～0.1%に引き下げるとともに、このような実質ゼロ金利政策を物価の安定が展望できる情勢になったと判断するまで継続すると明示したほか、指数連動型上場投資信託（ETF）や不動産投資信託（J-REIT）などを含む多様な金融資産の買入れ等の基金を創設するなど、新たな金融緩和政策を導入しました。また、政府は「新成長戦略」で掲げた法人税減税について、その実現を求める声の高まりを受け、平成23年度「税制改正大綱」において法人実効税率の5ポイントの引き下げを明記し、平成22年12月に同「税制改正大綱」を閣議決定しました。

こうした中、日本経済には少しずつ明るい兆しが見え始めました。たとえば、平成22年11月の鉱工業生産指数は、6ヶ月ぶりに前月比でプラスに転じ、また同年12月調査の当月および翌月の製造工業生産予測指数は、ともに前月比3%を上回る大幅な伸びを示しました。世界経済の復調が日本経済にも及び始めたとの見方が出始めました。

なお、平成22年12月末には為替は1ドル81.11円（同年9月末比2.99円の円高）、日経平均株価は10,228.92円（同859.57円高）、10年国債利回りは1.127%（同0.19ポイントの上昇）となっています。

(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、レボ取引等の有担保調達方法があり、これらの多様化された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います。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。この結果、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、業務の継続が可能な体制が維持されています。

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。

当第3四半期連結会計期間末の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
(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		2,241
	その他の短期借入金		6,124
	コマーシャル・ペーパー		3,839
	1年内償還予定の社債		2,585
			14,791
流動性ポートフォリオ等合計		現金・預金	8,346
		国債・政府保証債等	3,445
	流動性ポートフォリオ		11,791
		その他の債券	8,661
		上場株式等	8,542
		その他	1,010
	補完的流動性ポートフォリオ		18,214
			30,006

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1兆1,791億円であります。また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は3兆6億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の202.9%に相当します。

<グループ全体の資金管理>

グループ全体の流動性は、当社グループの適正な流動性確保という基本方針の下、当社が一元的に管理・モニタリングしております。当社は、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、短期の無担保調達資金に対して、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、必要があれば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ており、一体化した効率的な資金調達及び資金管理を行っております。

ただし、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、当社グループの基本方針の枠組みの中で、各社が事業特性に応じた資金調達を行い、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、その状況を当社に報告する体制となっております。

<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います。

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います。

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3四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981億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3四半期連結会計期間末の株主資本は、8,792億円（前連結会計年度末比504億円減）となっております。利益剰余金は配当金支払いにより192億円減少したほか、四半期純損失を42億円計上したことにより、4,288億円（同235億円減）となりました。自己株式の控除額は、127億円の自己株式の買付を行ったことに加え、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式141億円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、前連結会計年度末に比べ269億円増加し、276億円となっております。

③ 格付会社による信用格付

当社、大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットには、国内外の格付会社により長期及び短期の信用格付が付与されております。

当社グループの信用格付に影響を及ぼす要因としては、マクロ経済環境及び主たる事業領域である証券市場等の事業環境、経営戦略、営業基盤、当社グループのマーケットにおける地位、収益性及び収益のボラティリティ、経費構造の柔軟性、リスク管理体制、流動性の状況、資本政策及び資本の十分性、コーポレート・ガバナンスの状況等が考えられます。

なお、格付けが付与された有価証券を発行して資金調達を行うのは、当社グループにおいては当社、大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットであります。

平成23年2月3日現在における当社、大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットの格付けは次のとおりであります。

格付会社	当社		大和証券		大和証券キャピタル・マーケット	
	長期	短期	長期	短期	長期	短期
Moody's Investors Service	Baa2	—	Baa1	P-2	Baa1	P-2
Standard & Poor's	BBB	A-2	BBB+	A-2	BBB+	A-2
Fitch Ratings	—	—	—	—	A-	F2
格付投資情報センター	A	a-1	A	—	A	a-1
日本格付研究所	A+	—	A+	—	A+	—

第 3 【設備の状況】

(1) 主要な設備の状況

当第 3 四半期連結会計期間において、主要な設備に重要な異動はありません。

(2) 設備の新設、除却等の計画

第 2 四半期連結会計期間末において、重要な設備の新設、除却等の計画はありませんでした。

また、当第 3 四半期連結会計期間において、新たに確定した重要な設備の新設、除却等の計画はありません。

第 4 【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22年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成23年2月7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」欄には、平成23年2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】

新株予約権の状況は以下のとおりであります。

① 平成16年定時株主総会の決議によるもの

当社は、ストック・オプションの目的で「商法等の一部を改正する法律」（平成13年法律第128号）（以下「平成13年改正旧商法」という。）第280条ノ20及び第280条ノ21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16年6月23日開催の株主総会及び平成16年8月24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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	1,644
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	1,644,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり727
新株予約権の行使期間	平成18年7月1日から平成23年8月31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 727 資本組入額 364
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

② 平成17年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で平成13年改正旧商法第280条ノ20及び第280条ノ21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17年6月24日開催の株主総会及び同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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	463
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	463,000
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17年7月1日から平成37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 当社及び当社子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37年6月1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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で平成13年改正旧商法第280条ノ20及び第280条ノ21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17年6月24日開催の株主総会及び平成17年8月25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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	1,967
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	1,967,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり750
新株予約権の行使期間	平成19年7月1日から平成24年8月31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 750 資本組入額 375
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

③ 平成18年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 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18年6月24日開催の株主総会及び同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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	265
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	265,000
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18年7月1日から平成38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 当社及び当社子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38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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(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1,363円を加算した資本組入額は682円となります。

(ii) 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18年6月24日開催の株主総会及び平成18年8月24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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	2,593
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	132
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)	2,593,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1,455
新株予約権の行使期間	平成23年7月1日から平成28年6月23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 1,455 資本組入額 728
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格1,455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499.8円を加算した資本組入額は978円となります。

④ 平成19年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 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19年6月23日開催の株主総会及び同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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	282
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	282,000
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19年7月1日から平成39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 当社及び当社子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39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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(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1,312円を加算した資本組入額は657円となります。

(ii) 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19年6月23日開催の株主総会及び平成19年8月23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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	2,570
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	96
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)	2,570,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1,176
新株予約権の行使期間	平成24年7月1日から平成29年6月22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 1,176 資本組入額 588
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格1,176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349円を加算した資本組入額は763円となります。

⑤ 平成20年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 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20年6月21日開催の株主総会及び同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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	332
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	332,000
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20年7月1日から平成40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 当社及び当社子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40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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(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972円を加算した資本組入額は487円となります。

- (ii) 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20年6月21日開催の株主総会及び平成20年8月28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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	3,099
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	71
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)	3,099,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり881
新株予約権の行使期間	平成25年7月1日から平成30年6月20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 881 資本組入額 441
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格881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243.7円を加算した資本組入額は563円となります。

⑥ 平成21年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 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21年6月20日開催の株主総会及び同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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	651
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	651,000
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21年7月1日から平成41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 当社及び当社子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41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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(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580円を加算した資本組入額は291円となります。

(ii) 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21年6月20日開催の株主総会及び平成21年10月23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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	4,413
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	81
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)	4,413,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり496
新株予約権の行使期間	平成26年7月1日から平成31年6月19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 496 資本組入額 248
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格496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152円を加算した資本組入額は324円となります。

⑦ 平成22年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 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22年6月26日開催の株主総会及び同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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	1,056
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—
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)	1,056,000
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22年7月1日から平成42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 当社及び当社子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42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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(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375円を加算した資本組入額は188円となります。

- (ii) 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22年6月26日開催の株主総会及び平成22年8月23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3四半期会計期間末現在 (平成22年12月31日)
新株予約権の数(個)	7,399
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	41
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)	7,399,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり380
新株予約権の行使期間	平成27年7月1日から平成32年6月25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 380 資本組入額 190
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。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

(注) 上記の「資本組入額」には、株式の発行価格380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83円を加算した資本組入額は232円となります。

(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22年10月1日から 平成22年12月31日	12	1,749,378	7	247,397	7	226,751

(注) 新株予約権の行使による増加であります。

(6) 【大株主の状況】

当第3四半期会計期間において、当社による自己株式の取得のほかは大株主の異動は把握しておりません。

当社は、平成22年10月29日開催の取締役会決議に基づき、平成22年11月1日から平成22年11月24日の期間にわたり当社普通株式35,000,000株(発行済株式総数に対する割合2.00%)を取得しております。

(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ず、記載することができませんので、直前の基準日である平成22年9月30日の株主名簿により記載しております。

① 【発行済株式】

平成22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 879,000	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,745,335,000	1,742,090	—
単元未満株式	普通株式 3,152,772	—	—
発行済株式総数	1,749,366,772	—	—
総株主の議決権	—	1,742,090	—

- (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、当社の証券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3,245,000株(議決権3,245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39,290,000株(議決権39,290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124株が含まれております。
- 5 当社は、平成22年10月29日開催の取締役会決議に基づき、平成22年11月1日から平成22年11月24日の期間にわたり当社普通株式35,000,000株を取得しております。なお、当該株式数は上記の表に含まれておりません。

② 【自己株式等】

平成22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 1丁目9番1号	879,000	—	879,000	0.05
計	—	879,000	—	879,000	0.05

- (注) 1 上記のほか、当社の証券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3,245,000株(議決権3,245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 当社は、平成22年10月29日開催の取締役会決議に基づき、平成22年11月1日から平成22年11月24日の期間にわたり当社普通株式35,000,000株(発行済株式総数に対する割合2.00%)を取得しております。なお、当該株式数は上記の表に含まれておりません。

2 【株価の推移】

【当該四半期累計期間における月別最高・最低株価】

月別	平成22年 4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
最高(円)	520	480	414	405	379	373	359	407	432
最低(円)	481	396	372	355	338	336	320	320	372

(注) 株価は東京証券取引所市場第一部におけるものであります。

3 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当四半期報告書提出日までの役員の異動は、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5 【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。以下「四半期連結財務諸表規則」という。）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。

なお、前第3四半期連結会計期間（平成21年10月1日から平成21年12月31日まで）及び前第3四半期連結累計期間（平成21年4月1日から平成21年12月31日まで）は、改正前の四半期連結財務諸表規則に基づき、当第3四半期連結会計期間（平成22年10月1日から平成22年12月31日まで）及び当第3四半期連結累計期間（平成22年4月1日から平成22年12月31日まで）は、改正後の四半期連結財務諸表規則に基づい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、前第3四半期連結会計期間（平成21年10月1日から平成21年12月31日まで）及び前第3四半期連結累計期間（平成21年4月1日から平成21年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表については、あずさ監査法人により四半期レビューを受け、当第3四半期連結会計期間（平成22年10月1日から平成22年12月31日まで）及び当第3四半期連結累計期間（平成22年4月1日から平成22年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により四半期レビューを受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となりました。

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)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成22年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	831,357	699,179
預託金	252,752	291,104
受取手形及び売掛金	9,728	12,447
有価証券	112,885	184,867
トレーディング商品	※2 7,453,421	※2 7,654,333
商品有価証券等	5,118,728	5,707,007
デリバティブ取引	2,334,692	1,947,325
営業投資有価証券	209,514	252,469
投資損失引当金	△35,875	△33,628
営業貸付金	75,955	66,759
仕掛品	885	896
信用取引資産	144,099	185,878
信用取引貸付金	106,662	119,474
信用取引借証券担保金	37,436	66,404
有価証券担保貸付金	6,988,596	7,067,400
借入有価証券担保金	6,988,596	7,067,400
立替金	3,975	13,980
短期貸付金	19,022	13,692
未収収益	33,959	33,067
繰延税金資産	3,555	23,047
その他の流動資産	220,314	171,232
貸倒引当金	△385	△433
流動資産計	16,323,762	16,636,295
固定資産		
有形固定資産	※1 138,236	※1 142,446
無形固定資産	135,514	121,578
のれん	27,112	10,878
その他	108,401	110,700
投資その他の資産	270,075	255,024
投資有価証券	※2 187,731	※2 191,904
長期貸付金	10,709	12,116
長期差入保証金	24,181	24,909
繰延税金資産	32,121	13,103
その他	※5 16,257	※5 15,665
貸倒引当金	※5 △926	※5 △2,674
固定資産計	543,825	519,050
資産合計	16,867,587	17,155,345

(単位：百万円)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成22年3月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	4,466	4,913
トレーディング商品	4,911,492	4,925,289
商品有価証券等	3,034,809	3,468,625
デリバティブ取引	1,876,683	1,456,663
約定見返勘定	134,760	228,042
信用取引負債	74,454	72,765
信用取引借入金	4,976	5,605
信用取引貸証券受入金	69,477	67,160
有価証券担保借入金	4,460,474	3,886,234
有価証券貸借取引受入金	4,288,387	3,341,894
現先取引借入金	172,086	544,339
預り金	145,504	177,255
受入保証金	251,657	246,602
短期借入金	3,312,871	4,335,493
コマーシャル・ペーパー	383,933	351,750
1年内償還予定の社債	258,545	118,402
未払法人税等	1,170	22,254
繰延税金負債	550	4
賞与引当金	19,716	33,376
その他の流動負債	61,217	73,095
流動負債計	14,020,814	14,475,481
固定負債		
社債	1,286,404	1,226,718
長期借入金	577,150	378,319
繰延税金負債	567	534
退職給付引当金	29,428	27,946
訴訟損失引当金	618	615
負ののれん	18,263	21,687
その他の固定負債	3,275	2,606
固定負債計	1,915,706	1,658,428
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,907	3,907
特別法上の準備金計	3,907	3,907
負債合計	15,940,429	16,137,816

(単位：百万円)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成22年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,384
資本剰余金	230,618	230,593
利益剰余金	428,880	452,456
自己株式	△27,607	△689
株主資本合計	879,288	929,744
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7,118	20,365
繰延ヘッジ損益	368	315
為替換算調整勘定	△43,615	△23,262
評価・換算差額等合計	△36,129	△2,581
新株予約権	4,189	3,242
少数株主持分	79,809	87,123
純資産合計	927,158	1,017,528
負債・純資産合計	16,867,587	17,155,345

(2) 【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21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
営業収益		
受入手数料	195,779	159,867
トレーディング損益	71,003	76,490
株券等トレーディング損益	17,558	△20,497
債券・為替等トレーディング損益	53,444	96,988
営業投資有価証券関連損益	80,501	2,895
金融収益	42,953	52,889
その他の売上高	31,127	27,459
営業収益計	421,365	319,603
金融費用	37,831	43,197
売上原価	23,522	19,839
純営業収益	360,011	256,566
販売費・一般管理費		
取引関係費	46,304	51,705
人件費	※1 129,308	※1 118,793
不動産関係費	32,313	33,462
事務費	19,269	20,044
減価償却費	28,798	29,107
租税公課	5,565	5,551
貸倒引当金繰入れ	87	—
その他	10,250	10,556
販売費・一般管理費計	271,897	269,222
営業利益又は営業損失 (△)	88,113	△12,655
営業外収益		
受取利息	207	156
受取配当金	2,084	3,952
負ののれん償却額	—	3,424
持分法による投資利益	320	2,007
その他	3,671	2,516
営業外収益計	6,284	12,056
営業外費用		
支払利息	140	82
株式交付費	868	—
為替差損	—	727
その他	633	602
営業外費用計	1,641	1,411
経常利益又は経常損失 (△)	92,756	△2,010

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
特別利益		
投資有価証券売却益	482	3,499
関係会社株式売却益	—	1,571
貸倒引当金戻入額	—	614
その他	262	347
特別利益計	744	6,033
特別損失		
固定資産除売却損	584	627
減損損失	1,368	49
投資有価証券評価損	3,229	828
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	—	603
その他	744	256
特別損失計	5,927	2,365
税金等調整前四半期純利益	87,573	1,657
法人税、住民税及び事業税	16,038	3,876
法人税等調整額	16,948	1,254
法人税等合計	32,986	5,131
少数株主損益調整前四半期純損失 (△)	—	△3,473
少数株主利益	8,359	728
四半期純利益又は四半期純損失 (△)	46,227	△4,202

【第3四半期連結会計期間】

(単位：百万円)

	前第3四半期連結会計期間 (自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結会計期間 (自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)
営業収益		
受入手数料	67,256	54,618
トレーディング損益	7,754	31,605
株券等トレーディング損益	688	6,154
債券・為替等トレーディング損益	7,066	25,451
営業投資有価証券関連損益	86,532	8,136
金融収益	12,344	17,511
その他の売上高	9,726	6,343
営業収益計	183,615	118,214
金融費用	10,982	16,298
売上原価	7,122	5,398
純営業収益	165,509	96,517
販売費・一般管理費		
取引関係費	16,014	17,989
人件費	※1 52,095	※1 42,205
不動産関係費	10,813	10,939
事務費	6,174	5,874
減価償却費	9,746	9,667
租税公課	1,689	1,770
貸倒引当金繰入れ	△387	—
その他	3,630	3,934
販売費・一般管理費計	99,775	92,381
営業利益	65,733	4,136
営業外収益		
受取利息	71	49
受取配当金	785	1,563
負ののれん償却額	—	1,141
持分法による投資利益	320	816
その他	957	63
営業外収益計	2,134	3,633
営業外費用		
支払利息	44	22
有価証券運用損	11	△112
為替差損	—	727
持分法による投資損失	△364	—
その他	285	114
営業外費用計	△22	753
経常利益	67,891	7,017

(単位：百万円)

	前第3四半期連結会計期間 (自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結会計期間 (自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)
特別利益		
投資有価証券売却益	33	2,114
その他	73	347
特別利益計	106	2,462
特別損失		
固定資産除売却損	65	75
投資有価証券評価損	2,252	35
その他	35	△48
特別損失計	2,353	62
税金等調整前四半期純利益	65,645	9,416
法人税、住民税及び事業税	5,418	1,743
法人税等調整額	23,998	3,608
法人税等合計	29,416	5,352
少数株主損益調整前四半期純利益	—	4,064
少数株主利益	9,862	2,882
四半期純利益	26,366	1,182

(3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前四半期純利益	87,573	1,657
減価償却費	32,430	32,067
のれん償却額	1,216	1,036
負ののれん償却額	—	△3,424
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	86	△658
受取利息及び受取配当金	△2,292	△4,108
支払利息	140	82
持分法による投資損益 (△は益)	△320	△2,007
固定資産除売却損益 (△は益)	584	627
投資有価証券売却損益 (△は益)	△287	△3,498
関係会社株式売却損益 (△は益)	—	△1,571
投資有価証券評価損益 (△は益)	3,229	828
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	△19,746	36,867
トレーディング商品の増減額	△1,318,939	108,002
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	155,217	35,441
営業貸付金の増減額 (△は増加)	3,266	△8,402
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	12,619	43,468
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	△484,684	713,431
短期貸付金の増減額 (△は増加)	409	△3,640
預り金の増減額 (△は減少)	11,701	△30,344
その他	41,778	△72,683
小計	△1,476,015	843,171
利息及び配当金の受取額	2,339	4,740
利息の支払額	△160	△88
法人税等の支払額又は還付額 (△は支払)	10,631	△24,453
営業活動によるキャッシュ・フロー	△1,463,205	823,370
投資活動によるキャッシュ・フロー		
定期預金の預入による支出	△213,426	△105,822
定期預金の払戻による収入	209,529	107,006
有価証券の取得による支出	△26,541	△42,407
有価証券の売却及び償還による収入	26,532	72,540
有形固定資産の取得による支出	△7,125	△4,421
無形固定資産の取得による支出	△22,019	△21,712
投資有価証券の取得による支出	△12,867	△11,564
投資有価証券の売却及び償還による収入	10,350	16,261
関係会社株式の取得による支出	△189,008	△16,962
営業譲受による支出	—	△96,511
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の取得による支出	△6,626	△516
貸付けによる支出	△1,384	△2,912
貸付金の回収による収入	7,720	2,317
その他	2,302	△125
投資活動によるキャッシュ・フロー	△222,563	△104,830

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入金の純増減額（△は減少）	1,788,084	△1,018,177
長期借入れによる収入	156,000	268,000
長期借入金の返済による支出	△35,720	△22,753
社債の発行による収入	81,146	294,815
社債の償還による支出	△66,963	△94,744
株式の発行による収入	175,130	—
自己株式の売却による収入	29,561	1,833
自己株式の取得による支出	—	△28,788
配当金の支払額	△12,781	△19,233
その他	△187	△23
財務活動によるキャッシュ・フロー	2,114,268	△619,070
現金及び現金同等物に係る換算差額	△1,732	△9,079
現金及び現金同等物の増減額（△は減少）	426,766	90,389
現金及び現金同等物の期首残高	415,600	753,982
新規連結に伴う現金及び現金同等物の増加額	96	—
連結除外に伴う現金及び現金同等物の減少額	—	△844
非連結子会社との合併に伴う現金及び現金同等物の増加額	—	306
現金及び現金同等物の四半期末残高	※1 842,463	※1 843,834

【四半期連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項等の変更】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)	
1	連結の範囲に関する事項の変更 (1) 連結の範囲の変更 第1四半期連結会計期間より、新規設立により1社を連結の範囲に含めております。 第2四半期連結会計期間より、新規設立により2社を連結の範囲に含め、重要性が低下したことにより1社を連結の範囲から除外しております。 当第3四半期連結会計期間において、新規設立により1社、株式の取得により1社を連結の範囲に含めております。 (2) 変更後の連結子会社の数 58社
2	持分法の適用に関する事項の変更 (1) 持分法適用関連会社の変更 第2四半期連結会計期間より、重要性が低下したことにより、1社を持分法適用の範囲から除外しております。 (2) 変更後の持分法適用関連会社の数 6社
3	会計処理基準に関する事項の変更 (1) 「持分法に関する会計基準」及び「持分法適用関連会社の会計処理に関する当面の取扱い」の適用 第1四半期連結会計期間より、「持分法に関する会計基準」（企業会計基準第16号 平成20年3月10日公表分）及び「持分法適用関連会社の会計処理に関する当面の取扱い」（実務対応報告第24号 平成20年3月10日）を適用し、連結決算上必要な修正を行っております。 なお、この変更による損益に与える影響はありません。 (2) 資産除去債務に関する会計基準の適用 第1四半期連結会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。 なお、この適用に伴い、当第3四半期連結累計期間の営業損失及び経常損失がそれぞれ19百万円増加し、税金等調整前四半期純利益が623百万円減少しております。 (3) 企業結合に関する会計基準等の適用 第1四半期連結会計期間より、「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）、「連結財務諸表に関する会計基準」（企業会計基準第22号 平成20年12月26日）、「『研究開発費等に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第23号 平成20年12月26日）、「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成20年12月26日）、「持分法に関する会計基準」（企業会計基準第16号 平成20年12月26日公表分）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）を適用しております。 (4) 配当金の収益計上方法の変更 市場価格のある株式の配当金については、従来、支払いを受けた日の属する連結会計期間に収益計上しておりましたが、第1四半期連結会計期間より、各銘柄の配当落ち日（配当権利付き最終売買日の翌日）をもって、公表されている予想配当額に基づいて未収配当金を見積もり計上する方法に変更しております。 この変更は、企業業績の回復等による増配を実施する企業の増加傾向の下、当該企業の配当金の収益計上の時期と当該企業株式の評価時点との整合性を確保し、経営成績をより適正に表示するために行ったものであります。 なお、この変更による損益に与える影響は軽微であります。

【表示方法の変更】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
(四半期連結損益計算書) 「連結財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第22号 平成20年12月26日)に基づく財務諸表等規則等の一部を改正する内閣府令(平成21年3月24日 内閣府令第5号)の適用により、当第3四半期連結累計期間では、「少数株主損益調整前四半期純損失(△)」の科目で表示しております。 (四半期連結キャッシュ・フロー計算書) 前第3四半期連結累計期間において、「財務活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に含めていた「自己株式の取得による支出」は重要性が増加したため、当第3四半期連結累計期間では区分掲記しております。 なお、前第3四半期連結累計期間の「財務活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に含まれる「自己株式の取得による支出」は△221百万円であります。

当第3四半期連結会計期間 (自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)
(四半期連結損益計算書) 「連結財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第22号 平成20年12月26日)に基づく財務諸表等規則等の一部を改正する内閣府令(平成21年3月24日 内閣府令第5号)の適用により、当第3四半期連結会計期間では、「少数株主損益調整前四半期純利益」の科目で表示しております。

【追加情報】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
(従業員持株E S O P信託に関する会計処理について) 当社は、当社グループ従業員の当社の業績に対する意識を高め、さらなる労働意欲向上を促すとともに、株式価値の向上を目指した業務遂行を一層促進することにより中長期的な企業価値の向上を図ることを目的とし、当社グループ従業員へのインセンティブ・プランとして「従業員持株E S O P信託」制度を導入しております。 当該制度は、当社が従業員持株会及び拡大従業員持株会(以下「持株会」という。)に加入するグループ従業員のうち一定の要件を充足する者を受益者とする信託(以下「当該信託口」という。)を設定し、当該信託口は今後5年間にわたり持株会が取得すると見込まれる数の当社株式を、予め定める取得可能期間内に取得し、その後、当該信託口から持株会に対し、毎月一定日に当社株式の売却を行うものであります。 当該信託口に関しては、信託期間満了時に信託収益がある場合には受益者たる持株会の会員等に金銭が分配される他益信託という法的形式及び契約を重視し、当該信託口で所有する当社株式の処分損益については第三者に帰属する取引として処理しておりますが、当該信託口の借入により負担する一切の債務について当社が保証していることから、当該信託口が所有する当社株式や当該信託口の資産及び負債については、自己の取引とみなして当第3四半期連結財務諸表に含めて計上しております。 なお、当第3四半期連結会計期間末において当該信託口が所有する当社株式の数及び金額は36,178千株及び14,155百万円であります。

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)	前連結会計年度末 (平成22年3月31日)																								
※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は120,111百万円であります。	※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は113,710百万円であります。																								
※2 担保に供されている資産	※2 担保に供されている資産																								
トレーディング商品 1,847,302百万円	トレーディング商品 2,723,331百万円																								
投資有価証券 22,607	投資有価証券 26,011																								
計 1,869,909	計 2,749,342																								
(注) 上記の金額は四半期連結貸借対照表計上額によっております。なお上記担保資産のほか、借り入れた有価証券等1,195,699百万円を担保として差し入れております。	(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。なお上記担保資産のほか、借り入れた有価証券等1,273,546百万円を担保として差し入れております。																								
3 差し入れた有価証券等の時価	3 差し入れた有価証券等の時価																								
消費貸借契約により貸し付けた有価証券 5,048,393百万円	消費貸借契約により貸し付けた有価証券 3,799,164百万円																								
現先取引で売却した有価証券 172,281	現先取引で売却した有価証券 546,121																								
その他 612,055	その他 521,876																								
計 5,832,731	計 4,867,161																								
(注) ※2担保に供されている資産に属するものは除いております。	(注) ※2担保に供されている資産に属するものは除いております。																								
4 差し入れを受けた有価証券等の時価	4 差し入れを受けた有価証券等の時価																								
消費貸借契約により借り入れた有価証券 8,205,073百万円	消費貸借契約により借り入れた有価証券 7,686,295百万円																								
その他 477,829	その他 357,909																								
計 8,682,902	計 8,044,204																								
※5 貸倒引当金10,904百万円は、債権額と相殺して表示しております。	※5 貸倒引当金10,714百万円は、債権額と相殺して表示しております。																								
6 保証債務	6 保証債務																								
<table><tr><td>被保証者</td><td>被保証債務の内容</td><td>金額 (百万円)</td></tr><tr><td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,606</td></tr><tr><td>その他 (2社)</td><td>債務</td><td>1,447</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>3,053</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	1,606	その他 (2社)	債務	1,447	合計		3,053	<table><tr><td>被保証者</td><td>被保証債務の内容</td><td>金額 (百万円)</td></tr><tr><td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,770</td></tr><tr><td>その他 (2社)</td><td>債務</td><td>731</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>2,501</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	1,770	その他 (2社)	債務	731	合計		2,501
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																							
従業員	借入金	1,606																							
その他 (2社)	債務	1,447																							
合計		3,053																							
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																							
従業員	借入金	1,770																							
その他 (2社)	債務	731																							
合計		2,501																							

(四半期連結損益計算書関係)

第3四半期連結累計期間

前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
※1 人件費には、賞与引当金繰入額26,049百万円が含まれております。	※1 人件費には、賞与引当金繰入額18,474百万円が含まれております。

第3四半期連結会計期間

前第3四半期連結会計期間 (自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結会計期間 (自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)
※1 人件費には、賞与引当金繰入額9,701百万円が含まれております。	※1 人件費には、賞与引当金繰入額4,544百万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)

前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
※1 現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係	※1 現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係
現金・預金勘定 755,526百万円	現金・預金勘定 831,357百万円
預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 Δ 13,063	預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 Δ 75,523
預入期間が3ヶ月 以内の譲渡性預金 100,000	預入期間が3ヶ月 以内の譲渡性預金 88,000
<u>現金及び現金同等物 842,463</u>	<u>現金及び現金同等物 843,834</u>

(株主資本等関係)

当第3四半期連結会計期間末(平成22年12月31日)及び当第3四半期連結累計期間(自平成22年4月1日至平成22年12月31日)

1 発行済株式の種類及び総数

普通株式 1,749,378千株

2 自己株式の種類及び株式数

普通株式 72,051千株

(注) 自己株式の数には、従業員持株E S O P信託口が取得した当社株式36,178千株を含めております。これは、当該従業員持株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ためであります。

3 新株予約権の四半期連結会計期間末残高

会社名	内訳	当第3四半期 連結会計期間末残高 (百万円)
提出会社	ストック・オプションとしての 新株予約権	4,189

4 配当に関する事項

(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
平成22年10月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,245	3	平成22年9月30日	平成22年12月1日

(注) 平成22年10月29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117百万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)

【事業の種類別セグメント情報】

前第3四半期連結会計期間(自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)及び前第3四半期連結累計期間(自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)

当企業集団は、①有価証券及びデリバティブ商品の売買等、②有価証券及びデリバティブ商品の売買等の委託の媒介、③有価証券の引受け及び売出し、④有価証券の募集及び売出しの取扱い、⑤有価証券の私募の取扱いなどの有価証券関連業を中心とする営業活動をグローバルに展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。従って、当企業集団の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しております。

【所在地別セグメント情報】

前第3四半期連結会計期間(自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)

	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	(百万円) 連結
純営業収益							
(1) 外部顧客からの 純営業収益	154,477	2,372	5,964	2,695	165,509	—	165,509
(2) セグメント間の 内部純営業収益	1,067	522	2,830	1,129	5,548	(5,548)	—
計	155,544	2,894	8,794	3,825	171,058	(5,548)	165,509
営業利益又は営業損失(△)	66,278	△106	△334	△382	65,455	278	65,733

- (注) 1 国または地域の区分の方法は、地理的近接度によっております。
2 各区分に属する主な国または地域
米州・・・・・・アメリカ
欧州・・・・・・イギリス、ドイツ、スイス、フランス
アジア・オセアニア・・・香港、シンガポール

前第3四半期連結累計期間(自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)

	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	(百万円) 連結
純営業収益							
(1) 外部顧客からの 純営業収益	319,161	8,581	23,921	8,347	360,011	—	360,011
(2) セグメント間の 内部純営業収益	3,783	3,218	7,459	3,418	17,879	(17,879)	—
計	322,944	11,799	31,381	11,765	377,891	(17,879)	360,011
営業利益又は営業損失(△)	81,966	2,658	3,490	△135	87,980	133	88,113

- (注) 1 国または地域の区分の方法は、地理的近接度によっております。
2 各区分に属する主な国または地域
米州・・・・・・アメリカ
欧州・・・・・・イギリス、ドイツ、スイス、フランス
アジア・オセアニア・・・香港、シンガポール

【海外売上高】

前第3四半期連結会計期間（自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	(百万円) 計
I 海外売上高 (純営業収益)	3,923	4,788	1,902	10,614
II 連結純営業収益				165,509
III 連結純営業収益に占める 海外売上高の割合(%)	2.4	2.9	1.1	6.4

- (注) 1 国または地域の区分の方法は、地理的近接度によっております。
 2 各区分に属する主な国または地域
 米州・・・・・・・・・・アメリカ
 欧州・・・・・・・・・・イギリス、ドイツ、スイス、フランス
 アジア・オセアニア・・・香港、シンガポール

前第3四半期連結累計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	(百万円) 計
I 海外売上高 (純営業収益)	13,110	16,489	6,452	36,053
II 連結純営業収益				360,011
III 連結純営業収益に占める 海外売上高の割合(%)	3.6	4.6	1.8	10.0

- (注) 1 国または地域の区分の方法は、地理的近接度によっております。
 2 各区分に属する主な国または地域
 米州・・・・・・・・・・アメリカ
 欧州・・・・・・・・・・イギリス、ドイツ、スイス、フランス
 アジア・オセアニア・・・香港、シンガポール

【セグメント情報】

(追加情報)

第1四半期連結会計期間より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(企業会計基準第17号 平成21年3月27日)及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日)を適用しております。

1. 報告セグメントの概要

当社グループの報告セグメントは、当社グループの構成単位のうち分離された財務情報が入手可能であり、当社の最高経営意思決定機関が、経営資源の配分の決定及び業績を評価するために、定期的に検討を行う対象となっているものであります。

当社グループは有価証券関連業を中核とし、これを支えるグループサポート事業との連携により総合的な金融サービスを提供しており、大和証券グループ本社において、連結子会社及び持分法適用関連会社の行う事業について、金融サービス別に国内及び海外の包括的な戦略を決定し、事業活動を展開しております。

従って、当社グループは個々の連結子会社及び持分法適用関連会社を基礎とした金融サービス別のセグメントから構成されており、経済的特徴が概ね類似しているセグメントを集約した「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」及び「投資部門」の5つを報告セグメントとしております。

リテール部門は、主に個人や未上場法人のお客様に幅広い金融商品・サービスを提供しております。グローバル・マーケット部門は、主に国内外の機関投資家や事業法人、金融法人、公共法人等のお客様向けに、株式、債券・為替及びそれらの派生商品のセールスとトレーディングを行っております。グローバル・インベストメント・バンキング部門は、国内外における有価証券の引受け、M&Aアドバイザリー等、多様なインベストメント・バンキング・サービスを提供しております。アセット・マネジメント部門は、さまざまな資産を投資対象とした投資信託の設定・運用を行っているほか、国内外の機関投資家に対し年金資産に関する投資助言・運用サービスを提供しております。投資部門は、プライベート・エクイティ投資を中心とした投資ビジネスを行っております。

2 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

当第3四半期連結累計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)

(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	99,529	65,916	26,968	44,155	4,745	241,316	△4,484	236,831
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	33,642	△13,956	△4,898	△16,982	△77	△2,272	19,045	16,772
計	133,171	51,960	22,070	27,173	4,667	239,043	14,560	253,603
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(△))	28,915	△30,617	△10,700	12,045	△620	△978	△6,215	△7,193

(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、売上原価及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

当第3四半期連結会計期間(自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)

(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	34,199	26,658	9,466	14,770	8,221	93,317	△3,622	89,694
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	11,216	△6,129	△1,828	△5,593	110	△2,224	1,396	△827
計	45,416	20,529	7,637	9,177	8,331	91,093	△2,225	88,867
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(△))	10,010	△8,847	△3,465	4,453	6,754	8,905	△2,804	6,100

(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、売上原価及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

3 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)

当第3四半期連結累計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)

(単位：百万円)

利益又は損失（△）	金額
報告セグメント計	△978
「その他」の区分の損失（△）	△6,215
セグメント間取引消去	△174
のれん及び負ののれんの償却額	3,176
未実現損益の調整額	1,713
その他の調整額	468
四半期連結損益計算書の経常損失（△）	△2,010

当第3四半期連結会計期間(自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)

(単位：百万円)

利益又は損失（△）	金額
報告セグメント計	8,905
「その他」の区分の損失（△）	△2,804
セグメント間取引消去	△81
のれん及び負ののれんの償却額	1,480
未実現損益の調整額	297
その他の調整額	△780
四半期連結損益計算書の経常利益	7,017

(有価証券関係)

1 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)		
	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	1,400	1,399	△0
その他	—	—	—
計	1,400	1,399	△0

2 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)		
	取得原価	四半期連結貸借 対照表計上額	差額
株券	103,720	121,205	17,485
債券	13,671	12,769	△901
国債・地方債等	—	—	—
社債	6,208	5,303	△905
その他	7,462	7,466	3
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	53,665	53,348	△316
その他	154,585	153,224	△1,360
計	325,642	340,549	14,906

(注) 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1,359百万円の減損処理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

1 トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)			
	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,492,998	336,469	4,088,584	297,628
為替予約取引	1,357,395	39,248	601,392	28,928
先物・先渡取引	783,282	11,346	476,656	56,816
スワップ取引	50,727,723	1,929,897	47,340,578	1,462,865
その他	1,278,651	31,496	1,194,387	30,443
リスクリザーブ	—	△13,766	—	—

2 トレーディングに係るものの以外

(単位：百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)		
	契約額等	時価	評価損益
為替予約取引	240	△0	△0
通貨スワップ取引	3,678	42	42

(注) ヘッジ会計が適用されているものは除いております。

(1株当たり情報)

1 1株当たり純資産額

当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)	前連結会計年度末 (平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 502.68円	1株当たり純資産額 530.27円

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	当第3四半期連結会計期間末 (平成22年12月31日)	前連結会計年度末 (平成22年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	927,158	1,017,528
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	83,999	90,365
(うち新株予約権(百万円))	(4,189)	(3,242)
(うち少数株主持分(百万円))	(79,809)	(87,123)
普通株式に係る四半期連結会計期間末(連結会計年度末)の純資産額(百万円)	843,159	927,163
1株当たり純資産額の算定に用いられた四半期連結会計期間末(連結会計年度末)の普通株式の数(千株)(注)	1,677,327	1,748,473

(注) 当第3四半期連結会計期間末の普通株式の数については、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当第3四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。

2. 1株当たり四半期純利益金額及び潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額

第3四半期連結累計期間

前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)
1株当たり四半期純利益金額 28.72円	1株当たり四半期純損失金額(△) △2.45円
潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額 28.68円	潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額 — 円

(注) 1 当第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であるため記載しておりません。

2 1株当たり四半期純利益金額又は四半期純損失金額(△)及び潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前第3四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22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(△)		
四半期純利益又は四半期純損失(△) (百万円)	46,227	△4,202
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又は四半期純損失(△)(百万円)	46,227	△4,202
普通株式の期中平均株式数(千株)(注)	1,609,827	1,712,999
(2) 潜在株式調整後1株当たり 四半期純利益金額		
四半期純利益調整額(百万円)	—	—
普通株式増加数(千株)	1,885	—
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	平成21年定時株主総会の決議によるもの(ii)の新株予約権 この概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況 (2)新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。	平成22年定時株主総会の決議によるもの(i)及び(ii)の新株予約権 この概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況 (2)新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。

(注) 当第3四半期連結累計期間の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当第3四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。

第3四半期連結会計期間

前第3四半期連結会計期間 (自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)		当第3四半期連結会計期間 (自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)	
1株当たり四半期純利益金額	15.08円	1株当たり四半期純利益金額	0.70円
潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	15.06円	潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	0.70円

(注) 1株当たり四半期純利益金額及び潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前第3四半期連結会計期間 (自 平成21年10月1日 至 平成21年12月31日)	当第3四半期連結会計期間 (自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額		
四半期純利益(百万円)	26,366	1,182
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(百万円)	26,366	1,182
普通株式の期中平均株式数(千株)(注)	1,748,445	1,687,465
(2) 潜在株式調整後1株当たり 四半期純利益金額		
四半期純利益調整額(百万円)	—	—
普通株式増加数(千株)	1,885	2,749
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	平成21年定時株主総会の決議によるもの(ii)の新株予約権 この概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況 (2) 新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。	平成22年定時株主総会の決議によるもの(ii)の新株予約権 この概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況 (2) 新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。

(注) 当第3四半期連結会計期間の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当第3四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3四半期連結会計期間(自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日)

該当事項はありません。

2 【その他】

(剰余金の配当)

平成22年10月29日開催の取締役会において、平成22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 5,245百万円
- 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22年12月1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117百万円が含まれております。
- 2 平成22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22年 2 月10日

株式会社大和証券グループ本社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 業務執行社員	公認会計士	堀 内	巧 印
-------------------	-------	-----	-----

指 定 社 員 業務執行社員	公認会計士	小 澤 陽 一 印
-------------------	-------	-----------

指 定 社 員 業務執行社員	公認会計士	福 井 淳 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21年4月1日から平成22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21年10月1日から平成21年12月31日まで)及び第3四半期連結累計期間(平成21年4月1日から平成21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及び四半期連結キャッシュ・フロー計算書について四半期レビューを行った。この四半期連結財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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により行われており、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限定された手続により行われた。

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21年12月31日現在の財政状態、同日をもって終了する第3四半期連結会計期間及び第3四半期連結累計期間の経営成績並びに第3四半期連結累計期間のキャッシュ・フローの状況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。

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おりません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

平成23年 2 月 7 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 福 井 淳 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 梅 津 広 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22年4月1日から平成23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22年10月1日から平成22年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成22年4月1日から平成22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及び四半期連結キャッシュ・フロー計算書について四半期レビューを行った。この四半期連結財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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により行われており、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限定された手続により行われた。

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22年12月31日現在の財政状態、同日をもって終了する第3四半期連結会計期間及び第3四半期連結累計期間の経営成績並びに第3四半期連結累計期間のキャッシュ・フローの状況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。

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。

