

# 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21年4月1日  
(第73期 I) 至 平成21年6月30日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第73期第1四半期（自平成21年4月1日 至平成21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73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】	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】	14
第4 【提出会社の状況】	15
1 【株式等の状況】	15
2 【株価の推移】	26
3 【役員の状況】	26
第5 【経理の状況】	27
1 【四半期連結財務諸表】	28
2 【その他】	43
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	44

## 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21年8月12日
【四半期会計期間】	第73期第1四半期 (自 平成21年4月1日 至 平成21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 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72期 前第1四半期 連結累計(会計)期間	第73期 当第1四半期 連結累計(会計)期間	第72期
会計期間	自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30日	自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日	自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日
営業収益 (百万円)	165,376	132,119	413,936
純営業収益 (百万円)	93,026	107,364	199,544
経常利益又は経常損失 (△) (百万円)	8,321	22,827	△141,150
四半期純利益 又は当期純損失 (△) (百万円)	5,885	17,870	△85,039
純資産額 (百万円)	1,089,393	1,107,811	952,329
総資産額 (百万円)	16,731,380	15,309,320	14,182,579
1株当たり純資産額 (円)	612.96	612.12	534.99
1株当たり四半期純利益金額 又は当期純損失金額 (△) (円)	4.37	13.27	△63.16
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額 (円)	4.36	13.26	—
自己資本比率 (%)	4.9	5.4	5.1
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	809,865	△104,299	1,519,387
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	34,346	△61,614	9,437
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△817,843	122,112	△1,459,438
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高 (百万円)	391,925	374,890	415,600
従業員数 (人)	15,705	15,733	15,224

- (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72期の潜在株式調整後1株当たり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1四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21年6月30日現在

従業員数(人)	15,733
---------	--------

(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501人を含めております。

### (2) 提出会社の状況

平成21年6月30日現在

従業員数(人)	299
---------	-----

(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1四半期連結会計期間において、財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の異常な変動等または、前事業年度の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1四半期連結会計期間において、経営上の重要な契約等は締結されておられません。

### 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1四半期連結会計期間におけるわが国の景気は、世界的な信用収縮が緩和され始めたことや在庫調整等の対策が進展したことを受け、アジア向けを中心とした輸出や素材、部品などを中心とした鉱工業生産が増加に転じ、回復に向かいました。経済の先行き不透明感が残るものの、雇用維持政策など即効性の高い政策が奏功し、雇用不安の緩和に寄与しました。しかしながら、企業業績をはじめ経済環境は依然として厳しく、平成20年度前半に比べると回復水準は低いものとどまる状況となっております。

このような収益環境のもと、当第1四半期連結会計期間の当社グループの営業収益は1,321億円（前年同四半期比20.1%減）となりました。

（百万円）

	前第1四半期連結会計期間 （自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30日）	当第1四半期連結会計期間 （自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日）	前年同四半期比 （%）
受入手数料	61,792	70,514	14.1
トレーディング損益	21,300	34,712	63.0
営業投資有価証券 関連損益	△1,007	△1,567	—
金融収益	69,748	16,815	△75.9
その他の売上高	13,541	11,644	△14.0
営業収益	165,376	132,119	△20.1
金融費用	62,343	15,508	△75.1
売上原価	10,006	9,247	△7.6
純営業収益	93,026	107,364	15.4

金融危機の影響が一巡し、金融機関のほか事業会社においても資本増強のニーズが高まり、株式市場の回復を受けて大型資金調達が増加するなど、受入手数料は705億円（同14.1%増）となりました。また、トレーディング損益は347億円（同63.0%増）と回復基調となりましたが、営業投資有価証券関連損益は投資案件に対する投資損失引当金を計上したことにより、15億円の損失となりました。金融収支は13億円（同82.3%減）、純営業収益は1,073億円（同15.4%増）となっております。

事業別の受入手数料の内訳は次のとおりです。

(百万円)

	前第1四半期連結会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30日)					
	エクイティ (株式関連)	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント (資産運用)	インベスト メント・ バンキング (投資銀行)	その他	合計
委託手数料	16,907	135	106	—	—	17,149
引受け・売出し・特定 投資家向け売付け勧誘 等の手数料	—	—	—	4,559	—	4,559
(株券等)	(—)	(—)	(—)	(1,297)	(—)	(1,297)
(債券等)	(—)	(—)	(—)	(3,259)	(—)	(3,259)
募集・売出し・特定投 資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料	—	—	7,247	418	—	7,666
その他の受入手数料	414	262	23,602	2,520	5,616	32,417
合計	17,321	398	30,956	7,499	5,616	61,792

	当第1四半期連結会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日)					
	エクイティ (株式関連)	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント (資産運用)	インベスト メント・ バンキング (投資銀行)	その他	合計
委託手数料	15,057	75	122	—	—	15,255
引受け・売出し・特定 投資家向け売付け勧誘 等の手数料	—	—	—	24,532	—	24,532
(株券等)	(—)	(—)	(—)	(20,786)	(—)	(20,786)
(債券等)	(—)	(—)	(—)	(3,648)	(—)	(3,648)
募集・売出し・特定投 資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料	—	—	7,237	61	—	7,298
その他の受入手数料	410	85	16,760	2,018	4,153	23,427
合計	15,467	160	24,120	26,612	4,153	70,514

	前年同四半期比 (%)					
	エクイティ (株式関連)	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント (資産運用)	インベスト メント・ バンキング (投資銀行)	その他	合計
委託手数料	△10.9	△44.4	15.4	—	—	△11.0
引受け・売出し・特定 投資家向け売付け勧誘 等の手数料	—	—	—	438.0	—	438.0
(株券等)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)	(—)
(債券等)	(—)	(—)	(—)	(11.9)	(—)	(11.9)
募集・売出し・特定投 資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料	—	—	△0.1	△85.4	—	△4.8
その他の受入手数料	△0.9	△67.6	△29.0	△19.9	△26.1	△27.7
合計	△10.7	△59.7	△22.1	254.9	△26.1	14.1

(注) 「有価証券関連業務の統一に関する規則」の一部改正(平成20年12月12日施行)に伴い、従来の「引受け・売出し手数料」は「引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料」、「募集・売出しの取扱手数料」は「募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料」に勘定科目をそれぞれ変更しております。

[エクイティ（株式関連）]

当第1四半期連結会計期間の東京証券取引所における株式の一日平均売買代金が1兆7,212億円（同31.8%減）と減少したことなどから、委託手数料は150億円（同10.9%減）となりました。受入手数料合計は154億円（同10.7%減）となっております。

[フィックス・インカム（債券）]

受入手数料は、委託手数料のほか、利金・償還金等の支払事務代行にかかる代理事務手数料等で構成されています。受入手数料合計は1億円（同59.7%減）となりました。

[アセット・マネジメント（資産運用）]

投資信託の事務代行手数料や信託報酬からなるその他受入手数料は、株式型投資信託の平均純資産残高の減少に伴う信託報酬の減少により、167億円（同29.0%減）となりました。受入手数料合計は241億円（同22.1%減）となっております。

[インベストメント・バンキング（投資銀行）]

受入手数料は、主に公募・売出しにかかる手数料のほか、M&A業務の手数料などで構成されています。当第1四半期連結会計期間は、大型引受案件の共同主幹事を務めたことなどから、株券等の引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は207億円と前年同四半期の12億円から大幅に増加し、受入手数料は合計で266億円（同254.9%増）となりました。

[その他]

主なものは、カストディ・フィー（保管手数料）、投資事業組合等運営報酬、個人年金保険の販売手数料であります。その他の受入手数料合計は41億円（同26.1%減）となりました。

（百万円）

	前第1四半期連結会計期間 （自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30日）	当第1四半期連結会計期間 （自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日）	前年同四半期比 （%）
純営業収益	93,026	107,364	15.4
販売費・一般管理費	88,446	86,552	△2.1
経常利益	8,321	22,827	174.3
四半期純利益	5,885	17,870	203.6

販売費・一般管理費は、取引関係費143億円（同20.4%減）、人件費399億円（同7.6%増）、不動産関係費105億円（同4.8%減）などにより、合計で865億円（同2.1%減）となりました。主な減少要因は、支払手数料の減少や、広告宣伝費や事務費などの削減によるものです。

経常利益は228億円（同174.3%増）と大幅に増加しております。

特別損失に投資有価証券評価損6億円などを計上したことにより、特別損益は純額で6億円の損失となりました。法人税等及び少数株主利益を加味した結果、四半期純利益は178億円（同203.6%増）となりました。

所在地別セグメントの業績は以下のとおりとなっております。

(百万円)

	前第1四半期連結会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30日)						
	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	連結
純営業収益	81,404	4,286	6,934	3,842	96,467	(3,441)	93,026
営業利益又は 営業損失(△)	3,400	1,107	△98	170	4,580	(0)	4,580

	当第1四半期連結会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日)						
	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	連結
純営業収益	91,355	5,662	13,184	3,774	113,976	(6,611)	107,364
営業利益	15,219	2,550	2,896	153	20,820	(7)	20,812

<国内>

国内主要グループ会社の動向は次のとおりです。

(百万円)

	大和証券		大和証券エスエムビーシー (連結)		大和証券投資信託委託	
	前第1四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間	前第1四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間	前第1四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間
営業収益	48,365	49,043	43,581	64,358	20,330	14,544
経常利益又は 経常損失(△)	12,364	11,135	△12,473	10,177	4,363	2,187
四半期純利益又は 四半期純損失(△)	8,021	6,437	△11,254	10,135	2,591	1,177

リテール証券業務を営む大和証券の営業収益は490億円(同1.4%増)、経常利益は111億円(同9.9%減)となりました。個人の株式売買が減少したことにより、エクイティを中心とする委託手数料は94億円(同6.5%減)となる一方、大型エクイティ・ファイナンス案件により、募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は154億円(同68.1%増)となりました。その他受入手料は、投資信託の代理事務手数料が減少したことから117億円(同27.3%減)となっております。トレーディング損益は109億円(同1.5%減)となりました。また、ダイワFX(外国為替証拠金取引)の売買代金は過去最高の約2.3兆円となっており、平成21年6月末の口座数は約3万口座となりました。

ホールセール証券業務を営む大和証券エスエムビーシー(連結)の営業収益は643億円(同47.7%増)となりました。エクイティ・ファイナンス案件収益の大幅な増加などに伴い、投資銀行業務が好調となったことや、金融市場の正常化に伴う収益環境の改善により、トレーディングが好調であったことなどから、経常利益は101億円(前年同四半期は124億円の経常損失)となりました。

アセット・マネジメント業務を営む大和証券投資信託委託では、株式型投資信託の平均純資産残高が前年同四半期比で減少したことから信託報酬が減少しました。その結果、経常利益は21億円(同49.9%減)となりました。

また、その他の国内主要グループ会社の経常利益又は経常損失は以下のとおりです。

(百万円)

	大和総研3社 (注1)		大和住銀投信投資顧問		大和SMB Cキャピタル (注2)	
	前第1四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間	前第1四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間	前第1四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間
経常利益又は 経常損失(△)	3,387	1,365	1,114	393	770	△ 2,971

(注) 1 大和総研ホールディングス、大和総研及び大和総研ビジネス・イノベーションの合計（内部取引及び配当の受取りを除く）。

2 エヌ・アイ・エフSMB Cベンチャーズは、平成20年10月1日付で大和SMB Cキャピタルに商号変更しております。

#### <海外>

米州の営業利益は、株式の委託手数料の増加や債券・為替等トレーディングの好調により、25億円（同130.2%増）となりました。欧州の営業利益は、投資銀行業務やトレーディング業務が好調で、28億円（前年同四半期は0.9億円の営業損失）となりました。アジア・オセアニアの営業利益は、金融収支の減少などにより、1億円（同9.7%減）となりました。海外合計の営業利益は56億円（同374.7%増）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15兆3,093億円（前連結会計年度末比1兆1,267億円増）となりました。内訳は流動資産が14兆7,945億円（同1兆1,175億円増）であり、このうちトレーディング商品が6兆6,732億円（同4,694億円増）、有価証券担保貸付金が5兆9,089億円（同4,953億円増）となっております。固定資産は5,148億円（同92億円増）となっております。

### <負債の部・純資産の部>

負債合計は14兆2,015億円（同9,712億円増）となりました。内訳は流動負債が12兆6,875億円（同9,897億円増）であり、このうちトレーディング商品が4兆8,578億円（同487億円増）、有価証券担保借入金が4兆9,951億円（同1,019億円増）となっております。固定負債は1兆5,095億円（同185億円減）であり、このうち社債が1兆2,432億円（同172億円減）となっております。

純資産合計は1兆1,078億円（同1,554億円増）となりました。利益剰余金は四半期純利益による178億円の増加や配当金支払いによる40億円の減少の結果、4,356億円（同138億円増）となりました。その他有価証券評価差額金は1,373億円（同856億円増）、少数株主持分は2,813億円（同516億円増）となりました。

## (2) キャッシュ・フローの状況

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の増加などにより1,042億円の減少（前年同四半期は8,098億円の増加）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、定期預金の増加などにより616億円の減少（同343億円の増加）となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金の増加などにより1,221億円の増加（同8,178億円の減少）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1四半期連結会計期間末の現金及び現金同等物の残高は、前連結会計年度末に比べ407億円減少し、3,748億円となりました。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第1四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) 重要な会計方針及び見積もり

当社の四半期連結財務諸表は、わが国において一般に公正妥当と認められる会計基準に基づき作成されております。また、当社は、四半期連結財務諸表を作成するにあたり、会計方針に基づいていくつかの重要な見積もりを行っており、これらの見積もりは一定の条件や仮定を前提としております。そのため、条件や仮定が変化した場合には、実際の結果が見積もりと異なることがあり、結果として四半期連結財務諸表に重要な影響を与える場合があります。重要な会計方針のうち、特に重要と考える項目は、次の4項目です。

① 金融商品の評価

当社グループでは、トレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引は、時価をもって貸借対照表価額とし、評価損益はトレーディング損益として損益計算書に計上しております。評価に用いる時価は、市場で取引が行われている有価証券やデリバティブ取引については当第1四半期連結会計期間末時点の市場価格を、市場価格のない有価証券やデリバティブ取引については理論価格を、それぞれ使用しております。理論価格を算出する際には、対象となる商品や取引について最も適切と考えられるモデルを採用しております。

② 有価証券の減損

当社グループでは、投資有価証券等のトレーディング商品に属さない有価証券も保有しております。このうち時価のある有価証券については、時価が著しく下落し、かつ、回復する見込みがないと判断した場合には、減損処理を行っております。具体的には、当第1四半期連結会計期間末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は、著しい下落かつ回復する見込みがないと判断して、減損処理を行っております。時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、時価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復する見込みを検討し、回復する見込みがないと判断したもののについては、減損処理を行っております。また、時価のない有価証券については、実質価額が著しく低下し、かつ、回復する見込みがないと判断した場合には、減損処理を行っております。

③ 固定資産の減損

当社グループでは、各資産グループにおいて、収益性が著しく低下した資産については、当該資産の帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失と計上しております。なお、資産のグルーピングは、継続使用資産のうち、証券店舗など個別性の強い資産については個別物件単位で行い、その他の事業用資産については管理会計上の区分に従って行っております。

#### ④ 繰延税金資産の回収可能性

当社グループでは、税務上の繰越欠損金や、企業会計上の資産・負債と税務上の資産・負債との差額である一時差異について税効果会計を適用し、繰延税金資産及び繰延税金負債を計上しております。繰延税金資産の回収可能性については、将来の合理的な見積可能期間における課税所得の見積額を限度として、当該期間における一時差異等のスケジューリングの結果に基づき判断しております。

### (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1四半期連結会計期間のマクロ経済環境>

##### ① 海外の状況

平成20年9月の米国大手投資銀行リーマン・ブラザーズの経営破綻を契機として急速な悪化を続けていた世界の主要国の景況感は、平成21年1-3月期を最悪期として、徐々に改善の兆しを見せ始めています。その背景としては、これまで世界各国の実体経済を下振れさせる要因となっていた過度の信用収縮、すなわち金融機関の融資態度の厳格化、LIBORの急騰等に起因する市場からの資金調達難、さらに新興国における外国資本の逃避等の事象が、各国が協調的に実施した大規模な金融緩和策の下で次第に解消され始めたことが挙げられます。

また、主要金融機関の破綻に対する懸念や、銀行システムの健全性に対する根強い不信感が、平成21年5月に米国金融当局により公表された大手金融機関を対象としたストレステスト（健全性審査）の結果を受けてある程度解消されるとともに、資本不足と判断された各金融機関が市場を通じて速やかに資本増強を実施したことも、金融危機の深刻化に歯止めをかける結果となりました。

昨年10月以来、各国において、有事の対応として、中央銀行による金利引き下げや量的緩和、政府による大量の国債発行を伴った財政出動等が、大規模かつ迅速に行われてきました。そして、こうした経済対策により、金融市場と実体経済の連鎖的な悪化に一定の歯止めがかけられてきたといえます。しかしながら、他方では大規模な流動性の供給によりインフレ懸念が高まったり、財政悪化の懸念から米国の長期金利が大きく上昇するなど、経済対策の副作用も生じ始めています。そのため各国においては、有事に対応するための金融財政政策をいかに秩序立てて収束させるかという戦略を構築するとともに、財政再建への道筋を策定する必要性が生じてきているといえます。

##### ② 日本の状況

日本国内の実体経済は、平成20年9月から平成21年2月にかけて急速な悪化を続けましたが、平成21年3月以降は、世界的な信用収縮が次第に緩和され始めたことや、各企業における在庫調整等の対策が進展したことを受けて、アジア向けの輸出や、素材や部品等を中心とした鉱工業生産が増加傾向に転じ、国内の景況感も次第に改善の兆しを見せ始めています。また、平成20年夏以降に相次いで実施された三度にわたる経済対策に続き、平成21年4月には15.4兆円規模の財政支出を伴う大型の「経済危機対策」が打ち出されました。経済の先行き不透明感は依然として払拭されてはいないものの、雇用維持対策等の即効性の高い政策が奏功し、雇用不安の緩和に寄与しました。また、低燃費車やグリーン家電の普及促進策は、鉱工業生産を押し上げたほか、消費者マインドや個人消費の持ち直しにも寄与しました。

政府は、平成21年4月の経済指標に基づき、6月の「月例経済報告」の基調判断から“悪化”という表現を削除し、事実上の景気底打ち宣言をしました。また、6月調査の日銀短観においても2年半ぶりに業況の改善が見られました。

このように、日本国内の実体経済は、輸出や鉱工業生産の回復を牽引役として改善し始めましたが、平成20年度前半に比べると依然としてその回復は低い水準にとどまっています。6月調査の日銀短観にみる企業の生産設備や雇用の水準は、平成21年度設備投資計画では前年度比17.1%減、新卒採用の増減率では平成21年度が8.2%減、平成22年度が23.0%減の大幅削減が予定されるなど、足元における過剰感が強まっています。以上のように、輸出や鉱工業生産の回復の一方で、設備投資や個人消費といった内需の回復力が懸念される状況となっています。

## (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活動を行っております。

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、商業・ペーパー、コールマネー、現先取引、レポ取引等の方法があり、これらの方法を適切に組み合わせることにより、効率的な資金調達の実現を図っております。

一方で、財務の安定性の確保も重視しております。当社グループでは、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たすことのないよう、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、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するとともに、調達資金の借換えが困難となる場合も想定し、資金調達に際しては中長期の安定的資金の占める割合を高めるようにしております。

なお、当社グループは、グループ全体で、現金・預金、国債等の換金性の高い有価証券等により構成される合計1兆1,162億円（当第1四半期連結会計期間末）のポートフォリオを保有しております。

#### <グループ全体の資金管理>

グループ全体の流動性は、当社が一元的に管理・モニタリングしております。国内外の証券子会社等（大和証券、大和証券エスエムビーシー、大和SMB Cキャピタル、大和証券SMB Cヨーロッパ等）については各社が独自に資金調達と流動性の管理を行っておりますが、当社は、その状況を常にモニタリングし、必要があれば当社から資金を供給できる体制を整えております。その他の子会社については、当社が一元的に資金調達を行い、当社から各社に資金を配分することで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。

また、金融市場の混乱等により調達資金の借換えが困難となるリスクを想定し、短期の無担保調達資金に対し、手元流動性及び調達余力が十分に確保できている状態を保てるよう常にモニタリングを行っております。

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無担保資金調達の状況は次のとおりです。

当第1四半期連結会計期間末の当社グループの無担保資金調達状況

(億円)

	銀行等からの短期借入	2,325
	その他の短期借入	4,025
	コマーシャル・ペーパー	4,201
	1年以内償還予定の社債	155
(短期)無担保資金調達		10,708
	銀行等からの長期借入	2,355
	社債	12,432
(長期)無担保資金調達		14,787
株主資本合計		7,101
合計		32,597

(注) 上記のほか、日本銀行の共通担保オペを利用した資金調達があります。

<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、コンティンジェンシー・プランを策定しております。これによって、市場環境の激変や想定外のクレジット・クランチ等が発生し、短期の無担保資金調達が困難になった場合にも、十分な流動性を確保できるものと考えております。

大和証券エスエムビーシーは、トレーディング・ポジションを中心とする流動資産の保有に伴う資金調達額が大きいため、同社のコンティンジェンシー・プランは、当社グループにとって最も重要です。同社では、短期の無担保資金調達が困難となった場合、自己資本、長期の無担保資金調達可能額及びその時点における短期の無担保資金調達可能額の合計金額の範囲内まで、トレーディング・ポジションの圧縮を図ることとしております。

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・ライン契約を結んでおります。

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、前連結会計年度末に比べて138億円増加し、7,101億円となっております。資本金及び資本剰余金の合計は3,360億円であり、当第1四半期連結会計期間における変動はありませんでした。利益剰余金は四半期純利益178億円の計上や配当金支払いによる40億円の減少の結果、前連結会計年度末比138億円増加して4,356億円となっております。自己株式の控除額は前連結会計年度末と比べほぼ変動はなく615億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エスエムビーシーには、国内外の大手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などの事業環境、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エスエムビーシーであります。

平成21年8月5日現在における当社、大和証券及び大和証券エスエムビーシーの格付は次のとおりであります。

#### 当社

格付会社	長期格付	短期格付
Moody's Investors Service	Baa1	—
Standard & Poor's	BBB+	A-2
格付投資情報センター	A	a-1
日本格付研究所	A+	—

#### 大和証券

格付会社	長期格付	短期格付
Moody's Investors Service	Baa1	—
Standard & Poor's	BBB+	A-2
格付投資情報センター	A	—
日本格付研究所	A+	—

#### 大和証券エスエムビーシー

格付会社	長期格付	短期格付
Moody's Investors Service	A1	P-1
Standard & Poor's	A	A-1
格付投資情報センター	A+	a-1

### 第3 【設備の状況】

(1) 主要な設備の状況

当第1四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

前連結会計年度末において、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1四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1四半期会計期間 末現在発行数(株) (平成21年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成21年8月12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	1,404,664,772	1,749,307,772	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	1,404,664,772	1,749,307,772	—	—

(注) 「提出日現在発行数」欄には、平成21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】

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」といいます）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1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30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 756
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 756 資本組入額 378
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1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30日)
新株予約権の数(個)	504
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)	504,000
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	<ol style="list-style-type: none"> <li>1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
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1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30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 781
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 781 資本組入額 391
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1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30日)
新株予約権の数(個)	293
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)	293,000
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	<ol style="list-style-type: none"> <li>1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
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」欄には、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日開催の執行役員会において決議されたものであります。

	第1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30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)	85
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 1,515
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 1,515 資本組入額 758
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」欄には、株式の発行価格1,515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1,008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1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30日)
新株予約権の数(個)	306
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)	306,000
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	<ol style="list-style-type: none"> <li>1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
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」欄には、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日開催の執行役員会において決議されたものであります。

	第1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30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)	54
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 1,224
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 1,224 資本組入額 612
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」欄には、株式の発行価格1,224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787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員において決議されたものであります。

	第1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30日)
新株予約権の数(個)	350
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)	350,000
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」欄には、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日開催の執行役員会において決議されたものであります。

	第1四半期会計期間末現在 (平成21年6月30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)	22
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 917
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 917 資本組入額 459
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」欄には、株式の発行価格917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581円となります。

(3) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

(4) 【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)
自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日	—	1,404,664	—	178,324	—	157,678

(注) 1 一般募集

平成21年7月15日を払込期日とする一般募集による増資により、発行済株式総数が302,635千株、資本金が58,652百万円、資本準備金が58,652百万円それぞれ増加しております。なお、募集による新株発行と同時に、自己株式の処分による普通株式57,865千株の売出しを行っております。

2 第三者割当増資

平成21年8月11日を払込期日とするSMB Cフレンド証券株式会社への第三者割当増資により、発行済株式総数が42,000千株、資本金が10,389百万円、資本準備金が10,389百万円それぞれ増加しております。

3 新株予約権

平成21年7月1日から平成21年7月31日までの間に、新株予約権の行使により、発行済株式総数が8千株、資本金が2百万円、資本準備金2百万円それぞれ増加しております。

(5) 【大株主の状況】

当第1四半期会計期間において、大株主の異動は把握しておりません。

(6) 【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21年3月31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21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 58,316,000	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,342,796,000	1,341,946	—
単元未満株式	普通株式 3,552,772	—	—
発行済株式総数	1,404,664,772	—	—
総株主の議決権	—	1,341,946	—

(注) 1 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、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850,000株(議決権850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 「単元未満株式」欄の株式数には、当社所有の自己株式760株が含まれております。

## ② 【自己株式等】

平成21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	58,316,000	—	58,316,000	4.15
計	—	58,316,000	—	58,316,000	4.15

(注) 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850,000株(議決権850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 【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21年 4月	5月	6月
最高(円)	557	647	741
最低(円)	445	509	563

(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変動は、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

退任執行役

役名	職名	氏名	退任年月日
執行役	米州部門副担当	森 剛 朗	平成21年6月30日

## 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1四半期連結累計期間（平成20年4月1日から平成20年6月30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1四半期連結会計期間（平成21年4月1日から平成21年6月30日まで）及び当第1四半期連結累計期間（平成21年4月1日から平成21年6月30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1四半期連結累計期間（平成20年4月1日から平成20年6月30日まで）に係る四半期連結財務諸表について、また、当第1四半期連結会計期間（平成21年4月1日から平成21年6月30日まで）及び当第1四半期連結累計期間（平成21年4月1日から平成21年6月30日まで）に係る四半期連結財務諸表について、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)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金	417,633	409,709
預託金	307,816	214,455
受取手形及び売掛金	9,700	11,146
有価証券	50,579	48,920
トレーディング商品	※2 6,673,237	※2 6,203,742
商品有価証券等	4,316,147	3,564,001
デリバティブ取引	2,357,090	2,639,740
約定見返勘定	—	143,309
営業投資有価証券	※2 746,165	※2 547,006
投資損失引当金	△26,893	△31,237
営業貸付金	70,891	69,592
仕掛品	1,586	897
信用取引資産	259,351	248,059
信用取引貸付金	117,632	79,094
信用取引借証券担保金	141,719	168,964
有価証券担保貸付金	5,908,925	5,413,525
借入有価証券担保金	5,908,925	5,413,525
立替金	7,242	21,662
短期貸付金	1,487	1,869
未収収益	30,509	27,033
繰延税金資産	4,517	3,784
その他の流動資産	331,977	343,758
貸倒引当金	△215	△232
流動資産計	14,794,515	13,677,003
固定資産		
有形固定資産	※1 149,885	※1 150,201
無形固定資産	110,221	110,828
その他	110,221	110,828
投資その他の資産	254,698	244,545
投資有価証券	※2 183,113	※2 167,883
長期貸付金	17,962	18,432
長期差入保証金	25,788	26,091
繰延税金資産	13,245	16,328
その他	※5 22,342	※5 22,904
貸倒引当金	※5 △7,755	※5 △7,094
固定資産計	514,805	505,576
資産合計	15,309,320	14,182,579

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
<b>負債の部</b>		
流動負債		
支払手形及び買掛金	3,452	4,182
トレーディング商品	4,857,827	4,809,092
商品有価証券等	3,013,381	2,644,720
デリバティブ取引	1,844,445	2,164,372
約定見返勘定	488,291	—
信用取引負債	134,050	133,872
信用取引借入金	6,663	3,852
信用取引貸証券受入金	127,386	130,020
有価証券担保借入金	4,995,195	4,893,261
有価証券貸借取引受入金	4,230,042	4,228,519
現先取引借入金	765,152	664,742
預り金	245,786	138,669
受入保証金	284,926	339,891
短期借入金	978,689	936,149
コマーシャル・ペーパー	420,180	320,400
1年内償還予定の社債	15,541	11,632
未払法人税等	3,073	1,822
繰延税金負債	102,377	17,693
賞与引当金	10,316	12,527
その他の流動負債	147,834	78,555
流動負債計	12,687,542	11,697,751
固定負債		
社債	1,243,260	1,260,526
長期借入金	235,521	237,867
繰延税金負債	1,884	927
退職給付引当金	26,099	25,474
訴訟損失引当金	281	365
その他の固定負債	2,502	2,920
固定負債計	1,509,549	1,528,081
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	4,416	4,416
特別法上の準備金計	4,416	4,416
負債合計	14,201,509	13,230,249

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
<b>純資産の部</b>		
株主資本		
資本金	178,324	178,324
資本剰余金	157,678	157,678
利益剰余金	435,646	421,819
自己株式	△61,526	△61,525
株主資本合計	710,122	696,296
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	※7 137,374	※7 51,751
繰延ヘッジ損益	640	498
為替換算調整勘定	△24,027	△28,274
評価・換算差額等合計	113,986	23,975
新株予約権	2,374	2,369
少数株主持分	281,326	229,688
純資産合計	1,107,811	952,329
負債・純資産合計	15,309,320	14,182,579

(2) 【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20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
営業収益		
受入手数料	61,792	70,514
トレーディング損益	21,300	34,712
株券等トレーディング損益	21,033	14,685
債券・為替等トレーディング損益	266	20,026
営業投資有価証券関連損益	△1,007	△1,567
金融収益	69,748	16,815
その他の売上高	13,541	11,644
営業収益計	165,376	132,119
金融費用	62,343	15,508
売上原価	10,006	9,247
純営業収益	93,026	107,364
販売費・一般管理費		
取引関係費	18,013	14,346
人件費	※1 37,120	※1 39,938
不動産関係費	11,082	10,555
事務費	7,836	6,350
減価償却費	8,252	9,506
租税公課	1,816	2,113
貸倒引当金繰入れ	1,157	280
その他	3,167	3,460
販売費・一般管理費計	88,446	86,552
営業利益	4,580	20,812
営業外収益		
受取利息	63	74
受取配当金	2,475	1,211
持分法による投資利益	188	—
その他	1,416	1,528
営業外収益計	4,143	2,814
営業外費用		
支払利息	36	48
デリバティブ評価損	136	—
持分法による投資損失	—	526
その他	228	223
営業外費用計	402	798
経常利益	8,321	22,827

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
<b>特別利益</b>		
投資有価証券売却益	—	233
金融商品取引責任準備金戻入	402	—
新株予約権戻入益	—	110
その他	59	29
特別利益計	462	373
<b>特別損失</b>		
固定資産除売却損	162	233
投資有価証券評価損	—	624
関係会社株式評価損	155	—
貸倒引当金繰入額	2,270	—
その他	441	194
特別損失計	3,029	1,053
税金等調整前四半期純利益	5,754	22,148
法人税、住民税及び事業税	4,830	3,181
法人税等調整額	△1,011	△1,477
法人税等合計	3,819	1,703
少数株主利益又は少数株主損失(△)	△3,950	2,574
四半期純利益	5,885	17,870

## (3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
<b>営業活動によるキャッシュ・フロー</b>		
税金等調整前四半期純利益	5,754	22,148
減価償却費	9,551	10,632
のれん償却額	—	257
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	3,421	302
金融商品取引責任準備金の増減額 (△は減少)	△402	—
受取利息及び受取配当金	△2,538	△1,285
支払利息	36	48
持分法による投資損益 (△は益)	△188	526
固定資産除売却損益 (△は益)	162	233
投資有価証券売却損益 (△は益)	—	△100
投資有価証券評価損益 (△は益)	—	624
関係会社株式評価損	155	—
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	19,515	△100,716
トレーディング商品の増減額	2,045,082	212,240
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	6,530	10,531
営業貸付金の増減額 (△は増加)	△5,460	△1,326
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	△21,265	△11,114
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	△1,412,298	△363,351
短期貸付金の増減額 (△は増加)	124,025	419
預り金の増減額 (△は減少)	27,043	107,298
その他	26,862	13,293
小計	825,989	△99,338
利息及び配当金の受取額	2,577	1,311
利息の支払額	△30	△58
法人税等の支払額	△18,670	△6,214
営業活動によるキャッシュ・フロー	809,865	△104,299
<b>投資活動によるキャッシュ・フロー</b>		
定期預金の預入による支出	△30,701	△46,865
定期預金の払戻による収入	81,978	3,392
有価証券の取得による支出	△2,139	△14,290
有価証券の売却及び償還による収入	3,125	7,796
有形固定資産の取得による支出	△3,039	△3,432
無形固定資産の取得による支出	△9,244	△6,375
投資有価証券の取得による支出	△5,065	△4,445
投資有価証券の売却及び償還による収入	511	3,497
子会社株式の取得による支出	—	△2,510
貸付けによる支出	△3,058	△242
貸付金の回収による収入	944	932
その他	1,034	929
投資活動によるキャッシュ・フロー	34,346	△61,614

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30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)	△841,695	138,835
長期借入れによる収入	2,500	16,000
長期借入金の返済による支出	△11,253	△15,512
社債の発行による収入	74,625	13,723
社債の償還による支出	△28,214	△26,896
配当金の支払額	△13,463	△4,039
その他	△342	0
財務活動によるキャッシュ・フロー	△817,843	122,112
現金及び現金同等物に係る換算差額	5,496	3,092
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	31,864	△40,709
現金及び現金同等物の期首残高	359,851	415,600
新規連結に伴う現金及び現金同等物の増加額	209	—
現金及び現金同等物の四半期末残高	※1 391,925	※1 374,890

【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1四半期連結会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日)
<p>1 会計処理基準に関する事項の変更</p> <p>(1) 連結財務諸表における子会社及び関連会社の範囲の決定に関する適用指針の適用</p> <p>当第1四半期連結会計期間より、「連結財務諸表における子会社及び関連会社の範囲の決定に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第22号 平成20年5月13日)を適用しております。</p> <p>なお、この変更による損益に与える影響はありません。</p> <p>(2) 完成工事高及び完成工事原価の計上基準の変更</p> <p>一部の国内連結子会社における受注制作ソフトウェアにかかる収益の計上基準については、従来、工事完成基準を適用しておりましたが、当第1四半期連結会計期間より「工事契約に関する会計基準」(企業会計基準第15号 平成19年12月27日)及び「工事契約に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第18号 平成19年12月27日)を適用しております。これにより、当第1四半期連結会計期間に着手した請負契約から、当第1四半期連結会計期間末までの進捗部分について成果の確実性が認められる場合については工事進行基準(工事の進捗率の見積もりは原価比例法)を、その他の場合については工事完成基準を適用しております。</p> <p>なお、この変更による損益に与える影響はありません。</p>

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末 (平成21年3月31日)																																																																				
<p>※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は107,565百万円であります。</p> <p>※2 担保に供されている資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">トレーディング商品</td> <td style="text-align: right;">808,242百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">営業投資有価証券</td> <td style="text-align: right;">14</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">投資有価証券</td> <td style="text-align: right;">66,579</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">874,835</td> </tr> </table> <p>(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に、借り入れた有価証券等199,041百万円を担保として差し入れております。</p> <p>※3 差し入れた有価証券等の時価</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td> <td style="text-align: right;">4,488,629百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">現先取引で売却した有価証券</td> <td style="text-align: right;">771,387</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">537,588</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">5,797,605</td> </tr> </table> <p>(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。</p> <p>4 差し入れを受けた有価証券等の時価</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">消費貸借契約により借り入れた有価証券</td> <td style="text-align: right;">6,640,198百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">396,393</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">7,036,591</td> </tr> </table> <p>※5 貸倒引当金9,278百万円は、債権額と相殺して表示しております。</p> <p>6 保証債務</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; text-align: center;"> <thead> <tr> <th style="width: 20%;">被保証者</th> <th style="width: 40%;">被保証債務の内容</th> <th style="width: 40%;">金額 (百万円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>従業員</td> <td>借入金</td> <td>1,976</td> </tr> <tr> <td>その他(2社)</td> <td>債務</td> <td>860</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td></td> <td style="border-top: 1px solid black;">2,837</td> </tr> </tbody> </table> <p>※7 その他有価証券評価差額金には、「種類株式の貸借対照表価額に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第10号)に基づく種類株式にかかる118,250百万円が含まれております。</p>	トレーディング商品	808,242百万円	営業投資有価証券	14	投資有価証券	66,579	計	874,835	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	4,488,629百万円	現先取引で売却した有価証券	771,387	その他	537,588	計	5,797,605	消費貸借契約により借り入れた有価証券	6,640,198百万円	その他	396,393	計	7,036,591	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	1,976	その他(2社)	債務	860	合計		2,837	<p>※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は104,760百万円であります。</p> <p>※2 担保に供されている資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">トレーディング商品</td> <td style="text-align: right;">423,145百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">営業投資有価証券</td> <td style="text-align: right;">14</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">投資有価証券</td> <td style="text-align: right;">61,960</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">485,119</td> </tr> </table> <p>(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に、借り入れた有価証券等165,159百万円を担保として差し入れております。</p> <p>3 差し入れた有価証券等の時価</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td> <td style="text-align: right;">4,448,294百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">現先取引で売却した有価証券</td> <td style="text-align: right;">671,022</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">592,975</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">5,712,292</td> </tr> </table> <p>(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。</p> <p>4 差し入れを受けた有価証券等の時価</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">消費貸借契約により借り入れた有価証券</td> <td style="text-align: right;">5,761,634百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">388,890</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">6,150,524</td> </tr> </table> <p>※5 貸倒引当金9,312百万円は、債権額と相殺して表示しております。</p> <p>6 保証債務</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; text-align: center;"> <thead> <tr> <th style="width: 20%;">被保証者</th> <th style="width: 40%;">被保証債務の内容</th> <th style="width: 40%;">金額 (百万円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>従業員</td> <td>借入金</td> <td>2,197</td> </tr> <tr> <td>その他(2社)</td> <td>債務</td> <td>840</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td></td> <td style="border-top: 1px solid black;">3,037</td> </tr> </tbody> </table> <p>※7 その他有価証券評価差額金には、「種類株式の貸借対照表価額に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第10号)に基づく種類株式にかかる47,108百万円が含まれております。</p>	トレーディング商品	423,145百万円	営業投資有価証券	14	投資有価証券	61,960	計	485,119	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	4,448,294百万円	現先取引で売却した有価証券	671,022	その他	592,975	計	5,712,292	消費貸借契約により借り入れた有価証券	5,761,634百万円	その他	388,890	計	6,150,524	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	2,197	その他(2社)	債務	840	合計		3,037
トレーディング商品	808,242百万円																																																																				
営業投資有価証券	14																																																																				
投資有価証券	66,579																																																																				
計	874,835																																																																				
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	4,488,629百万円																																																																				
現先取引で売却した有価証券	771,387																																																																				
その他	537,588																																																																				
計	5,797,605																																																																				
消費貸借契約により借り入れた有価証券	6,640,198百万円																																																																				
その他	396,393																																																																				
計	7,036,591																																																																				
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																																			
従業員	借入金	1,976																																																																			
その他(2社)	債務	860																																																																			
合計		2,837																																																																			
トレーディング商品	423,145百万円																																																																				
営業投資有価証券	14																																																																				
投資有価証券	61,960																																																																				
計	485,119																																																																				
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	4,448,294百万円																																																																				
現先取引で売却した有価証券	671,022																																																																				
その他	592,975																																																																				
計	5,712,292																																																																				
消費貸借契約により借り入れた有価証券	5,761,634百万円																																																																				
その他	388,890																																																																				
計	6,150,524																																																																				
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																																			
従業員	借入金	2,197																																																																			
その他(2社)	債務	840																																																																			
合計		3,037																																																																			

## (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20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
※1 人件費には、賞与引当金繰入額5,725百万円が含まれております。	※1 人件費には、賞与引当金繰入額8,770百万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1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30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 380,861百万円	現金・預金勘定 417,633百万円
預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 $\Delta$ 33,936	預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 $\Delta$ 52,743
預入期間が3ヶ月 以内の譲渡性預金 45,000	預入期間が3ヶ月 以内の譲渡性預金 10,000
<u>現金及び現金同等物 391,925</u>	<u>現金及び現金同等物 374,890</u>

(株主資本等関係)

当第1四半期連結会計期間末(平成21年6月30日)及び当第1四半期連結累計期間(自平成21年4月1日至平成21年6月30日)

- 1 発行済株式の種類及び総数  
普通株式 1,404,664千株
- 2 自己株式の種類及び株式数  
普通株式 58,334千株

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1四半期 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	2,374

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21年5月19日 取締役会	普通株式	利益剰余金	4,039	3	平成21年3月31日	平成21年6月1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。

## (セグメント情報)

## 【事業の種類別セグメント情報】

前第1四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30日)
事業の種類別セグメント情報 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。	事業の種類別セグメント情報 同左

## 【所在地別セグメント情報】

前第1四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30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	81,447	3,624	4,793	3,160	93,026	—	93,026
(2) セグメント間の 内部純営業収益	△43	661	2,140	681	3,441	(3,441)	—
計	81,404	4,286	6,934	3,842	96,467	(3,441)	93,026
営業利益又は営業損失 (△)	3,400	1,107	△98	170	4,580	(0)	4,580

- (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

当第1四半期連結累計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30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	89,319	3,182	12,193	2,669	107,364	—	107,364
(2) セグメント間の 内部純営業収益	2,035	2,479	991	1,105	6,611	(6,611)	—
計	91,355	5,662	13,184	3,774	113,976	(6,611)	107,364
営業利益	15,219	2,550	2,896	153	20,820	(7)	20,812

- (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1四半期連結累計期間（自 平成20年4月1日 至 平成20年6月30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)	6,173	4,878	3,300	14,352
II 連結純営業収益				93,026
III 連結純営業収益に占める 海外売上高の割合(%)	6.6	5.2	3.5	15.4

- (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

当第1四半期連結累計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年6月30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)	4,014	4,856	2,981	11,852
II 連結純営業収益				107,364
III 連結純営業収益に占める 海外売上高の割合(%)	3.7	4.5	2.8	11.0

- (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

(有価証券及びデリバティブ取引関係)

1 トレーディングに係るもの  
デリバティブ取引

(百万円)

種類	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)			
	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,451,634	266,541	3,353,393	244,236
為替予約取引	861,887	14,181	1,285,956	41,996
先物・先渡取引	2,042,258	84,221	1,266,873	177,965
スワップ取引	48,188,826	1,945,724	43,689,566	1,331,119
その他	791,751	53,624	862,242	49,128
リスクリザーブ	—	△7,202	—	—

2 トレーディングに係るもの以外

(1) 満期保有目的の債券で時価のあるもの  
該当事項はありません。

(2) その他有価証券で時価のあるもの

(百万円)

種類	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)		
	取得原価	四半期連結貸借 対照表計上額	差額
株券	231,551	599,424	367,873
債券	1,191	1,191	0
国債・地方債等	—	—	—
社債	—	—	—
その他	1,191	1,191	0
その他	14,185	12,568	△1,617
計	246,928	613,184	366,256

(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84百万円の減損処理を行っております。

(3) デリバティブ取引

(百万円)

種類	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)		
	契約額等	時価	評価損益
為替予約取引	287	2	2
金利スワップ取引	40,000	△51	△51
通貨スワップ取引	9,560	27	27

(注) ヘッジ会計を適用し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1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末 (平成21年3月31日)
1株当たり純資産額 612.12円	1株当たり純資産額 534.99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1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末 (平成21年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	1,107,811	952,329
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	283,701	232,057
(うち新株予約権(百万円))	(2,374)	(2,369)
(うち少数株主持分(百万円))	(281,326)	(229,688)
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)	824,109	720,272
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)	1,346,330	1,346,338

## 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

前第1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
1株当たり四半期純利益金額 4.37円	1株当たり四半期純利益金額 13.27円
潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額 4.36円	潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額 13.26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1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額		
四半期純利益(百万円)	5,885	17,870
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)	5,885	17,870
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,346,351	1,346,333
(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)	(0)	—
普通株式増加数(千株)	1,964	1,445
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	—	—

(重要な後発事象)

当第1四半期連結会計期間(自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)

平成21年6月26日開催の当社執行役会において決議した新株式発行、自己株式の処分及び売出しに関し、その払込手続きが完了いたしました。条件等は次のとおりであります。

(1) 募集による新株式発行

募集等の方法	一般募集
発行する株式の種類及び数	普通株式 302,635,000株
発行価格	1株につき516円
発行価格の総額	156,159百万円
払込金額	1株につき494.72円
払込金額の総額	149,719百万円
資本組入額の総額	58,652百万円
払込期日	平成21年7月15日
資金の使途	リテールビジネス及びアジア・新興国を中心とした海外ビジネス等の拡大に向けて、ファンド出資資金(一部連結子会社を通じた出資を含む)、当社の子会社への投融資に充当し、残額を借入金返済に充当する予定であります。また、当該子会社は、その資金を投融資及び運転資金に充当する予定であります。

(2) 自己株式の処分

処分の方法	引受人の買取引受けによる売出し
処分する株式の数	57,865,000株
売出価格	1株につき516円
売出価格の総額	29,858百万円
払込金額	1株につき494.72円
払込金額の総額	28,626百万円
払込期日	平成21年7月15日

(3) オーバーアロットメントによる売出しに関連して行う第三者割当増資

平成21年6月26日開催の当社執行役会において、オーバーアロットメントによる売出しに関連して、SMB Cフレンド証券株式会社を割当先とする第三者割当増資を行うことを決議しておりますが、平成21年8月6日において同社から割当に応じる旨の通知があり、その払込手続きが完了いたしました。条件等は次のとおりであります。

発行する株式の種類及び数	普通株式 42,000,000株
払込金額	1株につき494.72円
払込金額の総額	20,778百万円
資本組入額の総額	10,389百万円
払込期日	平成21年8月11日
資金の使途	(1) 募集による新株式発行と同様であります。

## 2【その他】

(剰余金の配当)

平成21年5月19日開催の取締役会において、平成21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 期末配当による配当金の総額 4,039百万円
- ② 1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21年6月1日

(注) 平成21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います。

## 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20年 8月12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20年4月1日から平成21年3月31日までの連結会計年度の第1四半期連結累計期間(平成20年4月1日から平成20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20年6月30日現在の財政状態並びに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及びキャッシュ・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 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21年 8月12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1四半期連結会計期間（平成21年4月1日から平成21年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成21年4月1日から平成21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6月30日現在の財政状態並びに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及びキャッシュ・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。

## 追記情報

重要な後発事象に記載されているとおり、募集による新株式発行及び自己株式の処分に係る払込手続が平成21年7月15日に、また第三者割当増資に係る払込手続が平成21年8月11日に完了している。

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。

