

半 期 報 告 書

事業年度 自 平成18年 4 月 1 日
(第70期中) 至 平成18年 9 月30日

株式会社 大和証券グループ本社

(541003)

第70期中（自平成18年4月1日 至平成18年9月30日）

半 期 報 告 書

- 1 本書は半期報告書を証券取引法第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半期報告書に添付された中間監査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70期中 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】	4
3 【関係会社の状況】	4
4 【従業員の状況】	4
第 2 【事業の状況】	5
1 【業績等の概要】	5
2 【対処すべき課題】	9
3 【経営上の重要な契約等】	9
4 【研究開発活動】	9
第 3 【設備の状況】	10
1 【主要な設備の状況】	10
2 【設備の新設、除却等の計画】	10
第 4 【提出会社の状況】	11
1 【株式等の状況】	11
2 【株価の推移】	19
3 【役員の状況】	19
第 5 【経理の状況】	20
1 【中間連結財務諸表等】	21
2 【中間財務諸表等】	58
第 6 【提出会社の参考情報】	72
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	73
中間監査報告書	巻末

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成18年12月18日提出
【中間会計期間】	第70期中(自 平成18年4月1日 至 平成18年9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】	東京都千代田区大手町2丁目6番4号
【電話番号】	03(3243)2100
【事務連絡者氏名】	財務部長 小 松 幹 太
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区大手町2丁目6番4号
【電話番号】	03(3243)2100
【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 (大阪府中央区北浜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3番17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】

(1) 連結経営指標等

会計期間	自 平成16年 4月1日 至 平成16年 9月30日 (平成17年3月期中)	自 平成17年 4月1日 至 平成17年 9月30日 (平成18年3月期中)	自 平成18年 4月1日 至 平成18年 9月30日 (平成19年3月期中)	自 平成16年 4月1日 至 平成17年 3月31日 (平成17年3月期)	自 平成17年 4月1日 至 平成18年 3月31日 (平成18年3月期)
営業収益 (百万円)	243,180	330,812	419,391	519,337	845,659
純営業収益 (百万円)	191,021	229,972	241,343	390,432	579,358
経常利益 (百万円)	57,259	83,956	86,451	120,433	260,651
中間(当期)純利益 (百万円)	24,165	45,822	40,127	52,665	139,948
純資産額 (百万円)	615,303	701,733	1,142,402	648,332	792,281
総資産額 (百万円)	12,430,836	14,753,923	14,300,872	12,378,961	14,898,890
1株当たり純資産額 (円)	462.39	527.40	624.25	486.70	598.27
1株当たり 中間(当期)純利益 (円)	18.16	34.43	30.04	39.03	103.90
潜在株式調整後 1株当たり中間 (当期)純利益 (円)	17.31	32.74	28.50	37.36	98.61
自己資本比率 (%)	4.9	4.8	6.1	5.2	5.3
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△861,135	100,992	725,596	△1,002,888	369,860
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△5,077	39,869	△11,598	△26,062	△911
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	841,693	△117,605	△827,096	883,867	△324,056
現金及び現金同等物 の中間期末(期末)残高 (百万円)	460,663	364,196	281,211	338,697	392,350
従業員数 [外、平均臨時 雇用者数] (人)	11,609 [1,607]	12,687 [1,741]	13,373 [2,009]	11,295 [1,675]	12,561 [1,798]

- (注) 1 従業員数は、就業人員数を表示しております。
- 2 平成17年3月期以前の有価証券報告書及び半期報告書の「従業員の状況」の注記において記載していたF A (ファイナンシャルアドバイザー)社員数を、平成17年9月中間期より従業員数に含めて記載しております。
- 3 営業収益等については、消費税等を含んでおりません。
- 4 純資産額の算定にあたり、平成18年9月中間期から「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」(企業会計基準第5号)及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」(企業会計基準適用指針第8号)を適用しております。

(2) 提出会社の経営指標等

回次	第68期中	第69期中	第70期中	第68期	第69期
会計期間	自 平成16年 4月1日 至 平成16年 9月30日	自 平成17年 4月1日 至 平成17年 9月30日	自 平成18年 4月1日 至 平成18年 9月30日	自 平成16年 4月1日 至 平成17年 3月31日	自 平成17年 4月1日 至 平成18年 3月31日
営業収益 (百万円)	22,692	33,671	76,039	26,236	35,215
経常利益 (百万円)	17,699	29,333	72,343	16,302	25,140
中間(当期)純利益 (百万円)	18,213	35,573	76,719	32,228	51,335
資本金 (百万円)	138,431	138,432	178,324	138,432	138,828
発行済株式総数 (千株)	1,331,735	1,331,736	1,404,664	1,331,736	1,332,460
純資産額 (百万円)	559,794	609,470	732,884	573,115	613,824
総資産額 (百万円)	1,101,131	1,050,264	1,281,242	1,088,665	1,224,643
1株当たり配当額 (円)	5.00	12.00	12.00	13.00	34.00
自己資本比率 (%)	50.8	58.0	57.2	52.6	50.1
従業員数 (人)	261	259	268	257	257

- (注) 1 中間連結財務諸表を作成しているため、提出会社の1株当たり純資産額、1株当たり中間(当期)純利益、潜在株式調整後1株当たり中間(当期)純利益の記載を省略しております。
- 2 従業員数は、就業人員数を表示しております。
- 3 営業収益等については、消費税等を含んでおりません。
- 4 純資産額の算定にあたり、平成18年9月中間期から「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」(企業会計基準第5号)及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」(企業会計基準適用指針第8号)を適用しております。

2 【事業の内容】

当中間連結会計期間において、大和証券グループ(当社、連結子会社47社及び持分法適用関連会社4社)が営む事業の内容について、重要な変更はありません。

3 【関係会社の状況】

当中間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18年9月30日現在

従業員数(人)	13,373 [2,009]
---------	-------------------

- (注) 1 当社グループは単一事業セグメントを有しており、全連結会社の従業員数の合計を記載しております。
2 従業員数は就業人員数であり、臨時従業員は [] 内に当中間連結会計期間の平均人員を外数で記載しております。
3 従業員数には、F A(ファイナンシャルアドバイザー)社員の雇用人員1,070人を含めております。

(2) 提出会社の状況

平成18年9月30日現在

従業員数(人)	268
---------	-----

- (注) 従業員数は就業人員数であります。

(3) 労働組合の状況

特記事項はありません。

第2 【事業の状況】

1 【業績等の概要】

(1) 業績

当中間連結会計期間の株式相場は、日経平均株価17,000円台前半の水準から始まり、一部投資家による利益確定売りの動きなどを受けて一時日経平均株価14,000円台前半まで下落しました。その後は米国株価の上昇や堅調な本邦経済指標などをを受けて上昇し、9月末の日経平均株価は16,127円58銭となりました。

期初に1.8%台であった10年物国債利回りは、堅調な本邦経済指標などを背景に5月には2%台まで上昇しましたが、その後は日銀の金融政策変更に対する思惑などから低下し、9月末には1.6%台となりました。

期初に117円台であった円の対米ドル相場は、米国の金融政策の変更などから円高・ドル安で推移しましたが、日米金利差に着目した円売りなどにより円安・ドル高に推移し、9月末は118円台前半となっております。

このような環境の下、当中間連結会計期間の連結純営業収益は、受入手数料や営業投資有価証券関連損益が増加したことなどにより2,413億円（前年同期比4.9%増）となりました。販売費・一般管理費は1,615億円（同7.7%増）となり、経常利益は864億円（同3.0%増）、中間純利益は401億円（同12.4%減）となりました。

① 営業収益及び純営業収益の状況

当中間連結会計期間の営業収益は4,193億円（前年同期比26.8%増）となりました。営業収益の内訳は次のとおりであります。また、純営業収益は2,413億円（同4.9%増）となりました。

<営業収益及び純営業収益の内訳>

	前中間連結会計期間 平成17年9月期 (百万円)	当中間連結会計期間 平成18年9月期 (百万円)	対前年同期増減率(%)
受入手数料	107,984	134,968	25.0
トレーディング損益	104,351	73,068	△30.0
営業投資有価証券関連損益	6,080	18,660	206.9
金融収益	95,448	171,762	80.0
その他の売上高	16,946	20,930	23.5
営業収益	330,812	419,391	26.8
金融費用	88,039	162,037	84.1
売上原価	12,800	16,010	25.1
純営業収益	229,972	241,343	4.9

当中間連結会計期間の東京証券取引所における1日平均株式売買代金は2兆5,772億円（前年同期比52.3%増）となりました。受入手数料のうち委託手数料合計は461億円（同4.9%増）となりました。新規公開の主幹事案件が増加したことなどから株券等の引受け・売出し手数料が増加し、引受け・売出し手数料合計は192億円（同33.1%増）となりました。また、株式型投資信託を中心に販売が好調であったことなどからアセット・マネジメント関連手数料が増加し、募集・売出しの取扱手数料合計は184億円（同9.8%増）となりました。その他の受入手数料合計は、株式投資信託の純資産残高の伸びに伴う信託報酬の増加などにより、511億円（同56.2%増）となりました。

株券等トレーディング損益が122億円（同73.7%減）と大幅に減少したことから、トレーディング損益合計は730億円（同30.0%減）となりました。金融収益は1,717億円（同80.0%増）、金融費用は1,620億円（同84.1%増）とそれぞれ大幅に増加しました。金融収益から金融費用を差し引いた金融収支は、主に有価証券貸借取引収支や信用取引収支の増加により、97億円（同31.2%増）となりました。

事業別の受入手数料の内訳とトレーディング損益の内訳は次のとおりであります。

< 事業別の受入手数料の内訳 >

(百万円)

	前中間連結会計期間					
	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	43,383	479	102	—	—	43,965
引受け・売出し手数料	—	—	—	14,453	—	14,453
募集・売出しの取扱手数料	—	—	15,849	970	—	16,820
その他の受入手数料 (うち代理事務手数料)	883 (—)	1,245 (1,235)	16,790 (9,305)	6,639 (—)	7,185 (—)	32,744 (10,540)
合計	44,266	1,725	32,743	22,062	7,185	107,984
構成比率(%)	41.0	1.6	30.3	20.4	6.7	100.0

(百万円)

	当中間連結会計期間					
	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	45,604	365	158	—	—	46,128
引受け・売出し手数料	—	—	—	19,238	—	19,238
募集・売出しの取扱手数料	—	—	17,703	767	—	18,471
その他の受入手数料 (うち代理事務手数料)	917 (—)	1,135 (1,135)	30,608 (16,202)	6,786 (—)	11,682 (—)	51,131 (17,338)
合計	46,521	1,501	48,470	26,792	11,682	134,968
構成比率(%)	34.5	1.1	35.9	19.8	8.7	100.0

(%)

	対前年同期増減率					
	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	5.1	△23.8	53.9	—	—	4.9
引受け・売出し手数料	—	—	—	33.1	—	33.1
募集・売出しの取扱手数料	—	—	11.7	△20.9	—	9.8
その他の受入手数料 (うち代理事務手数料)	3.9 (—)	△8.8 (△8.0)	82.3 (74.1)	2.2 (—)	62.6 (—)	56.2 (64.5)
合計	5.1	△13.0	48.0	21.4	62.6	25.0

[エクイティ(株式関連)]

株券等の委託手数料が456億円（前年同期比5.1%増）となったことから、合計では465億円（同5.1%増）となりました。

[フィックス・インカム(債券)]

主に海外子会社で計上される先物取引等の委託手数料3億円（同23.8%減）、利金・償還金等の支払事務代行に対する代理事務手数料11億円（同8.0%減）などから、合計では15億円（同13.0%減）となりました。

[アセット・マネジメント(資産運用)]

株式型投資信託の販売が堅調に推移したことなどから、募集・売出しの取扱手数料は177億円（同11.7%増）と増加しました。また、投資信託の事務代行手数料や信託報酬からなるその他の受入手数料が、株式投資信託残高などの増加に伴い306億円（同82.3%増）と大幅に増加したため、合計では484億円（同48.0%増）となりました。

[インベストメント・バンキング(投資銀行)]

引受け・売出し手数料は、新規公開の主幹事案件が増加したことなどから、192億円（同33.1%増）となりました。また、その他の受入手数料は、M&A業務の手数料の増加などにより67億円（同2.2%増）となり、合計では267億円（同21.4%増）となりました。

[その他]

主なものは、海外子会社で計上するカストディ・フィー（保管手数料）、エヌ・アイ・エフSMB Cベンチャーズ株式会社などで計上する投資事業組合運営報酬、大和証券株式会社が計上する生命保険販売手数料です。投資事業組合運営報酬や生命保険販売手数料の増加などにより、合計では116億円（同62.6%増）と大幅な増加となりました。

<トレーディング損益の内訳>

	前中間連結会計期間 平成17年9月期 (百万円)	当中間連結会計期間 平成18年9月期 (百万円)	対前年同期増減率(%)
株券等	46,477	12,226	△73.7
債券・為替等	57,873	60,841	5.1
（債券等）	(28,802)	(25,366)	(△11.9)
（為替等）	(29,070)	(35,475)	(22.0)
合計	104,351	73,068	△30.0

<トレーディングのリスク量>

マーケットリスクの測定方法として、バリュエ・アット・リスク (VaR) を採用しております。

	前中間連結会計期間 平成17年9月期			当中間連結会計期間 平成18年9月期		
	最大値(億円)	最小値(億円)	平均値(億円)	最大値(億円)	最小値(億円)	平均値(億円)
VaR	24	9	15	37	15	22

(注) 1 当企業集団のうちトレーディング業務を行っております大和証券エスエムビーシー株式会社、大和証券株式会社及び海外子会社2社の合算値を記載しております。

2 VaRの範囲と前提

対象範囲： 国内外における主要なトレーディング商品

信頼区間： 片側99%

保有期間： 1日

② 損益の状況

債券販売に伴う支払手数料、投資信託にかかる支払信託報酬の増加などにより、取引関係費が331億円（前年同期比13.2%増）となったほか、事務費が111億円（同33.7%増）と増加したため、販売費・一般管理費は1,615億円（同7.7%増）となりました。純営業収益2,413億円から販売費・一般管理費1,615億円を差し引いた営業利益は798億円（同0.2%減）となりました。このほか営業外収益78億円、営業外費用12億円を計上し、経常利益は864億円（同3.0%増）となりました。中間純利益は401億円（同12.4%減）となりました。

③ 所在地別セグメント

[日本]

エクイティ（株式関連）は、東京証券取引所における1日平均株式売買代金が大きく増加したものの、前年同期とほぼ同水準となりました。また、アセット・マネジメント（資産運用）は、その他の受入手数料が株式投資信託残高の増加により増収となったことなどから、大幅な増収となりました。インベストメント・バンキング（投資銀行）は、新規公開の主幹事案件が増加したことなどから引受け・売出し手数料が増加しました。また、トレーディング損益は株券等のトレーディング損益が減少したことにより減収となりました。結果、純営業収益は2,211億円（前年同期比0.2%増）となりました。また、販売費・一般管理費は、債券販売に伴う支払手数料や投資信託にかかる支払信託報酬が増加したことなどにより1,440億円（同6.8%増）となりました。この結果、営業利益は770億円（同10.1%減）となりました。

[米州]

米国の金利上昇に伴い金融収益は大幅に増加しましたが、一方で金融費用が増加したことなどにより、純営業収益は65億円（同7.7%増）にとどまりました。販売費・一般管理費は人件費の増加などにより62億円（同19.1%増）となりました。この結果、営業利益は2億円（同64.7%減）となりました。

[欧州]

インベストメント・バンキング（投資銀行）の受入手数料が増加したことなどにより、純営業収益は136億円（同5.7%増）となりました。販売費・一般管理費は人件費の増加などにより、123億円（同19.3%増）となりました。営業利益は12億円（同51.0%減）となりました。

[アジア・オセアニア]

大型の引受案件などにより引受け・売出し手数料が増加しました。純営業収益は64億円（同35.5%増）、営業利益は12億円（同19.4%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、有価証券担保借入金の増加などにより、7,255億円の増加（前中間連結会計期間においては1,009億円の増加）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、有価証券の取得による支出などにより、115億円の減少（前中間連結会計期間においては398億円の増加）となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金の減少などにより、8,270億円の減少（前中間連結会計期間においては1,176億円の減少）となりました。当中間連結会計期間末における現金及び現金同等物の残高は、前連結会計年度末に比べ1,111億円減少し、2,812億円（前中間連結会計期間末は3,641億円）となりました。

2 【対処すべき課題】

当中間連結会計期間において、対処すべき課題について重要な変更はありません。

なお、当社の子会社である大和証券株式会社は、平成18年12月1日、同社の姫路支店において不公正取引の未然防止等に関し法令違反が認められたため、金融庁より行政処分を受けました。

当社グループといたしましては、かかる事態を厳粛に受け止め、法令遵守と内部管理を徹底し、信頼回復に努めて参る所存であります。

3 【経営上の重要な契約等】

当中間連結会計期間において、経営上の重要な契約等はありません。

4 【研究開発活動】

該当事項はありません。

第3 【設備の状況】

1 【主要な設備の状況】

当中間連結会計期間において、当社の子会社であるエヌ・アイ・エフＳＭＢＣベンチャーズ株式会社は、本社機能を東京都中央区から東京都千代田区へ移転することを、平成18年7月26日開催の同社の取締役会において決議し、平成18年11月27日に移転いたしました。

2 【設備の新設、除却等の計画】

当中間連結会計期間において、リテール証券業務を行う大和証券の店舗にかかる改装及び店舗機能の拡張等のリニューアル計画を、61ヶ店 総額7,150百万円から83ヶ店 総額10,023百万円に変更いたしました。この店舗リニューアル計画のうち、当中間連結会計期間に完成したものは38ヶ店であります。

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	中間会計期間末 現在発行数(株) (平成18年9月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成18年12月18日)	上場証券取引所名又は 登録証券業協会名	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	—	—

(2) 【新株予約権等の状況】

新株予約権

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。

	中間会計期間末現在 (平成18年9月30日)	提出日の前月末現在 (平成18年11月30日)
新株予約権の数(個)	2,699	2,608
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,699,000	2,608,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり756	同左
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	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左
代用払込みに関する事項	—	—

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。

	中間会計期間末現在 (平成18年9月30日)	提出日の前月末現在 (平成18年11月30日)
新株予約権の数(個)	533	同左
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	533,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
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	同左
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	同左
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、執行役員の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。	同左
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。	同左
代用払込みに関する事項	—	—

(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。

	中間会計期間末現在 (平成18年9月30日)	提出日の前月末現在 (平成18年11月30日)
新株予約権の数(個)	2,560	同左
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,560,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり781	同左
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	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左
代用払込みに関する事項	—	—

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。

	中間会計期間末現在 (平成18年9月30日)	提出日の前月末現在 (平成18年11月30日)
新株予約権の数(個)	301	同左
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	301,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
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	同左
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	同左
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、執行役員の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。	同左
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。	同左
代用払込みに関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」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1,363.0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。

	中間会計期間末現在 (平成18年9月30日)	提出日の前月末現在 (平成18年11月30日)
新株予約権の数(個)	2,593	同左
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,593,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1,515	同左
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	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左
代用払込みに関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」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。

(3) 【発行済株式総数、資本金等の状況】

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18年4月1日 ～ 平成18年9月30日	72,204	1,404,664	39,495	178,324	39,495	157,678

(注) 資本金及び資本準備金の増加は、転換社債の転換によるものであります。

(4) 【大株主の状況】

平成18年9月30日現在

氏名又は名称	住所	所有株式数 (千株)	発行済株式 総数に対する 所有株式数 の割合(%)
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口)	東京都中央区晴海1丁目8番11号	90,421	6.44
日本マスタートラスト信託銀行株式会社(信託口)	東京都港区浜松町2丁目11番3号	71,381	5.08
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区有楽町1丁目1番2号	30,328	2.16
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口4)	東京都中央区晴海1丁目8番11号	28,401	2.02
ステート ストリート バンク アンド トラスト カンパニー (常任代理人 株式会社みずほ コーポレート銀行 兜町証券決 済業務室)	P.O.Box 351 Boston Massachusetts 02101 U.S.A. (東京都中央区日本橋兜町6番7号)	26,949	1.92
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社・住友信託退給口	東京都中央区晴海1丁目8番11号	24,888	1.77
ザ チェース マンハッタン バンク 385036 (常任代理人 株式会社みずほ コーポレート銀行 兜町証券決 済業務室)	360 N.Crescent Drive Beverly Hills, California 90210 U.S.A. (東京都中央区日本橋兜町6番7号)	24,776	1.76
太陽生命保険株式会社	東京都港区海岸1丁目2番3号	23,140	1.65
インベスターズ バンク (常任代理人 スタンダードチ ャータード銀行)	200 CLARENDON STREET P.O. BOX 9130 BOSTON, MA 02117-9130, USA (東京都千代田区永田町2丁目11番1号 山王パ ークタワー21階)	22,658	1.61
ドイチェ バンク アーゲー ロンドン 610 (常任代理人 ドイツ証券株式 会社)	WINCHESTER HOUSE 1 GREAT WINCHESTER STREET LONDON EC2N 2DB, UK (東京都千代田区永田町2丁目11番1号 山王パ ークタワー)	22,494	1.60
計	—	365,437	26.02

(注) 1 住友信託銀行株式会社から株券等の大量保有に関する「変更報告書」(平成18年2月15日)の提出があり、平成18年1月31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ので、上記「大株主の状況」では考慮しておりません。

なお「変更報告書」記載内容は以下のとおりです。

大量保有者名 住友信託銀行株式会社

保有株券等の数 69,795千株

株券等の保有割合 5.24%

2 J P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18年7月14日)の提出があり、平成18年6月30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ので、上記「大株主の状況」では考慮しておりません。

なお「変更報告書」の記載内容は以下のとおりです。

大量保有者名 J Pモルガン信託銀行株式会社(他共同保有者7名)

保有株券等の数 73,021千株

株券等の保有割合 5.47%

3 バークレイズ・グローバル・インベスターズ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18年10月11日)の提出があり、平成18年9月30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主数の確認ができませんので、上記「大株主の状況」では考慮しておりません。

なお「変更報告書」の記載内容は以下のとおりです。

大量保有者名 バークレイズ・グローバル・インベスターズ信託銀行株式会社(他共同保有者10名)

保有株券等の数 88,144千株

株券等の保有割合 6.60%

4 フィデリティ投信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18年10月13日)の提出があり、平成18年9月30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主数の確認ができませんので、上記「大株主の状況」では考慮しておりません。

なお「変更報告書」の記載内容は以下のとおりです。

大量保有者名 フィデリティ投信株式会社

保有株券等の数 74,322千株

株券等の保有割合 5.56%

(5) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

平成18年9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 9,615,000	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,390,338,000	1,384,848	—
単元未満株式	普通株式 4,711,772	—	1 単元(1,000株)未満の株式
発行済株式総数	1,404,664,772	—	—
総株主の議決権	—	1,384,848	—

(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44,000株(議決権44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証券業務として自己の名義で保有している株式5,446,000株(議決権5,446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192株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成18年9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(%)
(自己所有株式) 株式会社 大和証券グループ本社	東京都千代田区大手町 2丁目6番4号	9,615,000	—	9,615,000	0.68
計	—	9,615,000	—	9,615,000	0.68

(注) 上記のほか、当社の証券子会社が証券業務として自己の名義で保有している株式が5,446,000株(議決権5,446個)あります。なお、当該株式数は上記「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】

【当該中間会計期間における月別最高・最低株価】

月別	平成18年4月	5月	6月	7月	8月	9月
最高(円)	1,645	1,672	1,471	1,452	1,486	1,454
最低(円)	1,503	1,353	1,241	1,170	1,250	1,280

(注) 株価は、東京証券取引所市場第一部におけるものです。

3 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当半期報告書提出日までにおいて、役員の異動はありません。

第5 【経理の状況】

1 中間連結財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

- (1) 当社の中間連結財務諸表は、「中間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11年大蔵省令第24号。以下「中間連結財務諸表規則」という。)並びに同規則第48条及び第69条の規定に基づき、当企業集団の主たる事業である証券業を営む会社の財務諸表に適用される「証券会社に関する内閣府令」(平成10年総理府令・大蔵省令第32号)及び「証券業経理の統一について」(昭和49年11月14日付日本証券業協会理事会決議)に準拠して作成しております。

なお、前中間連結会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)は改正前の中間連結財務諸表規則に基づき、当中間連結会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)は改正後の中間連結財務諸表規則に基づいて作成しております。

- (2) 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、前中間会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)は改正前の中間財務諸表等規則に基づき、当中間会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)は改正後の中間財務諸表等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、証券取引法第193条の2の規定に基づき、前中間連結会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)及び前中間会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)並びに当中間連結会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)及び当中間会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)の中間連結財務諸表及び中間財務諸表について、あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1 【中間連結財務諸表等】

(1) 【中間連結財務諸表】

① 【中間連結貸借対照表】

		前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)		当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)		前連結会計年度の 要約連結貸借対照表 (平成18年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(資産の部)							
I 流動資産							
1 現金・預金	※2	369,007		287,135		407,889	
2 預託金		175,722		203,547		297,878	
3 受取手形及び売掛金		7,857		11,728		11,368	
4 有価証券		19,727		23,722		20,205	
5 トレーディング商品	※2	6,338,146		5,392,907		6,162,242	
(1) 商品有価証券等		5,687,721		4,572,141		4,491,212	
(2) デリバティブ取引		650,425		820,766		1,671,029	
6 約定見返勘定		435,571		227,853		—	
7 営業投資有価証券	※2	240,746		416,326		390,917	
8 投資損失引当金		△8,202		△8,527		△8,496	
9 その他の棚卸資産		2,454		2,082		2,271	
10 信用取引資産		369,100		547,883		563,537	
(1) 信用取引貸付金		163,236		329,096		359,331	
(2) 信用取引借証券担保金		205,863		218,786		204,206	
11 有価証券担保貸付金		6,124,106		6,430,302		6,274,505	
(1) 借入有価証券担保金		6,124,106		6,430,177		6,274,385	
(2) 現先取引貸付金		—		125		120	
12 立替金		14,667		13,786		25,940	
13 短期貸付金	※2, 5	38,810		44,891		59,997	
14 未収収益		23,952		36,059		36,558	
15 繰延税金資産		9,840		10,504		20,187	
16 その他の流動資産	※2	128,970		165,086		127,683	
貸倒引当金	※5	△378		△224		△293	
流動資産計		14,290,100	96.9	13,805,066	96.5	14,392,393	96.6
II 固定資産							
1 有形固定資産	※1	137,470		126,569		126,531	
2 無形固定資産		64,284		76,248		68,813	
3 投資その他の資産		262,068		292,987		311,153	
(1) 投資有価証券	※2	205,245		232,135		249,647	
(2) 長期貸付金		12,010		10,659		11,866	
(3) 長期差入保証金		22,515		24,253		23,538	
(4) 繰延税金資産		4,612		10,350		9,300	
(5) その他	※5	20,176		18,264		18,651	
貸倒引当金	※5	△2,493		△2,676		△1,851	
固定資産計		463,823	3.1	495,805	3.5	506,497	3.4
資産合計		14,753,923	100.0	14,300,872	100.0	14,898,890	100.0

		前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)		当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)		前連結会計年度の 要約連結貸借対照表 (平成18年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(負債の部)							
I 流動負債							
1 支払手形及び買掛金		2,723		6,218		5,138	
2 トレーディング商品		3,929,639		4,050,230		4,879,188	
(1) 商品有価証券等		3,345,589		3,440,617		3,321,855	
(2) デリバティブ取引		584,050		609,613		1,557,332	
3 約定見返勘定		—		—		302,572	
4 信用取引負債		187,816		239,768		197,482	
(1) 信用取引借入金	※2	8,126		16,297		7,569	
(2) 信用取引貸証券受入金		179,690		223,470		189,912	
5 有価証券担保借入金		5,928,683		6,031,486		4,744,007	
(1) 有価証券貸借取引 受入金		5,512,569		5,287,122		4,525,203	
(2) 現先取引借入金		416,114		744,363		218,803	
6 預り金		157,121		198,778		166,508	
7 受入保証金		79,054		99,967		99,224	
8 短期借入金	※2,6	2,175,630		903,476		1,795,320	
9 コマーシャル・ペーパー		116,681		272,710		234,210	
10 一年以内償還社債		50,797		28,496		80,207	
11 一年以内償還転換社債		79,985		—		79,193	
12 未払法人税等		26,236		18,351		73,779	
13 繰延税金負債		5,281		1,328		2,898	
14 賞与引当金		24,371		23,736		41,713	
15 その他の流動負債		117,304		89,473		111,462	
流動負債計		12,881,327	87.3	11,964,023	83.6	12,812,909	86.0
II 固定負債							
1 社債		749,101		965,645		819,559	
2 長期借入金	※2,6	167,282		164,129		167,952	
3 繰延税金負債		19,141		31,444		39,007	
4 退職給付引当金		19,835		21,738		19,912	
5 役員退職慰労引当金		261		488		383	
6 訴訟損失引当金		—		550		—	
7 その他の固定負債		3,395		2,935		3,141	
固定負債計		959,018	6.5	1,186,932	8.3	1,049,956	7.1
III 特別法上の準備金	※7						
1 証券取引責任準備金		5,649		7,513		7,024	
2 金融先物取引責任準備金		0		0		0	
特別法上の準備金計		5,649	0.0	7,513	0.1	7,024	0.0
負債合計		13,845,995	93.8	13,158,469	92.0	13,869,891	93.1
少数株主持分		206,194	1.4	—	—	236,718	1.6

		前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)		当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)		前連結会計年度の 要約連結貸借対照表 (平成18年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(資本の部)							
I 資本金		138,432	0.9	—	—	138,828	0.9
II 資本剰余金		117,940	0.8	—	—	118,339	0.8
III 利益剰余金		398,057	2.7	—	—	476,216	3.2
IV その他有価証券評価差額金		53,060	0.4	—	—	72,694	0.5
V 為替換算調整勘定		△4,930	△0.0	—	—	863	0.0
VI 自己株式		△827	△0.0	—	—	△14,660	△0.1
資本合計		701,733	4.8	—	—	792,281	5.3
負債、少数株主持分及び 資本合計		14,753,923	100.0	—	—	14,898,890	100.0
(純資産の部)							
I 株主資本							
1 資本金		—	—	178,324	1.2	—	—
2 資本剰余金		—	—	157,678	1.1	—	—
3 利益剰余金		—	—	484,637	3.4	—	—
4 自己株式		—	—	△12,501	△0.0	—	—
5 自己株式申込証拠金		—	—	0	0.0	—	—
株主資本合計		—	—	808,140	5.7	—	—
II 評価・換算差額等							
1 その他有価証券 評価差額金		—	—	57,145	0.4	—	—
2 繰延ヘッジ損益		—	—	485	0.0	—	—
3 為替換算調整勘定		—	—	5,082	0.0	—	—
評価・換算差額等合計		—	—	62,713	0.4	—	—
III 新株予約権		—	—	468	0.0	—	—
IV 少数株主持分		—	—	271,080	1.9	—	—
純資産合計		—	—	1,142,402	8.0	—	—
負債・純資産合計		—	—	14,300,872	100.0	—	—

② 【中間連結損益計算書】

区分	注記 番号	前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)		当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)		前連結会計年度の 要約連結損益計算書 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)	
		金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)
I 営業収益							
1 受入手数料		107,984		134,968		309,188	
(1) 委託手数料		43,965		46,128		119,520	
(2) 引受け・売出し手数料		14,453		19,238		64,313	
(3) 募集・売出しの 取扱手数料		16,820		18,471		43,830	
(4) その他の受入手数料		32,744		51,131		81,523	
2 トレーディング損益		104,351		73,068		224,912	
3 営業投資有価証券 関連損益		6,080		18,660		21,539	
4 金融収益		95,448		171,762		245,210	
5 その他の売上高		16,946		20,930		44,808	
営業収益計		330,812	100.0	419,391	100.0	845,659	100.0
II 金融費用		88,039	26.6	162,037	38.6	231,572	27.4
III 売上原価		12,800	3.9	16,010	3.8	34,729	4.1
純営業収益		229,972	69.5	241,343	57.6	579,358	68.5
IV 販売費・一般管理費							
1 取引関係費	※1	29,258		33,117		63,909	
2 人件費		77,446		79,508		171,061	
3 不動産関係費		16,059		17,055		32,659	
4 事務費		8,324		11,125		17,273	
5 減価償却費		11,140		11,006		22,640	
6 租税公課		3,599		3,872		8,071	
7 貸倒引当金繰入		39		—		123	
8 その他		4,118		5,835		9,458	
販売費・一般管理費計		149,985	45.3	161,522	38.6	325,199	38.4
営業利益		79,987	24.2	79,821	19.0	254,159	30.1
V 営業外収益							
1 持分法による投資利益	※2	661		578		1,528	
2 その他		4,000		7,268		7,168	
営業外収益計		4,662	1.4	7,846	1.9	8,697	1.0
VI 営業外費用							
1 その他	※3	693		1,216		2,204	
営業外費用計		693	0.2	1,216	0.3	2,204	0.3
経常利益		83,956	25.4	86,451	20.6	260,651	30.8

		前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)		当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)		前連結会計年度の 要約連結損益計算書 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)
VII 特別利益							
1 関係会社株式売却益		3,714		147		3,714	
2 投資有価証券売却益		2,443		1,768		6,385	
3 証券取引責任準備金戻入		0		—		—	
4 持分変動益		4,725		—		4,725	
特別利益計		10,883	3.3	1,916	0.5	14,825	1.8
VIII 特別損失							
1 訴訟損失		—		—		1,279	
2 関係会社株式評価減		—		200		—	
3 投資有価証券評価減		121		546		499	
4 固定資産除売却損	※4	249		437		548	
5 減損損失	※7	—		—		6,850	
6 臨時償却費		—		—		4,439	
7 投資有価証券売却損		17		238		69	
8 海外子会社為替差損		—		—		1,563	
9 訴訟損失引当金繰入		—		550		—	
10 証券取引責任準備金繰入		—		183		1,374	
11 証券市場基盤整備基金 拠出金		—		—		200	
12 その他	※5	226		—		297	
特別損失計		614	0.2	2,157	0.5	17,122	2.0
税金等調整前中間(当期)純利益		94,225	28.5	86,209	20.6	258,355	30.6
法人税、住民税及び事業税	※6	25,176		25,221		77,675	
法人税等調整額	※6	10,795		12,042		391	
		35,972	10.9	37,264	8.9	78,066	9.2
少数株主利益(△)		△12,430	△3.7	△8,817	△2.1	△40,339	△4.8
中間(当期)純利益		45,822	13.9	40,127	9.6	139,948	16.6

③ 【中間連結剰余金計算書】

		前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)		前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資本剰余金の部)					
I 資本剰余金期首残高			117,941		117,941
II 資本剰余金増加高					
1 転換社債の転換による 新株式の発行		—		395	
2 自己株式処分差益		—	—	2	398
III 資本剰余金減少高					
1 自己株式処分差損		0	0	—	—
IV 資本剰余金 中間期末(期末)残高			117,940		118,339
(利益剰余金の部)					
I 利益剰余金期首残高			362,948		362,948
II 利益剰余金増加高					
1 中間(当期)純利益		45,822		139,948	
2 子会社合併による増加高		609	46,432	609	140,557
III 利益剰余金減少高					
1 配当金		10,644		26,611	
2 取締役賞与金		678	11,323	678	27,290
IV 利益剰余金 中間期末(期末)残高			398,057		476,216

④ 【中間連結株主資本等変動計算書】

当中間連結会計期間(自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式申込証拠金	株主資本合計
平成18年3月31日残高(百万円)	138,828	118,339	476,216	△14,660	—	718,723
中間連結会計期間中の変動額						
新株の発行	39,495	39,495				78,991
剰余金の配当			△29,065			△29,065
役員賞与			△1,827			△1,827
中間純利益			40,127			40,127
自己株式の取得				△162		△162
自己株式の処分		△156	△813	2,322		1,353
その他					0	0
中間連結会計期間中の変動額合計(百万円)	39,495	39,339	8,420	2,160	0	89,416
平成18年9月30日残高(百万円)	178,324	157,678	484,637	△12,501	0	808,140

	評価・換算差額等				新株予約権	少数株主持分	純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	為替換算 調整勘定	評価・換算 差額等合計			
平成18年3月31日残高(百万円)	72,694	—	863	73,557	—	236,718	1,028,999
中間連結会計期間中の変動額							
新株の発行				—			78,991
剰余金の配当				—			△29,065
役員賞与				—			△1,827
中間純利益				—			40,127
自己株式の取得				—			△162
自己株式の処分				—			1,353
その他				—			0
株主資本以外の項目の中間連結 会計期間中の変動額(純額)	△15,548	485	4,218	△10,844	468	34,362	23,985
中間連結会計期間中の変動額合計 (百万円)	△15,548	485	4,218	△10,844	468	34,362	113,402
平成18年9月30日残高(百万円)	57,145	485	5,082	62,713	468	271,080	1,142,402

⑤ 【中間連結キャッシュ・フロー計算書】

		前中間連結会計期間 (自 平成17年 4月 1日 至 平成17年 9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年 4月 1日 至 平成18年 9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年 4月 1日 至 平成18年 3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)	金額(百万円)
I 営業活動による キャッシュ・フロー				
1 税金等調整前中間 (当期)純利益		94,225	86,209	258,355
2 減価償却費		11,140	11,006	22,640
3 退職給付引当金の増加額		662	174	738
4 受取利息及び受取配当金		△96,697	△175,038	△245,724
5 支払利息		87,988	161,848	231,335
6 持分法による投資損益		△661	△578	△1,528
7 特別損益項目に係る調整				
(1) 固定資産除売却損		249	437	548
(2) 関係会社株式売却益		△3,714	△147	△3,714
(3) 関係会社株式評価減		—	200	—
(4) 投資有価証券売却益		△2,443	△1,768	△6,385
(5) 投資有価証券売却損		17	238	69
(6) 投資有価証券評価減		121	546	499
(7) 持分変動益		△4,725	—	△4,725
(8) 訴訟損失		—	—	1,279
(9) 訴訟損失引当金繰入		—	550	—
(10) 減損損失		—	—	6,850
(11) 臨時償却費		—	—	4,439
(12) 海外子会社為替差損		—	—	1,563
(13) 証券取引責任準備金 繰入		—	183	1,374
(14) 証券市場基盤整備 基金拠出金		—	—	200
(15) その他		226	—	297
8 顧客分別金信託の増減		△21,451	104,734	△137,291
9 貸付金の増減		37,713	16,369	17,495
10 営業投資有価証券の増減		△66,315	△25,536	△192,644
11 トレーディング商品の増減		△1,250,472	△582,960	615,610
12 信用取引資産・負債の増減		△11,111	61,237	△195,882
13 有価証券担保貸付金・ 有価証券担保借入金の増減		1,271,393	1,110,005	△63,703
14 その他		54,982	19,506	59,506
小計		101,128	787,218	371,203
15 利息及び配当金の受取額		92,801	172,784	232,214
16 利息の支払額		△85,302	△159,816	△222,153
17 法人税等の支払額		△7,635	△74,589	△11,404
営業活動による キャッシュ・フロー		100,992	725,596	369,860

		前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)	金額(百万円)
Ⅱ 投資活動による キャッシュ・フロー				
1 定期預金の増加による支出		—	△2,602	△10,685
2 定期預金の減少による収入		55,201	12,602	55,201
3 有価証券の取得による支出		△6,064	△16,791	△14,382
4 有価証券の売却・償還 による収入		2,228	13,093	10,423
5 有形固定資産の取得 による支出		△4,215	△5,000	△12,525
6 有形固定資産の売却 による収入		17	265	718
7 無形固定資産の取得 による支出		△10,413	△15,634	△24,311
8 連結範囲の変更を伴う 子会社株式の取得		—	1,356	—
9 関係会社株式の取得 による支出		△7,582	△1,765	△7,582
10 関係会社株式の売却 による収入		13,416	302	13,416
11 投資有価証券の取得 による支出		△10,358	△8,474	△29,589
12 投資有価証券の売却・ 償還による収入		8,314	9,859	19,763
13 貸付による支出		△66	△35	△116
14 貸付の回収による収入		79	168	253
15 その他		△686	1,057	△1,496
投資活動による キャッシュ・フロー		39,869	△11,598	△911
Ⅲ 財務活動による キャッシュ・フロー				
1 短期借入の増減		△157,223	△891,941	△446,189
2 社債・転換社債の償還 による支出		△182,238	△191,462	△401,373
3 社債・転換社債の発行 による収入		186,510	285,622	505,357
4 転換社債償還基金への 支出		—	△61,877	—
5 長期借入の返済による支出		△56,014	△9,487	△70,004
6 長期借入による収入		101,500	42,300	128,500
7 配当金の支払額		△10,644	△29,065	△26,611
8 少数株主への配当金の 支払額		△9,174	△12,033	△9,176
9 少数株主への株式発行 による収入		9,999	40,080	9,999
10 自己株式の売却による収入		14	1,353	21
11 その他		△333	△583	△14,578
財務活動による キャッシュ・フロー		△117,605	△827,096	△324,056
Ⅳ 現金及び現金同等物に 係る換算差額		1,639	1,959	7,428
Ⅴ 現金及び現金同等物の 増加額又は減少額(△)		24,896	△111,138	52,321
Ⅵ 現金及び現金同等物の 期首残高		338,697	392,350	338,697
Ⅶ 子会社合併に伴う現金及び 現金同等物の増加額		602	—	1,331
Ⅷ 現金及び現金同等物の 中間期末(期末)残高	※1	364,196	281,211	392,350

中間連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項

前中間連結会計期間 (自 平成17年 4 月 1 日 至 平成17年 9 月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年 4 月 1 日 至 平成18年 9 月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年 4 月 1 日 至 平成18年 3 月31日)
1 連結の範囲に関する事項 (1) 連結子会社の数 46社 主要な連結子会社名 大和証券株式会社 大和証券エスエムビーシー株式会社 大和証券投資信託委託株式会社 株式会社大和総研 株式会社大和証券ビジネスセンター 大和プロパティ株式会社 エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社 大和証券SMBCヨーロッパリミテッド 大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc 大和アメリカ Corporation 大和セキュリティーズ アメリカInc. 大和証券SMBCアジアホールディングB. V. 大和証券SMBC香港リミテッド 大和証券SMBCシンガポールリミテッド 当中間連結会計期間において、連結子会社と非連結子会社が合併しております。なお、この合併による連結子会社数に変更はありません。 (2) 主要な非連結子会社の名称等 主要な非連結子会社 株式会社大和ソフトウェアリサーチ 連結の範囲から除いた理由 非連結子会社の総資産、営業収益(または売上高)、中間純損益(持分に見合う額)及び利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも中間連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。	1 連結の範囲に関する事項 (1) 連結子会社の数 47社 主要な連結子会社名 大和証券株式会社 大和証券エスエムビーシー株式会社 大和証券投資信託委託株式会社 株式会社大和総研 株式会社大和証券ビジネスセンター 大和プロパティ株式会社 エヌ・アイ・エフ SMBC ベンチャーズ株式会社 大和証券SMBCヨーロッパリミテッド 大和アメリカ Corporation 大和セキュリティーズ アメリカInc. 大和証券SMBCアジアホールディングB. V. 大和証券SMBC香港リミテッド 大和証券SMBCシンガポールリミテッド 当中間連結会計期間において、株式の追加取得により 1 社を連結の範囲に含めております。 (2) 主要な非連結子会社の名称等 主要な非連結子会社 株式会社大和ソフトウェアリサーチ 連結の範囲から除いた理由 非連結子会社の総資産、営業収益(または売上高)、中間純損益(持分に見合う額)及び利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも中間連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。	1 連結の範囲に関する事項 (1) 連結子会社の数 46社 主要な連結子会社名 大和証券株式会社 大和証券エスエムビーシー株式会社 大和証券投資信託委託株式会社 株式会社大和総研 株式会社大和証券ビジネスセンター 大和プロパティ株式会社 エヌ・アイ・エフ SMBC ベンチャーズ株式会社 大和証券SMBCヨーロッパリミテッド 大和アメリカ Corporation 大和セキュリティーズ アメリカInc. 大和証券SMBCアジアホールディングB. V. 大和証券SMBC香港リミテッド 大和証券SMBCシンガポールリミテッド 当連結会計年度において、連結財務諸表に及ぼす重要性が増したことから国内非連結子会社 1 社を連結の範囲に含め、国内連結子会社 2 社と国内非連結子会社が合併したことに伴い、連結子会社が 1 社減少しております。 (2) 主要な非連結子会社の名称等 主要な非連結子会社 株式会社大和ソフトウェアリサーチ 連結の範囲から除いた理由 非連結子会社の総資産、営業収益(または売上高)、当期純損益(持分に見合う額)及び利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
	(3) 他の会社等の議決権の過半数を自己の計算において所有しているにもかかわらず、一部の会社等を子会社としておりません。当該他の会社等の数及び主要な会社の名称、子会社としなかった理由は次のとおりであります。 当該他の会社等の数 9社 子会社としなかった主要な会社の名称 三井観光開発株式会社 明星電気株式会社 子会社としなかった理由 当社の一部の連結子会社が、プリンシパル・ファイナンス業務及びベンチャー・キャピタル業務の営業目的で取得、保有しているものであり、当社グループの傘下に入れることを目的としていないためであります。	(3) 他の会社等の議決権の過半数を自己の計算において所有しているにもかかわらず、一部の会社等を子会社としておりません。当該他の会社等の数及び主要な会社の名称、子会社としなかった理由は次のとおりであります。 当該他の会社等の数 3社 子会社としなかった主要な会社の名称 三井観光開発株式会社 明星電気株式会社 上記のほか、投資事業有限責任組合等を通じて所有している議決権を考慮した場合の当該他の会社等の数は2社であります。 子会社としなかった理由 当社の一部の連結子会社が、プリンシパル・ファイナンス業務及びベンチャー・キャピタル業務の営業目的で取得、保有しているものであり、当社グループの傘下に入れることを目的としていないためであります。
2 持分法の適用に関する事項 (1) 持分法適用の非連結子会社数 0社 (2) 持分法適用の関連会社数 6社 主要な会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社 海際大和証券有限責任公司 東短ホールディングス株式会社 東京短資株式会社 当中間連結会計期間において、株式を取得したことに伴い関連会社となった1社を持分法適用会社に加えました。	2 持分法の適用に関する事項 (1) 持分法適用の非連結子会社数 0社 (2) 持分法適用の関連会社数 4社 主要な会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社 海際大和証券有限責任公司 東短ホールディングス株式会社 東京短資株式会社 当中間連結会計期間において、会社の清算に伴い1社を持分法の適用から除外しております。	2 持分法の適用に関する事項 (1) 持分法適用の非連結子会社数 0社 (2) 持分法適用の関連会社数 5社 主要な会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社 海際大和証券有限責任公司 東短ホールディングス株式会社 東京短資株式会社 当連結会計年度において、株式を取得したことに伴い1社を持分法適用の関連会社に加え、国内連結子会社との合併により持分法適用の関連会社が1社減少しました。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
(3) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社 持分法を適用しない非連結子会社のうち主要な会社名 株式会社大和ソフトウェアリサーチ 持分法を適用しない関連会社のうち主要な会社名 大興電子通信株式会社 持分法を適用しない理由 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の間純損益(持分に見合う額)、利益剰余金(持分に見合う額)等のそれぞれの合計額は、いずれも中間連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。 (4) 持分法適用会社のうち、中間決算日が中間連結決算日と異なる会社については、当該会社の中間会計期間にかかる財務諸表を使用しております。	(3) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社 持分法を適用しない非連結子会社のうち主要な会社名 株式会社大和ソフトウェアリサーチ 持分法を適用しない理由 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の間純損益(持分に見合う額)、利益剰余金(持分に見合う額)等のそれぞれの合計額は、いずれも中間連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。 (4) 同左 (5) 他の会社等の議決権の20%以上、50%以下を自己の計算において所有しているにもかかわらず、一部の会社等を関連会社としておりません。当該他の会社等の数及び主要な会社の名称、関連会社としなかった理由は次のとおりであります。 当該他の会社等の数 34社 関連会社としなかった主要な会社の名称 三洋電機株式会社 三井住友建設株式会社 丸善株式会社 株式会社オギハラ 関連会社としなかった理由 当社の一部の連結子会社が、プリンシパル・ファイナンス業務及びベンチャー・キャピタル業務の営業目的で取得、保有しているものであり、人事、資金、技術、取引等の関係を通じて当社グループの傘下に入れることを目的とする保有でないためであります。	(3) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社 持分法を適用しない非連結子会社のうち主要な会社名 株式会社大和ソフトウェアリサーチ 持分法を適用しない関連会社のうち主要な会社名 大興電子通信株式会社 持分法を適用しない理由 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の当期純損益(持分に見合う額)、利益剰余金(持分に見合う額)等のそれぞれの合計額は、いずれも連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。 (4) 持分法適用会社のうち、決算日が連結決算日と異なる会社については、当該会社の事業年度にかかる財務諸表を使用しております。 (5) 他の会社等の議決権の20%以上、50%以下を自己の計算において所有しているにもかかわらず、一部の会社等を関連会社としておりません。当該他の会社等の数及び主要な会社の名称、関連会社としなかった理由は次のとおりであります。 当該他の会社等の数 12社 関連会社としなかった主要な会社の名称 三洋電機株式会社 三井住友建設株式会社 丸善株式会社 株式会社オギハラ 上記のほか、投資事業有限責任組合等を通じて所有している議決権を考慮した場合の当該他の会社等の数は1社であります。 関連会社としなかった理由 当社の一部の連結子会社が、プリンシパル・ファイナンス業務及びベンチャー・キャピタル業務の営業目的で取得、保有しているものであり、人事、資金、技術、取引等の関係を通じて当社グループの傘下に入れることを目的とする保有でないためであります。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
3 連結子会社の中間決算日等に関する事項 連結子会社の中間決算日は以下のとおりであります。 9月 45社 6月 1社 連結子会社の中間決算日が中間連結決算日と異なる会社(DBP-大和証券SMBCフィリピン, Inc.)については当該中間決算日現在の財務諸表を使用し、中間連結決算日との間に生じた重要な取引については連結上必要な調整を行っております。 4 会計処理基準に関する事項 (1) 重要な資産の評価基準及び評価方法 ① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法 国内連結子会社における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等については、時価法で計上し、在外連結子会社の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等については、主として時価法で計上しております。 ② トレーディング商品に属さない有価証券、その他の商品の評価基準及び評価方法 トレーディング商品に属さない有価証券等については以下のとおりであります。 ア 満期保有目的債券 償却原価法によっております。 イ その他有価証券 時価のあるものについては中間連結決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部資本直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券または投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部資本直入法により処理しております)。	3 連結子会社の中間決算日等に関する事項 連結子会社の中間決算日は以下のとおりであります。 9月 46社 6月 1社 連結子会社の中間決算日が中間連結決算日と異なる会社(DBP-大和証券SMBCフィリピン, Inc.)については当該中間決算日現在の財務諸表を使用し、中間連結決算日との間に生じた重要な取引については連結上必要な調整を行っております。 4 会計処理基準に関する事項 (1) 重要な資産の評価基準及び評価方法 ① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法 同左 ② トレーディング商品に属さない有価証券、その他の商品の評価基準及び評価方法 トレーディング商品に属さない有価証券等については以下のとおりであります。 ア 売買目的有価証券 時価法(売却原価は移動平均法により算定)によっております。 イ 満期保有目的債券 同左 ウ その他有価証券 時価のあるものについては中間連結決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券または投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。	3 連結子会社の事業年度等に関する事項 連結子会社の決算日は以下のとおりであります。 3月 45社 12月 1社 連結子会社の決算日が連結決算日と異なる会社(DBP-大和証券SMBCフィリピン, Inc.)については当該会社の決算日現在の財務諸表を使用し、連結決算日との間に生じた重要な取引については連結上必要な調整を行っております。 4 会計処理基準に関する事項 (1) 重要な資産の評価基準及び評価方法 ① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法 同左 ② トレーディング商品に属さない有価証券、その他の商品の評価基準及び評価方法 トレーディング商品に属さない有価証券等については以下のとおりであります。 ア 売買目的有価証券 同左 イ 満期保有目的債券 同左 ウ その他有価証券 時価のあるものについては連結決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部資本直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券または投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部資本直入法により処理しております)。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
なお、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。 ③ その他の棚卸資産の評価基準及び評価方法 主として、個別法による原価法で計上しております。 (2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法 ① 有形固定資産 国内連結会社においては、主として定率法によっております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法を採用しております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。 在外連結子会社は主として定額法を採用しております。 ② 無形固定資産、投資その他の資産 主として、定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。 (3) 重要な引当金の計上基準 ① 貸倒引当金 貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 ② 投資損失引当金 一部の連結子会社において、当中間連結会計期間末に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資先会社の実情を勘案の上、その損失見込額を計上しております。	なお、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。 ③ その他の棚卸資産の評価基準及び評価方法 同左 (2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法 ① 有形固定資産 同左 ② 無形固定資産、投資その他の資産 同左 (3) 重要な引当金の計上基準 ① 貸倒引当金 同左 ② 投資損失引当金 同左	なお、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。 ③ その他の棚卸資産の評価基準及び評価方法 同左 (2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法 ① 有形固定資産 同左 (追加情報) 当連結会計年度において、当社及び一部の連結子会社の本店移転決定に伴い、現在本店として使用している一部の建物及び建物附属設備等の耐用年数を移転予定時までの期間に短縮いたしました。この耐用年数の短縮に伴う臨時償却費は4,439百万円であり、特別損失に計上しております。税金等調整前当期純利益は、同額減少しております。 ② 無形固定資産、投資その他の資産 同左 (3) 重要な引当金の計上基準 ① 貸倒引当金 同左 ② 投資損失引当金 一部の連結子会社において、当連結会計年度末に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資先会社の実情を勘案の上、その損失見込額を計上しております。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
③ 賞与引当金 当社の役員、従業員及び連結子会社の従業員に対する賞与の支払に備えるため、各社所定の計算基準による支払見積額の当中間連結会計期間負担分を計上しております。 ④ 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社及び一部を除く国内連結子会社は、社内規程に基づく当中間連結会計期間末における退職金要支給額を計上しております。これは、当該各社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。その他一部の連結子会社については、当連結会計年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間連結会計期間末において発生していると認められる金額を計上しております。また、年金受給権者のみを対象とする閉鎖型適格退職年金については、当連結会計年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間連結会計期間末において発生していると認められる金額を計上しております。 ⑤ 役員退職慰労引当金 一部の連結子会社において役員の退職慰労金の支出に備えるため、各社の役員退職慰労金規程に基づく当中間連結会計期間末における要支給額を計上しております。 一部の連結子会社は、平成17年3月の取締役会において取締役に対する退職慰労金制度の廃止を決定し、重任する取締役に対しては、平成17年3月までの在任期間に対応する退職慰労金を当該重任取締役の退任時に支払うことが、当該連結子会社の平成17年6月の定時株主総会において承認可決されました。これに伴い、当該株主総会終結時における支払予定金額(437百万円)を「その他の固定負債」へ振替えております。	③ 賞与引当金 役員及び従業員に対する賞与の支払に備えるため、各社所定の計算基準による支払見積額の当中間連結会計期間負担分を計上しております。 ④ 退職給付引当金 同左 ⑤ 役員退職慰労引当金 一部の連結子会社において役員の退職慰労金の支出に備えるため、各社の役員退職慰労金規程に基づく当中間連結会計期間末における要支給額を計上しております。	③ 賞与引当金 当社の役員、従業員及び連結子会社の従業員に対する賞与の支払に備えるため、各社所定の計算基準による支払見積額の当連結会計年度負担分を計上しております。 ④ 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社及び一部を除く国内連結子会社は、社内規程に基づく当連結会計年度末における退職金要支給額を計上しております。これは、当該各社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。その他一部の連結子会社については、当連結会計年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当連結会計年度末において発生していると認められる金額を計上しております。また、年金受給権者のみを対象とする閉鎖型適格退職年金については、当連結会計年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当連結会計年度末において発生していると認められる金額を計上しております。 ⑤ 役員退職慰労引当金 一部の連結子会社において役員の退職慰労金の支出に備えるため、各社の役員退職慰労金規程に基づく当連結会計年度末における要支給額を計上しております。 一部の連結子会社は、平成17年3月の取締役会において取締役に対する退職慰労金制度の廃止を決定し、重任する取締役に対しては、平成17年3月までの在任期間に対応する退職慰労金を当該重任取締役の退任時に支払うことが、当該連結子会社の平成17年6月の定時株主総会において承認可決されました。これに伴い、当該株主総会終結時における支払予定金額(437百万円)を「その他の固定負債」へ振替えております。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
(4) 重要なリース取引の処理方法 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、主として通常の賃貸借取引にかかる方法に準じた会計処理によっております。 (5) 重要なヘッジ会計の方法 原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし特例処理の条件を満たしている場合には、金利変動リスク及び為替変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理及び振当処理によっております。 当社及び一部の連結子会社は、一部の借入金、発行社債等にかかる金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っております。 ヘッジの有効性の検証については、ヘッジ手段の時価またはキャッシュ・フロー変動の累計額とヘッジ対象の時価またはキャッシュ・フロー変動の累計額とを比較する方法によっております。 (6) その他中間連結財務諸表作成のための重要な事項 ① 消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。 ② 繰延資産の処理方法 新株発行費及び社債発行費は、全額発生時の費用として処理しております。	⑥ 訴訟損失引当金 証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払に備えるため、経過状況等に基づく当中間連結会計期間末における支払見積額を計上しております。 (追加情報) 当中間連結会計期間より、従来の算定方法に加え、過去の支払実績を勘案した方法を加味して計上しております。 (4) 重要なリース取引の処理方法 同左 (5) 重要なヘッジ会計の方法 同左 (6) その他中間連結財務諸表作成のための重要な事項 ① 消費税等の会計処理方法 同左 ② _____	(4) 重要なリース取引の処理方法 同左 (5) 重要なヘッジ会計の方法 同左 (6) その他連結財務諸表作成のための重要な事項 ① 消費税等の会計処理方法 同左 ② 繰延資産の処理方法 新株発行費及び社債発行費は、全額発生時の費用として処理しております。

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
③ 連結納税制度の適用 当社、大和証券エスエムビーシー株式会社及びエヌ・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社をそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。 5 中間連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲 中間連結キャッシュ・フロー計算書における資金(現金及び現金同等物)は手許現金及び当座預金、普通預金等随時引き出し可能な預金からなっております。	③ 連結納税制度の適用 当社、大和証券エスエムビーシー株式会社、エヌ・アイ・エフ SMBC ベンチャーズ株式会社及びその他1社をそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。 5 中間連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲 同左	③ 連結納税制度の適用 当社、大和証券エスエムビーシー株式会社及びエヌ・アイ・エフ SMBC ベンチャーズ株式会社をそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。 5 連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲 連結キャッシュ・フロー計算書における資金(現金及び現金同等物)は、手許現金及び当座預金、普通預金等随時引き出し可能な預金からなっております。

会計方針の変更

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
—————	(貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準) 当中間連結会計期間より、「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」(企業会計基準第5号 平成17年12月9日)及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」(企業会計基準適用指針第8号 平成17年12月9日)を適用しております。 これまでの資本の部の合計に相当する金額は、870,368百万円であります。 なお、当中間連結会計期間における中間連結貸借対照表の純資産の部については、中間連結財務諸表規則の改正に伴い、改正後の中間連結財務諸表規則により作成しております。	—————
—————	(役員賞与に関する会計基準) 当中間連結会計期間より、「役員賞与に関する会計基準」(企業会計基準第4号 平成17年11月29日)を適用しております。 従来、各連結子会社の株主総会決議時に利益剰余金の減少として会計処理していた役員賞与を当中間連結会計期間より発生時に費用として計上しております。	—————
—————	これにより営業利益、経常利益及び税金等調整前中間純利益は、それぞれ675百万円減少しております。 (ストック・オプション等に関する会計基準) 当中間連結会計期間より、「ストック・オプション等に関する会計基準」(企業会計基準第8号 平成17年12月27日)及び「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第11号 平成18年5月31日)を適用しております。 これにより営業利益、経常利益及び税金等調整前中間純利益は、それぞれ468百万円減少しております。	—————

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
	(投資事業組合に対する支配力基準及び影響力基準の適用に関する実務上の取扱い) 当中間連結会計期間より「投資事業組合に対する支配力基準及び影響力基準の適用に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第20号 平成18年9月8日)を適用しております。 当実務対応報告の適用による連結財務諸表への影響はありません。	

表示方法の変更

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)
(中間連結貸借対照表) 「証券取引法等の一部を改正する法律」(平成16年法律第97号)が平成16年6月9日に公布され、平成16年12月1日より適用となること及び「金融商品会計に関する実務指針」(会計制度委員会報告第14号)が平成17年2月15日付で改正されたことに伴い、投資事業有限責任組合等への出資は、前連結会計年度より有価証券として表示しております。この変更に伴い、「その他の流動資産」及び「その他の投資等」がそれぞれ20,776百万円、72,046百万円減少し、「営業投資有価証券」及び「投資有価証券」がそれぞれ89,661百万円、3,161百万円増加しております。 (中間連結損益計算書) 投資事業有限責任組合等への出資について、従来、組合等の営業により獲得した損益を「金融収益」として表示しておりましたが、当中間連結会計期間より「営業投資有価証券売買損益」と合わせて「営業投資有価証券関連損益」として表示しております。この変更に伴い、従来の方法によった場合と比べ、「金融収益」が6,266百万円減少しております。 (中間連結キャッシュ・フロー計算書) 前中間連結会計期間において投資活動によるキャッシュ・フローの「その他」に含めていた「定期預金の増加による支出」は、前連結会計年度より区分掲記し、「定期預金の減少による収入」は、重要性が増したため、当中間連結会計期間より区分掲記しております。	_____ _____ _____

注記事項

(中間連結貸借対照表関係)

前中間連結会計期間末 (平成17年 9 月 30 日)	当中間連結会計期間末 (平成18年 9 月 30 日)	前連結会計年度末 (平成18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100,264百万円であります。	※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は109,422百万円であります。	※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は105,753百万円であります。
※2 担保に供されている資産	※2 担保に供されている資産	※2 担保に供されている資産
現金・預金 21,174百万円	現金・預金 380百万円	トレーディング商品 997,505百万円
トレーディング商品 1,873,293	トレーディング商品 827,181	営業投資有価証券 24
投資有価証券 89,953	営業投資有価証券 24	短期貸付金 42,633
計 1,984,421	短期貸付金 7,820	その他の流動資産 3,457
被担保債務	その他の流動資産 478	投資有価証券 99,671
信用取引借入金 8,126百万円	投資有価証券 87,513	計 1,143,291
短期借入金 1,554,537	計 923,397	被担保債務
計 1,562,663	被担保債務	信用取引借入金 7,569百万円
(注) 上記の金額は中間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他に、借り入れた有価証券414,251百万円を担保として差し入れております。	信用取引借入金 16,293百万円	短期借入金 1,045,300
	短期借入金 301,856	長期借入金 30
	長期借入金 30	計 1,052,899
	計 318,180	(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他に、借り入れた有価証券384,371百万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	(注) 上記の金額は中間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他に、借り入れた有価証券等194,302百万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
消費貸借契約により貸し付けた有価証券 6,222,938百万円	消費貸借契約により貸し付けた有価証券 6,598,119百万円	消費貸借契約により貸し付けた有価証券 5,613,009百万円
現先取引で売却した有価証券 416,145	現先取引で売却した有価証券 747,912	現先取引で売却した有価証券 218,580
その他 537,508	その他 408,308	その他 713,788
計 7,176,592	計 7,754,340	計 6,545,377
(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。	(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。

前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)	当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)	前連結会計年度末 (平成18年3月31日)																														
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 8,746,516百万円 有価証券 その他 383,017 計 9,129,533 ※5 貸倒引当金7,914百万円は、債権額と相殺して表示しております。 ※6 長期借入金には「証券会社の自己資本規制に関する内閣府令」(平成13年内閣府令第23号)第2条に定める劣後特約付借入金が102,000百万円含まれております。 ※7 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は以下のとおりであります。 証券取引責任準備金 証券取引法第51条 金融先物取引責任準備金 金融先物取引法第81条 8 保証債務 <table border="1"> <thead> <tr> <th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>従業員</td><td>借入金</td><td>3,040</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>借入金等</td><td>1</td></tr> <tr> <td>合計</td><td></td><td>3,041</td></tr> </tbody> </table> 9 連結子会社における借入コミットメントにかかる借入未実行残高は86,641百万円であります。	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	3,040	その他	借入金等	1	合計		3,041	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 8,215,977百万円 有価証券 その他 999,849 計 9,215,826 ※5 貸倒引当金7,689百万円は、債権額と相殺して表示しております。 ※6 短期借入金及び長期借入金には「証券会社の自己資本規制に関する内閣府令」(平成13年内閣府令第23号)第2条に定める劣後特約付借入金がそれぞれ62,000百万円、60,000百万円含まれております。 ※7 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は以下のとおりであります。 証券取引責任準備金 証券取引法第51条 金融先物取引責任準備金 金融先物取引法第81条 8 保証債務 <table border="1"> <thead> <tr> <th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>従業員等</td><td>借入金</td><td>1,997</td></tr> </tbody> </table> 9 連結子会社における借入コミットメントにかかる借入未実行残高は94,939百万円であります。	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員等	借入金	1,997	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 8,251,238百万円 有価証券 現先取引で買い付けた有価証券 120 その他 578,147 計 8,829,506 ※5 貸倒引当金8,277百万円は、債権額と相殺して表示しております。 ※6 短期借入金及び長期借入金には「証券会社の自己資本規制に関する内閣府令」(平成13年内閣府令第23号)第2条に定める劣後特約付借入金がそれぞれ20,000百万円、82,000百万円含まれております。 ※7 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は以下のとおりであります。 証券取引責任準備金 証券取引法第51条 金融先物取引責任準備金 金融先物取引法第81条 8 保証債務 <table border="1"> <thead> <tr> <th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>従業員</td><td>借入金</td><td>2,505</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>借入金</td><td>1</td></tr> <tr> <td>合計</td><td></td><td>2,506</td></tr> </tbody> </table> 9 連結子会社における借入コミットメントにかかる借入未実行残高は85,105百万円であります。	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	2,505	その他	借入金	1	合計		2,506
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																														
従業員	借入金	3,040																														
その他	借入金等	1																														
合計		3,041																														
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																														
従業員等	借入金	1,997																														
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																														
従業員	借入金	2,505																														
その他	借入金	1																														
合計		2,506																														

(中間連結損益計算書関係)

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
※1 人件費の中には、賞与引当金繰入額23,028百万円、役員退職慰労引当金繰入額87百万円が含まれております。	※1 人件費の中には、賞与引当金繰入額22,680百万円、役員退職慰労引当金繰入額93百万円が含まれております。	※1 人件費の中には、賞与引当金繰入額40,744百万円、役員退職慰労引当金繰入額173百万円が含まれております。
※2 営業外収益の「その他」には、受取利息461百万円及び受取配当金1,610百万円を含めております。	※2 営業外収益の「その他」には、受取利息2,861百万円及び受取配当金1,915百万円を含めております。	※2 営業外収益の「その他」には、受取利息567百万円及び受取配当金2,271百万円を含めております。
※3 営業外費用の「その他」には、支払利息111百万円を含めております。	※3 営業外費用の「その他」には、支払利息74百万円を含めております。	※3 営業外費用の「その他」には、支払利息241百万円を含めております。
※4 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。 固定資産売却損 有形固定資産 93百万円 その他の投資等 69百万円 固定資産除却損 有形固定資産 80百万円 その他の投資等 5百万円	※4 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。 固定資産売却損 有形固定資産 126百万円 その他の投資等 7百万円 固定資産除却損 有形固定資産 282百万円 無形固定資産 20百万円	※4 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。 固定資産売却損 建物 59百万円 土地 33百万円 その他の投資等 94百万円 固定資産除却損 建物 61百万円 器具備品 101百万円 電話加入権 179百万円 その他
※5 特別損失の「その他」は、主に連結子会社において店舗の統合等に伴い発生した費用であります。		
※6 当中間連結会計期間に係る納付税額及び法人税等調整額は、当連結会計年度末において、一部の連結子会社で予定している利益処分による特別償却準備金の取崩しを前提として、当中間連結会計期間にかかる金額を計算しております。	※6 当中間連結会計期間に係る納付税額及び法人税等調整額は、当連結会計年度末において、一部の連結子会社で予定している特別償却準備金の取崩しを前提として、当中間連結会計期間にかかる金額を計算しております。	
		※7 以下の資産グループについて減損損失を計上しております。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い行っております。また、処分予定資産については個別物件単位で行っております。

前中間連結会計期間 (自 平成17年 4 月 1 日 至 平成17年 9 月30 日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年 4 月 1 日 至 平成18年 9 月30 日)	前連結会計年度 (自 平成17年 4 月 1 日 至 平成18年 3 月31 日)																
		用途の変更、時価の下落または稼働率の低下に伴い、収益性が著しく低下している資産については、帳簿価額を回収可能額まで減額し、当該減少額を減損損失(6,850百万円)として特別損失に計上しております。 <table><tr><td></td><td>用途</td><td>地域</td><td>減損損失 (百万円)</td></tr><tr><td>継続使用 資産</td><td>低収益性 資産</td><td>関東、 近畿、 その他</td><td>6,201</td></tr><tr><td>処分予定 資産</td><td>低稼働 資産</td><td>関東、 その他</td><td>649</td></tr><tr><td colspan="3">合計</td><td>6,850</td></tr></table> その内訳は、継続使用資産6,201百万円(うち建物1,212百万円、土地4,988百万円)、処分予定資産649百万円(うち建物71百万円、土地578百万円)であります。 なお、当該資産の回収可能価額について、継続使用資産は、主として使用価値により測定しており、将来キャッシュ・フローを5%で割り引いて算定しております。また、処分予定資産は、正味売却価額により測定しており、建物及び土地については主として不動産鑑定評価基準に基づき評価しております。		用途	地域	減損損失 (百万円)	継続使用 資産	低収益性 資産	関東、 近畿、 その他	6,201	処分予定 資産	低稼働 資産	関東、 その他	649	合計			6,850
	用途	地域	減損損失 (百万円)															
継続使用 資産	低収益性 資産	関東、 近畿、 その他	6,201															
処分予定 資産	低稼働 資産	関東、 その他	649															
合計			6,850															

(中間連結株主資本等変動計算書関係)

当中間連結会計期間(自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	前連結会計年度末 株式数	増加株式数	減少株式数	当中間連結会計期間末 株式数
普通株式(千株)	1,332,460	72,204	—	1,404,664

(注) 普通株式の株式数の増加は、転換社債の転換によるものであります。

2 自己株式に関する事項

株式の種類	前連結会計年度末 株式数	増加株式数	減少株式数	当中間連結会計期間末 株式数
普通株式(千株)	11,295	115	1,786	9,624

(注) 1 普通株式の自己株式の株式数の増加115千株は、単元未満株式の買取請求による取得であります。

2 普通株式の自己株式の株式数の減少1,786千株は、単元未満株式の売渡請求による譲渡10千株、新株予約権の行使による譲渡1,776千株であります。

3 新株予約権等に関する事項

区分	内訳	目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間連結 会計期間末 残高 (百万円)
			前連結会計 年度末	増加	減少	当中間連結 会計期間末	
提出会社	ストック・オプション としての新株予約権		—				432
連結 子会社	ストック・オプション としての新株予約権		—				35
合計			—				468

(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18年5月18日 取締役会	普通株式	29,065	22	平成18年3月31日	平成18年6月1日

(2) 基準日が当中間連結会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間連結会計期間末後となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	配当の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成18年10月26日 取締役会	普通株式	16,740	利益剰余金	12	平成18年9月30日	平成18年12月1日

(中間連結キャッシュ・フロー計算書関係)

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
※1 現金及び現金同等物の中間 期末残高と中間連結貸借対 照表に掲記されている科目 の金額との関係 (単位：百万円) 現金・預金勘定 369,007 預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 △4,810 現金及び現金同等物 364,196	※1 現金及び現金同等物の中間 期末残高と中間連結貸借対 照表に掲記されている科目 の金額との関係 (単位：百万円) 現金・預金勘定 287,135 預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 △5,924 現金及び現金同等物 281,211 2 重要な非資金取引の内容 当中間連結会計期間の転換社 債の転換による資本金増加額 及び資本準備金増加額、並び に転換社債減少額は次のとお りであります。 (単位：百万円) 転換社債の転換によ る資本金増加額 39,495 転換社債の転換によ る資本準備金増加額 39,495 転換による転換社債 減少額 78,992	※1 現金及び現金同等物の期末 残高と連結貸借対照表に掲 記されている科目の金額と の関係 (単位：百万円) 現金・預金勘定 407,889 預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 △15,539 現金及び現金同等物 392,350

(リース取引関係)

前中間連結会計期間 (自 平成17年 4月 1日 至 平成17年 9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年 4月 1日 至 平成18年 9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年 4月 1日 至 平成18年 3月31日)																																																																														
< 借手側 > 1 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引は次のとおりであります。 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額 <table><tr><td colspan="2">器具備品等</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>8,368百万円</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>4,568</td></tr></table> <table><tr><td>中間期末残高相当額</td><td>3,799</td></tr></table> 未経過リース料中間期末残高相当額 <table><tr><td>1年内</td><td>1,629百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>2,264</td></tr><tr><td>合計</td><td>3,893</td></tr></table> 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 <table><tr><td>支払リース料</td><td>1,028百万円</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>980百万円</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>46百万円</td></tr></table> 減価償却費相当額の算定方法 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。 利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。 2 オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 未経過リース料 <table><tr><td>1年内</td><td>2,004百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>9,343</td></tr><tr><td>合計</td><td>11,348</td></tr></table>	器具備品等		取得価額相当額	8,368百万円	減価償却累計額相当額	4,568	中間期末残高相当額	3,799	1年内	1,629百万円	1年超	2,264	合計	3,893	支払リース料	1,028百万円	減価償却費相当額	980百万円	支払利息相当額	46百万円	1年内	2,004百万円	1年超	9,343	合計	11,348	< 借手側 > 1 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引は次のとおりであります。 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額 <table><tr><td colspan="2">器具備品等</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>7,251百万円</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>4,764</td></tr></table> <table><tr><td>中間期末残高相当額</td><td>2,487</td></tr></table> 未経過リース料中間期末残高相当額 <table><tr><td>1年内</td><td>1,360百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>1,197</td></tr><tr><td>合計</td><td>2,557</td></tr></table> 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 <table><tr><td>支払リース料</td><td>831百万円</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>790百万円</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>30百万円</td></tr></table> 減価償却費相当額の算定方法 同左 利息相当額の算定方法 同左 2 オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 未経過リース料 <table><tr><td>1年内</td><td>2,095百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>8,731</td></tr><tr><td>合計</td><td>10,826</td></tr></table>	器具備品等		取得価額相当額	7,251百万円	減価償却累計額相当額	4,764	中間期末残高相当額	2,487	1年内	1,360百万円	1年超	1,197	合計	2,557	支払リース料	831百万円	減価償却費相当額	790百万円	支払利息相当額	30百万円	1年内	2,095百万円	1年超	8,731	合計	10,826	< 借手側 > 1 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引は次のとおりであります。 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 <table><tr><td colspan="2">器具備品等</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>7,684百万円</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>4,584</td></tr></table> <table><tr><td>期末残高相当額</td><td>3,100</td></tr></table> 未経過リース料期末残高相当額等 <table><tr><td>1年内</td><td>1,500百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>1,680</td></tr><tr><td>合計</td><td>3,181</td></tr></table> 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 <table><tr><td>支払リース料</td><td>1,919百万円</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>1,827百万円</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>83百万円</td></tr></table> 減価償却費相当額の算定方法 同左 利息相当額の算定方法 同左 2 オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 未経過リース料 <table><tr><td>1年内</td><td>1,999百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>7,000</td></tr><tr><td>合計</td><td>9,000</td></tr></table>	器具備品等		取得価額相当額	7,684百万円	減価償却累計額相当額	4,584	期末残高相当額	3,100	1年内	1,500百万円	1年超	1,680	合計	3,181	支払リース料	1,919百万円	減価償却費相当額	1,827百万円	支払利息相当額	83百万円	1年内	1,999百万円	1年超	7,000	合計	9,000
器具備品等																																																																																
取得価額相当額	8,368百万円																																																																															
減価償却累計額相当額	4,568																																																																															
中間期末残高相当額	3,799																																																																															
1年内	1,629百万円																																																																															
1年超	2,264																																																																															
合計	3,893																																																																															
支払リース料	1,028百万円																																																																															
減価償却費相当額	980百万円																																																																															
支払利息相当額	46百万円																																																																															
1年内	2,004百万円																																																																															
1年超	9,343																																																																															
合計	11,348																																																																															
器具備品等																																																																																
取得価額相当額	7,251百万円																																																																															
減価償却累計額相当額	4,764																																																																															
中間期末残高相当額	2,487																																																																															
1年内	1,360百万円																																																																															
1年超	1,197																																																																															
合計	2,557																																																																															
支払リース料	831百万円																																																																															
減価償却費相当額	790百万円																																																																															
支払利息相当額	30百万円																																																																															
1年内	2,095百万円																																																																															
1年超	8,731																																																																															
合計	10,826																																																																															
器具備品等																																																																																
取得価額相当額	7,684百万円																																																																															
減価償却累計額相当額	4,584																																																																															
期末残高相当額	3,100																																																																															
1年内	1,500百万円																																																																															
1年超	1,680																																																																															
合計	3,181																																																																															
支払リース料	1,919百万円																																																																															
減価償却費相当額	1,827百万円																																																																															
支払利息相当額	83百万円																																																																															
1年内	1,999百万円																																																																															
1年超	7,000																																																																															
合計	9,000																																																																															
< 貸手側 > 1 オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 未経過リース料 <table><tr><td>1年内</td><td>232百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>864</td></tr><tr><td>合計</td><td>1,097</td></tr></table>	1年内	232百万円	1年超	864	合計	1,097	< 貸手側 > 1 オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 未経過リース料 <table><tr><td>1年内</td><td>286百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>819</td></tr><tr><td>合計</td><td>1,106</td></tr></table>	1年内	286百万円	1年超	819	合計	1,106	< 貸手側 > 1 オペレーティング・リース取引は次のとおりであります。 未経過リース料 <table><tr><td>1年内</td><td>387百万円</td></tr><tr><td>1年超</td><td>1,415</td></tr><tr><td>合計</td><td>1,802</td></tr></table>	1年内	387百万円	1年超	1,415	合計	1,802																																																												
1年内	232百万円																																																																															
1年超	864																																																																															
合計	1,097																																																																															
1年内	286百万円																																																																															
1年超	819																																																																															
合計	1,106																																																																															
1年内	387百万円																																																																															
1年超	1,415																																																																															
合計	1,802																																																																															

(有価証券及びデリバティブ取引関係)

1 取引の状況に関する事項

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
(1) 取引の内容 当社グループにおいては主に証券会社がトレーディング業務を行っております。トレーディング・ポジションは顧客との取引及び自己の計算で行う取引から発生しております。トレーディング業務において取扱っている商品を大別しますと、①株式・債券・その他の商品有価証券等の現物取引、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引の金融派生商品、③金利及び通貨スワップ・先物外国為替取引・選択権付債券売買・通貨オプション・FRA・有価証券店頭デリバティブ等の取引所取引以外の金融派生商品(店頭デリバティブ取引)の3種類であります。 また、当社グループではトレーディング以外の資産・負債にかかるリスクをヘッジするため、主にスワップ取引を利用しております。 (2) 取引の利用目的 トレーディング業務を行う証券会社では、現物市場とデリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者として取引しております。金融派生商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供等があります。最終利用者としては、当社グループの資産・負債にかかる金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。	(1) 取引の内容 同左 (2) 取引の利用目的 同左	(1) 取引の内容 同左 (2) 取引の利用目的 同左

2 有価証券及びデリバティブ取引

(1) トレーディング商品に属するもの

① 商品有価証券(売買目的有価証券)等

種類	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)		当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)		前連結会計年度末 (平成18年3月31日)	
	資産(百万円)	負債(百万円)	資産(百万円)	負債(百万円)	資産(百万円)	負債(百万円)
株券・ワラント	358,060	126,438	283,844	100,610	371,947	99,551
債券	5,144,277	3,217,659	4,053,977	3,333,455	4,005,131	3,216,833
CP及びCD	18,220	—	25,747	—	8,032	—
受益証券等	167,162	1,490	208,572	6,550	106,100	5,471

② デリバティブ取引

種類	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)				当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)				前連結会計年度末 (平成18年3月31日)			
	資産(百万円)		負債(百万円)		資産(百万円)		負債(百万円)		資産(百万円)		負債(百万円)	
	契約額等	時価	契約額等	時価	契約額等	時価	契約額等	時価	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	5,919,224	123,357	6,143,899	183,621	11,131,142	140,099	10,930,622	205,499	21,584,309	908,197	22,481,967	1,007,981
為替予約取引	1,242,626	15,745	904,150	6,677	1,216,769	35,485	1,001,840	7,367	714,290	10,686	1,180,516	9,833
先物・先渡取引	782,642	84,638	1,870,600	66,267	2,420,944	128,487	1,006,790	28,649	714,102	146,247	2,352,521	57,398
スワップ取引	27,545,307	428,198	25,517,514	326,809	30,871,862	517,268	27,288,897	367,101	28,329,460	607,482	26,410,508	480,972
その他	44,890	577	98,321	673	125,114	1,464	166,068	997	76,338	1,127	117,235	1,147
クレジット リザーブ	—	△2,090	—	—	—	△2,037	—	—	—	△2,711	—	—

(注) 為替予約取引及び先物取引についてはみなし決済損益を時価欄に記載しております。

(2) トレーディング商品に属さないもの

① 満期保有目的の債券で時価のあるもの

種類	前中間連結会計期間末 (平成17年9月30日)			当中間連結会計期間末 (平成18年9月30日)			前連結会計年度末 (平成18年3月31日)		
	中間連結 貸借対照 表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)	中間連結 貸借対照 表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)	連結貸借 対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
流動資産に属する もの	2,407	2,402	△4	2,530	2,529	△1	2,509	2,501	△7
国債・地方債等	2,407	2,402	△4	2,530	2,529	△1	2,509	2,501	△7
社債	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—

その他有価証券で時価のあるもの

種類	前中間連結会計期間末 (平成17年 9月30日)			当中間連結会計期間末 (平成18年 9月30日)			前連結会計年度末 (平成18年 3月31日)		
	取得原価 (百万円)	中間連結 貸借対照 表計上額 (百万円)	差額 (百万円)	取得原価 (百万円)	中間連結 貸借対照 表計上額 (百万円)	差額 (百万円)	取得原価 (百万円)	連結貸借 対照表 計上額 (百万円)	差額 (百万円)
流動資産に属するもの	22,390	45,595	23,205	14,854	25,008	10,154	17,289	36,507	19,218
株券	21,757	44,868	23,111	14,854	25,008	10,154	17,289	36,507	19,218
債券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国債・地方債等	—	—	—	—	—	—	—	—	—
社債	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	633	727	93	—	—	—	—	—	—
固定資産に属するもの	75,034	146,816	71,782	76,717	165,026	88,309	79,073	182,252	103,178
株券	62,526	133,284	70,758	64,882	151,826	86,944	65,204	166,620	101,416
債券	150	160	10	150	157	7	150	158	8
国債・地方債等	—	—	—	—	—	—	—	—	—
社債	—	—	—	—	—	—	—	—	—
その他	150	160	10	150	157	7	150	158	8
その他	12,358	13,371	1,013	11,685	13,042	1,357	13,718	15,473	1,754

(注) 前中間連結会計期間においては101百万円、当中間連結会計期間においては27百万円、前連結会計年度においては42百万円の減損処理を行っております。

なお、有価証券の減損にあたって、時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は著しい下落とみなし、減損処理を行っております。また、時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、過去2年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可能性を検討し、必要と認められた額については減損処理を行っております。

時価評価されていない主な有価証券の内容及び中間連結貸借対照表計上額

種類	前中間連結会計期間末 (平成17年 9月30日)	当中間連結会計期間末 (平成18年 9月30日)	前連結会計年度末 (平成18年 3月31日)
	中間連結貸借対照表計上額 (百万円)	中間連結貸借対照表計上額 (百万円)	連結貸借対照表計上額 (百万円)
その他有価証券	242,924	450,173	409,626
流動資産に 属するもの	212,470	409,231	368,564
株券	99,680	259,290	231,205
債券	582	1,188	659
投資事業有限 責任組合等へ の出資	95,440	130,663	122,370
その他	16,766	18,089	14,328
固定資産に 属するもの	30,453	40,942	41,062
株券	20,730	27,718	21,973
債券	—	—	—
投資事業有限 責任組合等へ の出資	4,708	6,844	10,787
その他	5,015	6,379	8,301

(注) 当中間連結会計期間末の投資事業有限責任組合等への出資には、「投資事業組合に対する支配力基準及び影響力基準の適用に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第20号)に基づき、子会社となる投資事業有限責任組合等への出資が18,139百万円含まれております。

デリバティブ取引

種類	前中間連結会計期間末 (平成17年 9月30日)			当中間連結会計期間末 (平成18年 9月30日)			前連結会計年度末 (平成18年 3月31日)		
	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
通貨スワップ取引	6,006	10	10	9,543	8	8	11,289	17	17
為替予約取引	1,242	15	15	1,603	34	34	800	23	23

(注) ヘッジ会計を適用しているものは除いております。

(ストック・オプション等関係)

当中間連結会計期間 (自 平成18年 4 月 1 日 至 平成18年 9 月30日)

1 スtock・オプションにかかる当中間連結会計期間における費用計上額及び科目名

販売費・一般管理費の人件費 468百万円

2 当中間連結会計期間に付与したストック・オプションの内容

会社名	提出会社		
新株予約権の名称	2006年 7 月発行新株予約権	第 3 回新株予約権	
決議年月日	平成18年 6 月24日（株主総会）		
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の子会社の取締役及び執行役員 77名	当社の使用人 86名 当社の関係会社の取締役 14名 当社の関係会社の執行役員及び使用人 1,730名	
株式の種類及び付与数（株）	普通株式 301,000	普通株式 2,593,000	
付与日	平成18年 7 月 1 日	平成18年 9 月 4 日	
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成23年 6 月30日）まで継続して勤務していること	
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成18年 9 月 4 日～平成23年 6 月30日	
権利行使期間	平成18年 7 月 1 日～平成38年 6 月30日	平成23年 7 月 1 日～平成28年 6 月23日	
権利行使価格（円）	1 株当たり1	1 株当たり1,515	
付与日における公正な評価単価（円）	1 株当たり1,363.0	1 株当たり499.8	

会社名	連結子会社		
新株予約権の名称	2006年 9 月発行新株予約権Ⅰ	2006年 9 月発行新株予約権Ⅱ	2006年 9 月発行新株予約権Ⅲ
決議年月日	平成18年 6 月27日（株主総会）		
付与対象者の区分及び人数	連結子会社の取締役 5 名	連結子会社の執行役員 14名	連結子会社の使用人 141名
株式の種類及び付与数（株）	連結子会社発行普通株式 31	連結子会社発行普通株式 50	連結子会社発行普通株式 343
付与日	平成18年 9 月 7 日		平成18年 8 月31日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません。	権利確定条件は付されていません。	付与日（平成18年 8 月31日）以降、権利確定日（平成23年 6 月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません。	対象勤務期間の定めはありません。	4 年11ヵ月間（自 平成18年 8 月31日 至 平成23年 6 月30日）
権利行使期間	平成18年 9 月 8 日～平成38年 9 月 7 日	平成18年 9 月 8 日～平成38年 9 月 7 日	平成23年 7 月 1 日～平成28年 6 月26日
権利行使価格（円）	1	1	430,290
付与日における公正な評価単価（円）	400,993	400,993	247,558

(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。

(セグメント情報)

【事業の種類別セグメント情報】

前中間連結会計期間(自 平成17年4月1日 至 平成17年9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証券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。

当中間連結会計期間(自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)

同上

前連結会計年度(自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)

同上

【所在地別セグメント情報】

前中間連結会計期間(自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)

所在地別の純営業収益、販売費・一般管理費及び営業利益は次のとおりであります。

	日本 (百万円)	米州 (百万円)	欧州 (百万円)	アジア・ オセアニア (百万円)	計 (百万円)	消去又は 全社 (百万円)	連結 (百万円)
純営業収益							
外部顧客からの純営業収益	213,878	2,735	8,934	4,423	229,972	—	229,972
セグメント間の内部純営業収益	6,789	3,365	3,955	315	14,426	(14,426)	—
計	220,667	6,101	12,890	4,738	244,398	(14,426)	229,972
販売費・一般管理費	134,921	5,275	10,391	3,700	154,289	(4,304)	149,985
営業利益	85,746	825	2,499	1,038	90,109	(10,121)	79,987

当中間連結会計期間(自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)

所在地別の純営業収益、販売費・一般管理費及び営業利益は次のとおりであります。

	日本 (百万円)	米州 (百万円)	欧州 (百万円)	アジア・ オセアニア (百万円)	計 (百万円)	消去又は 全社 (百万円)	連結 (百万円)
純営業収益							
外部顧客からの純営業収益	224,087	6,002	5,255	5,998	241,343	—	241,343
セグメント間の内部純営業収益	(2,931)	570	8,367	423	6,430	(6,430)	—
計	221,155	6,573	13,622	6,422	247,773	(6,430)	241,343
販売費・一般管理費	144,090	6,281	12,398	5,181	167,952	(6,430)	161,522
営業利益	77,065	291	1,223	1,240	79,821	0	79,821

前連結会計年度(自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)

所在地別の純営業収益、販売費・一般管理費、営業利益及び資産は次のとおりであります。

	日本 (百万円)	米州 (百万円)	欧州 (百万円)	アジア・ オセアニア (百万円)	計 (百万円)	消去又は 全社 (百万円)	連結 (百万円)
I 純営業収益							
外部顧客からの純営業収益	541,666	5,527	21,672	10,492	579,358	—	579,358
セグメント間の内部純営業収益	1,529	8,758	12,085	1,605	23,979	(23,979)	—
計	543,195	14,286	33,758	12,097	603,337	(23,979)	579,358
販売費・一般管理費	294,984	11,920	23,679	8,471	339,055	(13,856)	325,199
営業利益	248,211	2,366	10,078	3,625	264,281	(10,122)	254,159
II 資産	12,239,341	2,807,086	1,145,933	72,880	16,265,243	(1,366,352)	14,898,890

(注) 1 国又は地域の区分の方法及び各区分に属する主な国又は地域

(1) 国又は地域の区分の方法

……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又は地域

……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

2 資産のうち消去又は全社の項目に含めた全社資産はありません。

【海外売上高】（純営業収益）

当社及び連結子会社の本邦以外の国又は地域からの純営業収益（連結会社間の内部収益を除く）は次のとおりであります。

前中間連結会計期間（自 平成17年 4 月 1 日 至 平成17年 9 月30日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計
I 海外売上高 （純営業収益） （百万円）	4,946	18,727	4,733	28,407
II 連結純営業収益 （百万円）				229,972
III 連結純営業収益 に占める海外売 上高の割合（%）	2.2	8.1	2.1	12.4

当中間連結会計期間（自 平成18年 4 月 1 日 至 平成18年 9 月30日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計
I 海外売上高 （純営業収益） （百万円）	10,133	3,954	5,388	19,475
II 連結純営業収益 （百万円）				241,343
III 連結純営業収益 に占める海外売 上高の割合（%）	4.2	1.6	2.2	8.1

前連結会計年度（自 平成17年 4 月 1 日 至 平成18年 3 月31日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計
I 海外売上高 （純営業収益） （百万円）	10,312	19,370	11,015	40,698
II 連結純営業収益 （百万円）				579,358
III 連結純営業収益 に占める海外売 上高の割合（%）	1.8	3.3	1.9	7.0

（注） 国又は地域の区分の方法及び各区分に属する主な国又は地域

（1） 国又は地域の区分の方法

……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又は地域

……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

(1株当たり情報)

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
1株当たり純資産額 527.40円	1株当たり純資産額 624.25円	1株当たり純資産額 598.27円
1株当たり中間純利益 34.43円	1株当たり中間純利益 30.04円	1株当たり当期純利益 103.90円
潜在株式調整後1株 当たり中間純利益金額 32.74円	潜在株式調整後1株 当たり中間純利益金額 28.50円	潜在株式調整後1株 当たり当期純利益金額 98.61円
	(1株当たり純資産額の算定上の基礎)	
	1株当たり純資産額	
	・純資産の部の合計額	
	1,142,402百万円	
	・純資産の部の合計額から控除する金額	
	271,548百万円	
	(うち少数株主持分)	
	(271,080百万円)	
	・普通株式にかかる中間期末の純資産額	
	870,853百万円	
	・1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末の普通株式の数	
	1,395,040千株	
(1株当たり中間純利益または潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定上の基礎)	(1株当たり中間純利益または潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定上の基礎)	(1株当たり当期純利益または潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定上の基礎)
1株当たり中間純利益金額	1株当たり中間純利益金額	1株当たり当期純利益金額
・中間純利益	・中間純利益	・当期純利益
45,822百万円	40,127百万円	139,948百万円
・普通株主に帰属しない金額	・普通株主に帰属しない金額	・普通株主に帰属しない金額
—	—	1,862百万円
		(うち利益処分による役員賞与金)
		(1,862百万円)
・普通株式にかかる中間純利益	・普通株式にかかる中間純利益	・普通株式にかかる当期純利益
45,822百万円	40,127百万円	138,085百万円
・普通株式の期中平均株式数	・普通株式の期中平均株式数	・普通株式の期中平均株式数
1,330,577千株	1,335,725千株	1,328,967千株
潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額	潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額	潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額
・中間純利益調整額	・中間純利益調整額	・当期純利益調整額
146百万円	61百万円	286百万円
(うち支払利息(税額相当額控除後))	(うち支払利息(税額相当額控除後))	(うち支払利息(税額相当額控除後))
(140百万円)	(0百万円)	(277百万円)
(うち事務手数料(税額相当額控除後))	(うち事務手数料(税額相当額控除後))	(うち事務手数料(税額相当額控除後))
(6百万円)	(61百万円)	(13百万円)
・普通株式増加数	・普通株式増加数	・普通株式増加数
73,403千株	74,237千株	74,244千株
(うち転換社債)	(うち転換社債)	(うち転換社債)
(73,112千株)	(70,390千株)	(72,388千株)
(うち新株予約権)	(うち新株予約権)	
(290千株)	(3,847千株)	
・希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	・希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	・希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要
新株予約権方式によるストック・オプション2種類。	新株予約権方式によるストック・オプション1種類。	
新株予約権の概要は「第4提出会社の状況 1 株式の状況 (2) 新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。	新株予約権等の概要は「第4提出会社の状況 1 株式の状況 (2) 新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。	

(重要な後発事象)

前中間連結会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間連結会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前連結会計年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
当社の連結子会社であるエヌ・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社は、平成17年10月1日をもってSMBCキャピタル株式会社と合併し、商号を「エヌ・アイ・エフSMB Cベンチャーズ株式会社」に変更致しました。 なお、この合併による連結財務諸表に与える影響は軽微であります。	大和証券株式会社は、平成18年12月1日に金融庁より、同社の姫路支店において不公正取引の未然防止等に関し法令違反が認められたため、証券取引法第56条第1項及び金融機関等による顧客等の本人確認等及び預金口座等の不正な利用の防止に関する法律第9条の規定に基づく行政処分（同支店に対する一部業務停止命令、並びに同社に対する業務改善命令及び是正命令）を受けております。	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することが、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ております。 概要は「第4提出会社の状況 1 株式等の状況 (7) スtock オプション制度の内容 ③ 平成18年定時株主総会の決議によるもの (i)」に記載のとおりであります。

(2) 【その他】

該当事項はありません。

2 【中間財務諸表等】

(1) 【中間財務諸表】

① 【中間貸借対照表】

		前中間会計期間末 (平成17年 9 月30日)		当中間会計期間末 (平成18年 9 月30日)		前事業年度の 要約貸借対照表 (平成18年 3 月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(資産の部)							
I 流動資産							
1 現金・預金		92,342		47,572		129,130	
2 有価証券		—		3,277		3,542	
3 短期貸付金	※ 3	26,073		157,483		133,404	
4 未収入金		—		70,716		44,244	
5 繰延税金資産		210		195		564	
6 その他の流動資産		17,882		12,603		2,746	
流動資産計		136,508	13.0	291,849	22.8	313,632	25.6
II 固定資産							
1 有形固定資産	※ 1	10,091		10,003		10,026	
2 無形固定資産		668		809		755	
3 投資その他の資産		902,995		978,580		900,228	
(1) 投資有価証券	※ 2	683,926		777,338		706,934	
(2) 長期貸付金		198,126		178,480		170,946	
(3) 長期差入保証金		12,464		13,189		12,885	
(4) その他	※ 3	8,974		10,013		9,911	
貸倒引当金	※ 3	△496		△441		△449	
固定資産計		913,755	87.0	989,392	77.2	911,010	74.4
資産合計		1,050,264	100.0	1,281,242	100.0	1,224,643	100.0

		前中間会計期間末 (平成17年9月30日)		当中間会計期間末 (平成18年9月30日)		前事業年度の 要約貸借対照表 (平成18年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(負債の部)							
I 流動負債							
1 短期借入金		70,710		93,385		62,235	
2 一年以内償還転換社債		79,985		—		79,193	
3 有価証券担保借入金		75,339		74,314		132,112	
4 未払法人税等		111		117		176	
5 賞与引当金		791		696		1,613	
6 その他の流動負債		2,674		3,526		2,734	
流動負債計		229,611	21.9	172,040	13.4	278,064	22.7
II 固定負債							
1 社債		135,400		287,900		236,400	
2 長期借入金		46,500		49,000		49,000	
3 長期受入保証金		4,093		3,569		4,042	
4 繰延税金負債		20,394		32,387		38,739	
5 退職給付引当金		3,527		1,805		2,361	
6 訴訟損失引当金		—		240		—	
7 その他の固定負債		1,266		1,414		2,211	
固定負債計		211,182	20.1	376,317	29.4	332,754	27.2
負債合計		440,793	42.0	548,357	42.8	610,819	49.9
(資本の部)							
I 資本金		138,432	13.2	—	—	138,828	11.3
II 資本剰余金							
1 資本準備金		117,786		—		118,182	
2 その他資本剰余金		153		—		156	
資本剰余金合計		117,940	11.2	—	—	118,339	9.7
III 利益剰余金							
1 利益準備金		45,335		—		45,335	
2 任意積立金		218,000		—		218,000	
3 中間(当期)未処分利益		51,003		—		50,798	
利益剰余金合計		314,338	29.9	—	—	314,133	25.6
IV その他有価証券 評価差額金		39,585	3.8	—	—	57,183	4.7
V 自己株式		△826	△0.1	—	—	△14,660	△1.2
資本合計		609,470	58.0	—	—	613,824	50.1
負債・資本合計		1,050,264	100.0	—	—	1,224,643	100.0

		前中間会計期間末 (平成17年 9 月30日)		当中間会計期間末 (平成18年 9 月30日)		前事業年度の 要約貸借対照表 (平成18年 3 月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(純資産の部)							
I 株主資本							
1 資本金		—	—	178,324	13.9	—	—
2 資本剰余金							
(1) 資本準備金		—	—	157,678		—	
資本剰余金合計		—	—	157,678	12.3	—	—
3 利益剰余金							
(1) 利益準備金		—	—	45,335		—	
(2) その他利益剰余金							
任意積立金		—	—	218,000		—	
繰越利益剰余金		—	—	97,638		—	
利益剰余金合計		—	—	360,974	28.2	—	—
4 自己株式		—	—	△12,500	△1.0	—	—
5 自己株式申込証拠金		—	—	0	0.0	—	—
株主資本合計		—	—	684,477	53.4	—	—
II 評価・換算差額等							
1 その他有価証券 評価差額金		—	—	47,455	3.7	—	—
2 繰延ヘッジ損益		—	—	519	0.1	—	—
評価・換算差額等合計		—	—	47,974	3.8	—	—
III 新株予約権		—	—	432	0.0	—	—
純資産合計		—	—	732,884	57.2	—	—
負債・純資産合計		—	—	1,281,242	100.0	—	—

② 【中間損益計算書】

		前中間会計期間 (自 平成17年 4 月 1 日 至 平成17年 9 月30日)		当中間会計期間 (自 平成18年 4 月 1 日 至 平成18年 9 月30日)		前事業年度の 要約損益計算書 (自 平成17年 4 月 1 日 至 平成18年 3 月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)
I 営業収益							
1 関係会社配当金		32,243		73,894		32,257	
2 関係会社貸付金利息		1,371		1,968		2,805	
3 その他		56		176		152	
営業収益計		33,671	100.0	76,039	100.0	35,215	100.0
II 営業費用							
1 販売費・一般管理費		4,301		4,873		9,210	
(1) 取引関係費		971		733		1,747	
(2) 人件費		1,858		1,875		4,130	
(3) 不動産関係費		308		280		614	
(4) 事務費		405		791		855	
(5) 減価償却費	※1	175		153		350	
(6) 租税公課		157		482		290	
(7) その他		423		555		1,221	
2 金融費用		1,548		1,804		2,971	
営業費用計		5,849	17.4	6,677	8.8	12,181	34.6
営業利益		27,821	82.6	69,362	91.2	23,033	65.4
III 営業外収益		1,559	4.6	3,551	4.7	2,841	8.1
IV 営業外費用		47	0.1	569	0.8	733	2.1
経常利益		29,333	87.1	72,343	95.1	25,140	71.4
V 特別利益							
1 関係会社清算益		1,200		—		1,200	
2 関係会社株式売却益		6,146		138		6,146	
3 投資有価証券売却益		1,714		—		2,333	
4 貸倒引当金戻入	※4	—		6,135		—	
特別利益計		9,061	26.9	6,273	8.2	9,681	27.5
VI 特別損失							
1 訴訟損失	※5	—		—		1,279	
2 関係会社株式評価減		—		722		—	
3 投資有価証券評価減		74		888		75	
4 投資有価証券売却損		—		10		4	
5 固定資産除売却損	※2	104		—		120	
6 貸倒引当金繰入	※3	—		—		211	
7 海外子会社為替差損	※6	—		—		1,563	
8 訴訟損失引当金繰入		—		240		—	
特別損失計		179	0.5	1,862	2.4	3,255	9.2
税引前中間(当期)純利益		38,215	113.5	76,755	100.9	31,566	89.7
法人税、住民税及び事業税		△9,647		△299		△37,973	
法人税等調整額		12,288		334		18,205	
		2,641	7.8	35	0.0	△19,768	△56.1
中間(当期)純利益		35,573	105.7	76,719	100.9	51,335	145.8
前期繰越利益		15,429		—		15,429	
中間配当額		—		—		15,966	
中間(当期)未処分利益		51,003		—		50,798	

③ 【中間株主資本等変動計算書】

当中間会計期間(自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
平成18年3月31日残高(百万円)	138,828	118,182	156	118,339
中間会計期間中の変動額				
新株の発行	39,495	39,495		39,495
自己株式の処分			△156	△156
中間会計期間中の変動額合計(百万円)	39,495	39,495	△156	39,339
平成18年9月30日残高(百万円)	178,324	157,678	—	157,678

	株主資本						
	利益剰余金				自己株式	自己株式申込 証拠金	株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合 計			
		任意積立金	繰越利益 剰余金				
平成18年3月31日残高(百万円)	45,335	218,000	50,798	314,133	△14,660	—	556,640
中間会計期間中の変動額							
新株の発行				—			78,991
剰余金の配当（注）			△29,065	△29,065			△29,065
中間純利益			76,719	76,719			76,719
自己株式の取得				—	△162		△162
自己株式の処分			△813	△813	2,322		1,353
その他				—		0	0
中間会計期間中の変動額合計 (百万円)	—	—	46,840	46,840	2,160	0	127,836
平成18年9月30日残高(百万円)	45,335	218,000	97,638	360,974	△12,500	0	684,477

	評価・換算差額等			新株予約権	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計		
平成18年3月31日残高(百万円)	57,183	—	57,183	—	613,824
中間会計期間中の変動額					
新株の発行			—		78,991
剰余金の配当 (注)			—		△29,065
中間純利益			—		76,719
自己株式の取得			—		△162
自己株式の処分			—		1,353
その他			—		0
株主資本以外の項目の中間会計期間中の変動額(純額)	△9,727	519	△9,208	432	△8,775
中間会計期間中の変動額合計(百万円)	△9,727	519	△9,208	432	119,060
平成18年9月30日残高(百万円)	47,455	519	47,974	432	732,884

(注) 平成18年5月の取締役会決議による利益処分項目であります。

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法 有価証券 (1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法によっております。 (2) その他有価証券 時価のあるものについては中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部資本直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部資本直入法により処理しております)。 2 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については、定額法を採用しております。なお、耐用年数については法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。 (2) 無形固定資産、投資その他の資産 定額法によっております。なお、耐用年数については法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。	1 資産の評価基準及び評価方法 有価証券 (1) 売買目的有価証券 移動平均法による時価法によっております。 (2) 子会社株式及び関連会社株式 同左 (3) その他有価証券 時価のあるものについては中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。 2 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 同左 (2) 無形固定資産、投資その他の資産 同左	1 有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 売買目的有価証券 同左 (2) 子会社株式及び関連会社株式 同左 (3) その他有価証券 時価のあるものについては決算期末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部資本直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)、時価のないものについては移動平均法による原価法で計上しております。 なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部資本直入法により処理しております)。 2 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 同左 (2) 無形固定資産、投資その他の資産 同左

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
3 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金 貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員及び従業員に対する賞与の支払に備えるため、当社所定の計算基準による支払見積額の当中間会計期間負担分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、年金受給権者のみを対象とする閉鎖型適格退職年金については、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる金額を計上しております。	3 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左 (4) 訴訟損失引当金 証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当中間会計期間末における支払見積額を計上しております。 (追加情報) 当中間会計期間より、従来の算定方法に加え、過去の支払実績を勘案した方法を加味して計上しております。	3 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 役員及び従業員に対する賞与の支払に備えるため、当社所定の計算基準による支払見積額の当事業年度負担分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、年金受給権者のみを対象とする閉鎖型適格退職年金については、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる金額を計上しております。
4 リース取引の処理方法 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引にかかる方法に準じた会計処理によっております。	4 リース取引の処理方法 同左	4 リース取引の処理方法 同左

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
5 ヘッジ会計の方法 金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。 当社は、一部の借入金等にかかる金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っております。	5 ヘッジ会計の方法 原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、特例処理の条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。 当社は、一部の借入金、発行社債等にかかる金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っております。	5 ヘッジ会計の方法 同左
6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 (1) 消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。 (2) 繰延資産の処理方法 新株発行費及び社債発行費は全額発生時の費用として処理しております。 (3) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。	6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 (1) 消費税等の会計処理方法 同左 (2) _____ (3) 連結納税制度の適用 同左	6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 (1) 消費税等の会計処理方法 同左 (2) 繰延資産の処理方法 新株発行費及び社債発行費は全額発生時の費用として処理しております。 (3) 連結納税制度の適用 同左

会計方針の変更

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
	(貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準) 当中間会計期間より、「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」(企業会計基準第5号 平成17年12月9日)及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」(企業会計基準適用指針第8号 平成17年12月9日)を適用しております。 これまでの資本の部の合計に相当する金額は、731,933百万円であります。 なお、当中間会計期間における中間貸借対照表の純資産の部については、中間財務諸表等規則の改正に伴い、改正後の中間財務諸表等規則により作成しております。 (ストック・オプション等に関する会計基準) 当中間会計期間より、「ストック・オプション等に関する会計基準」(企業会計基準第8号 平成17年12月27日)及び「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第11号 平成18年5月31日)を適用しております。 これにより営業利益、経常利益及び税引前中間純利益は、それぞれ432百万円減少しております。	

表示方法の変更

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)
(中間損益計算書) 前中間会計期間において区分掲記していた「金融収益」及び「商標使用料収入」は、金額的重要性が乏しくなったことから、当中間会計期間から営業収益の「その他」に含めて表示しております。 「金融収益」及び「商標使用料収入」の当中間会計期間の金額は、それぞれ50百万円、6百万円であります。	(中間貸借対照表) 前中間会計期間末において「その他の流動資産」に含めていた「未収入金」については、当中間会計期間末において資産の総額の百分の五を超えたため、当中間会計期間末より区分掲記しております。 なお、前中間会計期間の「未収入金」は15,981百万円であります。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

前中間会計期間末 (平成17年 9月30日)	当中間会計期間末 (平成18年 9月30日)	前事業年度末 (平成18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2,992百万円であります。 ※2 投資有価証券のうち114,605百万円を子会社に貸し付けております。 ※3 貸倒引当金10,521百万円は、債権額と相殺して表示しております。 4 保証債務 <table> <tr> <th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>大和ヨーロッパファイナンスB.V.</td><td>メディアム・ターム・ノート</td><td>4,000</td></tr> <tr> <td>従業員</td><td>借入金</td><td>2,431</td></tr> <tr> <td rowspan="2">大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc</td><td>メディアム・ターム・ノート</td><td>2,100</td></tr> <tr> <td>スワップ等</td><td>148</td></tr> <tr> <td>大和サンコー株式会社</td><td>未払金</td><td>14</td></tr> <tr> <td>合計</td><td></td><td>8,694</td></tr> </table>	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	大和ヨーロッパファイナンスB.V.	メディアム・ターム・ノート	4,000	従業員	借入金	2,431	大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc	メディアム・ターム・ノート	2,100	スワップ等	148	大和サンコー株式会社	未払金	14	合計		8,694	※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は3,114百万円であります。 ※2 投資有価証券のうち128,418百万円を子会社に貸し付けております。 ※3 貸倒引当金4,113百万円は、債権額と相殺して表示しております。 4 保証債務 <table> <tr> <th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>大和ヨーロッパファイナンスB.V.</td><td>メディアム・ターム・ノート</td><td>2,000</td></tr> <tr> <td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,501</td></tr> <tr> <td rowspan="2">大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc</td><td>メディアム・ターム・ノート</td><td>100</td></tr> <tr> <td></td><td></td></tr> <tr> <td>大和サンコー株式会社</td><td>未払金</td><td>15</td></tr> <tr> <td>合計</td><td></td><td>3,617</td></tr> </table>	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	大和ヨーロッパファイナンスB.V.	メディアム・ターム・ノート	2,000	従業員	借入金	1,501	大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc	メディアム・ターム・ノート	100			大和サンコー株式会社	未払金	15	合計		3,617	※1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は3,054百万円であります。 ※2 投資有価証券のうち125,139百万円、関係会社株式のうち14,321百万円を子会社に貸し付けております。 ※3 貸倒引当金10,249百万円は、債権額と相殺して表示しております。 4 保証債務 <table> <tr> <th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr> <tr> <td>大和ヨーロッパファイナンスB.V.</td><td>メディアム・ターム・ノート</td><td>2,000</td></tr> <tr> <td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,980</td></tr> <tr> <td rowspan="2">大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc</td><td>メディアム・ターム・ノート</td><td>600</td></tr> <tr> <td></td><td></td></tr> <tr> <td>大和サンコー株式会社</td><td>未払金</td><td>8</td></tr> <tr> <td>合計</td><td></td><td>4,589</td></tr> </table>	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	大和ヨーロッパファイナンスB.V.	メディアム・ターム・ノート	2,000	従業員	借入金	1,980	大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc	メディアム・ターム・ノート	600			大和サンコー株式会社	未払金	8	合計		4,589
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																												
大和ヨーロッパファイナンスB.V.	メディアム・ターム・ノート	4,000																																																												
従業員	借入金	2,431																																																												
大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc	メディアム・ターム・ノート	2,100																																																												
	スワップ等	148																																																												
大和サンコー株式会社	未払金	14																																																												
合計		8,694																																																												
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																												
大和ヨーロッパファイナンスB.V.	メディアム・ターム・ノート	2,000																																																												
従業員	借入金	1,501																																																												
大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc	メディアム・ターム・ノート	100																																																												
大和サンコー株式会社	未払金	15																																																												
合計		3,617																																																												
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																												
大和ヨーロッパファイナンスB.V.	メディアム・ターム・ノート	2,000																																																												
従業員	借入金	1,980																																																												
大和セキュリティーズ トラスト アンド バンキング(ヨーロッパ)plc	メディアム・ターム・ノート	600																																																												
大和サンコー株式会社	未払金	8																																																												
合計		4,589																																																												

(中間損益計算書関係)

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
※1 当中間会計期間の減価償却実 施額は次のとおりでありま す。 有形固定資産 85 百万円 無形固定資産 74 投資その他の資産 15 計 175	※1 当中間会計期間の減価償却実 施額は次のとおりでありま す。 有形固定資産 61 百万円 無形固定資産 73 投資その他の資産 17 計 153	※1 当期の減価償却実施額は次の とおりであります。 有形固定資産 171 百万円 無形固定資産 146 投資その他の資産 32 計 350
※2 固定資産除売却損の内容は、 次のとおりであります。 固定資産除却損 有形固定資産 21 百万円 その他の投資等 83 百万円 _____ _____ _____ _____	_____ ※4 貸倒引当金戻入 関係会社に対する債権に設定 した引当金戻入額6,133百万 円を含んでおります。 _____ _____	※2 固定資産除売却損の内容は、 次のとおりであります。 固定資産売却損 その他の投資等 94 百万円 固定資産除却損 器具備品 26 百万円 ※3 貸倒引当金繰入 関係会社に対する債権に設定 した引当金繰入額11 百万円を 含んでおります。 _____ ※5 訴訟損失 元顧客との証券取引に関する 訴訟損失であります。 ※6 海外子会社が替差損 海外子会社からの資本回収に 伴う替差損であります。

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)

1 自己株式に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数	増加株式数	減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式 (千株)	11,285	115	1,786	9,615

(注) 1 普通株式の自己株式の株式数の増加115千株は、単元未満株式の買取請求による取得であります。

2 普通株式の自己株式の株式数の減少1,786千株は、単元未満株式の売渡請求による譲渡10千株、新株予約権の行使に伴う譲渡1,776千株であります。

(リース取引関係)

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引は次のとおりであります。	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引は次のとおりであります。	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引は次のとおりであります。
(1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額	(1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額	(1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額
器具備品 取得価額相当額 290百万円 減価償却累計額相当額 198 中間期末残高相当額 92	器具備品 取得価額相当額 92百万円 減価償却累計額相当額 35 中間期末残高相当額 57	器具備品 取得価額相当額 141百万円 減価償却累計額相当額 61 期末残高相当額 79
(2) 未経過リース料中間期末残高相当額	(2) 未経過リース料中間期末残高相当額	(2) 未経過リース料期末残高相当額
1年内 30百万円 1年超 71 合計 101	1年内 20百万円 1年超 37 合計 57	1年内 28百万円 1年超 52 合計 80
(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額	(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額	(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額
支払リース料 31百万円 減価償却費相当額 30百万円 支払利息相当額 0百万円	支払リース料 10百万円 減価償却費相当額 10百万円 支払利息相当額 0百万円	支払リース料 49百万円 減価償却費相当額 46百万円 支払利息相当額 1百万円
(4) 減価償却費相当額の算定方法 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。	(4) 減価償却費相当額の算定方法 同左	(4) 減価償却費相当額の算定方法 同左
(5) 利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	(5) 利息相当額の算定方法 同左	(5) 利息相当額の算定方法 同左

(有価証券関係)

前中間会計期間末(平成17年9月30日)

子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	12,065百万円	35,403百万円	23,337百万円
関連会社株式	274百万円	609百万円	334百万円

当中間会計期間末(平成18年9月30日)

子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	19,648百万円	71,034百万円	51,386百万円

前事業年度末(平成18年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	19,648百万円	148,219百万円	128,571百万円
関連会社株式	274百万円	710百万円	436百万円

(1株当たり情報)

当社は中間連結財務諸表を作成しておりますので、記載を省略しております。

(重要な後発事象)

前中間会計期間 (自 平成17年4月1日 至 平成17年9月30日)	当中間会計期間 (自 平成18年4月1日 至 平成18年9月30日)	前事業年度 (自 平成17年4月1日 至 平成18年3月31日)
		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 を無償発行することが、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てお ります。 概要は「第4 提出会社の状 況 1 株式等の状況 (7) ストック オプション制度の内容 ③ 平成18年 定時株主総会の決議によるも の (i)」に記載のとおりでありま す。

(2) 【その他】

平成18年10月26日開催の取締役会において、当期中間配当に関し、次のとおり決議いたしました。

① 中間配当による配当金の総額 16,740百万円

② 1株当たりの金額 12円00銭

③ 支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成18年12月1日

(注) 平成18年9月30日現在の株主名簿及び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6 【提出会社の参考情報】

当中間会計期間の開始日から半期報告書提出日までの間に、次の書類を提出しております。

- | | | | | |
|---|---|----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| 1 | 有価証券報告書
及びその添付書類 | 事業年度
(第69期) | 自 平成17年4月1日
至 平成18年3月31日 | 平成18年6月26日
関東財務局長に提出 |
| 2 | 訂正発行登録書 発行登録書(平成16年6月28日提出)に関する訂正
同上 | | | 平成18年6月8日
平成18年6月26日
関東財務局長に提出 |
| 3 | 有価証券届出書(新株予約権証券)及びその添付書類 | | | 平成18年8月24日
関東財務局長に提出 |
| 4 | 有価証券届出書の訂正届出書 有価証券届出書(平成18年8月24日
提出)に関する訂正 | | | 平成18年9月5日
関東財務局長に提出 |
| 5 | 発行登録追補書類及びその添付書類 | | | 平成18年6月2日
関東財務局長に提出 |
| 6 | 自己株券買付状況報告書 | | | 平成18年4月10日
関東財務局長に提出 |
| 7 | 発行登録書(社債)及びその添付書類 | | | 平成18年6月28日
関東財務局長に提出 |

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。

独立監査人の中間監査報告書

株式会社大和証券グループ本社

取締役会 御中

平成17年12月14日

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 河 合 利 治 ㊞

指定社員
業務執行社員 公認会計士 堀 内 巧 ㊞

指定社員
業務執行社員 公認会計士 小 澤 陽 一 ㊞

当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「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17年4月1日から平成18年3月31日までの連結会計年度の中間連結会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)に係る中間連結財務諸表、すなわち、中間連結貸借対照表、中間連結損益計算書、中間連結剰余金計算書及び中間連結キャッシュ・フロー計算書について中間監査を行った。この中間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中間連結財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間連結財務諸表には全体として中間連結財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間連結財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間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17年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間連結会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)の経営成績及びキャッシュ・フローの状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

追記情報

重要な後発事象に記載されているとおり、会社の連結子会社であるエヌ・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社は平成17年10月1日をもってSMB Cキャピタル株式会社と合併し、商号を「エヌ・アイ・エフ SMB Cベンチャーズ株式会社」に変更した。

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

※ 上記は、中間監査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、その原本は半期報告書提出会社が別途保管しております。

独立監査人の中間監査報告書

株式会社大和証券グループ本社

取締役会 御中

平成18年12月18日

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 井 上 寅 喜 (印)

指定社員
業務執行社員 公認会計士 小 澤 陽 一 (印)

当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「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18年4月1日から平成19年3月31日までの連結会計年度の中間連結会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)に係る中間連結財務諸表、すなわち、中間連結貸借対照表、中間連結損益計算書、中間連結株主資本等変動計算書及び中間連結キャッシュ・フロー計算書について中間監査を行った。この中間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中間連結財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間連結財務諸表には全体として中間連結財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間連結財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間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18年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間連結会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)の経営成績及びキャッシュ・フローの状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

追記情報

会計方針の変更に記載のとおり、会社は当中間連結会計期間より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準及び貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針を適用している。

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。

当監査法人は、会社に対し、監査証明との同時提供が認められる公認会計士法第2条第2項の業務を継続的に行っている。

以 上

上記は、中間監査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、その原本は半期報告書提出会社が別途保管しております。

独立監査人の中間監査報告書

株式会社大和証券グループ本社
取締役会 御中

平成17年12月14日

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 河 合 利 治 ⑩

指定社員
業務執行社員 公認会計士 堀 内 巧 ⑩

指定社員
業務執行社員 公認会計士 小 澤 陽 一 ⑩

当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「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17年4月1日から平成18年3月31日までの第69期事業年度の中間会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表及び中間損益計算書について中間監査を行った。この中間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中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間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の平成17年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(平成17年4月1日から平成17年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

上記は、中間監査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、その原本は半期報告書提出会社が別途保管しております。

独立監査人の中間監査報告書

株式会社大和証券グループ本社
取締役会 御中

平成18年12月18日

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	㊞
指定社員 業務執行社員	公認会計士	井	上	寅	喜 ㊞
指定社員 業務執行社員	公認会計士	小	澤	陽	一 ㊞

当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「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18年4月1日から平成19年3月31日までの第70期事業年度の中間会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間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中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間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の平成18年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(平成18年4月1日から平成18年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

追記情報

会計方針の変更に記載のとおり、会社は当中間会計期間より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準及び貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針を適用している。

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。

当監査法人は、会社に対し、監査証明との同時提供が認められる公認会計士法第2条第2項の業務を継続的に行っている。

以 上

上記は、中間監査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、その原本は半期報告書提出会社が別途保管しております。

