

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20年4月1日
(第72期Ⅰ)	至	平成20年6月30日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第72期第1四半期（自平成20年4月1日 至平成20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72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 【経営上の重要な契約等】	4
2 【財政状態及び経営成績の分析】	4
第3 【設備の状況】	13
第4 【提出会社の状況】	14
1 【株式等の状況】	14
2 【株価の推移】	23
3 【役員の状況】	23
第5 【経理の状況】	24
1 【四半期連結財務諸表】	25
2 【その他】	41
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	42
四半期レビュー報告書	巻末

【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20年8月12日
【四半期会計期間】	第72期第1四半期 (自 平成20年4月1日 至 平成20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 小 松 幹 太
【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 小 松 幹 太
【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 当第1四半期連結 累計(会計)期間	第71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19年4月1日 至 平成20年3月31日
営業収益 (百万円)	165,376	825,422
純営業収益 (百万円)	93,026	447,491
経常利益 (百万円)	8,321	90,143
四半期(当期)純利益 (百万円)	5,885	46,411
純資産額 (百万円)	1,089,393	1,082,923
総資産額 (百万円)	16,731,380	17,307,119
1株当たり純資産額 (円)	612.96	607.64
1株当たり四半期 (当期)純利益金額 (円)	4.37	33.69
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	33.63
自己資本比率 (%)	4.9	4.7
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	809,865	△782,533
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	34,346	△189,042
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△817,843	991,086
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高 (百万円)	391,925	359,851
従業員数 (人)	15,705	14,456

- (注) 1 従業員数は、就業人員数を表示しております。
2 営業収益等については、消費税等を含んでおりません。

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20年6月30日現在

従業員数(人)	15,705 [1,775]
---------	----------------

(注) 1 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673人を含めております。

2 従業員数は就業人員数であり、臨時従業員数は[]内に当第1四半期連結会計期間の平均人員を外数で記載しております。

(2) 提出会社の状況

平成20年6月30日現在

従業員数(人)	313
---------	-----

(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 【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いません。

2 【財政状態及び経営成績の分析】

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、米国の景気減退や資源・エネルギー価格の高騰により企業業績の悪化が懸念されたことを受けて、減速基調となりました。また、米国のサブプライムローン問題に端を発した国際金融市場における信用収縮の影響を引き続き受け、金融市場は軟調な展開となりました。

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1,653億円となりました。

	(百万円)
	当第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)
受入手数料	61,792
トレーディング損益	21,300
営業投資有価証券関連損益	△1,007
金融収益	69,748
その他の売上高	13,541
営業収益	165,376
金融費用	62,343
売上原価	10,006
純営業収益	93,026

マーケットの混乱は収まってきてはいるものの、株式に対する投資家心理は十分に回復してはおらず、また、企業のエクイティ・ファイナンス意欲が冷え込んでいることから、受入手数料は617億円にとどまりました。トレーディング損益は213億円の黒字を計上しましたが、営業投資有価証券関連損益は投資案件に対する損失引当等の影響により10億円の赤字となりました。金融収支は74億円、純営業収益は930億円となっております。

事業別の受入手数料の内訳は次のとおりです。

(百万円)

	当第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 手数料	—	—	—	4,559	—	4,559
(株券等)	(一)	(一)	(一)	(1,297)	(一)	(1,297)
(債券等)	(一)	(一)	(一)	(3,259)	(一)	(3,259)
募集・売出しの 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

[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2兆5,390億円となったことなどから、委託手数料は169億円となりました。受入手数料合計は173億円となっております。

[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3億円となりました。

[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236億円となりました。受入手数料合計は309億円となっております。

[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・売出しに係る手数料のほか、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、エクイティ・ファイナンスやM&Aのマーケットが縮小したことなどから厳しい収益環境となり、受入手数料合計で74億円となりました。

[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56億円となりました。

(百万円)

	当第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)
純営業収益	93,026
販売費・一般管理費	88,446
経常利益	8,321
四半期純利益	5,885

販売費・一般管理費は、取引関係費180億円、人件費371億円、不動産関係費110億円などにより、合計で884億円となりました。

この結果、経常利益は83億円となりました。

貸倒引当金繰入額22億円を特別損失に計上したことなどにより、特別損益は純額で25億円の損失となりました。法人税等及び少数株主損失を加味した結果、当第1四半期連結会計期間における四半期純利益は58億円となりました。

この結果、自己資本利益率(連結)は年率換算で2.9%となっております。

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)

	当第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	合計
地域別営業利益 又は営業損失(△)	3,400	1,107	△98	170	4,580

<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)

	当第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)		
	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
営業収益	48,365	43,581	20,330
経常利益又は経常損失(△)	12,364	△12,473	4,363
四半期純利益又は四半期純損失(△)	8,021	△11,254	2,591

リテール証券業務を営む大和証券の営業収益は483億円、経常利益は123億円となりました。世界的な市況の低迷を受け、エクイティを中心とする委託手数料は101億円、募集・売出しの取扱い手数料は92億円となりました。一方、その他受入手料は投資信託の代理事務手数料が安定的な収益を計上し162億円となっております。また、トレーディング損益は111億円の黒字となりました。当第1四半期連結会計期間末の大和証券顧客資産は、株式市況の下落によるエクイティ資産の減少により、30.1兆円となっております。ダイワファンドラップサービスの顧客数と契約資産残高は順調に拡大しております。

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435億円となりました。エクイティ・ファイナンス市場の縮小などに伴う投資銀行業務の低迷や、大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツが手がけるプリンシパル・インベストメント業務に関する営業投資有価証券関連損益にかかる損失計上などにより、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、株式投資信託の運用資産残高が比較的安定的に推移したことから信託報酬も堅調に推移しました。その結果、経常利益は43億円となりました。

また、その他の国内主要グループ会社の経常利益は以下のとおりです。

(百万円)

	当第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)		
	大和総研	大和住銀投信投資顧問	エヌ・アイ・エフ SMB Cベンチャーズ
経常利益	3,387	1,114	770

<海外>

米州の営業利益は、主に金融収支が改善したことにより、11億円となっております。欧州は、市場の混乱が続いていることもありトレーディングが不振であったほか、投資銀行業務が低調となったことで、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、アジア事業基盤を強化するための人員増強などで経費が増加したため、1億円となりました。海外合計の営業利益は11億円となっております。

② 財政状態の分析

<資産の部>

当第1四半期連結会計期間末の総資産は16兆7,313億円となりました。内訳は流動資産が16兆1,607億円であり、このうちトレーディング商品が6兆2,682億円、有価証券担保貸付金が7兆4,448億円となっております。固定資産は5,706億円となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は15兆6,419億円となりました。内訳は流動負債が14兆2,982億円であり、このうちトレーディング商品が4兆9,270億円、有価証券担保借入金が6兆773億円となっております。固定負債は1兆3,360億円であり、このうち社債が1兆1,118億円となっております。

純資産合計は1兆893億円となりました。利益剰余金は、四半期純利益による58億円の増加や配当金支払いによる134億円の減少などの結果、前連結会計年度末比78億円減の5,197億円となりました。

(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、トレーディング商品の減少などにより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、定期預金の減少により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、借入れの返済などにより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3,919億円となりました。

(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た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を保有しております。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た場合、回復する見込みがあると認められるときを除き、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、過去6ヶ月間の株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た場合に、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、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、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等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もり可能期間内の課税所得の見積もり額を限度として、当該期間内の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＞

平成14年から始まった日本の景気回復は、輸出が主導する形で生産拡大と企業収益の増加をもたらしてきました。これが設備投資の拡大につながり、日本の景気はいざなぎ景気を超えるほどの長い成長を遂げてきました。しかし、世界の需要を牽引してきた米国経済の低迷を受けて、国内経済の先行きを左右する企業部門の輸出が減速するなかで、昨年の秋頃より企業収益の伸びにも鈍化が見られるようになりました。

加えて、原油や鉄鉱石等をはじめとする国際商品市況の高騰も国内経済に大きな影響を及ぼしました。我が国はエネルギー利用効率こそ高いものの、原材料を多く消費する製造業の割合が高く、かつ資源を輸入に頼っているため、資源価格の上昇が海外への所得の流出につながりやすい構造となっています。こうした企業部門の変調は、平成20年6月調査の日銀短観においても、業況判断の悪化や経常利益計画の大幅な下方修正として表れました。

国際商品市況の高騰がもたらす影響は、ガソリンや食料品など生活必需品の物価上昇を通じて家計部門にも及び始めました。平成14年以降の景気回復の間でも家計所得は大きく上昇しておらず、平成20年夏のボーナスも前年比で増加率ゼロ%前後と見込まれるなかで、消費者物価の上昇が、家計部門への負担を増加させました。このように当第1四半期連結会計期間の日本の景気は、海外の景気悪化により弱まりを見せることとなりました。

海外の経済環境は、米国景気の低迷、原油を初めとする資源価格の高騰、尾を引く金融市場の信用不安、さらに世界的なインフレ傾向などの不安定要因が残り、厳しい状況が続きました。特に米国ではサブプライムローン問題の拡大による住宅不動産価格の下落や銀行による融資の厳格化が消費者マインドと労働市場の悪化をもたらし、实体经济に影響を及ぼしたことによって、景気後退が懸念されました。このような状況下、ドル安の進行や株式・債券市場からの商品市況への資金シフトにより、資源価格や食料品価格が高騰するなど、世界的なインフレと景気減速が並立するスタグフレーションへの警戒感が高まりました。

当第1四半期連結会計期間の株式市場は、欧米金融機関の資本増強を受け信用不安が一時的に後退したことや、米国の利下げ観測が薄れ円安傾向となったことを支援材料に好調なスタートを切り、平成20年6月初旬には日経平均株価が当第1四半期連結会計期間の高値となる14,601円27銭となりました。

しかし、米格付機関による米モノライン大手の格下げや米大手証券の損失拡大が信用不安を再燃させることとなったほか、1バレル140ドル台に達するなどWTI原油先物価格の高騰が続き、米国の雇用統計が悪化するなか、米連邦準備制度理事会(FRB)がインフレ警戒姿勢を強めることとなりました。当第1四半期連結会計期間末の日経平均株価は、前連結会計年度末比7.63%上昇の13,481円38銭で終了しました。

(7) 資本の財源及び資金の流動性に係る情報

① 流動性の管理

<財務の効率性と安定性の両立>

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネス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、普通社債、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、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います。

一方で、財務の安定性の確保も重視しています。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います。特に、金融市場の混乱が予測される際には、予め流動性の積み増しを実行し、不測の事態に備えています。グループ全体で、現金・預金、国債等の極めて換金性の高い有価証券等により構成される合計1兆3,819億円（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います。

<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・モニタリングしています。国内外の証券子会社（大和証券、大和証券エスエムビーシー、大和証券SMB Cヨーロッパ等）及び上場している子会社（エヌ・アイ・エフSMB Cベンチャーズ）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ています。その他の子会社については、当社が一元的に資金調達し、効率的に配分するなど、一体化した資金管理をしております。

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の状況

(億円)

	銀行等からの短期借入	3,921
	その他の短期借入	8,590
	コマーシャル・ペーパー	4,372
	1年以内償還予定の社債	1,292
(短期)無担保資金調達		18,176
	銀行等からの長期借入	1,900
	社債	11,118
(長期)無担保資金調達		13,019
株主資本合計		7,940
合計		39,136

(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とため、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で可能な短期の無担保資金調達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務等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、アメリカ、イギリス、アジアその他の地域で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7,940億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、利益剰余金は四半期純利益の計上や配当金支払いによる減少などの結果、5,197億円となりました。自己株式の控除額は616億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、経費構造及び経費の柔軟性、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20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	P-2
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20年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成20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	1,404,664,772	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	—
計	1,404,664,772	1,404,664,772	—	—

(注) 「提出日現在発行数」欄には、平成20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20年6月30日)
新株予約権の数(個)	1,675
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)	1,675,000
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20年6月30日)
新株予約権の数(個)	528
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)	528,000
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1四半期会計期間末現在 (平成20年6月30日)
新株予約権の数(個)	1,973
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)	1,973,000
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20年6月30日)
新株予約権の数(個)	298
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)	298,000
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」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20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)	57
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20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	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」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20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)	28
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。

(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20年4月1日 至 平成20年6月30日	—	1,404,664	—	178,324	—	157,678

(5) 【大株主の状況】

当第1四半期会計期間において、JPモルガン信託銀行株式会社から株券等の大量保有の状況に関する「変更報告書」（平成20年6月20日）の提出があり、平成20年6月13日現在で以下の株式を所有している旨の報告を受けましたが、当社としては実質所有株式数の確認ができません。

なお、「変更報告書」の記載内容は次のとおりです。

大量保有者名 JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社（他共同保有者4名）
 所有株式数 71,520千株（共同保有者も含む）
 所有株式数の割合 5.09%

(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、実質株主が把握できず、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20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20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 58,319,000	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,342,000,000	1,340,546	—
単元未満株式	普通株式 4,345,772	—	—
発行済株式総数	1,404,664,772	—	—
総株主の議決権	—	1,340,546	—

(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12,000株(議決権12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。

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1,442,000株(議決権1,442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532株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成20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	58,319,000	—	58,319,000	4.15
計	—	58,319,000	—	58,319,000	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1,442,000株(議決権1,442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20年 4月	5月	6月
最高(円)	1,055	1,112	1,187
最低(円)	827	967	966

(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

役職の異動

新役名及び職名		旧役名及び職名		氏名	異動年月日
専務執行役	企画・人事担当 兼 ホールセール部門副担当	専務執行役	企画・人事担当	日比野 隆司	平成20年7月1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)並びに同規則第61条及び第82条の規定に基づき、当企業集団の主たる事業である有価証券関連業を営む会社の財務諸表に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)に準拠して作成しております。

2 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当第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、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20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20年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	380,861	429,976
預託金	221,080	233,544
受取手形及び売掛金	13,088	13,580
有価証券	74,740	54,105
トレーディング商品	※2 6,268,296	※2 7,857,122
商品有価証券等	4,964,301	6,271,253
デリバティブ取引	1,303,995	1,585,868
約定見返勘定	67,824	219,314
営業投資有価証券	※2 481,317	※2 483,268
投資損失引当金	△10,938	△11,536
営業貸付金	80,882	75,421
商品	78	0
仕掛品	1,867	1,601
信用取引資産	365,967	369,312
信用取引貸付金	181,649	192,000
信用取引借証券担保金	184,317	177,311
有価証券担保貸付金	7,444,828	6,206,327
借入有価証券担保金	7,443,178	6,206,125
現先取引貸付金	1,649	202
立替金	10,152	12,511
短期貸付金	※2 24,904	※2 148,991
未収収益	34,839	36,597
繰延税金資産	12,366	15,913
その他の流動資産	※2 691,043	※2 608,629
貸倒引当金	△2,470	△1,384
流動資産計	16,160,730	16,753,297
固定資産		
有形固定資産	※1 152,669	※1 153,392
無形固定資産	105,231	101,879
その他	105,231	101,879
投資その他の資産	312,748	298,549
投資有価証券	※2 229,676	※2 215,611
長期貸付金	17,129	15,061
長期差入保証金	29,565	30,130
繰延税金資産	17,979	15,434
その他	※5 22,953	※5 24,579
貸倒引当金	※5 △4,555	※5 △2,267
固定資産計	570,649	553,821
資産合計	16,731,380	17,307,119

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成20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20年3月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	4,732	4,941
トレーディング商品	4,927,004	4,643,643
商品有価証券等	3,970,948	3,443,374
デリバティブ取引	956,055	1,200,269
信用取引負債	177,399	202,010
信用取引借入金	8,909	8,617
信用取引貸証券受入金	168,490	193,392
有価証券担保借入金	6,077,341	6,238,684
有価証券貸借取引受入金	5,990,256	5,535,106
現先取引借入金	87,084	703,577
預り金	161,416	134,361
受入保証金	114,544	101,149
短期借入金	1,574,733	2,362,803
コマーシャル・ペーパー	437,272	488,300
1年内償還予定の社債	129,231	130,613
未払法人税等	3,993	21,537
繰延税金負債	62	13
賞与引当金	6,319	17,325
本社移転関連費用引当金	3,863	4,129
その他の流動負債	680,379	571,406
流動負債計	14,298,295	14,920,920
固定負債		
社債	1,111,854	1,063,741
長期借入金	190,057	199,070
繰延税金負債	6,136	4,541
退職給付引当金	24,098	23,576
訴訟損失引当金	817	779
その他の固定負債	3,111	3,548
固定負債計	1,336,075	1,295,257
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	7,614	—
証券取引責任準備金	—	8,017
特別法上の準備金計	7,614	8,017
負債合計	15,641,986	16,224,195

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成20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20年3月31日)
純資産の部		
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	519,700	527,579
自己株式	△61,640	△61,701
自己株式申込証拠金	24	—
株主資本合計	794,087	801,880
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	32,747	24,470
繰延ヘッジ損益	493	800
為替換算調整勘定	△2,014	△9,061
評価・換算差額等合計	31,226	16,208
新株予約権	1,549	1,429
少数株主持分	262,530	263,404
純資産合計	1,089,393	1,082,923
負債・純資産合計	16,731,380	17,307,119

(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)

当第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)	
営業収益	
受入手数料	61,792
トレーディング損益	21,300
株券等トレーディング損益	21,033
債券・為替等トレーディング損益	266
営業投資有価証券関連損益	△1,007
金融収益	69,748
その他の売上高	13,541
営業収益計	165,376
金融費用	62,343
売上原価	10,006
純営業収益	93,026
販売費・一般管理費	
取引関係費	18,013
人件費	※1 37,120
不動産関係費	11,082
事務費	7,836
減価償却費	8,252
租税公課	1,816
貸倒引当金繰入れ	1,157
その他	3,167
販売費・一般管理費計	88,446
営業利益	4,580
営業外収益	
持分法による投資利益	188
受取利息	63
受取配当金	2,475
その他	1,416
営業外収益計	4,143
営業外費用	
支払利息	36
デリバティブ評価損	136
その他	228
営業外費用計	402
経常利益	8,321

(単位：百万円)

当第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)

特別利益	
金融商品取引責任準備金戻入	402
その他	59
特別利益計	462
特別損失	
貸倒引当金繰入額	2,270
固定資産除売却損	162
関係会社株式評価損	155
その他	441
特別損失計	3,029
税金等調整前四半期純利益	5,754
法人税、住民税及び事業税	4,830
法人税等調整額	△1,011
法人税等合計	3,819
少数株主損失(△)	△3,950
四半期純利益	5,885

(3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

当第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)

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	5,754
減価償却費	9,551
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	3,421
受取利息及び受取配当金	△2,538
支払利息	36
持分法による投資損益 (△は益)	△188
関係会社株式評価損	155
固定資産除売却損益 (△は益)	162
金融商品取引責任準備金の増減額 (△は減少)	△402
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	19,515
トレーディング商品の増減額	2,045,082
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	6,530
営業貸付金の増減額 (△は増加)	△5,460
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	△21,265
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
短期貸付金の増減額 (△は増加)	124,025
預り金の増減額 (△は減少)	27,043
その他	26,862
小計	825,989
利息及び配当金の受取額	2,577
利息の支払額	△30
法人税等の支払額	△18,670
営業活動によるキャッシュ・フロー	809,865
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	△30,701
定期預金の払戻による収入	81,978
有価証券の取得による支出	△2,139
有価証券の売却及び償還による収入	3,125
有形固定資産の取得による支出	△3,039
無形固定資産の取得による支出	△9,244
投資有価証券の取得による支出	△5,065
投資有価証券の売却及び償還による収入	511
貸付けによる支出	△3,058
貸付金の回収による収入	944
その他	1,034
投資活動によるキャッシュ・フロー	34,346

(単位：百万円)

当第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)

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
長期借入れによる収入	2,500
長期借入金の返済による支出	△11,253
社債の発行による収入	74,625
社債の償還による支出	△28,214
配当金の支払額	△13,463
その他	△342
財務活動によるキャッシュ・フロー	△817,843
現金及び現金同等物に係る換算差額	5,496
現金及び現金同等物の増減額（△は減少）	31,864
現金及び現金同等物の期首残高	359,851
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

【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20年4月1日 至 平成20年6月30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 当第1四半期連結会計期間において、重要性が増したことにより1社を連結の範囲に含めております。また、清算等に伴い3社を連結の範囲から除外しております。 (2) 変更後の連結子会社の数 44社 2 会計処理基準に関する事項の変更 (1) たな卸資産の評価に関する会計基準の適用 当第1四半期連結会計期間より、「棚卸資産の評価に関する会計基準」(企業会計基準第9号 平成18年7月5日)を適用しております。 なお、この変更による損益に与える影響はありません。 (2) 「連結財務諸表作成における在外子会社の会計処理に関する当面の取扱い」の適用 当第1四半期連結会計期間より、「連結財務諸表作成における在外子会社の会計処理に関する当面の取扱い」(実務対応報告第18号 平成18年5月17日)を適用しております。 なお、この変更による損益に与える影響はありません。 (3) リース取引に関する会計基準等の適用 「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号 平成5年6月17日)及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号 平成6年1月18日)を当第1四半期連結会計期間から早期に適用し、所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理から通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理に変更し、リース資産として計上しております。 また、リース資産の減価償却の方法は、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 ただし、リース取引開始日が適用初年度前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を引き続き採用しております。 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。

【追加情報】

当第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)
従来、特別法上の準備金として、旧証券取引法第51条の規定により計上しておりました「証券取引責任準備金」について、当第1四半期連結会計期間より金融商品取引法第46条の5の規定に基づく方法により「金融商品取引責任準備金」として計上しております。 この変更により、従来と同一の算定方法によった場合と比べて税金等調整前四半期純利益は268百万円減少しております。

【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20年 6 月30日)	前連結会計年度 (平成20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 109,432百万円であります。	※ 1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は 106,710百万円であります。																								
※ 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 882,237百万円	トレーディング商品 1,165,096百万円																								
営業投資有価証券 14	営業投資有価証券 314																								
短期貸付金 22,107	短期貸付金 34,720																								
その他の流動資産 2,230	その他の流動資産 10,522																								
投資有価証券 39,542	投資有価証券 62,247																								
計 946,131	計 1,272,901																								
 (注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によ ております。なお上記担保資産の他に、借 り入れた有価証券等191,221百万円を担保 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 ております。なお上記担保資産の他に、借 り入れた有価証券等609,272百万円を担保 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 7,204,375百万円	消費貸借契約により 貸し付けた有価証券 6,782,108百万円																								
現先取引で売却した 有価証券 85,650	現先取引で売却した 有価証券 710,431																								
その他 605,696	その他 577,499																								
計 7,895,722	計 8,070,038																								
(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 8,876,014百万円	消費貸借契約により 借り入れた有価証券 7,542,741百万円																								
その他 473,675	その他 466,116																								
計 9,349,690	計 8,008,857																								
※ 5 貸倒引当金8,258百万円は、債権額と相殺して表示 しております。	※ 5 貸倒引当金8,325百万円は、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>1,313</td></tr><tr><td>その他 (2 社)</td><td>債務</td><td>312</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>1,626</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	1,313	その他 (2 社)	債務	312	合計		1,626	<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>1,400</td></tr><tr><td>その他 (2 社)</td><td>債務</td><td>290</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>1,690</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	1,400	その他 (2 社)	債務	290	合計		1,690
被保証者	被保証債務の 内容	金額 (百万円)																							
従業員	借入金	1,313																							
その他 (2 社)	債務	312																							
合計		1,626																							
被保証者	被保証債務の 内容	金額 (百万円)																							
従業員	借入金	1,400																							
その他 (2 社)	債務	290																							
合計		1,690																							

(四半期連結損益計算書関係)

当第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)	
※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。

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

当第1四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20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	
現金・預金勘定	380,861百万円
預入期間が3ヶ月を 超える定期預金	△33,936
預入期間が3ヶ月 以内の譲渡性預金	45,000
現金及び現金同等物	391,925

(株主資本等関係)

当第1四半期連結会計期間末(平成20年6月30日)及び当第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)

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 58,272千株

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)
当社	ストック・オプションとしての 新株予約権	1,455
連結子会社	ストック・オプションとしての 新株予約権	93
合計		1,549

(注)上記の連結子会社は、エヌ・アイ・エフSMB Cベンチャーズ株式会社であります。

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20年5月19日 取締役会	普通株式	利益剰余金	13,463	10	平成20年3月31日	平成20年6月2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】

当第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】

当第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

【海外売上高】

当第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
連結純営業収益に III 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

(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20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	3,865,935	176,880	3,860,375	207,968
為替予約取引	1,412,951	35,082	1,438,925	17,913
先物・先渡取引	1,826,942	117,465	794,285	58,412
スワップ取引	47,945,405	960,069	43,060,283	652,947
その他	518,708	16,237	701,992	18,812
クレジットリザーブ	—	△1,739	—	—

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20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	122,224	165,728	43,503
債券	5,322	5,262	△60
国債・地方債等	—	—	—
社債	—	—	—
その他	5,322	5,262	△60
その他	16,439	17,226	786
計	143,986	188,216	44,230

(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1,485百万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20年6月30日)		
	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ取引	12,395	△5	△5
為替予約取引	3,339	150	150

(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20年6月30日)	前連結会計年度末 (平成20年3月31日)
1 株当たり純資産額 612.96円	1 株当たり純資産額 607.64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20年6月30日)	前連結会計年度末 (平成20年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	1,089,393	1,082,923
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	264,103	264,833
(うち新株予約権)	(1,549)	(1,429)
(うち少数株主持分)	(262,530)	(263,404)
(うち自己株式申込証拠金)	(24)	(—)
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)	825,289	818,089
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)	1,346,392	1,346,335

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

当第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)
1 株当たり四半期純利益金額 4.37円
潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額 4.36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。

	当第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)
(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
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
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,346,351
(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
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20年4月1日 至 平成20年6月30日)

該当事項はありません。

2【その他】

(剰余金の配当)

平成20年5月19日開催の取締役会において、平成20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 13,463百万円

②1株当たりの金額 10円00銭

③支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成20年6月2日

(注) 平成20年3月31日現在の株主名簿または実質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。

