

有 価 証 券 報 告 書

(証券取引法第24条第1項に基づく報告書)

事業年度	自	平成12年4月1日
(第64期)	至	平成13年3月31日

株式会社 大和証券グループ本社

(541003)

有 価 証 券 報 告 書

(証券取引法第24条第1項に基づく報告書)

事業年度 自 平成12年4月1日
(第64期) 至 平成13年3月31日

関東財務局長 殿

平成13年6月27日提出

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 取締役社長 原 良 也

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

連絡者 執行役員
財務部長 脇 水 純一郎

もよりの連絡場所 同上

電話番号 同上

連絡者 同上

有価証券報告書の写しを縦覧に供する場所

名称	所在地
大和証券株式会社 大阪支店	大阪市北区曽根崎新地1丁目13番20号
〃 名古屋支店	名古屋市中区錦3丁目15番30号
〃 横浜支店	横浜市中区尾上町2丁目20番地
〃 神戸支店	神戸市中央区三宮町1丁目2番4号
〃 千葉支店	千葉市中央区富士見2丁目2番3号
〃 大宮支店	さいたま市宮町1丁目89番地
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6番10号
名古屋証券取引所	名古屋市中区栄3丁目3番17号

(注) 上記の内、大和証券株式会社の大阪、名古屋、横浜、神戸、千葉および大宮の各支店は証券取引法の規定による備置場所ではありませんが、投資者の便宜を図るために備え置きます。

目 次

	頁
第一部 企業情報	1
第1 企業の概況	1
1. 主要な経営指標等の推移	1
2. 沿革	3
3. 事業の内容	5
4. 関係会社の状況	6
5. 従業員の状況	8
第2 事業の状況	9
1. 業績等の概要	9
2. 対処すべき課題	15
3. 経営上の重要な契約等	19
4. 研究開発活動	19
第3 設備の状況	20
1. 設備投資等の概要	20
2. 主要な設備の状況	21
3. 設備の新設及び除却等の計画	23
第4 提出会社の状況	24
1. 株式等の状況	24
2. 自己株式の取得等の状況	29
3. 配当政策	30
4. 株価の推移	30
5. 役員の状況	31
第5 経理の状況	33
監査報告書	35
1. 連結財務諸表等	39
監査報告書	79
2. 財務諸表等	83
第6 提出会社の株式事務の概要	104
第7 提出会社の参考情報	105
第二部 提出会社の保証会社等の情報	106

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

項目	自 平成8年4月1日 至 平成9年3月31日 (平成9年3月期)	自 平成9年4月1日 至 平成10年3月31日 (平成10年3月期)	自 平成10年4月1日 至 平成11年3月31日 (平成11年3月期)	自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日 (平成12年3月期)	自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日 (平成13年3月期)
営業収益 (百万円)	582,722	523,896	354,960	654,650	718,113
経常利益 又は経常損失() (百万円)	49,923	13,179	87,959	224,121	177,795
当期純利益 又は当期純損失() (百万円)	80,021	83,657	127,889	105,375	64,550
純資産額 (百万円)	873,190	774,698	639,858	666,071	716,817
総資産額 (百万円)	13,425,964	10,132,456	6,268,596	8,514,213	9,250,223
1株当たり純資産額 (円)	649.42	580.08	480.47	502.05	539.72
1株当たり当期純利益 又は1株当たり 当期純損失() (円)	59.51	62.35	96.00	79.43	48.62
潜在株式調整後 1株当たり当期純利益 (円)	—	—	—	76.19	46.26
自己資本比率 (%)	8.1	9.3	12.9	10.0	9.3
自己資本利益率 (%)	—	—	—	16.1	9.3
株価収益率 (倍)	—	—	—	24.3	24.4
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	—	—	—	459,015	240,930
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	—	—	—	140,803	4,968
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	—	—	—	306,867	42,797
現金及び現金同等物の 期末残高 (百万円)	—	—	471,500	488,865	303,398
従業員数 〔外 平均臨時 雇用者数〕 (人)	—	—	—	11,415 〔1,364〕	11,114 〔1,564〕

(注) 1. 上記の比率は以下の算式により算出しております。

・自己資本比率 = $\frac{\text{資本合計}}{\text{負債()} \cdot \text{少数株主持分} \cdot \text{資本合計}} \times 100(\%)$ (受入保証金代用有価証券及び短期借入有価証券等を除く)

・自己資本利益率 = $\frac{\text{当期純利益}}{(\text{前期末資本合計} + \text{当期末資本合計}) \div 2} \times 100(\%)$

- 平成9年3月期、平成10年3月期及び平成11年3月期の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失を計上しているため、記載をしておりません。
- 従業員数は、就業人員数を表示しております。
- 消費税等の課税取引については、消費税等を含んでおりません。
- 「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する省令」(平成10年12月21日大蔵省令第173号)附則第3項ただし書により、平成11年3月期の連結会計年度から税効果会計を適用しております。

(2) 提出会社の経営指標等

回次	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期
決算年月	平成 9 年 3 月	平成10年 3 月	平成11年 3 月	平成12年 3 月	平成13年 3 月
営業収益 (うち受入手数料) (百万円)	291,783 (230,828)	255,946 (182,307)	257,184 (177,123)	41,283 (17,711)	29,909 (—)
経常利益 (百万円)	44,264	5,109	16,592	8,414	12,419
当期純利益 又は当期純損失() (百万円)	84,023	57,969	116,972	125,070	8,859
資本金 (百万円)	138,424	138,424	138,424	138,430	138,431
発行済株式総数 (千株)	1,344,575	1,335,554	1,331,722	1,331,733	1,331,735
純資産額 (百万円)	823,842	751,059	626,193	744,617	753,635
総資産額 (百万円)	6,485,062	6,076,702	4,671,392	1,498,350	1,321,097
1株当たり純資産額 (円)	612.71	562.35	470.21	559.13	565.90
1株当たり配当額 (うち1株当たり 中間配当額) (円)	8.00 (—)	6.00 (—)	5.00 (—)	13.0 (—)	13.0 (—)
1株当たり当期純利益 又は1株当たり 当期純損失() (円)	62.49	43.20	87.80	93.91	6.65
潜在株式調整後 1株当たり当期純利益 (円)	—	—	—	89.89	6.60
自己資本比率 (%)	21.1	17.6	18.7	49.7	57.0
自己資本利益率 (%)	—	—	—	18.25	1.18
自己資本配当率 (%)	1.31	1.07	1.06	2.32	2.29
自己資本規制比率 (%)	293.7	303.3	312.3	—	—
株価収益率 (倍)	—	—	—	20.6	178.4
配当性向 (%)	—	—	—	13.79	194.88
従業員数 (人)	7,348	7,319	7,571	334	315

(注) 1. 上記の比率は以下の算式により算出しております。

- ・ 自己資本比率 = $\frac{\text{資本合計}}{\text{負債()} + \text{資本合計}} \times 100(\%)$ (受入保証金代用有価証券及び短期借入有価証券等を除く)
- ・ 自己資本利益率 = $\frac{\text{当期純利益}}{(\text{前期末資本合計} + \text{当期末資本合計}) \div 2} \times 100(\%)$
- ・ 自己資本配当率 = $\frac{\text{配当金総額}}{\text{資本合計}} \times 100(\%)$
- ・ 第62期までの自己資本規制比率は、証券取引法第52条第1項の規定に基づき、「証券会社の自己資本規制に関する省令」の定めにより決算数値をもとに算出したものであります。
- 2. 第63期中平成11年4月25日までは証券業を営んでおりましたが、平成11年4月26日以降は持株会社へと業態変更しております。
- 3. 第60期、第61期及び第62期の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失を計上しているため、記載をしておりません。
- 4. 従業員数は、第63期より就業人員数を表示しております。
- 5. 消費税等の課税取引については、消費税等を含んでおりません。
- 6. 「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する省令」(平成10年12月21日大蔵省令第173号)附則第3項ただし書により、第62期から税効果会計を適用しております。

2. 沿革

年月	沿革
昭和18年12月27日	「藤本証券(株)」と「(株)日本信託銀行」は対等合併し、「大和証券株式会社」を設立。
19年 7 月	「吉川証券(株)」を合併。
23年10月	証券取引法による証券業者登録。
24年 4 月	東京証券取引所に会員として加入。
34年12月	「大和証券投資信託委託(株)」設立。
36年10月	当社株式を東京、大阪、名古屋の各証券取引所市場第二部に上場。
39年12月	ニューヨークに「大和セキュリティーズ アメリカ Inc.」設立。
43年 4 月	改正証券取引法による総合証券会社として、大蔵大臣より免許を受ける。
45年 2 月	当社株式を東京、大阪、名古屋の各証券取引所市場第一部に上場。
8 月	「大和土地建物(株)」設立。
12月	香港に「大和証券国際(香港)有限公司」設立。(現「大和証券SMBC香港リミテッド」)
47年 6 月	シンガポールに「DBS・大和セキュリティーズインターナショナル Ltd.」設立。(現「大和証券SMBCシンガポールリミテッド」)
48年 6 月	「大和投資顧問(株)」設立。(現「大和住銀投信投資顧問(株)」)
50年 8 月	「大和コンピューターサービス(株)」設立。(現「(株)大和総研」)
56年 3 月	ロンドンに「大和ヨーロッパLimited」設立。(現「大和証券SMBCヨーロッパリミテッド」)
57年 4 月	金地金の売買、売買の媒介、取次及び代理並びに保管業務を開始。
8 月	「日本インベストメント・ファイナンス(株)」設立。
58年 6 月	保護預り公共債を担保として金銭を貸付ける業務を開始。
58年10月	「大和ファイナンス(株)」設立。
59年 4 月	譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパーで外国において発行されたものの売買、売買の媒介、取次及び代理業務を開始。
60年 6 月	譲渡性預金の売買、売買の媒介、取次及び代理業務を開始。
61年 4 月	円建銀行引受手形の売買、売買の媒介、取次及び代理業務を開始。
6 月	ロンドンに「大和ヨーロッパ ファイナンス Ltd.」設立。(現「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」)
62年11月	国内で発行されたコマーシャル・ペーパーの売買、売買の媒介、取次及び代理業務を開始。
63年 1 月	「大和ビジネスサービス(株)」設立。(現「(株)大和証券ビジネスセンター」)
63年 9 月	有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引及び外国市場証券先物取引並びにその媒介、取次及び代理業務を開始。
11月	抵当証券の販売の媒介及び保管業務を開始。
平成元年 6 月	金融先物取引業を開始。
2 年 3 月	ニューヨークに「大和アメリカ Corporation」設立。
4 月	当社株式をロンドン国際、アムステルダム、パリ、ルクセンブルグ、フランクフルト、チューリッヒ、ブリュッセルの各証券取引所に上場。
6 月	ロンドンに「大和ヨーロッパ プロパティ plc」設立。
5 年 8 月	「大和インターナショナル信託銀行(株)」設立。
11月	MMF・中期国債ファンドのキャッシング業務を開始。
6 年 3 月	小口債権販売業を開始。
10月	金銭の相互支払に関する取引(金利スワップ)業務、金利先渡取引業務を開始。
12月	アムステルダムに「大和証券アジアホールディング B.V.」設立。(現「大和証券SMBCアジアホールディング B.V.」)

年月	沿革
7年6月	商品投資販売業を開始。
8年6月	情報提供・コンサルティング業務、金銭債権等の売買、売買の媒介、取次及び代理業務の開始。
9年2月	投資事業組合契約の締結又はその媒介、取次及び代理業務の開始。
5月	事業組合への出資の媒介、取次及び代理業務の開始。
11年1月	台北に「大和全球証券股份有限公司」設立。(現「大和國泰証券股份有限公司」)
4月	「大和投資顧問(株)」、「住銀投資顧問(株)」、及び「エス・ビー・アイ・エム投信(株)」が合併し、「大和住銀投信投資顧問(株)」発足。 ホールセール証券業務を「大和証券エスビーキャピタル・マーケッツ(株)」へ譲渡、同社営業開始。 リテール証券業務を(新)「大和証券(株)」へ譲渡、同社営業開始。(旧)「大和証券(株)」はグループ会社の支配・管理を目的とする持株会社となり、「(株)大和証券グループ本社」へと商号変更。
10月	「大和ヨーロッパ・リミテッド」(パリ、フランクフルト、ジュネーブ及びバハレーンの欧州・中近東各支店を含む)並びに「大和証券アジアホールディングB.V.」(子会社である香港、シンガポール、オーストラリア、台湾及びフィリピン(合併会社)の各証券現地法人を含む)を、「大和証券エスビーキャピタル・マーケッツ(株)」へ移管。
12年4月	「大和ファイナンス(株)」のカード事業を分離し、「(株)大和カードサービス」へ営業譲渡、同社営業開始。 「大和ファイナンス(株)」が「日本インベストメント・ファイナンス(株)」と合併、「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ(株)」へと商号変更。 「大和インターナショナル信託銀行(株)」全株式を住友信託銀行(株)へ譲渡。
13年4月	「大和証券エスビーキャピタル・マーケッツ(株)」がさくら証券(株)から営業全部を譲受け、「大和証券エスエムピーシー(株)」へと商号変更。

3. 事業の内容

当社及び当社の関係会社(連結子会社52社、持分法適用関連会社4社)の主たる事業は証券業を中核とする投資・金融サービス業であり、具体的な事業として有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び売買等の委託の媒介、有価証券の引受及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い、その他証券業並びに金融業等を営んでおります。当社及び当社の関係会社は、日本をはじめ、米州、欧州、アジア・オセアニアの主要な金融市場に営業拠点を設置し、グローバルなネットワークにより世界中の顧客の資金調達と運用の双方のニーズに対応して幅広いサービスを提供しております。

投資・金融サービス業（当社、連結子会社52社、持分法適用関連会社4社）

株式会社大和証券グループ本社

証券関連業務

国 内 4 社

大和証券株式会社

大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社（注）

大和証券投資信託委託株式会社

大和住銀投信投資顧問株式会社

欧 州 5 社

大和証券SBキャピタル・マーケット・ヨーロッパ・リミテッド（注）他

アジア・オセアニア 17社

大和証券SBキャピタル・マーケット・アジア・ホールディング・V.（注）

大和証券SBキャピタル・マーケット・香港・リミテッド（注）

大和証券SBキャピタル・マーケット・シンガポール・リミテッド（注）他

米 州 11社

大和アメリカCorporation

大和セキュリティーズ アメリカ Inc.

他

国 内

ベンチャーキャピタル

エス・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社

その他関連業務 10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

大和土地建物株式会社

他

金融業・その他関連業務

欧 州 8 社

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

大和ヨーロッパ プロパティplc

他

（注） 大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社は、平成13年4月1日付で大和証券エムビーシー株式会社と商号を変更いたしました。並びに、SBキャピタル・マーケットの名を冠しておりました傘下の海外現地法人におきましても、SMBCと商号を変更しております。

4. 関係会社の状況

名称	住所	資本金	主要な事業の内容	議決権の所有割合(%)	関係内容	摘要
(連結子会社)						
大和証券株式会社	東京都千代田区	千円 100,000,000	証券業	100.0	金銭の貸借 役員の兼任等... 2 転籍... 8	2, 4
大和証券エスピーキャピタル・ マーケット株式会社	東京都中央区	千円 205,600,000	証券業	60.0	有価証券の売買等 役員の兼任等... 0 金銭の貸借 転籍... 8	2, 3, 4
大和証券投資信託委託株式会社	東京都中央区	千円 15,174,273	投資信託 委託業	88.0	有価証券の売買等 役員の兼任等... 1 転籍... 5	2
株式会社大和総研	東京都江東区	千円 3,898,000	情報 サービス業	84.4 (21.5)	情報提供 業務委託 役員の兼任等... 1 転籍... 10	
株式会社大和証券ビジネスセン ター	東京都江東区	千円 495,000	事務代行業	100.0	事務代行 役員の兼任等... 2 転籍... 4	
大和土地建物株式会社	東京都中央区	千円 793,800	不動産業	57.4 (5.0)	不動産の貸借 役員の兼任等... 1 転籍... 4	
エヌ・アイ・エフ ベンチャー ズ株式会社	東京都中央区	千円 8,292,450	ベンチャー キャピタル 業	96.2 (69.6)	金銭の貸借 役員の兼任等... 1 転籍... 8	
大和証券SBキャピタル・マーケ ッツ・ヨーロッパ・リミテッド	イギリス ロンドン市	スターリング ポンド 109,121,063	証券業	100.0 (100.0)	有価証券の売買等 役員の兼任等... 0 転籍... 0	2, 3
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	イギリス ロンドン市	スターリング ポンド 120,603,845	金融業	100.0	金銭の貸借等 役員の兼任等... 1 転籍... 1	2
大和ヨーロッパプロパティ plc	イギリス ロンドン市	スターリング ポンド 260,000,000	不動産 管理業	100.0	役員の兼任等... 2 転籍... 1	2
大和アメリカ Corporation	アメリカ ニューヨーク市	米ドル 431,000,000	子会社の 統合・管理	100.0	米国子会社との金銭の貸借 役員の兼任等... 1 転籍... 0	2
大和セキュリティーズ アメリカ Inc.	アメリカ ニューヨーク市	米ドル 100,000,000	証券業	100.0 (100.0)	有価証券の売買等 役員の兼任等... 0 転籍... 0	4
大和証券SBキャピタル・マーケ ッツ・アジア・ホールディング B.V.	オランダ アムステルダム市	オランダギルダー 270,694,135	子会社の 統合・管理	100.0 (100.0)	アジア子会社との金銭の貸借 役員の兼任等... 0 転籍... 0	2, 3
大和証券SBキャピタル・マーケ ッツ・香港・リミテッド	香港	香港ドル 100,000,000	証券業	100.0 (100.0)	有価証券の売買等 役員の兼任等... 0 転籍... 0	3
大和証券SBキャピタル・マーケ ッツ・シンガポール・リミテッ ド	シンガポール シンガポール市	シンガポールドル 42,000,000	証券業 金融業	100.0 (100.0)	有価証券の売買等 役員の兼任等... 0 金銭の貸借 転籍... 0	3
その他37社						
(持分法適用関連会社)						
大和住銀投信投資顧問株式会社	東京都中央区	千円 2,000,000	投資顧問業	44.0	役員の兼任等... 1 転籍... 5	
その他 3 社						

(注) 1. 議決権のうち間接保有の割合は、()に内書きしております。

2. 特定子会社に該当します。

3. 大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社は、平成13年4月1日付で商号を大和証券エスエムピーシー株式会社と商号を変更いたしました。並びに、SBキャピタル・マーケットの名を冠しておりました傘下の海外現地法人におきましても、SMBCと商号を変更しております。

4. 営業収益(連結相互間の内部収益を除く)の連結営業収益に占める割合が10%を超えております。
各社の主要な損益状況等は次のとおりであります。

(単位：百万円)

	大和証券株式会社	大和証券エスビー キャピタル・マー ケッツ株式会社	大和セキュリティーズ アメリカ Inc.
営業収益	178,959	230,735	181,652
経常利益	24,355	123,640	1,567
当期純利益	13,396	70,802	1,125
純資産額	202,644	394,136	13,643
総資産額	586,653	5,626,580	1,759,270

5. 従業員の状況

(1) 連結会社の状況

(平成13年 3月31日現在)

	従業員数(人)
連結会社合計	11,114 [1,564]

- (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. 上記のほか、投信債券外務員等の平成13年 3月末の雇用人員は、1,166人であります。
3. 従業員は就業人員であり、臨時従業員は [] 内に年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13年 3月31日現在)

従業員数(人)	平均年齢(歳)	平均勤続年数(年)	平均年間給与(円)
315	37歳 2 ヶ月	11年 5 ヶ月	9,080,090

- (注) 平均年間給与は、賞与及び基準外賃金を含んでおります。

(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

当連結会計年度におけるわが国経済は、平成12年中は厳しいながらも緩やかな回復基調を辿りました。輸出が堅調に推移し、生産活動が活発化したほか、製造業を中心に情報関連投資など民間設備投資が3年ぶりに増加に転じ、経済成長を支えました。個人消費においては、所得の緩やかな改善はみられたものの、失業率が高止まりで推移したこともあって、回復感の乏しい状況が続きました。平成13年にはいと、前年秋口から顕在化しつつあった輸出の鈍化、鉱工業生産の頭打ち傾向に加え、設備投資の先行きが不透明となり、銀行の不良債権問題も再浮上したことなどから、景気の停滞感が強まりました。

当企業集団(当社、連結子会社及び持分法適用関連会社)の業績と最も深い関わりを有する証券市場においては、株式市場では外国人投資家の売り越し基調、法人投資家の持合解消に伴う需給悪化、米国株式市場の下落基調への連動から、日経平均株価は平成12年4月に20,833円の高値をつけた後、年度を通じほぼ一貫して下落し、平成13年3月には11,819円と16年ぶりの安値をつけるに至りました。東京証券取引所における株式の年間売買代金は、前年度比9%減の216兆9,661億円となりました。

また債券市場では、日本銀行がゼロ金利政策を解除したことに加え、国債の増発による需給悪化懸念も生じたことから、期中には新発長期国債の利回りが2.0%近くまで上昇する局面もありましたが、その後は米国経済の減速や景気の先行きに対する不安感の台頭で利回りは低下傾向を辿り、債券相場は堅調な展開となりました。

このような環境下にあって、グループ各社はそれぞれの経営目標、戦略に基づいた営業活動を積極的に展開いたしました。その結果、当連結会計期間の営業収益は前年度比109.7%の7,181億円となりました。

< 営業収益の内訳 >

(単位：百万円)

	当連結会計年度 平成13年3月期	前連結会計年度 平成12年3月期	前年度比
受入手数料	254,704	364,115	70.0%
トレーディング損益	165,637	117,625	140.8%
営業投資有価証券売買損益	3,853	8,199	47.0%
その他の商品売買損益	15	345	4.6%
金融収益	223,992	103,882	215.6%
その他の売上高	69,909	60,481	115.6%
合計	718,113	654,650	109.7%

受入手数料は、多数の新規公開株式の主幹事をつとめるなど引受・売出手数料が前年度比111.4%の388億円と順調に推移しましたが、特に下半期において株式市場が調整局面を迎えたことでエクイティ委託手数料が前年度比56.3%の822億円、投資信託の販売に係る募集・売出しの取扱い手数料が前年度比43.2%の375億円と伸び悩みました。

トレーディング損益は、法人投資家等からの大口エクイティ取引の増加により株券等トレーディングで前年度比248.9%の1,303億円と収益機会を捉えましたが、債券・為替等トレーディングで伸び悩み、合計では前年度比140.8%の1,656億円となっております。

また金融収益は、海外現地法人の債券レポ取引の規模を拡大したこと等から前年度比215.6%の2,239億円と増加しました。

なお、事業部門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。

< 事業部門別の受入手数料の内訳 >

(単位：百万円)

	当連結会計年度					
	エクイティ	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント	インベスト メント・ バンキング	その他	合計
委託手数料	82,230	642	8	—	—	82,880
引受・売出手数料	—	—	—	38,858	—	38,858
(株券等)	(—)	(—)	(—)	(31,131)	(—)	(31,131)
(債券等)	(—)	(—)	(—)	(7,727)	(—)	(7,727)
募集・売出しの 取扱い手数料	—	—	37,509	2,099	—	39,609
その他の受入手数料	2,620	3,084	70,420	7,137	10,093	93,356
(代理事務手数料)	(—)	(2,949)	(38,637)	(—)	(—)	(41,587)
合計	84,850	3,726	107,938	48,096	10,093	254,704
構成比率	33.3%	1.5%	42.4%	18.9%	3.9%	100.0%

(単位：百万円)

	前連結会計年度					
	エクイティ	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント	インベス トメント・ バンキング	その他	合計
委託手数料	145,968	1,487	7	—	12	147,476
引受・売出手数料	—	—	—	34,887	—	34,887
(株券等)	(—)	(—)	(—)	(26,151)	(—)	(26,151)
(債券等)	(—)	(—)	(—)	(8,317)	(—)	(8,317)
募集・売出しの 取扱い手数料	—	—	86,763	1,439	—	88,203
その他の受入手数料	2,876	3,394	70,430	7,217	9,629	93,548
(代理事務手数料)	(—)	(2,943)	(40,685)	(—)	(—)	(43,628)
合計	148,844	4,882	157,202	43,544	9,642	364,115
構成比率	40.9%	1.3%	43.2%	12.0%	2.6%	100.0%

(注) 「エクイティ」部門の「委託手数料」には、転換社債及びワラントの委託手数料を含めております。

(単位：%)

	前年度比					
	エクイティ	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント	インベス トメント・ バンキング	その他	合計
委託手数料	56.3	43.2	114.3	—	0.0	56.2
引受・売出手数料	—	—	—	111.4	—	111.4
(株券等)	(—)	(—)	(—)	(119.0)	(—)	(119.0)
(債券等)	(—)	(—)	(—)	(92.9)	(—)	(92.9)
募集・売出しの 取扱い手数料	—	—	43.2	145.9	—	44.9
その他の受入手数料	91.1	90.9	100.0	98.9	104.8	99.8
(代理事務手数料)	(—)	(100.2)	(95.0)	(—)	(—)	(95.3)
合計	57.0	76.3	68.7	110.5	104.7	70.0

[エクイティ(株式関連)部門]

手数料率の自由化に伴うネット取引等が増加したことで手数料率が減少したほか、一部のIT関連銘柄の下落に端を発した市場規模の縮小傾向により、国内の株式委託手数料が伸び悩んだことで、部門合計では前年度比57.0%の848億円にとどまりました。

[フィックス・インカム(債券)部門]

海外を含む連結子会社で計上される先物取引等の委託手数料6億円(前年度比43.2%)、利金・償還金等の支払事務代行に対する代理事務手数料29億円(前年度比100.2%)等、部門合計で前年度比76.3%の37億円にとどまりました。

[アセット・マネジメント(資産運用)部門]

株式相場の軟調な地合いを受けて投資信託の販売に係る募集・売出しの取扱い手数料が前年度比43.2%の375億円と低迷しました。投資信託の事務代行手数料は前年度比95.0%の386億円、大和証券投資信託委託株式会社に計上される信託報酬(支払代理事務手数料控除後)は前年度比106.7%の315億円と安定的な収益源となっておりますが、部門合計では前年度比68.7%の1,079億円にとどまりました。

[インベストメント・バンキング(投資銀行)部門]

多数の新規公開株式の主幹事をつとめるなど引受活動に注力した成果があらわれました。国内及び海外の引受・売出手数料388億円(前年度比111.4%)、国内で計上される募集・売出しの取扱い手数料20億円(前年度比145.9%)及びその他受入手数料としてアドバイザリー・フィーやM&Aの手数料71億円(前年度比98.9%)、部門合計で前年度比110.5%の480億円となりました。

[その他の部門]

この部門に属する主なものは、銀行業務を営む海外現地法人で計上するカストディーフィー(保管手数料)、エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社に計上する投資事業組合等運営報酬等で、部門全体では前年度比104.7%の100億円となりました。

<トレーディング損益の内訳>

(単位：百万円)

	当連結会計年度 平成13年3月期	前連結会計年度 平成12年3月期	前年度比
株券等	130,300	52,346	248.9%
債券・為替等	35,336	65,278	54.1
(債券等)	(32,523)	(60,198)	(54.0)
(為替等)	(2,813)	(5,080)	(55.4)
合計	165,637	117,625	140.8

バスケット取引を中心とした法人投資家等のエクイティ取引が高水準となったことで、株券等トレーディング損益は前年度比248.9%の1,303億円と好調であった一方、低金利の継続に伴う相場の硬直化により収益機会の減少した債券・為替等トレーディング損益は、前年度比54.1%の353億円と低調な結果に終わりました。合計では、前年度比140.8%の1,656億円となっております。

< トレーディングのリスク量 >

マーケットリスク

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

(単位：億円)

	当期 平成13年 3 月期			前期 平成12年 3 月期		
	最大値	最小値	平均値	最大値	最小値	平均値
VaR	194	14	44	122	6	22

(注) 1. 当企業集団のうちトレーディング業務の中心となっております大和証券エスピーキャピタル・マーケットツ株式会社について記載しております。

2. VaRの範囲と前提

対象範囲： 国内における主要なトレーディング商品

信頼区間： 片側99% (標準偏差2.33)

注)：平成11年 6 月30日より信頼区間を95%から99%に変更しました。この変更に伴いそれ以前の数値につきましても95%から99%に換算のうえ記載しております。

保有期間： 1 日

クレジットリスク

OTCデリバティブ(スワップ取引・選択権付債券売買取引・先物外国為替取引等)の評価益に対しては、デフォルトによる想定損失相当の引当額(クレジット・リザーブ)を算定し、トレーディング損益より控除しております。

(単位：億円)

	当期末 平成13年 3 月31日	前期末 平成12年 3 月31日
評価益	3,016	1,157
上記に対するクレジット・リザーブ	10	10

(注) 当企業集団のうちトレーディング業務の中心となっております大和証券エスピーキャピタル・マーケットツ株式会社について記載しております。

営業費用においては、グループ中期計画の一環である「大和証券グループブランド」の確立、グループ企業価値の増大に向け、積極的に広告展開をしたこと等により取引関係費が前年度比113.0%の556億円と増加したほか、海外現地法人の債券レポ取引の規模拡大に伴い金融費用が前年度比216.5%の1,959億円と増加しております。

その結果、経常利益は前年度比79.3%の1,777億円、当期純利益は前年度比61.3%の645億円となっております。

また当連結会計期間の 1 株当たり当期純利益は48円62銭(前連結会計期間は79円43銭)となり、自己資本利益率(ROE)は9.3%(前連結会計年度は16.1%)となりました。

<所在地別セグメント>

[日本]

株式市場の調整に伴い、エクイティ委託手数料及び投資信託の販売に係る募集・売出しの取扱い手数料が低迷する一方で、多数の新規公開株式の主幹事をつとめたことによりインベストメント・バンキング部門の引受・売出手数料が好調に推移したほか、バスケット取引を中心とした法人投資家等のエクイティ取引が高水準となったことで株券等トレーディングが好調でありました。しかしながら、営業収益は前年度比92.4%の5,040億円、営業利益は前年度比78.8%の1,735億円にとどまっております。

[米州]

株式市場の調整に伴い、エクイティ委託手数料が減少したほか、債券レポ取引の規模を拡大したことにより、金融収益・金融費用が増加しました。営業収益は前年度比233.3%の1,979億円、営業利益は前年度比439.5%の111億円と好調でありました。

[欧州]

インベストメント・バンキング部門の引受・売出手数料が好調に推移しましたが、株式市場の調整に伴い、エクイティ委託手数料が減少しました。営業収益は前年度比79.3%の237億円、営業利益は前年度比78.2%の47億円にとどまっております。

[アジア・オセアニア]

インベストメント・バンキング部門の引受・売出手数料が好調に推移しましたが、株式市場の調整に伴い、エクイティ委託手数料が減少しました。営業収益は前年度比88.5%の77億円、営業利益は前年度比68.7%の10億円にとどまっております。

(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、レポ取引等の証券業務の拡大に伴うポジション増加により2,409億円(前連結会計年度は4,590億円)となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、投資有価証券の売却を推し進めたことにより49億円(前連結会計年度は1,408億円)となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、社債発行等により427億円(前連結会計年度は3,068億円)となりました。為替の影響を排除した後の現金及び現金同等物は、前年度末比1,854億円減少し3,033億円(前連結会計年度は4,888億円)となりました。

2. 対処すべき課題

1. 経営の基本方針

大和証券グループ(当社、連結子会社52社及び持分法適用関連会社4社)は、証券業を中心にアセット・マネジメント業務ほかの証券関連業務を展開し、「日本最強の証券グループ」を目指しております。持株会社体制のもとでグループの経営資源を競争力の源泉である証券業及び証券関連業務に集中し、当社グループの企業価値の最大化に取り組みます。

2. 中長期的な経営戦略

当社は、平成12年4月からの3ヵ年計画である「グループ中期経営計画」を策定し、連結ROE(自己資本利益率)15%、リテール営業資産の倍増(28.3兆円)、内外主要格付機関よりA格以上の格付取得(証券2社)の3つをグループ中期経営目標として掲げております。

また、本年3月には、大和証券グループのコーポレート・ブランド構築に向けて「ブランド・ステートメント」を発表いたしました。「ブランド・ステートメント」は、当社グループからお客様への約束であり、未永く守り続けていく基本的な価値観として、「お客様の『期待』を超える並外れたサービス」、「会社・事業の『粋』を超える幅広く厚みのあるサービス」、「時代の『標準』を超える革新的なサービス」の3つを定めたものです。

当社グループでは、今後、ステートメントの具現化に向けた施策を実践するブランド・マネジメントに積極的に取り組んでまいります。

3. グループ経営インフラストラクチャーの整備

上記の経営目標の達成に向けて、グループ経営のインフラストラクチャーの整備を進めております。

(1) ガバナンス体制

当社グループ全体が一体として機能するための戦略的意思決定の仕組みづくり、当社とグループ各社の権限の明確化、外部株主から見たグループ経営の透明性向上に取り組んでおります。具体的には、グループ主要会社社長による当社執行役員体制の整備、グループ経営会議の機能強化、報酬委員会の設置、経営諮問委員会のメンバー拡充等を実施いたしました。

(2) 人事政策

当社グループ各社の事業特性に応じた人事制度と、グループ全体的見地による人事制度のバランスを取ることを基本として、証券関連業務における人員増強、プロフェッショナルな人材の育成、マネジメント研修の一環である「大和経営アカデミー」の設置によるグループ・マネジメント層の養成、ストック・オプション、インセンティブ・ワラント等の株価連動インセンティブの活用を進めております。

(3) 財務戦略

当社グループ全体として経営資源の適正な配分・管理と効果的なリスク管理を進めます。特に、当面は安定収益の増加や収益構成多様化などを重視して財務安定性向上を図ります。また、グループ・キャッシュ・マネジメント・システムを整備して当社グループ全体の資金効率向上と流動性リスク等の抑制を図ります。

(4) 広報・IR戦略

大和証券グループのコーポレート・ブランドの確立に向けた、積極的な広報宣伝活動及び株主・投資家向けコミュニケーション活動の展開を行います。

(5) IT戦略

近年、証券業の情報産業化が急激に進行する中で、競争上の優位性を確立するためには、あらゆる業務分野における情報通信技術(IT)の戦略的活用が不可欠となっております。当社グループは、昨年4月に任命したIT担当執行役員(CIO)を中心に、グループIT戦略会議において、IT戦略の構築、IT投資に係る意思決定の迅速化ならびにIT投資効率の向上を図っております。

4. グループ各社の経営戦略

(1) 大和証券株式会社(リテール証券業務)

確定拠出年金制度の導入による企業年金制度の変革、ペイオフの実施に伴う預貯金の流動化等を控えて、今後予想される国民各層における証券投資の拡大に対応すべく、「3つのサービス・パッケージ」によりお客様の満足度向上を追求してまいりました。また、昨年度下期より「新世紀・改革プロジェクト」を推進し、コンサルティング営業体制の強化に取り組んでおります。また、お客様からの声を一元的に取りまとめサービスの改善に努めるため、CS推進室を新設いたしました。

(2) 大和証券エスピーキャピタル・マーケッツ株式会社(新社名：大和証券エスエムビーシー株式会社)(ホールセール証券業務)

本格的なインベストメントバンクとして、エクイティ、債券業務におけるマーケット・リーダーを目指すこと、新規公開業務に注力すること、証券化などのストラクチャード・ファイナンス、デリバティブ、M&A等の業務を成長させ、主要な収益部門にすること、日本関連のクロスボーダー取引に集中し、グローバル体制を再強化すること、ホールセールビジネスの特性にあった経営管理の仕組みや、人事制度等のインフラストラクチャーを確立することに取り組んでおります。

また、本年4月1日にさくら証券から営業を譲り受け、さらにM&A業務などさくら銀行の投資銀行業務の一部を同社に集約したことにより、収益基盤が一段と強化されました。

(3) 大和証券投資信託委託株式会社、大和住銀投信投資顧問株式会社(アセット・マネジメント業務)

個人金融資産の運用手段として証券投資信託の飛躍的な拡大が望まれることに加え、確定拠出年金制度の導入を控え、アセット・マネジメント業務の重要性はますます高まっております。

大和証券投資信託委託株式会社は、引き続きパフォーマンスの向上を目指します。また、商品開発力の強化に努め、主導的な投資信託運用会社の地位を不動のものに高めてまいります。

大和住銀投信投資顧問株式会社は、国内有数の投資顧問会社としてパフォーマンスの向上を通じて他社との差別化を進め、外部評価の一層の向上を図り、受託残高の拡大を目指します。また、投資信託においても商品ラインナップを充実し、運用資産の拡大を図ります。

(4) 株式会社大和総研(リサーチ、システム業務)

日本における代表的シンクタンクとして、リサーチ業務、システム業務を展開しております。

リサーチ業務においては、経済予測やアナリスト・レポート等を通じて、お客様により質の高い情報を提供していくとともに、タイムリーな政策提言により日本経済の活性化に貢献いたします。

また、システム業務においては、金融・資本市場を中心に、常に先端のニーズを捉え、当社グループやお客様に最適のシステム・ソリューションを提供してまいります。

(5) 株式会社大和証券ビジネスセンター(証券事務代行業務)

昨年11月、証券事務代行業務受託会社としては初めて、品質システムに関する国際規格ISO9001の認証を取得いたしました。

今後も専門性と効率性の高いサービスを提供することによって、当社グループの事務コストの削減に貢献いたします。

(6) エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ株式会社(ベンチャー・キャピタル業務)

これまで培ってきた実績と信用力、当社グループの一員としてグローバルな展開を進めてきたことにより培われた情報力・営業力を活かし、ベンチャー企業に対して資金調達面のみならず、経営支援、人材斡旋等の企業支援を行っております。また、これらのベンチャー企業の株式公開、M&A、MBOなどにも取り組んでおります。

5. 対処すべき課題

わが国における構造改革の本格化やIT革命の進展などにより、証券・金融業界を取巻く環境は、加速度的に変化しつつあります。

このような環境を踏まえ、当社はここ数年来、企業理念の制定を始めとして、自主営業体制への取組み、第一次中期経営計画の制定、住友銀行との提携、旧大和証券の分社化、持株会社体制によるグループ経営、グループ中期経営計画の策定と一連の経営改革を行ってまいりました。

他業態も巻き込んだ厳しい競争の中、当社が経営基盤をより強固なものとするためには、独自の商品・ノウハウを豊富に持つとともに、お客様からより高い評価をいただくことが鍵になります。そのためには人材・顧客・ブランドの3つの資産を拡大することが不可欠であると考えます。すなわち、知的資産としての人材に磨きをかけ、卓越した企画力に裏づけられた戦略を駆使することによってお客様からお預かりする営業資産を積上げ、その結果が業績の拡大となってブランド資産が確立されるという好循環が生まれると考えております。

このような取組みの下、当社グループでは平成13年度の開始に当たり、次の経営方針を掲げました。

(1) 大和証券グループ・ブランドの確立

「大和証券グループ・ブランド」とは、お客様が大和証券グループの商品やサービス等に対して抱かれる総体的な印象や評価を指します。大和証券グループがお客様から選ばれお客様の心をしっかりとらえるために、グループの役職員全員が、「お客様の『期待』を超える並外れたサービス」、「会社・事業の『粋』を超える幅広く厚みのあるサービス」、「時代の『標準』を超える革新的なサービス」という3つの基本的価値観を共有し、新しい時代にふさわしい優れた金融サービスの提供を目指します。

(2) リテール営業資産の飛躍的拡大

リテール営業資産は、大和証券グループの知的資産、ブランド資産に対するお客様からの信頼の証であると考えます。投資銀行部門、資産運用部門等との連携を高め、グループの総力を挙げてリテール営業資産の飛躍的拡大を図ります。

(3) 投資銀行部門の躍進

投資銀行部門は戦略的パートナーの拡大強化により、さらに大きな顧客基盤を有することになりました。お客様に対し高度のノウハウを駆使して積極的な提案活動を展開することにより、わが国最強の投資銀行に成長するよう全力を傾注いたします。

大和証券グループは、この経営方針をグループの全役職員が一丸となって貫徹することにより、平成12年3月に3ヵ年計画として策定し、その中で掲げた三項目の中期経営目標、すなわち連結ROE(自己資本利益率)15%、リテール営業資産の倍増(28.3兆円)、内外主要格付機関より「A」格以上の格付の取得(証券2社)、の達成に向け業務に邁進する所存であります。

3. 経営上の重要な契約等

ホールセール証券業務を主要業務とする子会社である大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社は、平成13年4月1日にさくら証券株式会社からその営業の全部を譲受け、商号を大和証券エスエムビーシー株式会社と変更いたしました。

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. 設備投資等の概要

国内のリテール証券業務を行っております大和証券株式会社の営業拠点については、帯広支店及び池袋西口支店新座志木営業所の新設、千葉支店の移転を行い、440百万円の設備投資を実施いたしました。また、分社化による社名ロゴの変更に伴い、大和証券本支店の看板交換(100店舗他)のため、657百万円の設備投資を行いました。

海外では、大和証券SBキャピタル・マーケット・ヨーロッパ・リミテッドの営業拠点として、マドリッド支店及びミラノ支店の新設を行い、52百万円の設備投資を実施いたしました。

2. 主要な設備の状況

当社グループ(当社及び連結子会社)における主要な設備は以下のとおりであります。

(1) 提出会社

店舗名	所在地	建物及び構築物 帳簿価額 (年間賃借料) (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数	摘要
			帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区	688 (—)	—	—	688	315	(注) 3

(2) 国内子会社

店舗名	所在地	建物及び構築物 帳簿価額 (年間賃借料) (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数	摘要
			帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
大和証券株式会社							
本店	東京都千代田区	1,149 (―)	697	2,884	1,846	692	(注) 3
横浜支店	横浜市中区	138 (―)	193	407	331	63	
札幌支店	札幌市中央区	74 (115)	―	―	74	75	
仙台支店	仙台市青葉区	480 (―)	3,639	1,504	4,119	50	
名古屋支店	名古屋市中区	764 (27)	283	1,099	1,047	101	(注) 3
大阪支店	大阪市北区	989 (―)	―	―	989	134	(注) 3
広島支店	広島市中区	169 (―)	1,683	433	1,852	47	
高松支店	高松市	468 (―)	1,491	706	1,959	41	
福岡支店	福岡市中央区	1,166 (53)	1,477	590	2,643	74	(注) 4
大和証券エスピーキャピタル・マーケッツ株式会社							
東京	東京都 中央区、江東区	1,526 (2,156)	―	―	1,526	1,337	(注) 3
大阪支店	大阪市北区	1,374 (―)	1,701	1,140	3,075	158	(注) 3
名古屋支店	名古屋市中区	175 (18)	―	―	175	81	(注) 3
株式会社大和総合研修センター	東京都多摩市	11,743 (―)	4,733	13,300	16,476	2	
株式会社大和総研	東京都江東区、 大阪市福島区他	8,384 (2,110)	6,101	7,117	14,485	1,331	(注) 3

(3) 在外子会社

店舗名	所在地	建物及び構築物 帳簿価額 (年間賃借料) (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数	摘要
			帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
大和アメリカ Corporation	アメリカ ニューヨーク市他	1,477 (455)	—	—	1,477	269	
大和証券SBキャピタル・マーケ ッツ・ヨーロッパ・リミテッド	イギリス ロンドン市 ドイツ フランクフル ト市他	965 (675)	—	—	965	401	

- (注) 1. 連結会社以外からの賃借設備については、「建物及び構築物帳簿価額(年間賃借料)」の欄の()に年間賃借料を記載しております。
2. 連結会社所有の設備は主たる使用者の欄に帳簿価額を記載しております。
3. 同一の建物を複数の連結会社で使用している場合の建物及び構築物の帳簿価額は使用床面積で案分した価額を記載し、土地の帳簿価額及び面積は主な使用者の欄に記載しております。
4. 大和証券株式会社・福岡支店の土地の一部は借地権であります。
5. 帳簿価額の金額には消費税等を含んでおりません。

3. 設備の新設及び除却等の計画

主な設備の新設、除却等の計画は、以下のとおりであります。

(1) 新設

会社及び事業所名	所在地	設備の内容	投資予定額(百万円)		資金調達方法	着手及び完了予定	
			総額	既支払額		着手	完了
大和証券株式会社 所沢支店ステーション プラザ	埼玉県 所沢市	店舗新設	179	—	自己資金	平成13年4月	平成13年5月 平成13年6月開設
大和証券株式会社 鎌倉支店大船営業所	神奈川県 鎌倉市	営業所新設	170	—	自己資金	平成13年下半年期	平成13年下半年期 平成13年下半年期開設
大和証券株式会社 渋谷支店溝の口営業所	神奈川県 川崎市 高津区	営業所新設	172	—	自己資金	平成13年下半年期	平成13年下半年期 平成13年下半年期開設

(2) 除却等

該当事項はありません。

第4 提出会社の状況

1. 株式等の状況

(1) 株式の総数等

種類	会社が発行する株式の総数	摘要
普通株式	4,000,000,000 株	(注)参照
優先株式	100,000,000	
計	4,100,000,000	—

(注) 定款での定めは、次のとおりであります。

当会社の発行する株式の総数は、41億株とし、このうち40億株は普通株式、1億株は優先株式とする。

ただし、普通株式につき消却があった場合、また、優先株式につき消却又は普通株式への転換があった場合には、それぞれこれに相当する株式数を減ずる。

	記名・無記名の別及び額面・無額面の別	種類	発行数		上場証券取引所名又は登録証券業協会名	摘要
			事業年度末現在 (平成13年3月31日)	提出日現在 (平成13年6月27日)		
発行済株式	記名式額面株式 (券面額 50円)	普通株式	1,331,735,258 株	1,331,735,258 株	東京証券取引所 大阪証券取引所 名古屋証券取引所 ロンドン国際証券取引所 パリ証券取引所 フランクフルト証券取引所 ブリュッセル証券取引所	各市場第一部 預託証券を上場 (注)1、2参照
	計	—	1,331,735,258	1,331,735,258	—	—

(注) 1. 議決権を有しております。

2. 提出日現在の発行数には平成13年6月1日以降の転換社債の株式への転換により発行された株式数は含まれておりません。

(2) 発行済株式総数、資本金等の推移

年月日	発行済株式総数		資本金		資本準備金		摘要
	増減数	残高	増減額	残高	増減額	残高	
平成8年4月1日～平成9年3月31日	千株 185	千株 1,344,575	百万円 127	百万円 138,424	百万円 127	百万円 117,779	転換社債の株式転換による増加
平成9年4月1日～平成10年3月31日	9,021	1,335,554	0	138,424	0	117,779	発行済株式総数の減少数9,021,000株は利益による自己株式の消却
平成10年4月1日～平成11年3月31日	3,832	1,331,722	0	138,424	0	117,779	発行済株式総数の減少数3,832,000株は利益による自己株式の消却
平成11年4月1日～平成12年3月31日	10	1,331,733	5	138,430	5	117,785	転換社債の株式転換による増加
平成12年4月1日～平成13年3月31日	1	1,331,735	0	138,431	0	117,786	転換社債の株式転換による増加

(注) 1. 平成13年4月1日から平成13年5月31日までの間に、転換社債の株式への転換は行われておりません。

2. 転換社債の残高、転換価額及び資本組入額は次の通りであります。

銘柄	残高	転換価額	資本組入額
平成13年3月31日現在			
第7回無担保転換社債	19,440百万円	3,035円90銭	1株当たり1,518円
第11回無担保転換社債	36,269百万円	2,367円00銭	1株当たり1,184円
第16回無担保転換社債	79,986百万円	1,094円00銭	1株当たり 547円
平成13年5月31日現在			
第7回無担保転換社債	19,440百万円	3,035円90銭	1株当たり1,518円
第11回無担保転換社債	36,269百万円	2,367円00銭	1株当たり1,184円
第16回無担保転換社債	79,986百万円	1,094円00銭	1株当たり 547円

3. 新株引受権の残高、新株引受権の残高、行使価額及び資本組入額は次の通りであります。

銘柄	残高	行使価額	資本組入額
平成13年3月31日現在			
第1回無担保新株引受権付社債	8,360百万円	1,345円00銭	1株当たり 673円
平成13年5月31日現在			
第1回無担保新株引受権付社債	8,360百万円	1,345円00銭	1株当たり 673円

(3) 所有者別状況

平成13年3月31日現在

区分	株式の状況(1単位の株式数1,000株)							単位未満株式の状況
	政府及び地方公共団体	金融機関	証券会社	その他の法人	外国法人等(うち個人)	個人その他	計	
株主数	2人	401	67	1,380	676(26)	70,182	72,708	—
所有株式数	1,746単位	621,142	6,555	97,486	397,100(76)	202,173	1,326,202	5,533,258株
割合	0.13%	46.84	0.49	7.35	29.94(0.01)	15.25	100.00	—

- (注) 1. 「その他の法人」には226単位、「単位未満株式の状況」には1,614株の財団法人証券保管振替機構名義の株式を含んでおります。
2. 「個人その他」には3,631単位、「単位未満株式の状況」には777株の自己名義株式を含んでおります。
- なお、3,631,777株は株主名簿記載上の株式数であり、期末日現在の実質的な自己所有株式数は3,627,777株であります。

(4) 大株主の状況

平成13年3月31日現在

氏名又は名称	住所	所有株式数	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	東京都中央区晴海1丁目8番11号	60,101千株	4.51%
中央三井信託銀行株式会社	東京都港区芝3丁目33番1号	54,663	4.10
ザ・チェース・マンハッタン・バンク エヌエイ・ロンドン エス・エル・オムニバス・アカウント	東京都中央区日本橋兜町6番7号 常任代理人 株式会社富士銀行兜町カストディ業務室	53,749	4.04
株式会社住友銀行	大阪市中央区北浜4丁目6番5号	43,827	3.29
三菱信託銀行株式会社	東京都千代田区永田町2丁目11番1号	43,789	3.29
太陽生命保険相互会社	東京都中央区日本橋2丁目11番2号	41,229	3.10
住友信託銀行株式会社	大阪市中央区北浜4丁目5番33号	38,944	2.92
ステート ストリート バンク アンド トラスト カンパニー	東京都中央区日本橋兜町6番7号 常任代理人 株式会社富士銀行兜町カストディ業務室	34,009	2.55
みずほ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内1丁目6番2号	31,296	2.35
日本生命保険相互会社	東京都千代田区有楽町1丁目2番2号	31,269	2.35
計	—	432,878	32.50

- (注) 1. 上記の所有株式数のうち、信託業務に係る株式数は、次のとおりであります。

日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	60,101千株
中央三井信託銀行株式会社	41,215千株
三菱信託銀行株式会社	38,497千株
住友信託銀行株式会社	3,515千株
みずほ信託銀行株式会社	31,296千株

2. 株式会社住友銀行は、平成13年4月1日をもって株式会社さくら銀行と合併し、株式会社三井住友銀行となりました。

なお、株式会社さくら銀行が所有しております当社株式7,923千株を加えますと株式会社三井住友銀行の所有する当社株式は合計51,750千株(3.89%)となります。

3. フィデリティ投信株式会社から平成13年 1月15日付けで株券等の大量保有の状況に関する「変更報告書」の提出があり、平成12年12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、当社としては当期末の実質所有状況の確認ができませんので、上記表には含めておりません。

なお、「変更報告書」の内容は次のとおりであります。

大量保有者名	フィデリティ投信株式会社
保有株式数	112,320千株
株式保有割合	8.43%

(5) 議決権の状況

平成13年3月31日現在

発行済株式	議決権のない株式数	議決権のある株式数		単位未満株式数	摘要
		自己株式等	その他		
株 —	株 3,627,000	株 1,322,575,000	株 5,533,258	(注)1、2参照	

- (注) 1. 「議決権のある株式数」の「その他」には財団法人証券保管振替機構名義の株式226,000株が含まれております。
2. 「単位未満株式数」には財団法人証券保管振替機構名義の株式1,614株、当社所有の自己株式777株が含まれております。

平成13年3月31日現在

自己株式等	所有者の氏名又は名称等		所有株式数			発行済株式総数に対する所有株式数の割合	摘要
	氏名又は名称	住所	自己名義	他人名義	計		
	株 株式会社大和証券グループ本社	株 東京都千代田区 大手町2丁目6番4号	株 3,627,000	株 —	株 3,627,000	% 0.27	(注)参照
	計	—	3,627,000	—	3,627,000	0.27	—

- (注) 株主名簿上は当社名義となっているが、実質的に所有していない株式が4,000株あります。なお、当該株式数は上記「発行済株式」の「議決権のある株式数」の「その他」の中に含めております。

(6) ストックオプション制度の内容

当社はストックオプション制度を採用しております。当該制度は商法第210条ノ2第2項の規定に基づき、当社が自己株式を買い付ける方法により、平成10年6月25日における取締役、当社職制規程に定める参与及び9級(部長職相当)、8級(次長職相当)、7級(課長職相当)である職員に対して付与することを、平成10年6月25日の定時株主総会において決議されたものです。当該制度の概要は、次のとおりです。

付与対象者	株式の種類	株式数	譲渡価額	権利行使期間	権利行使についての条件
取締役、参与 (37名)	普通株式	1,800,000株 ただし、1人当たり2万株以上10万株以内	667円 (注)1参照	平成12年7月1日から平成15年6月20日まで	(注)2参照
職員 (2,300名)	普通株式	4,200,000株 ただし、1人当たり1千株以上1万株以内	667円 (注)1参照	平成12年7月1日から平成15年6月20日まで	(注)2参照

当社は上記株主総会決議に基づき授權された6,000,000株のうち、取締役及び参与37名に対し合計1,032,000株、職員2,201名に対し合計4,004,000株、総計5,036,000株を平成11年3月30日に付与致し、当該付与対象者に株式を譲渡するため、平成11年4月1日から平成11年4月14日までに、自己株式5,038,000株の取得を実施いたしました。このうち過誤による買い付け及び譲渡請求権の喪失に伴う保有分67,000株につきましては売却いたしました。また、1,382,000株の権利が行使され、平成13年3月31日現在当社が付与対象者のために保有する自己株式の総数は3,589,000株となっております。

- (注) 1. 東京証券取引所における当社株式普通取引の権利付与前日の終値又は権利付与日の属する月の前月の各日(取引が成立しない日を除く)における終値平均値のいずれか高い方に105%を乗じた金額とする。1円未満の端数は切上げる。
- ただし、権利付与日の終値を下回ることができない。
- 667円は、東京証券取引所における当社株式普通取引の権利付与日(平成11年3月30日)前日の終値に105%を乗じた金額であります。
- なお株式の分割及び時価を下回る価額で新株を発行(転換社債の転換、新株引受権証書による権利行使の場合を含まない)するときは、次の算式により譲渡価額を調整し、調整により生ずる1円未満の端数は切上げる。

$$\text{調整後譲渡価額} = \text{調整前譲渡価額} \times \frac{\text{既発行株式数} + \frac{\text{新規発行株式数} \times 1 \text{株当たり払込金額}}{1 \text{株当たりの時価}}}{\text{既発行株式数} + \text{分割} \cdot \text{新規発行による増加株式数}}$$

2. 権利を与えられた者は、権利を与える契約所定の事由により当社の取締役、参与又は職員たる地位を失った後も、当該契約所定の期間内に所定の条件により、これを行使することができる。
- この他、権利喪失事由、権利を与える契約の変更、その他権利行使の条件は、当該定時株主総会決議及び取締役会決議に基づき、当社と対象取締役、参与、及び職員との間で締結する「株式譲渡請求権付与契約」に定めております。

2. 自己株式の取得等の状況

[取締役又は使用人への譲渡及び利益、資本準備金又は再評価差額金による消却に係る自己株式の取得等の状況]

(1) 前決議期間における自己株式の取得等の状況

イ 取締役又は使用人への譲渡のための取得の状況

該当事項はありません。

ロ 利益、資本準備金又は再評価差額金による消却のための買受けの状況

平成13年6月27日現在

区分		株式数	価額の総額	摘要
定時株主総会での決議状況 (平成 年 月 日決議)		株 —	円 —	(注)参照
取締役会での決議状況	利益による消却 (年 月 日決議)	—	—	
	資本準備金による消却 (年 月 日決議)	—	—	
	再評価差額金による消却 (年 月 日決議)	—	—	
前決議期間における取得自己株式		—	—	
残存授權株式等の総数及び価額の総額		—	—	
未行使割合		% —	% —	

(注) 「株式の消却の手続に関する商法の特例に関する法律」第3条の規定に基づき、平成9年6月27日後において取締役会決議をもって、1億株を限度として株式消却のために当社普通株式を買い受けることができる旨を定款に定めております。

八 取得自己株式の処理状況

該当事項はありません。

(2) 当定時株主総会における自己株式取得に係る決議状況

該当事項はありません。

[資本減少、定款の定めによる利益による消却又は償還株式の消却に係る自己株式の買受け等の状況]

(1) 前決議期間における自己株式の買受け等の状況

該当事項はありません。

(2) 当定時株主総会における自己株式取得に係る決議状況等

該当事項はありません。

3. 配当政策

当社は、(第一部企業情報 第2事業の状況 2.対処すべき課題)で述べました経営方針の下、利益配分を含む株主価値の最大化を持続的に実現することを目指しております。

利益配分にあたっては、「グループ中期経営計画」に沿って、当社グループの事業拡大、財務体質強化に要する資本を確保するとともに、連結業績の動向を踏まえ、安定性にも配慮して配当を実施してまいります。留保した利益を含む株主資本については、「グループ中期経営計画」に沿って適正に配分・管理してまいります。

以上の方針に基づき、当期の配当については、平成13年6月27日の第64回定時株主総会において1株当たり配当金を前期と同額の13円とすることと決議されました。

この結果、当期の配当性向は194.88%となります。

4. 株価の推移

最近5年間の事業年度別最高・最低株価	回次	第60期		第61期		第62期		第63期		第64期	
	決算年月	平成9年3月		平成10年3月		平成11年3月		平成12年3月		平成13年3月	
	最高	1,650 ^円		988		719		2,115		1,950	
	最低	873 ^円		390		281		623		860	
最近6箇月間の月別最高・最低株価	月別	平成12年10月		11月	12月	平成13年1月		2月	3月		
	最高	1,344 ^円		1,405	1,302	1,301		1,224	1,240		
	最低	1,192 ^円		1,133	1,067	1,098		1,028	860		

(注) 株価は、東京証券取引所市場第一部におけるものです。

5. 役員の状況

役名及び職名	氏名 (生年月日)	略歴	所有株式数 千株
取締役社長(CEO) (代表取締役)	原 良 也 (昭和18年4月3日生)	昭和42年4月 入社 平成3年5月 当社事業法人営業副本部長 平成3年6月 当社取締役 平成7年9月 当社常務取締役 平成9年10月 当社取締役社長 〔主要な兼職〕 大和証券株式会社代表取締役社長	51
専務取締役(CFO) (代表取締役) 〔グループ海外事業担当〕	小 森 脩 一 (昭和19年1月1日生)	昭和42年4月 入社 平成3年5月 当社法人副本部長兼企業提携部長兼大阪企業提携部長 平成3年6月 当社取締役 平成6年5月 当社米州本部長 平成8年6月 当社常務取締役 平成10年5月 当社海外業務統括(ロンドン駐在) 平成10年6月 当社専務取締役 平成11年2月 当社海外拠点担当兼海外業務部担当 平成11年4月 当社常務取締役 " 当社海外事業担当 平成12年7月 グループ海外事業担当 平成13年6月 当社専務取締役 〔主要な兼職〕 大和アメリカCorporation会長	56
専務取締役 〔経営企画(経営企画第一部)・IR・広報担当〕	鈴木 茂 晴 (昭和22年4月17日生)	昭和46年4月 入社 平成3年7月 当社引受第一部長 平成9年5月 当社事業法人本部担当 平成9年6月 当社取締役 平成10年5月 当社インベストメント・バンキング本部長 平成10年6月 当社常務取締役 平成11年2月 当社秘書室、人事部、職員相談室、総合企画室、広報部担当 平成11年4月 当社経営企画グループ担当 平成12年7月 経営企画・IR・広報担当 平成13年5月 経営企画(経営企画第一部)・IR・広報担当 平成13年6月 当社専務取締役	6
常務取締役 〔経営企画(経営企画第二部)担当兼事務管理担当〕	福田 憲 一 (昭和21年11月14日生)	昭和45年4月 入社 平成8年5月 当社総合企画室長 平成9年6月 当社取締役 平成10年5月 当社財務・管理本部担当兼財務・管理本部付部長 平成11年2月 当社経理部、資金部、業務部、事務統括部、総務事務部、関連事業部担当兼持株グループ担当付部長 平成11年4月 当社財務・管理グループ担当 平成12年7月 経営企画副担当兼事務管理担当 平成13年5月 経営企画(経営企画第二部)担当兼事務管理担当 平成13年6月 当社常務取締役 〔主要な兼職〕 大和ヨーロッパプロパティplc取締役	20

役名及び職名	氏名 (生年月日)	略歴	所有株式数 千株
取締役(CIO) [IT担当]	高 橋 直 昭 (昭和23年7月17日生)	昭和47年4月 入社 昭和50年8月 大和コンピューターサービス株式会社 (現 株式会社大和総研)へ出向 昭和54年8月 大和コンピューターサービス株式会社 (現 株式会社大和総研)へ転籍 平成8年10月 株式会社大和総研取締役証券システム 開発本部長 平成12年3月 当社執行役員 " IT担当 平成12年6月 当社取締役	15
監査役 (常勤)	川 口 碩 保 (昭和17年1月30日生)	昭和39年4月 入社 平成6年6月 当社取締役 平成9年6月 当社常務取締役 平成11年4月 当社取締役 平成12年6月 当社取締役を退任 " 当社監査役	34
監査役 (常勤)	岸 本 満 季 (昭和17年7月7日生)	昭和40年4月 入社 平成7年6月 当社取締役 平成10年6月 当社常務取締役 平成11年4月 大和証券エスピーキャピタル・マーケ ッツ株式会社常務執行役員 平成13年6月 当社監査役	41
監査役 (非常勤)	川 上 哲 郎 (昭和3年8月3日生)	昭和27年4月 住友電気工業株式会社入社 昭和50年5月 住友電気工業株式会社取締役経理部長 昭和53年6月 住友電気工業株式会社常務取締役 昭和55年6月 住友電気工業株式会社代表取締役専務 取締役 昭和57年6月 住友電気工業株式会社代表取締役社長 平成3年6月 住友電気工業株式会社代表取締役会長 平成10年6月 当社監査役 平成11年6月 住友電気工業株式会社相談役 〔主要な兼職〕 住友電気工業株式会社相談役	4
監査役 (非常勤)	吉 池 正 博 (昭和15年3月23日生)	昭和38年4月 太陽生命保険相互会社入社 平成2年7月 太陽生命保険相互会社取締役有価証券 部長 平成3年4月 太陽生命保険相互会社常務取締役有価 証券部長 平成7年7月 太陽生命保険相互会社代表取締役社長 平成12年6月 当社監査役 〔主要な兼職〕 太陽生命保険相互会社代表取締役社長	—
計	—	—	227

- (注) 1. 監査役川上哲郎及び吉池正博は、株式会社の監査等に関する商法の特例に関する法律第18条第1項に定める「社外監査役」であります。
2. 当社は、意思決定・監督機能と業務執行機能の分離による取締役会の活性化のため、執行役員制度を導入しております。執行役員は、取締役である原良也、小森脩一、鈴木茂晴、福田憲一、高橋直昭が兼務しているほか、財務部長 脇水純一郎、人事部長 高崎準二、米州担当 森郁夫で構成されています。また、グループ企業価値最大化の視点に基づく意思決定・調整機能を強化するため、主要子会社の社長である大和証券エスエムビーシー株式会社代表取締役社長 清田瞭、大和証券投資信託委託株式会社代表取締役社長 秦野輝男、株式会社大和総研代表取締役社長 川上達彦が特別執行役員に就任しております。

第5 経理の状況

1. 連結財務諸表及び財務諸表の作成方法について

(1) 当社は、「連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和51年大蔵省令第28号、以下「連結財務諸表規則」という)並びに同規則第46条及び第68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)に準拠して連結財務諸表を作成しております。

なお、前連結会計年度(平成11年4月1日から平成12年3月31日まで)は、改正前の連結財務諸表規則に基づき、当連結会計年度(平成12年4月1日から平成13年3月31日まで)は、改正後の連結財務諸表規則に基づいております。

(2) 当社は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)に基づいて財務諸表を作成しております。

なお、前事業年度(平成11年4月1日から平成12年3月31日まで)は改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度(平成12年4月1日から平成13年3月31日まで)は、改正後の財務諸表等規則に基づいております。

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、前連結会計年度(平成11年4月1日から平成12年3月31日まで)及び前事業年度(平成11年4月1日から平成12年3月31日まで)並びに当連結会計年度(平成12年4月1日から平成13年3月31日まで)及び当事業年度(平成12年4月1日から平成13年3月31日まで)の連結財務諸表及び財務諸表について、朝日監査法人による監査を受けております。

監査報告書は、連結財務諸表及び財務諸表それぞれの直前に掲げております。

監 査 報 告 書

平成12年 6 月28日

株式会社 大和証券グループ本社

取締役社長 原 良 也 殿

朝 日 監 査 法 人

代表社員
関与社員 公認会計士

伊東健治 

代表社員
関与社員 公認会計士

河合和治 

関与社員 公認会計士

楠原利和 

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（旧社名 大和証券株式会社）の平成11年4月1日から平成12年3月31日までの連結会計年度の連結財務諸表、すなわち、連結貸借対照表、連結損益計算書、連結剰余金計算書、連結キャッシュ・フロー計算書及び連結附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、連結財務諸表について会社の採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、かつ、前連結会計年度と同一の基準に従って継続して適用されており、また、連結財務諸表の表示方法は、「連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和51年大蔵省令第28号）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の連結財務諸表が株式会社 大和証券グループ本社（旧社名 大和証券株式会社）及び連結子会社の平成12年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する連結会計年度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るものと認める。

会社と当監査法人又は関与社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

（注） 会社は、当連結会計年度より連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項又は追加情報の注記に記載の通り、改訂後の連結財務諸表原則及び研究開発費等に係る会計基準が適用されることとなるため、これらの原則及び会計基準により連結財務諸表を作成している。

以 上

監 査 報 告 書

平成13年 6 月27日

株式会社 大和証券グループ本社
取締役社長 原 良 也 殿

朝日監査法人

代表社員
関与社員

公認会計士

伊東 健治 

代表社員
関与社員

公認会計士

河合 新治 

代表社員
関与社員

公認会計士

森 公高 

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12年4月1日から平成13年3月31日までの連結会計年度の連結財務諸表、すなわち、連結貸借対照表、連結損益計算書、連結剰余金計算書、連結キャッシュ・フロー計算書及び連結附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、連結財務諸表について会社の採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、かつ、前連結会計年度と同一の基準に従って継続して適用されており、また、連結財務諸表の表示方法は、「連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和51年大蔵省令第28号)の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の連結財務諸表が株式会社 大和証券グループ本社及び連結子会社の平成13年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する連結会計年度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るものと認める。

会社と当監査法人又は関与社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

(注) 会社は、当連結会計期間より連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項及び追加情報の注記に記載のとおり、退職給付に係る会計基準、金融商品に係る会計基準及び改訂後の外貨建取引等会計処理基準が適用されることとなるため、これらの会計基準により連結財務諸表を作成している。

以 上

1. 連結財務諸表等

(1) 連結財務諸表

連結貸借対照表

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 平成12年 3 月31日現在			当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在		
	金額		構成比	金額		構成比
			%			%
(資産の部)						
流動資産						
現金・預金	3	732,475		399,564		
預け金		8,060		8,975		
受取手形及び売掛金		24,559		16,886		
立替金		23,217		19,003		
募集等払込金		709		1,100		
短期貸付金	3	142,491		409,455		
未収収益		17,797		24,591		
有価証券		65,276		99,032		
営業投資有価証券		44,742		48,564		
投資損失引当金		570		1,107		
トレーディング商品	3	2,859,623		2,829,022		
商品有価証券等		2,736,870		2,513,079		
オプション取引		12,409		43,022		
派生商品評価勘定		110,343		272,920		
その他の棚卸資産	3	24,072		8,016		
信用取引勘定		393,629		228,292		
信用取引貸付金		308,326		88,171		
信用取引借証券担保金		85,302		140,120		
現先取引勘定		24,099		217,451		
借入有価証券担保金		1,368,118		2,512,269		
保管有価証券	3	1,820,905		1,556,172		
繰延税金資産		15,463		8,833		

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 平成12年 3 月31日現在			当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在		
	金額		構成比	金額		構成比
その他流動資産		104,294	%		73,991	%
貸倒引当金		7,827			8,163	
流動資産計		7,661,139	90.0		8,451,951	91.4
固定資産						
有形固定資産	1	324,561			313,905	
建物	3	107,417			101,801	
器具備品		18,158			19,996	
土地	3	198,985			192,108	
無形固定資産		31,869			46,801	
ソフトウェア		18,618			28,982	
借地権	3	11,565			11,531	
電話加入権その他		1,685			6,288	
投資等		472,016			437,564	
投資有価証券	2、3	220,072			227,875	
長期貸付金		26,125			15,782	
長期差入保証金		33,672			32,487	
繰延税金資産		98,074			83,366	
その他投資等	4	284,665			92,442	
貸倒引当金	4	190,593			14,390	
固定資産計		828,447	9.7		798,271	8.6
為替換算調整		24,626	0.3		—	—
資産合計		8,514,213	100.0		9,250,223	100.0

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 平成12年 3月31日現在			当連結会計年度 平成13年 3月31日現在		
	金額		構成比	金額		構成比
(負債の部)			%			%
流動負債						
支払手形及び買掛金		6,090			5,012	
短期借入金 3		783,242			600,028	
コマーシャル・ペーパー		145,600			516,300	
一年以内償還社債		58,245			17,419	
売渡抵当証券		42,823			—	
預り金		148,407			110,335	
約定見返勘定		57,537			13,813	
募集等受入金		7,299			1,823	
トレーディング商品		1,234,298			1,412,369	
商品有価証券等	1,117,439			1,109,527		
オプション取引	10,591			40,049		
派生商品評価勘定	106,267			262,793		
信用取引勘定		53,617			29,771	
貸借取引借入金 3	24,915			14,453		
信用取引貸証券受入金	28,701			15,318		
現先取引勘定		1,123,837			741,938	
貸付有価証券担保金		1,294,650			2,509,282	
短期借入有価証券 3		1,340,903			1,219,710	
受入保証金		84,265			89,282	
受入保証金代用有価証券		485,821			336,461	
未払法人税等		74,429			30,344	
繰延税金負債		—			1,836	
賞与引当金		19,490			18,747	
その他流動負債		81,901			61,037	
流動負債計		7,042,463	82.7		7,715,514	83.4

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 平成12年 3月31日現在			当連結会計年度 平成13年 3月31日現在		
	金額		構成比	金額		構成比
固定負債			%			%
社債		121,013			287,400	
転換社債		135,697			135,695	
長期借入金	3、5	361,557			152,324	
長期借入有価証券		6,000			6,000	
繰延税金負債		—			13,234	
退職給与引当金	6	4,792			—	
退職給付引当金		—			7,522	
役員退職慰労引当金		—			1,889	
厚生年金基金引当金		28,442			28,442	
その他固定負債		5,350			5,300	
固定負債計		662,853	7.8		637,810	6.9
特別法上の準備金	7					
証券取引責任準備金		980			1,974	
金融先物取引責任準備金		0			0	
特別法上の準備金計		980	0.0		1,974	0.0
負債合計		7,706,298	90.5		8,355,299	90.3
少数株主持分		141,843	1.7		178,106	1.9
(資本の部)						
資本金		138,430	1.6		138,431	1.5
資本準備金		117,785	1.4		117,786	1.3
連結剰余金		413,468	4.8		459,994	5.0
評価差額金		—	—		18,984	0.2
為替換算調整勘定		—	—		15,807	0.2
		669,685	7.8		719,389	7.8
自己株式		3,613	0.0		2,572	0.0
資本合計		666,071	7.8		716,817	7.8
負債・少数株主持分・資本合計		8,514,213	100.0		9,250,223	100.0

連結損益計算書

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日			当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日		
	金額		百分比	金額		百分比
営業収益			%			%
受入手数料		364,115			254,704	
委託手数料	147,476			82,880		
引受・売出手数料	34,887			38,858		
募集・売出しの 取扱い手数料	88,203			39,609		
その他	93,548			93,356		
トレーディング損益		117,625			165,637	
営業投資有価証券売買損益		8,199			3,853	
その他の商品売買損益		345			15	
金融収益		103,882			223,992	
その他の売上高		60,481			69,909	
営業収益計		654,650	100.0		718,113	100.0
営業費用						
金融費用		90,523			195,968	
売上原価		49,698			55,330	
販売費・一般管理費		287,498			286,948	
取引関係費	49,203			55,618		
人件費	140,647			140,426		
不動産関係費	40,787			38,662		
事務費	20,873			17,367		
減価償却費	14,780			15,494		
租税公課	7,311			7,553		
貸倒引当金繰入	3,496			2,571		
その他	10,396			9,254		
営業費用計		427,720	65.3		538,247	75.0
営業利益		226,929	34.7		179,866	25.0

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日			当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日		
	金額		百分比	金額		百分比
営業外収益		7,432	1.1		5,926	0.8
持分法による投資利益	—			761		
その他 2	7,432			5,165		
営業外費用		10,240	1.6		7,997	1.1
持分法による投資損失	551			—		
その他 3	9,689			7,997		
経常利益		224,121	34.2		177,795	24.7
特別利益						
固定資産売却益 7	1,983			245		
投資有価証券売却益	13,887			3,960		
関連会社株式売却益	4,014			—		
証券取引責任準備金戻入	779			—		
金融先物取引責任準備金戻入	4			—		
特別利益計		20,669	3.1		4,206	0.6
特別損失						
固定資産評価損 4	2,489			227		
投資有価証券評価減	4,103			3,669		
関係会社株式評価減	—			1,080		
固定資産除売却損 7	8,677			2,996		
投資有価証券売却損	1,145			1,956		
貸付債権売却損	—			1,519		
投資有価証券評価損	1,659			—		
関係会社等再編費用 6	12,418			—		

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日			当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日		
	金額		百分比	金額		百分比
移転関連費用	434		%	—		%
退職金精算損失 5	3,170			—		
厚生年金基金引当金繰入	28,442			—		
貸倒引当金繰入	30,602			2,942		
営業権償却 8	8,000			—		
営業権に係る 控除対象外消費税等	4,359			—		
子会社営業開始関連費用 9	3,134			—		
証券取引責任準備金繰入	980			993		
金融先物取引責任準備金繰入	0			0		
特別損失計		109,618	16.7		15,385	2.1
税金等調整前当期純利益		135,173	20.6		166,616	23.2
法人税等	77,643			48,019		
法人税等調整額	15,272	62,370	9.5	21,829	69,849	9.7
少数株主損失又は利益()		32,572	5.0		32,217	4.5
当期純利益		105,375	16.1		64,550	9.0

連結剰余金計算書

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日		当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日	
	金額		金額	
連結剰余金期首残高		383,671		413,468
連結剰余金増加高		7,503		—
持分法の適用範囲拡大に伴う 剰余金増加高	7,503		—	
連結剰余金減少高		83,081		18,024
連結範囲拡大に伴う 剰余金減少高	76,414		—	
連結子会社の持分変動に伴う 剰余金減少高	—		497	
配当金	6,658		17,246	
取締役賞与金	8		280	
当期純利益		105,375		64,550
連結剰余金期末残高		413,468		459,994

連結キャッシュ・フロー計算書

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
	金額	金額
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前当期純利益	135,173	166,616
減価償却費	14,780	15,494
退職給与引当金の減少額	2,584	—
退職給付引当金の増加額	—	4,253
貸倒引当金の増加額	3,357	1,403
受取利息及び受取配当金	94,572	218,143
支払利息	92,480	207,440
持分法による投資損益	551	761
特別損益項目に係る調整		
固定資産売却益	1,983	245
固定資産除売却損	8,677	2,996
固定資産評価損	2,489	227
関係会社株式評価減	—	1,080
投資有価証券売却益	13,887	3,960
投資有価証券売却損	1,145	1,956
投資有価証券評価減	4,103	3,669
投資有価証券評価損	1,659	—
関連会社株式売却益	4,014	—
関係会社等再編費用	10,552	—
厚生年金基金引当金繰入	28,442	—
貸倒引当金繰入	30,602	2,942
営業権償却	8,000	—
営業権に係る控除対象外消費税等	4,359	—
貸付債権売却損	—	1,519
その他	6,502	993
顧客分別金の増加	143,710	—
顧客分別金の減少	—	149,800
貸付金の増加	—	259,198
貸付金の減少	76,470	—
営業投資有価証券の増加	4,922	—
営業投資有価証券の減少	—	2,559
トレーディング商品(資産)の増加	408,398	—
トレーディング商品(資産)の減少	—	134,805
信用取引勘定(資産)の増加	263,189	—
信用取引勘定(資産)の減少	—	141,490
現先取引 / 担保金(資産)の増加	—	510,205
現先取引 / 担保金(負債)の増加	205,822	—
その他	143,509	2,262
小計	445,603	155,527
利息及び配当金の受取額	91,464	211,216
利息の支払額	93,939	205,945
法人税等の支払額	10,937	90,673
営業活動によるキャッシュ・フロー	459,015	240,930

(単位：百万円)

科目	前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
	金額	金額
投資活動によるキャッシュ・フロー		
有価証券の取得による支出	87,029	129,783
有価証券の売却・償還による収入	68,899	124,439
有形固定資産の取得による支出	14,681	10,408
有形固定資産の売却による収入	9,755	6,297
無形固定資産の取得による支出	9,061	21,242
投資有価証券の取得による支出	30,502	16,218
投資有価証券の売却・償還による収入	205,783	43,758
外部株主からの子会社株式取得による支出	57,824	497
貸付による支出	10,109	517
貸付の回収による収入	39,054	7,908
その他	26,518	1,232
投資活動によるキャッシュ・フロー	140,803	4,968
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入の増加額	121,138	59,441
社債・転換社債の発行による収入	80,000	192,109
社債・転換社債の償還による支出	39,409	67,707
長期借入による収入	69,428	26,000
長期借入の返済による支出	79,398	152,904
少数株主からの払込による株式の発行	162,000	2,145
ストックオプションの行使による収入	—	990
配当金の支払額	6,658	17,246
少数株主への配当金の支払額	233	29
財務活動によるキャッシュ・フロー	306,867	42,797
現金及び現金同等物に係る換算差額	8,839	7,696
現金及び現金同等物の減少額	2,505	185,467
現金及び現金同等物の期首残高	471,500	488,865
連結範囲の変更に伴う 現金及び現金同等物の増加額	22,701	—
連結範囲の変更に伴う 現金及び現金同等物の減少額	2,831	—
現金及び現金同等物の期末残高	488,865	303,398

連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13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 56社 主要な連結子会社名は、「第1 企業の概況 4. 関係会社の状況」に記載しておりますので省略します。 当連結会計年度に設立した3社、及び新たに支配力基準を適用した8社を新たに連結の範囲に加え、清算又は売却等に伴い10社を連結の範囲より除外しました。追加又は除外した主な子会社名は以下のとおりです。 (追加) 大和証券投資信託委託株式会社 日本インベストメント・ファイナンス株式会社 大和ファイナンス株式会社 株式会社大和総研 大和土地建物株式会社 大和ビル管理株式会社 大和住宅サービス株式会社 大和サンコー株式会社 株式会社大和カードサービス 大和SBCM(ケイマン) 大和SBCMファイナンシャル・プロダクツ(ケイマン)・リミテッド (除外) 大和インターナショナル信託銀行株式会社 大和ミドルイーストE.C. 大和ヨーロッパ(スペイン)ソシエダデ バローレスS.A. 大和ヨーロッパ(ポーランド)Sp.z o.o. 他6社 (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(又は売上高)、当期純損益(持分に見合う額)及び剰余金(持分に見合う額)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。 なお、大和インターナショナル信託銀行株式会社は、住友信託銀行株式会社と当社との間で、当社が保有する全株式の譲渡契約の締結について平成12年3月29日に合意したため、連結の対象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 4社 主要な会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社 東京短資株式会社 新たに影響力基準を適用した関連会社3社について、当連結会計年度より持分法を適用しております。追加した会社名は以下のとおりであります。 (新規) 大和住銀投信投資顧問株式会社 東京短資株式会社 大阪証券信用株式会社	1. 連結の範囲に関する事項 (1) 連結子会社の数 52社 主要な連結子会社名は、「第1 企業の概況 4. 関係会社の状況」に記載しておりますので省略します。 大和ファイナンス株式会社と日本インベストメント・ファイナンス株式会社は、平成12年4月1日付で合併し、エヌ・アイ・エフ・ベンチャーズ株式会社と商号を変更いたしました。また、清算により在外連結子会社3社を連結の範囲より除いております。 大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社は、平成13年4月1日付で大和証券エスエムビーシー株式会社と商号を変更いたしました。並びに、SBキャピタル・マーケットの名を冠しておりました傘下の海外現地法人におきましても、SMBCと商号を変更しております。 (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(又は売上高)、当期純損益(持分に見合う額)及び剰余金(持分に見合う額)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。 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 東京短資株式会社

前連結会計年度 自 平成11年 4月 1日 至 平成12年 3月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4月 1日 至 平成13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当期純損益、剰余金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係る財務諸表を使用しております。 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月末日 55社 12月末日 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SBキャピタル・マーケッツ・フィリピン, Inc.)については当該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。なお、新規に連結対象となった株式会社大和総研は、当連結会計年度より決算日を7月31日から3月31日に変更しております。当連結会計年度における当該子会社の会計期間は平成11年8月1日から平成12年3月31日までの8ヶ月となっております。 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 トレーディングに関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特定取引勘定に属する有価証券及び派生商品取引等については、時価法を採用するとともに約定基準で計上し、在外連結子会社のトレーディングに関する有価証券及び派生商品取引等については、主として時価法を採用するとともに約定基準で計上しております。	(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 同左 (4) 同左 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月末日 51社 12月末日 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SBキャピタル・マーケッツ・フィリピン, Inc)については当該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 トレーディングに関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特定取引勘定に属する有価証券及び派生商品取引等については、時価法で計上し、在外連結子会社のトレーディングに関する有価証券及び派生商品取引等については、主として時価法で計上しております。

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
トレーディング関連以外の有価証券、その他の商品の評価基準及び評価方法 主として、上場有価証券については移動平均原価に基づく低価法(洗替え方式)、非上場有価証券及びその他の商品については移動平均原価法を採用しております。 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。	トレーディング関連以外の有価証券、その他の商品の評価基準及び評価方法 特定取引勘定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、一部の国内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。 当連結会計年度より「金融商品に係る会計基準」が適用されることとなりましたが、「証券業における金融商品会計基準適用に関する当面の会計上及び監査上の取扱い」(平成12年7月6日付日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第17号)に基づき、現先取引、有価証券貸借取引等の会計処理については従前どおり「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)の規定によっております。 当該規定と「金融商品に係る会計基準」との差異の概要は以下のとおりであります。 ・現先取引 売現先取引に係る有価証券について、トレーディング商品または保管有価証券からの振替を行っていないこと、及び買現先取引に係る有価証券を連結貸借対照表に計上していないこと。 ・有価証券貸借取引 借入有価証券について、株式は取引発生時の価格、債券は額面により計上していること、貸付有価証券について、トレーディング商品又は保管有価証券からの振替を行っていないこと、並びに保管有価証券をショートポジションの有価証券の引渡しに充当する場合にトレーディング商品(負債)と保管有価証券との相殺を行っていないこと。 なお、当連結会計年度の損益への影響はありません。 同左

前連結会計年度 自 平成11年 4月 1日 至 平成12年 3月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4月 1日 至 平成13年 3月31日
(2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法 有形固定資産 国内連結会社においては、法人税法に規定する方法と同一の基準による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)については法人税法の規定に基づく定額法を採用しております。 在外連結子会社は主として定額法を採用しております。 無形固定資産、投資等 主として、法人税法に規定する方法と同一の基準による定額法によっております。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。また、営業権は全額支出時の費用として処理しております。 繰延資産の処理方法 親会社の社債発行費及び連結子会社の開発費及び新株発行費は、全額支出時の費用として処理しております。 (3) 重要な引当金の計上基準 貸倒引当金 貸付金等の貸倒損失に備えるため、国内連結会社は、法人税法に規定される実績繰入率による繰入限度額及び個別に判定した必要額を計上しております。当連結会計年度より、破産更生債権等に係る貸倒引当金は、連結貸借対照表において債権額と相殺して表示する方法に変更しております。当連結会計年度末の破産更生債権等の金額は116,801百万円であり、当該債権から、担保の処分等により回収可能と見込まれる金額を差し引いた114,855百万円を貸倒引当金として計上しております。なお、前連結会計年度末の債権額3,803百万円は投資等の「その他投資等」に含めており、当該債権に対する貸倒引当金は投資等の「貸倒引当金」に同額計上しております。在外連結子会社は、主として、個別の債権について回収可能性を検討し、貸倒見積額を計上する方法によっております。 投資損失引当金 当連結会計年度より新規に連結対象となった子会社において、期末日現在に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資会社の実情を勘案の上、損失見込額を計上しております。 賞与引当金 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該年度負担分を計上しております。	(2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法 有形固定資産 国内連結会社においては、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。 無形固定資産、投資等 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。 繰延資産の処理方法 社債発行費は、全額支出時の費用として処理しております。 (3) 重要な引当金の計上基準 貸倒引当金 貸付金等の貸倒損失に備えるため、国内連結会社は、一般債権については貸倒実績率法により、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。在外連結子会社は、主として個別の債権については回収可能性を検討し、貸倒見積額を計上しております。 投資損失引当金 一部の連結子会社において、期末日現在に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資会社の実情を勘案の上、損失見込額を計上しております。 賞与引当金 同左

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
退職給与引当金 従業員の退職に伴う退職金の支払いに備えるため、各社の社内規程に基づく当連結会計年度末退職金要支給額を計上しております。一部の会社を除く国内連結子会社は、従来の従業員退職金制度を一旦精算することを決定したため、退職給与引当金は取り崩し、その他流動負債に振り替えております。また役員退職慰労金についても、各社の社内規程に基づく当連結会計年度末要支給額を計上しております。 厚生年金基金引当金 当社及び一部の会社を除く国内連結子会社は総合型基金である日本証券業厚生年金基金に加入しておりますが、将来の年金給付の確保に備えるため、同基金の予測給付債務から年金資産の公正な評価額を控除した額のうち、当社及び一部の国内連結子会社分について合理的な方法で計算した額を計上しております。 同基金は、資産運用環境が低金利の継続等により厳しい状況にあることや加入員数の減少など、基金運営上の課題を近年有することとなりました。当連結会計年度において同基金の予測給付債務から年金資産の公正な評価額を控除した金額のうち、当社及び一部の国内連結子会社部分について合理的な方法で計算したところ、その額に重要性が認められました。このため、年金制度を巡る近年の環境変化という事態に対応し、将来の年金給付の確保に備えるため当該金額相当額を新たに厚生年金基金引当金として計上しております。 (4) 外貨建資産・負債の換算基準 国内連結会社は、「外貨建取引等会計処理基準」(昭和54年6月26日 最終改正 平成7年5月26日企業会計審議会報告)に基づき、在外連結子会社は主として、為替予約のあるものを除き決算日の為替相場により換算しております。	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各事業年度ごとに各人別に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 役員退職慰労引当金 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の要支給額を計上しております。 厚生年金基金引当金 一部の会社を除く国内連結会社は総合型基金である日本証券業厚生年金基金に加入しておりますが、将来の年金給付の確保に備えるため、同基金の予測給付債務から年金資産の公正な評価額を控除した額のうち、その負担分について合理的な方法で計算した額を計上しております。 (4) 外貨建資産・負債の換算基準 外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場によって換算し、換算差額は損益として処理しております。なお、在外子会社等の資産及び負債は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、収益及び費用は期中平均相場により円貨に換算し、換算差額は「資本の部」における為替換算調整勘定に含めております。

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
(5) 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係る方法に準じた会計処理によっております。 (6) その他連結財務諸表作成のための重要な事項 消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税等の会計処理は、税抜き方式によっております。ただし、資産に係る控除対象外消費税等は、発生した連結会計年度の期間費用としております。 5. 連結子会社の資産及び負債の評価に関する事項 連結子会社の資産及び負債の評価については、全面時価評価法を採用しております。 6. 連結調整勘定の償却に関する事項 連結調整勘定については、金額的に重要性がないため、発生した連結会計年度に一括して償却しております。 7. 利益処分項目等の取扱いに関する事項 連結剰余金計算書は、連結会社の利益処分について連結会計年度中に確定した利益処分に基いて作成しております。 8. 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。	(5) 重要なリース取引の処理方法 同左 (6) 重要なヘッジ会計の方法 主として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益又は評価差額をヘッジ対象に係る損益が認識されるまで資産又は負債として繰延べる方法によっております。金利変動リスク及び為替変動リスクのヘッジの一部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。 当社及び連結子会社は、一部の借入金及び発行社債等に係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、ヘッジ手段の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とヘッジ対象の時価又はキャッシュ・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。 (7) その他連結財務諸表作成のための重要な事項 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。 5. 連結子会社の資産及び負債の評価に関する事項 同左 6. 連結調整勘定の償却に関する事項 同左 7. 利益処分項目等の取扱いに関する事項 同左 8. 連結キャッシュ・フロー計算書における資金の範囲 同左

追加情報

前連結会計年度 自 平成11年 4月 1日 至 平成12年 3月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4月 1日 至 平成13年 3月31日
(連結貸借対照表) ソフトウェア(自社利用) 自社利用のソフトウェアについては、「研究開発費及びソフトウェアの会計処理に関する実務指針」(日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第12号 平成11年 3月31日)における経過措置の適用により、従来の会計処理方法を継続して採用しております。ただし、同報告により上記に係るソフトウェアの表示については、当連結会計年度より投資等の「その他投資等」から無形固定資産の「ソフトウェア」に変更し、減価償却の方法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。減価償却方法の変更に伴う利益への影響はありません。なお、期首における投資等の「その他投資等」から無形固定資産の「ソフトウェア」への振替額は9,939百万円であります。	(金融商品会計) 当連結会計年度から金融商品に係る会計基準(「金融商品に係る会計基準の設定に関する意見書」(企業会計審議会 平成11年 1月22日))を適用しております。この変更に伴い、従来の方法によった場合と比較して、経常利益が741百万円減少し、税金等調整前当期純利益が12,923百万円増加しております。 また、期首時点で保有する有価証券の保有目的を検討し、売買目的有価証券及び1年以内に満期の到来する有価証券は流動資産の有価証券として、それら以外のものは投資有価証券として表示しております。期首における流動資産の有価証券から投資有価証券への振替額は26,075百万円であり、投資有価証券から有価証券への振替額は2,557百万円であります。 (退職給付会計) 当連結会計期間から退職給付に係る会計基準(「退職給付に係る会計基準の設定に関する意見書」(企業会計審議会 平成10年 6月16日))を適用しております。 この変更に伴い、従来の方法によった場合と比べ、販売費・一般管理費が213百万円増加し、経常利益及び税金等調整前当期純利益が同額減少しております。 なお、退職給与引当金は退職給付引当金に含めて表示しているほか、従来退職給与引当金に含めていた役員退職慰労引当金は個別に表示しております。 (外貨建取引等会計基準) 当連結会計年度から改訂後の外貨建取引等会計処理基準(「外貨建取引等会計処理基準の改訂に関する意見書」(企業会計審議会 平成11年10月22日))を適用しております。この変更による損益への影響は軽微であります。 また、前連結会計年度において「資産の部」に計上していた為替換算調整勘定は、連結財務諸表規則の改正により、「資本の部」に含めて計上しております。

注記事項

(連結貸借対照表関係)

前連結会計年度 平成12年 3 月31日現在							当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在					
1. 有形固定資産から控除した減価償却累計額は84,045百万円であります。							1. 有形固定資産から控除した減価償却累計額は92,005百万円であります。					
2. 投資有価証券の中には、非連結子会社株式及び関連会社株式が27,619百万円含まれております。							2. 投資有価証券の中には、非連結子会社株式及び関連会社株式が27,402百万円含まれております。					
3. 担保に供されている資産							3. 担保に供されている資産					
(単位：百万円)							(単位：百万円)					
被担保債務	種類	短期借入金	貸借取引借入金	短期借入有価証券	長期借入金	計	被担保債務	種類	短期借入金	短期借入有価証券	長期借入金	計
	期末残高	90,189	24,915	1,576	78,786	195,467		期末残高	40,590	226	36,048	76,864
担保に供されている資産	トレーディング商品	36,984	—	—	—	36,984	担保に供されている資産	トレーディング商品	20,998	—	—	20,998
	その他の棚卸資産	12,713	—	—	—	12,713		その他の棚卸資産	2,934	—	—	2,934
	保管有価証券	25,000	35,127	—	—	60,127		保管有価証券	—	6,360	—	6,360
	建物	651	—	—	40,806	41,458		建物	8,553	—	29,553	38,106
	土地	2,059	—	—	116,098	118,157		土地	231	—	101,856	102,088
	借地権	—	—	—	4,875	4,875		借地権	—	—	4,875	4,875
	投資有価証券	—	16,469	28,526	1,246	46,242		投資有価証券	—	4,484	—	4,484
	計	77,409	51,597	28,526	163,026	320,559		計	32,718	10,845	136,284	179,848
(注) 1. 上記の金額は連結貸借対照表計上額によって おります。							(注) 1. 上記の金額は連結貸借対照表計上額によって おります。					
2. 上記のほか先物取引証拠金等の代用として、 トレーディング商品3,976百万円及び投資有 価証券52,492百万円を差し入れております。							2. 上記のほか先物取引証拠金等の代用として、 トレーディング商品57,858百万円及び投資有 価証券41,496百万円を差し入れております。					
3. スワップ取引等の担保として、短期貸付金 5,030百万円及び保管有価証券4,200百万円を 差入れております。							3. スワップ取引等の担保として、現金17,554百 万円及び保管有価証券7,000百万円を差入れ ております。					
4. また、短期借入金の物上保証として、預金 208百万円、建物9,679百万円及び土地231百 万円を差し入れており、長期借入金の物上保 証として土地9,347百万円を差し入れており ます。												
4. 貸倒引当金114,855百万円は、債権額と相殺して 表示しております。							4. 貸倒引当金22,334百万円は、債権額と相殺して表 示しております。					
5. 長期借入金には「証券会社の自己資本規制に関す る命令」(平成11年総理府令・大蔵省令第28号)第 2条に定める劣後特約付借入金が40,000百万円含 まれております。							5. 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 に定める下記の劣後特約付借入金が40,000百万円 含まれております。					
6. 役員退職慰労引当金1,536百万円を含めておりま す。												
7. 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項は 以下の通りであります。 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82条							7. 同左					

前連結会計年度 平成12年3月31日現在			当連結会計年度 平成13年3月31日現在		
8. 保証債務			8. 保証債務		
被保証人	被保証債務の内容	金額(百万円)	被保証人	被保証債務の内容	金額(百万円)
株式会社不二エース	借入金	1,339	従業員	借入金	6,487
その他	買掛金・借入金等	231	その他	買掛金・借入金等	286
合計		1,571	合計		6,773
(注) その他には、新台幣ドル建(30,000千新台幣ドル)及びスイスフラン建(747千スイスフラン)の保証債務を含んでおります。			(注) その他には、新台幣ドル建(30,000千新台幣ドル)の保証債務を含んでおります。		

(連結損益計算書関係)

前連結会計年度 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日																																																			
1. 人件費の中には、賞与引当金繰入額16,797百万円、退職給与引当金繰入額4,119百万円が含まれております。 2. 営業外収益の「その他」には、国内連結会社の受取利息803百万円、受取配当金656百万円及び有価証券売却益455百万円を含めております。 3. 営業外費用の「その他」には、国内連結子会社の支払利息6,348百万円を含めております。 4. 固定資産評価損は、ゴルフ会員権の評価替えを行ったことにより発生した損失であります。 5. 一部を除く国内連結子会社において、従来の退職金規程による自己都合退職に伴う期末要支給額を計上しておりました退職給与引当金を取り崩し、会社都合に基づく乗率により算定された額をもって従業員退職金制度を一旦精算することといたしました。これに伴う会社必要支払額と退職給与引当金との差額を「退職金精算損失」として計上しております。 6. 関係会社等再編費用は、関係会社の清算に伴い発生した損失等であります。 7. (1) 固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。<table><tr><td>建物</td><td>1,380百万円</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>45</td></tr><tr><td>土地</td><td>405</td></tr><tr><td>その他投資等 (ゴルフ会員権等)</td><td>151</td></tr></table>(2) 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。売却損は()に内書きしております。<table><tr><td>建物</td><td>4,111</td><td>(3,835)百万円</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>1,433</td><td>(312)</td></tr><tr><td>土地</td><td>1,166</td><td>(1,166)</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>969</td><td>(—)</td></tr><tr><td>その他投資等 (ゴルフ会員権等)</td><td>996</td><td>(996)</td></tr></table> 8. 営業権償却は、国内連結子会社が証券業の営業開始に伴い取得した営業権のうち、当企業集団以外から取得した営業権を一括して償却したものであります。 9. 子会社営業開始関連費用は、国内連結子会社が証券営業を開始するにあたり、開発費及び新株発行費を一括して償却したものであります。	建物	1,380百万円	器具備品	45	土地	405	その他投資等 (ゴルフ会員権等)	151	建物	4,111	(3,835)百万円	器具備品	1,433	(312)	土地	1,166	(1,166)	ソフトウェア	969	(—)	その他投資等 (ゴルフ会員権等)	996	(996)	1. 人件費の中には、賞与引当金繰入額17,336百万円、役員退職慰労引当金繰入額616百万円が含まれております。 2. 営業外収益の「その他」には、国内連結子会社の受取利息338百万円、受取配当金563百万円を含めております。 3. 営業外費用の「その他」には、国内連結子会社の支払利息6,130百万円を含めております。 4. 同左 7. (1) 固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。<table><tr><td>建物</td><td>2百万円</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>33</td></tr><tr><td>土地</td><td>167</td></tr><tr><td>借地権</td><td>0</td></tr><tr><td>その他投資等 (ゴルフ会員権等)</td><td>42</td></tr></table>(2) 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。売却損は()に内書きしております。<table><tr><td>建物</td><td>1,051</td><td>(705)百万円</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>242</td><td>(1)</td></tr><tr><td>土地</td><td>1,568</td><td>(1,568)</td></tr><tr><td>ソフトウェア</td><td>3</td><td>(—)</td></tr><tr><td>電話加入権その他</td><td>0</td><td>(—)</td></tr><tr><td>その他投資等 (ゴルフ会員権等)</td><td>131</td><td>(131)</td></tr></table>	建物	2百万円	器具備品	33	土地	167	借地権	0	その他投資等 (ゴルフ会員権等)	42	建物	1,051	(705)百万円	器具備品	242	(1)	土地	1,568	(1,568)	ソフトウェア	3	(—)	電話加入権その他	0	(—)	その他投資等 (ゴルフ会員権等)	131	(131)
建物	1,380百万円																																																			
器具備品	45																																																			
土地	405																																																			
その他投資等 (ゴルフ会員権等)	151																																																			
建物	4,111	(3,835)百万円																																																		
器具備品	1,433	(312)																																																		
土地	1,166	(1,166)																																																		
ソフトウェア	969	(—)																																																		
その他投資等 (ゴルフ会員権等)	996	(996)																																																		
建物	2百万円																																																			
器具備品	33																																																			
土地	167																																																			
借地権	0																																																			
その他投資等 (ゴルフ会員権等)	42																																																			
建物	1,051	(705)百万円																																																		
器具備品	242	(1)																																																		
土地	1,568	(1,568)																																																		
ソフトウェア	3	(—)																																																		
電話加入権その他	0	(—)																																																		
その他投資等 (ゴルフ会員権等)	131	(131)																																																		

(連結キャッシュ・フロー計算書関係)

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日																																						
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) <table> <tr> <td>現金・預金勘定</td><td>732,475</td></tr> <tr> <td>顧客分別金</td><td>235,300</td></tr> <tr> <td>預入期間が3ヶ月を超える定期預金</td><td>8,309</td></tr> <tr> <td>現金及び現金同等物</td><td>488,865</td></tr> </table> 2. 支配力基準を適用したことにより新たに連結子会社となった8社の資産及び負債の主な内訳 <table> <tr> <td>流動資産</td><td>310,526百万円</td></tr> <tr> <td>固定資産</td><td>385,510</td></tr> <tr> <td>流動負債</td><td>(420,746)</td></tr> <tr> <td>固定負債</td><td>(280,459)</td></tr> <tr> <td>少数株主持分</td><td>(71,245)</td></tr> </table> 3. 重要な非資金取引の内容 転換社債の転換 (単位：百万円) <table> <tr> <td>転換社債の転換による 資本金の増加額</td><td>5</td></tr> <tr> <td>転換社債の転換による 資本準備金の増加額</td><td>5</td></tr> <tr> <td>転換による転換社債の減少額</td><td>11</td></tr> </table>	現金・預金勘定	732,475	顧客分別金	235,300	預入期間が3ヶ月を超える定期預金	8,309	現金及び現金同等物	488,865	流動資産	310,526百万円	固定資産	385,510	流動負債	(420,746)	固定負債	(280,459)	少数株主持分	(71,245)	転換社債の転換による 資本金の増加額	5	転換社債の転換による 資本準備金の増加額	5	転換による転換社債の減少額	11	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) <table> <tr> <td>現金・預金勘定</td><td>399,564</td></tr> <tr> <td>顧客分別金</td><td>85,500</td></tr> <tr> <td>預入期間が3ヶ月を超える定期預金</td><td>10,665</td></tr> <tr> <td>現金及び現金同等物</td><td>303,398</td></tr> </table> 2. 重要な非資金取引の内容 転換社債の転換 (単位：百万円) <table> <tr> <td>転換社債の転換による 資本金の増加額</td><td>0</td></tr> <tr> <td>転換社債の転換による 資本準備金の増加額</td><td>0</td></tr> <tr> <td>転換による転換社債の減少額</td><td>2</td></tr> </table>	現金・預金勘定	399,564	顧客分別金	85,500	預入期間が3ヶ月を超える定期預金	10,665	現金及び現金同等物	303,398	転換社債の転換による 資本金の増加額	0	転換社債の転換による 資本準備金の増加額	0	転換による転換社債の減少額	2
現金・預金勘定	732,475																																						
顧客分別金	235,300																																						
預入期間が3ヶ月を超える定期預金	8,309																																						
現金及び現金同等物	488,865																																						
流動資産	310,526百万円																																						
固定資産	385,510																																						
流動負債	(420,746)																																						
固定負債	(280,459)																																						
少数株主持分	(71,245)																																						
転換社債の転換による 資本金の増加額	5																																						
転換社債の転換による 資本準備金の増加額	5																																						
転換による転換社債の減少額	11																																						
現金・預金勘定	399,564																																						
顧客分別金	85,500																																						
預入期間が3ヶ月を超える定期預金	10,665																																						
現金及び現金同等物	303,398																																						
転換社債の転換による 資本金の増加額	0																																						
転換社債の転換による 資本準備金の増加額	0																																						
転換による転換社債の減少額	2																																						

(リース取引関係)

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13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期末残高相当額 <table> <tr> <td></td><td>器具備品等</td></tr> <tr> <td>取得価額相当額</td><td>29,451百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td><td>16,774</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>12,676</td></tr> </table> 未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1年内</td><td>4,881百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>8,623</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>13,505</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>6,046百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>5,279百万円</td></tr> <tr> <td>支払利息相当額</td><td>358百万円</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。 借手側 <table> <tr> <td>未経過リース料</td><td></td></tr> <tr> <td>1年内</td><td>1,582百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>13,591</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>15,173</td></tr> </table>		器具備品等	取得価額相当額	29,451百万円	減価償却累計額相当額	16,774	期末残高相当額	12,676	1年内	4,881百万円	1年超	8,623	合計	13,505	支払リース料	6,046百万円	減価償却費相当額	5,279百万円	支払利息相当額	358百万円	未経過リース料		1年内	1,582百万円	1年超	13,591	合計	15,173	< 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></td><td>器具備品等</td></tr> <tr> <td>取得価額相当額</td><td>21,906百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td><td>12,886</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>9,019</td></tr> </table> 未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1年内</td><td>4,010百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>5,324</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>9,335</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>4,928百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>4,595百万円</td></tr> <tr> <td>支払利息相当額</td><td>294百万円</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。 借手側 <table> <tr> <td>未経過リース料</td><td></td></tr> <tr> <td>1年内</td><td>2,018百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>12,922</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>14,940</td></tr> </table>		器具備品等	取得価額相当額	21,906百万円	減価償却累計額相当額	12,886	期末残高相当額	9,019	1年内	4,010百万円	1年超	5,324	合計	9,335	支払リース料	4,928百万円	減価償却費相当額	4,595百万円	支払利息相当額	294百万円	未経過リース料		1年内	2,018百万円	1年超	12,922	合計	14,940
	器具備品等																																																								
取得価額相当額	29,451百万円																																																								
減価償却累計額相当額	16,774																																																								
期末残高相当額	12,676																																																								
1年内	4,881百万円																																																								
1年超	8,623																																																								
合計	13,505																																																								
支払リース料	6,046百万円																																																								
減価償却費相当額	5,279百万円																																																								
支払利息相当額	358百万円																																																								
未経過リース料																																																									
1年内	1,582百万円																																																								
1年超	13,591																																																								
合計	15,173																																																								
	器具備品等																																																								
取得価額相当額	21,906百万円																																																								
減価償却累計額相当額	12,886																																																								
期末残高相当額	9,019																																																								
1年内	4,010百万円																																																								
1年超	5,324																																																								
合計	9,335																																																								
支払リース料	4,928百万円																																																								
減価償却費相当額	4,595百万円																																																								
支払利息相当額	294百万円																																																								
未経過リース料																																																									
1年内	2,018百万円																																																								
1年超	12,922																																																								
合計	14,940																																																								

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日																																																
<貸手側> 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、減価償却累計額及び期末残高 <table> <tr> <td></td><td>器具備品等</td></tr> <tr> <td>取得価額</td><td>299百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額</td><td>152</td></tr> <tr> <td>期末残高</td><td>147</td></tr> </table> 未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1年内</td><td>57百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>111</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>169</td></tr> </table> 受取リース料、減価償却費及び受取利息相当額 <table> <tr> <td>受取リース料</td><td>78百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却費</td><td>55</td></tr> <tr> <td>受取利息相当額</td><td>11</td></tr> </table> 利息相当額の算定方法 リース料総額と見積残存価額の合計額からリース物件の購入価額を控除した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。 貸手側 <table> <tr> <td>未経過リース料</td><td></td></tr> <tr> <td>1年内</td><td>8百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>—</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>8</td></tr> </table>		器具備品等	取得価額	299百万円	減価償却累計額	152	期末残高	147	1年内	57百万円	1年超	111	合計	169	受取リース料	78百万円	減価償却費	55	受取利息相当額	11	未経過リース料		1年内	8百万円	1年超	—	合計	8	<貸手側> 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、減価償却累計額及び期末残高 <table> <tr> <td></td><td>器具備品等</td></tr> <tr> <td>取得価額</td><td>327百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額</td><td>207</td></tr> <tr> <td>期末残高</td><td>120</td></tr> </table> 未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1年内</td><td>89百万円</td></tr> <tr> <td>1年超</td><td>63</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>152</td></tr> </table> 受取リース料、減価償却費及び受取利息相当額 <table> <tr> <td>受取リース料</td><td>68百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却費</td><td>52</td></tr> <tr> <td>受取利息相当額</td><td>9</td></tr> </table> 利息相当額の算定方法 リース料総額と見積残存価額の合計額からリース物件の購入価額を控除した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。 _____		器具備品等	取得価額	327百万円	減価償却累計額	207	期末残高	120	1年内	89百万円	1年超	63	合計	152	受取リース料	68百万円	減価償却費	52	受取利息相当額	9
	器具備品等																																																
取得価額	299百万円																																																
減価償却累計額	152																																																
期末残高	147																																																
1年内	57百万円																																																
1年超	111																																																
合計	169																																																
受取リース料	78百万円																																																
減価償却費	55																																																
受取利息相当額	11																																																
未経過リース料																																																	
1年内	8百万円																																																
1年超	—																																																
合計	8																																																
	器具備品等																																																
取得価額	327百万円																																																
減価償却累計額	207																																																
期末残高	120																																																
1年内	89百万円																																																
1年超	63																																																
合計	152																																																
受取リース料	68百万円																																																
減価償却費	52																																																
受取利息相当額	9																																																

(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

前連結会計年度 自 平成11年 4月 1日 至 平成12年 3月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4月 1日 至 平成13年 3月31日
(1) 取引の内容 当企業集団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・ポジションは顧客の資金運用やリスク・ヘッジなどのニーズに対応するために行っている顧客との取引、及び、金融自由化による競争が激しさを増すなかで自己の計算において行っている取引(ディーリング業務)から発生しております。トレーディングにおいて取扱っている商品を大別しますと、株式・債券・その他の商品有価証券等の現物取引、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、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)の3種類であります。 また、当企業集団ではトレーディング以外にグループの資産・負債に係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) 取引に対する取組方針 トレーディング業務を行う証券会社では、有価証券市場における公正な価格形成及び円滑な流通を目的としてトレーディングを行っております。また、トレーディング以外に主に金利スワップ及び通貨スワップをヘッジ目的で利用しております。 (3) 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、従来からの現物市場に新たにデリバティブ市場を加えた両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持つ金融資産・負債に対する価格変動リスク、為替リスク、金利変動リスク等のヘッジ手段や新たな運用手段を提供することが出来るため、顧客の様々な金融ニーズに対応するための現物商品と同様不可欠な商品となっております。例としては、顧客の保有する外国債券の為替リスクのヘッジのための先物外国為替取引の提供や、顧客の発行社債の金利リスクのヘッジのための金利スワップの提供等がありますが、この他にも顧客の要望に応じ様々な形で金融派生商品を提供しております。最終利用者としては、当企業集団の資産・負債に関わる金利リスクのヘッジのための金利スワップの利用や、トレーディング・ポジションのヘッジのための各種先物取引、オプション取引等の利用があります。	(1) 取引の内容 同左 (2) 取引に対する取組方針 同左 (3) 取引の利用目的 同左

前連結会計年度 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日
(4) 取引に係るリスクの内容 トレーディングにおける現物取引の商品やデリバティブの取扱いに内在する様々なリスクのうち、主要なものは市場リスクと信用リスクであります。市場リスクとは、株式・債券・金利や為替などの市場の価格・金利変動により保有する金融資産の価値が変動した結果、損益の変化を伴うことを指します。信用リスクとは、取引の相手方が契約を履行できない結果、損失を被る可能性にさらされることであります。当企業集団のなかでデリバティブの取引を積極的に行っております大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社では、トレーディングにおけるリスク把握はリスクの計量化による方法を採用しております。市場リスクにつきましては、商品毎の保有残高・損益を把握することに加え、これを補完するためにバリュー・アット・リスク方式による計測を採用しております。一方、信用リスクにつきましては、取引先毎に付与した内部格付けによって当該取引先の信用力を勘案し、元本(想定元本)及び与信相当額によってその金額を把握しています。 トレーディング以外の取引についても、基本的にはトレーディングと同様のリスクが生じますが、市場リスクについては原資産に発生する市場リスクとの間でリスクは相殺されています。 (5) リスク管理体制 従来の証券業務においては規制緩和が急速に進む中で新たなリスクの発生が、また業際を超えた新規業務が展開される中ではとりわけデリバティブの取扱いによる商品の多様化とリスクの発生が、証券会社に対して適切なリスク管理体制の構築を不可欠なものにしております。当企業集団ではこうした時代背景を踏まえ、経営方針の重要な柱の一つとしてリスク管理を位置づけております。	(4) 取引に係るリスクの内容 同左 (5) リスク管理体制 従来の証券業務においては規制緩和が急速に進む中で新たなリスクの発生が、また業際を超えた新規業務が展開される中ではとりわけデリバティブの取扱いによる商品の多様化とリスクの発生が、証券会社に対して適切なリスク管理体制の構築を不可欠なものにしております。当企業集団ではこうした時代背景を踏まえ、経営方針の重要な柱の一つとしてリスク管理を位置づけております。

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
当企業集団のなかでデリバティブ取引を積極的に行っております大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社では、経営の積極的な関与、牽制機能の働く組織体制、リスク・リミット設定による経営の健全性確保、緊急時を想定したリスク管理、リスク管理プロセスの透明化、の5つをリスク管理の基本に据えております。は、経営者の参加するリスクマネジメント会議での各種方針の決定や、経営者向けの日常のリスク状況の報告、特に市場リスクに係るリスク量は日次ベースで経営者が把握できるようにしております。は、営業部門、商品部門とは独立したリスク管理の専門部署の設置を通じて達成しております。では、信用リスク、市場リスクに対して様々な切り口による限度額を設定しており、その遵守状況を監視すると同時にバリュエーション・リスクによる市場リスク額も算出しております。信用リスクに関する取引限度額は、スワップ取引をはじめとするデリバティブの場合は当該取引を再構築するためのコスト(再構築コスト)に加え将来の当該コストの予想上昇分を加えた与信相当額をベースに設定しております。また、信用リスクを軽減するためにネットینگ契約の締結、担保の徴求を必要に応じ行っております。では、大きな市場変動を想定したストレス・テストの実施を行っております。最後にでは、リスク管理のルール・手続きを文書化することを通じて、透明性を確保しております。 また、海外現地法人のリスク管理につきましては、現地の管理体制整備を一層進める一方、平成11年10月に現地法人の多くを株式会社大和証券グループ本社から大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社傘下へ移管したことにあわせてリスク管理ルールを見直し、大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社のもとでより一元的な管理体制を構築しております。株式会社大和証券グループ本社では、大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社及びその他の子会社から報告を受け、経営会議に報告する体制をとっております。 トレーディング以外の取引の市場リスクについてはヘッジ対象に発生する市場リスクとの間でリスクは相殺されています。また、信用リスクについては、取引相手先を信用度の高い相手先とすることでリスクを限定しております。	当企業集団のなかでデリバティブの取引を積極的に行っております大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社では、経営の積極的な関与、牽制機能の働く組織体制、リスク・リミット設定による経営の健全性確保、緊急時を想定したリスク管理、リスク管理プロセスの透明化、の5つをリスク管理の基本に据えております。は、経営者の参加するリスクマネジメント会議での各種方針の決定や、経営者向けの日常のリスク状況の報告、特に市場リスクに係るリスク量は日次ベースで経営者が把握できるようにしております。は、営業部門、商品部門とは独立したリスク管理の専門部署の設置を通じて達成しております。では、信用リスク、市場リスクに対して様々な切り口による限度額を設定しており、その遵守状況を監視すると同時にバリュエーション・リスクによる市場リスク額も算出しております。信用リスクに関する取引限度額は、スワップ取引をはじめとするデリバティブの場合は当該取引を再構築するためのコスト(再構築コスト)に加え将来の当該コストの予想上昇分を加えた与信相当額をベースに設定しております。また、信用リスクを軽減するためにネットینگ契約の締結、担保の徴求を必要に応じ行っております。では、大きな市場変動を想定したストレス・テストの実施を行っております。最後にでは、リスク管理のルール・手続きを文書化することを通じて、透明性を確保しております。 また、株式会社大和証券グループ本社では、大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社およびその他の子会社から報告を受け、経営会議に報告する体制をとっております。 トレーディング以外の取引の市場リスクについてはヘッジ対象に発生する市場リスクとの間でリスクは相殺されています。また、信用リスクについては、取引相手先を信用度の高い相手先とすることでリスクを限定しております。

2. 有価証券及びデリバティブ取引

(1) トレーディングに係るもの

前連結会計年度

有価証券の時価等

(単位：百万円)

種類	前連結会計年度 平成12年 3 月31日現在	
	買い持ち	売り持ち
株券・ワラント	251,865	84,662
債券	2,239,354	1,032,656
CP及びCD	210,397	—
受益証券	9,764	—
その他	25,489	120

デリバティブ取引

(単位：百万円)

種類	前連結会計年度 平成12年 3 月31日現在			
	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	586,228	12,409	580,960	10,591
為替予約取引	139,347	648	163,599	751
先物・先渡取引	521,876	1,624	487,502	8,043
スワップ取引	7,063,437	108,070	6,261,998	97,472

(注) トレーディングに係る取引については、連結貸借対照表日現在の時価並びにみなし決済損益を連結貸借対照表に計上しておりますので、評価損益を記載しておりません。時価の算定方法は以下のとおりです。

居住者が本邦において発行した上場有価証券	主たる証券取引所の最終値段(最終気配値段を含む)
店頭売買有価証券	日本証券業協会が定める基準価格
外国株券	主たる証券取引所の最終値段またはそれに準ずる価格
外国で発行された新株引受権証券	日本相互証券で取引されているものは同社の仲値、それ以外のものについては、主たる外国証券取引所の最終値段またはそれに準ずる価格
非上場証券投資 信託受益証券	基準価格
株価指数先物取引	各証券取引所が定める清算指数
株券オプション取引、 株価指数オプション取引	各証券取引所が定める証拠金算定基準値段
国債証券	原則として同残存年限の上場国債の時価を基準として日本証券業協会が公表する公社債基準気配および業者間気配を参考に算出した価格
国債証券以外の円建債券	原則として同残存年限の国債の時価、スワップレートを基準に発行体のクレジット、流動性を考慮し、日本証券業協会が公表する公社債基準気配および業者間気配を参考に算出した価格
外貨建債券	ブローカースクリーン等を参考に算出した価格、または、各国国債の時価、スワップレート、為替レート、発行体の格付等を勘案して算出した価格
債券先物取引	各証券取引所が定める清算値段

金利先物取引	各金融先物取引所が定める清算値段
債券オプション取引	各証券取引所が定める証拠金算定基準値段
金利オプション取引	各金融先物取引所が定める清算価格
選択権付債券売買取引	原証券の時価、ボラティリティ、金利等を基準として業者間気配を参考に算出した価格
金利先渡取引、金利スワップ取引	金利、ボラティリティ等を基に全ての予想キャッシュフローを計算し、現在の価値に割り引いた額
為替予約取引	各通貨のキャッシュフローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額
通貨スワップ取引	将来授受されるキャッシュフローを各通貨毎の短期金利、スワップレートを基に現在価値に割り引いた額

当連結会計年度

商品有価証券等(売買目的有価証券)

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年3月31日現在	
	資産	負債
株券・ワラント	347,569	93,339
債券	2,102,607	1,016,188
CP及びCD	34,146	—
受益証券	2,231	—
その他	26,524	—
当連結会計年度の損益に含まれた 評価差額	388	3,184

デリバティブ取引

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年3月31日現在			
	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	2,329,235	43,022	2,218,205	40,049
為替予約取引	303,887	2,712	332,548	2,720
先物・先渡取引	1,195,001	6,112	688,673	5,608
スワップ取引	13,204,507	264,066	13,522,355	254,454
その他	4,700	29	4,111	9

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引	各証券取引所が定める清算指数
株券オプション取引、 株価指数オプション取引	各証券取引所が定める証拠金算定基準値段
債券先物取引	各証券取引所が定める清算値段
金利先物取引	各金融先物取引所が定める清算値段

債券オプション取引	各証券取引所が定める証拠金算定基準値段
金利オプション取引	各金融先物取引所が定める清算価格
選択権付債券売買取引	原証券の時価、ボラティリティ、金利等を基準として業者間気配を参考に算出した価格
金利先渡取引、金利スワップ取引	金利、ボラティリティ等を基に全ての予想キャッシュフローを計算し、現在の価値に割り引いた額
為替予約取引	各通貨のキャッシュフローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額
通貨スワップ取引	将来授受されるキャッシュフローを各通貨毎の短期金利、スワップレートを基に現在価値に割り引いた額

(2) トレーディングに係るもの以外

前連結会計年度

有価証券の時価等

(単位：百万円)

種類	前連結会計年度 平成12年3月31日現在		
	連結貸借対照表計上額	時価	評価損益
流動資産	40,373	66,719	26,345
株券	15,707	41,786	26,078
債券	—	—	—
その他	24,666	24,933	267
固定資産	149,179	220,295	71,116
株券	119,492	190,052	70,560
債券	21,850	21,874	24
その他	7,836	8,368	531
合計	189,553	287,014	97,461

(注) 1. 時価の算定方法

居住者が本邦において発行した上場有価証券	主たる証券取引所における最終値段(最終気配値段を含む)
店頭売買有価証券	日本証券業協会が定める基準価格
外国株券	主たる証券取引所の最終値段またはそれに準ずる価格
国債証券	原則として同残存年限の上場国債の時価を基準として日本証券業協会が公表する公社債基準気配および業者間気配を参考に算出した価格
国債証券以外の円建債券	原則として同残存年限の国債の時価、スワップレートを基準に発行体のクレジット、流動性を考慮し、日本証券業協会が公表する公社債基準気配および業者間気配を参考に算出した価格
外貨建債券	ブローカースクリーン等を参考に算出した価格、または、各国債の時価、スワップレート、為替レート、発行体の格付等を勘案して算出した価格
非上場証券投資 信託受益証券	基準価格

2. 開示の対象から除いた有価証券の連結貸借対照表計上額

流動資産	非上場株式(店頭売買株式を除く)	26,171百万円
	非上場債券	4,272百万円
	受益証券	39,200百万円
固定資産	非上場株式(店頭売買株式を除く)	65,808百万円
	受益証券	38百万円
	外国投信受益証券	418百万円
	出資証券	4,628百万円

デリバティブ取引

(単位：百万円)

種類	前連結会計年度 平成12年3月31日現在		
	契約額等	時価	評価損益
金利スワップ取引	94,067	2,457	2,328
通貨スワップ取引	8,106	1,399	1,328

- (注) 1. 主として、長期借入金の支払利息に係る為替変動リスク及び金利変動リスクをヘッジするために利用しております。
2. 時価の算定方法 将来授受されるキャッシュフローを各通貨毎の短期金利、スワップレートを基に現在価値に割り引いた額
3. 評価損益は、当期末に計上した未収収益・未払費用を控除して算出しております。
4. 「外貨建取引等会計処理基準」により外貨建金銭債権債務等に振り当てたデリバティブ取引については、注記の対象から除いております。

当連結会計年度

満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年3月31日現在		
	連結貸借対照表計上額	時価	差額
時価が連結貸借対照表計上額を超えるもの	1,566	1,581	15
国債・地方債等	1,566	1,581	15
社債	—	—	—
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額を超えないもの	453	449	3
国債・地方債等	453	449	3
社債	—	—	—
その他	—	—	—

その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年 3月31日現在		
	取得原価	連結貸借対照表計上額	差額
連結貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	65,651	119,238	53,586
株券	56,378	109,438	53,060
債券	296	312	15
国債・地方債等	9	9	0
社債	287	302	14
その他	—	—	—
その他	8,976	9,487	510
連結貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	92,320	73,400	18,919
株券	78,443	63,895	14,547
債券	70	66	4
国債・地方債等	—	—	—
社債	70	66	4
その他	—	—	—
その他	13,806	9,437	4,368

当連結会計年度中に売却したその他有価証券(平成12年 4月 1日より平成13年 3月31日)

(単位：百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
42,317	11,178	5,320

時価のない主な有価証券の内容及び連結貸借対照表計上額

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在	
	連結貸借対照表計上額	
満期保有目的の債券	—	
国債・地方債等	—	
社債	—	
その他	—	
その他有価証券	153,409	
株券	43,822	
債券	9,708	
その他	99,879	

その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の今後の償還予定額

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在			
	1 年以内	1 年超 5 年以内	5 年超10年以内	10年超
債券				
国債・地方債等	1,255	773	—	—
社債	2,650	7,322	49	—
その他	—	—	—	—
その他	44,346	—	—	—
合計	48,253	8,095	49	—

デリバティブ取引

(単位：百万円)

種類	当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在		
	契約額等	時価	評価損益
通貨スワップ取引	85	0	0
為替予約取引	342	0	0

(注) 1. 時価の算定方法

通貨スワップ取引

将来授受されるキャッシュフローを各通貨毎の短期金利、スワップレートを基に現在価値に割り引いた額

為替予約取引

各通貨のキャッシュフローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額

2. ヘッジ会計を適用しているものは除いております。

(税効果会計関係)

前連結会計年度 平成12年 3 月31日現在		当連結会計年度 平成13年 3 月31日現在	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	(百万円)	繰延税金資産	(百万円)
営業権償却損金算入限度超過額	69,972	繰越欠損金	71,909
繰越欠損金	62,337	営業権償却損金算入限度超過額	52,585
厚生年金基金引当金繰入	11,194	厚生年金基金引当金繰入	12,127
その他	34,584	その他	36,228
繰延税金資産小計	178,087	繰延税金資産小計	172,850
評価性引当額	62,594	評価性引当額	78,840
繰延税金資産合計	115,493	繰延税金資産合計	94,009
繰延税金負債	1,954	繰延税金負債	
繰延税金資産の純額	113,538	評価差額金等	16,879
		繰延税金負債合計	16,879
		繰延税金資産の純額	77,129
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異は、法定実効税率の100分の5以下であったため省略いたしました。	
法定実効税率	42.1%		
(調整)			
評価性引当額	11.5%		
永久に損金に算入されない項目	1.6%		
永久に益金に算入されない項目	1.7%		
外国子会社との税率差異	2.0%		
その他	5.3%		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.1%		

(退職給付関係)

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日																																
	1. 採用している退職給付制度の概要 当社及び国内連結子会社は、一時払いの退職金制度を設けているほか、総合設立の厚生年金基金に加入しております。また、一部の国内連結会社は年金受給権者のみを対象とする閉鎖型適格退職年金制度を有しております。 一部の在外連結子会社は、確定拠出型の制度を設けております。 2. 退職給付債務に関する事項(平成13年3月31日現在) (百万円) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>16,635</td></tr> <tr> <td>年金資産</td><td>8,273</td></tr> <tr> <td>未積立退職給付債務(+)</td><td>8,361</td></tr> <tr> <td>未認識数理計算上の差異</td><td>838</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金(+)</td><td>7,522</td></tr> </table> (注) 1. 一部の国内連結子会社は、退職給付債務の算定に当たり簡便法を採用しております。 2. 上記のほか、総合設立の厚生年金基金に係る年金資産のうち、当社及び国内連結子会社の掛金拠出割合に基づく当連結会計年度末の年金資産残高は61,025百万円であります。 3. 退職給付費用に関する事項 (自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日) (百万円) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>5,099</td></tr> <tr> <td>利息費用</td><td>289</td></tr> <tr> <td>期待運用収益</td><td>285</td></tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td><td>209</td></tr> <tr> <td>小計(+ + +)</td><td>5,312</td></tr> <tr> <td>厚生年金基金掛金額</td><td>2,080</td></tr> <tr> <td>退職給付費用(+ + + +)</td><td>7,392</td></tr> </table> (注) 1. 簡便法を採用している連結子会社の退職給付費用は、「勤務費用」に計上しております。 2. 厚生年金基金に対する従業員拠出額を控除しております。 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 (平成13年3月31日現在) <table> <tr> <td>退職給付見込額の 期間配分方法</td><td>期間定額基準</td></tr> <tr> <td>割引率</td><td>1.5～3.0%</td></tr> <tr> <td>期待運用収益率</td><td>1.5～3.0%</td></tr> <tr> <td>数理計算上の差異の 処理年数</td><td>5年(定額法により発生 年度から費用処理して おります。)</td></tr> </table>	退職給付債務	16,635	年金資産	8,273	未積立退職給付債務(+)	8,361	未認識数理計算上の差異	838	退職給付引当金(+)	7,522	勤務費用	5,099	利息費用	289	期待運用収益	285	数理計算上の差異の費用処理額	209	小計(+ + +)	5,312	厚生年金基金掛金額	2,080	退職給付費用(+ + + +)	7,392	退職給付見込額の 期間配分方法	期間定額基準	割引率	1.5～3.0%	期待運用収益率	1.5～3.0%	数理計算上の差異の 処理年数	5年(定額法により発生 年度から費用処理して おります。)
退職給付債務	16,635																																
年金資産	8,273																																
未積立退職給付債務(+)	8,361																																
未認識数理計算上の差異	838																																
退職給付引当金(+)	7,522																																
勤務費用	5,099																																
利息費用	289																																
期待運用収益	285																																
数理計算上の差異の費用処理額	209																																
小計(+ + +)	5,312																																
厚生年金基金掛金額	2,080																																
退職給付費用(+ + + +)	7,392																																
退職給付見込額の 期間配分方法	期間定額基準																																
割引率	1.5～3.0%																																
期待運用収益率	1.5～3.0%																																
数理計算上の差異の 処理年数	5年(定額法により発生 年度から費用処理して おります。)																																

(セグメント情報)

前連結会計年度 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	当連結会計年度 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日																																																																																																																																																
(イ)事業の種類別セグメント情報 当企業集団は、有価証券の売買等、有価証券の 売買等の委託の媒介、有価証券の引受及び売出し、 有価証券の募集及び売出しの取扱い、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。	(イ)事業の種類別セグメント情報 同左																																																																																																																																																
(ロ)所在地別セグメント情報 所在地別の営業収益、営業費用及び営業利益並びに 資産は次のとおりであります。	(ロ)所在地別セグメント情報 所在地別の営業収益、営業費用及び営業利益並びに 資産は次のとおりであります。																																																																																																																																																
(単位：百万円)	(単位：百万円)																																																																																																																																																
<table><tr><th></th><th>日本</th><th>米州</th><th>欧州</th><th>アジア ・オセ アニア</th><th>計</th><th>消去又は 全社</th><th>連結</th></tr><tr><td>営業収益及び営業損益</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>営業収益</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>外部顧客 からの営 業収益</td><td>528,090</td><td>85,359</td><td>31,968</td><td>9,231</td><td>654,650</td><td>—</td><td>654,650</td></tr><tr><td>セグメン ト間の内 部収益</td><td>17,703</td><td>(516)</td><td>(1,960)</td><td>(454)</td><td>14,772</td><td>(14,772)</td><td>—</td></tr><tr><td>計</td><td>545,793</td><td>84,842</td><td>30,008</td><td>8,777</td><td>669,422</td><td>(14,772)</td><td>654,650</td></tr><tr><td>営業費用</td><td>325,440</td><td>82,304</td><td>23,877</td><td>7,226</td><td>438,849</td><td>(11,129)</td><td>427,720</td></tr><tr><td>営業利益</td><td>220,352</td><td>2,538</td><td>6,131</td><td>1,550</td><td>230,572</td><td>(3,642)</td><td>226,929</td></tr><tr><td>資産</td><td>7,807,068</td><td>709,836</td><td>339,697</td><td>57,809</td><td>8,914,412</td><td>(400,199)</td><td>8,514,213</td></tr></table>		日本	米州	欧州	アジア ・オセ アニア	計	消去又は 全社	連結	営業収益及び営業損益								営業収益								外部顧客 からの営 業収益	528,090	85,359	31,968	9,231	654,650	—	654,650	セグメン ト間の内 部収益	17,703	(516)	(1,960)	(454)	14,772	(14,772)	—	計	545,793	84,842	30,008	8,777	669,422	(14,772)	654,650	営業費用	325,440	82,304	23,877	7,226	438,849	(11,129)	427,720	営業利益	220,352	2,538	6,131	1,550	230,572	(3,642)	226,929	資産	7,807,068	709,836	339,697	57,809	8,914,412	(400,199)	8,514,213	<table><tr><th></th><th>日本</th><th>米州</th><th>欧州</th><th>アジア ・オセ アニア</th><th>計</th><th>消去又は 全社</th><th>連結</th></tr><tr><td>営業収益及び営業損益</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>営業収益</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>外部顧客 からの営 業収益</td><td>488,513</td><td>198,305</td><td>23,643</td><td>7,651</td><td>718,113</td><td>—</td><td>718,113</td></tr><tr><td>セグメン ト間の内 部収益</td><td>15,528</td><td>(370)</td><td>138</td><td>116</td><td>15,414</td><td>(15,414)</td><td>—</td></tr><tr><td>計</td><td>504,041</td><td>197,935</td><td>23,782</td><td>7,768</td><td>733,527</td><td>(15,414)</td><td>718,113</td></tr><tr><td>営業費用</td><td>330,499</td><td>186,779</td><td>18,989</td><td>6,702</td><td>542,972</td><td>(4,724)</td><td>538,247</td></tr><tr><td>営業利益</td><td>173,542</td><td>11,155</td><td>4,792</td><td>1,065</td><td>190,555</td><td>(10,689)</td><td>179,866</td></tr><tr><td>資産</td><td>7,104,228</td><td>1,817,111</td><td>572,243</td><td>76,507</td><td>9,570,091</td><td>(319,867)</td><td>9,250,223</td></tr></table>		日本	米州	欧州	アジア ・オセ アニア	計	消去又は 全社	連結	営業収益及び営業損益								営業収益								外部顧客 からの営 業収益	488,513	198,305	23,643	7,651	718,113	—	718,113	セグメン ト間の内 部収益	15,528	(370)	138	116	15,414	(15,414)	—	計	504,041	197,935	23,782	7,768	733,527	(15,414)	718,113	営業費用	330,499	186,779	18,989	6,702	542,972	(4,724)	538,247	営業利益	173,542	11,155	4,792	1,065	190,555	(10,689)	179,866	資産	7,104,228	1,817,111	572,243	76,507	9,570,091	(319,867)	9,250,223
	日本	米州	欧州	アジア ・オセ アニア	計	消去又は 全社	連結																																																																																																																																										
営業収益及び営業損益																																																																																																																																																	
営業収益																																																																																																																																																	
外部顧客 からの営 業収益	528,090	85,359	31,968	9,231	654,650	—	654,650																																																																																																																																										
セグメン ト間の内 部収益	17,703	(516)	(1,960)	(454)	14,772	(14,772)	—																																																																																																																																										
計	545,793	84,842	30,008	8,777	669,422	(14,772)	654,650																																																																																																																																										
営業費用	325,440	82,304	23,877	7,226	438,849	(11,129)	427,720																																																																																																																																										
営業利益	220,352	2,538	6,131	1,550	230,572	(3,642)	226,929																																																																																																																																										
資産	7,807,068	709,836	339,697	57,809	8,914,412	(400,199)	8,514,213																																																																																																																																										
	日本	米州	欧州	アジア ・オセ アニア	計	消去又は 全社	連結																																																																																																																																										
営業収益及び営業損益																																																																																																																																																	
営業収益																																																																																																																																																	
外部顧客 からの営 業収益	488,513	198,305	23,643	7,651	718,113	—	718,113																																																																																																																																										
セグメン ト間の内 部収益	15,528	(370)	138	116	15,414	(15,414)	—																																																																																																																																										
計	504,041	197,935	23,782	7,768	733,527	(15,414)	718,113																																																																																																																																										
営業費用	330,499	186,779	18,989	6,702	542,972	(4,724)	538,247																																																																																																																																										
営業利益	173,542	11,155	4,792	1,065	190,555	(10,689)	179,866																																																																																																																																										
資産	7,104,228	1,817,111	572,243	76,507	9,570,091	(319,867)	9,250,223																																																																																																																																										
(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	(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為替換算調整で、25,982百万円であります。	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。																																																																																																																																																
	3. 当連結会計期間により、(追加情報)に記載のとおり、「金融商品に係る会計基準」を適用しております。この結果、従来の方法によった場合と比較して、日本の営業収益、日本の営業費用、日本の営業利益が、それぞれ100百万円減少、641百万円増加、741百万円減少しております。また、日本、消去又は全社の資産がそれぞれ26,355百万円増加、506百万円増加しております。																																																																																																																																																

前連結会計年度 自 平成11年 4月 1日 至 平成12年 3月31日					当連結会計年度 自 平成12年 4月 1日 至 平成13年 3月31日				
(ハ)海外売上高(営業収益)					(ハ)海外売上高(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 営業収益(連結会社間の内部収益を除く)は以下のと おりであります。					当社及び連結子会社の本邦以外の国又は地域からの 営業収益(連結会社間の内部収益を除く)は以下のと おりであります。				
	(単位：百万円)					(単位：百万円)			
	米州	欧州	アジア ・オセ アニア	計		米州	欧州	アジア ・オセ アニア	計
海外売上高 (営業収益)	79,516	23,668	10,529	113,713	海外売上高 (営業収益)	188,739	22,045	7,631	218,416
連結営業収益				654,650	連結営業収益				718,113
連結営業収益 に占める海外 売上高の割合	12.1%	3.6%	1.6%	17.4%	連結営業収益 に占める海外 売上高の割合	26.3%	3.1%	1.1%	30.4%
(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					(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					(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。					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					(2) 各区分に属する主な国又は地域				
.....米州：アメリカ					米州：アメリカ				
欧州：イギリス、ドイツ、スイス、フラ ンス					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					アジア・オセアニア：香港、シンガポー ル				

(関連当事者との取引)

前連結会計年度(自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日)

1. 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

2. 役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

3. 子会社等

該当事項はありません。

4. 兄弟会社等

該当事項はありません。

当連結会計年度(自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日)

1. 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

2. 役員及び個人主要株主等

属性	会社等の 名称	住所	資本金又は 出資金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有(被 所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事実上 の関係				
役員	古池正博	—	—	当社監査役 (太陽生命保 険相互会社 代表取締役 社長)	なし	—	—	資金の貸付	—	長期貸付金	5,000
								貸付に伴う利息の 受取り	134	未収利息	53
								資金の借入	10,000	短期借入金	5,000
								借入に伴う利息の 支払い	393	長期借入金 未払利息	20,000 118

(注) 上記の取引は、監査役が第三者のためにする会社との間の取引であります。なお、利率等は、一般的取引条件によっております。

3. 子会社等

該当事項はありません。

4. 兄弟会社等

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日		当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日	
1株当たり純資産額	502.05円	1株当たり純資産額	539.72円
1株当たり当期純利益	79.43円	1株当たり当期純利益	48.62円
潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額	76.19円	潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額	46.26円

(重要な後発事象)

前連結会計年度 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日		当連結会計年度 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日	
<u>株式会社大和証券グループ本社の発行登録及び債券発行について</u> 株式会社大和証券グループ本社は、平成12年5月31日に発行登録(発行予定期間 平成12年6月8日から2年間、発行予定額2,000億円)を行い、平成12年6月8日開催の取締役会の決議に基づき、以下の社債を発行しております。 (1) 銘柄 : 株式会社大和証券グループ本社第1回無担保社債 (2) 発行登録追補書類提出日: 平成12年6月14日 (3) 発行年月日: 平成12年6月26日 (4) 発行総額 : 100,000百万円 (5) 発行価格 : 額面100円につき金100円 (6) 利率 : 年1.40% (7) 償還の方法: 償還金額は、額面100円につき金100円とし、本社債の元金は、償還期限にその総額を償還する。 (8) 償還期限 : 平成17年6月24日 (9) 資金の用途: 社債発行差引手取概算額99,508百万円は、転換社債償還資金に38,662百万円、借入金返済に14,000百万円及び子会社投融資に46,846百万円を充当する予定であります。 <u>大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社のユーロ・ミディアム・ターム・ノート・プログラムの設定及び債券発行について</u> 大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社は、平成12年4月24日開催の取締役会においてユーロ・ミディアム・ターム・ノート・プログラム(社債累積発行限度額: 2,000億円、設定日: 平成12年5月15日)に基づき、平成12年6月30日までの社債発行限度額を500億円(発行年限10年以下)とする社債発行に関する包括決議を行い、総額135億円、7銘柄の円貨建普通社債を発行しております。また、平成12年6月19日開催の取締役会において、上記プログラムに基づく平成12年9月30日までの社債発行限度額を1,000億円(発行年限10年以下)とする社債発行に関する包括決議を行いました。		該当事項はありません。	

連結附属明細表

a. 社債明細表

(単位：百万円)

会社名	銘柄	発行年月日	前期末残高	当期末残高	利率	担保	償還期限	摘要
* 1	第 1 回普通社債	平成12. 6 .26	—	100,000	1.40 %	無し	平成17. 6 .24	
* 1	第 7 回転換社債	昭和62. 8 .27	19,440	19,440	1.50	無し	平成14. 9 .30	
* 1	第11回転換社債	昭和63. 8 .31	36,269	36,269	1.40	無し	平成15. 8 .29	
* 1	第12回転換社債	昭和63. 8 .31	38,662	—	1.40	無し	平成12. 8 .31	償還
* 1	第16回転換社債	平成11. 9 .16	79,988	79,986	0.50	無し	平成18. 9 .29	
* 1	第 1 回新株引受権付社債	平成12. 8 .24	—	8,400	1.37	無し	平成16. 8 .24	
* 2	普通社債(ユーロ円)	平成12年～13年	—	77,600 (4,400)	0.39～ 7.00	無し	平成13年～25年	
* 3	普通社債(ユーロ円)	平成 9 . 2 .27	80,000	80,000	2.00	無し	平成14. 4 .16	
* 4	普通社債(ユーロ円)	平成 7 年～10年	60,597	38,545 (12,999)	0.00～ 5.15	無し	平成13年～20年	
* 5	その他の社債	平成12年	—	274 (19)	—	無し	平成13年～14年	
合計	—	—	314,956	440,514 (17,419)	—	—	—	—

(注) 1. * 1 当社についての記載であります。

* 2 大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社が発行した社債残高の集約となっております。

* 3 大和土地建物株式会社についての記載であります。

* 4 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及び大和ヨーロッパファイナンスB.V.が発行した社債残高の集約となっております。

* 5 大和SBCMフィナンシャル・プロダクツ(ケイマン)・リミテッドが発行した社債残高の集約となっております。

2. 1年内償還予定の金額は、当期末残高欄の()に内書きしております。

3. 転換社債に関する記載は次のとおりであります。

銘柄	転換請求期間	転換価格 (円/株)	発行株式	資本組入額 (円/株)
第 7 回転換社債	昭和62.10. 1～平成14. 9 .27	3,035.90	普通株式	1,518
第11回転換社債	昭和63.10. 1～平成15. 8 .28	2,367.00	普通株式	1,184
第16回転換社債	平成11.11. 1～平成18. 9 .28	1,094.00	普通株式	547

4. 新株引受権付社債に関する記載は次のとおりであります。

銘柄	新株引受権行使期間	発行価格 (円/株)	発行価額の総額	発行株式	付与割合
第 1 回新株引受権付社債	平成14. 9 . 2～ 平成16. 8 .23	1,345.00	8,360百万円	普通株式	99.53%

なお、新株引受権は、本社債と分離して譲渡することができます。

また、新株引受権行使により発行した株式はありません。

5. 連結決算日後 5 年以内における償還予定額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

1 年以内	1 年超 2 年以内	2 年超 3 年以内	3 年超 4 年以内	4 年超 5 年以内
17,419	107,488	40,217	9,900	107,300

b . 借入金等明細表

(単位：百万円)

区分	前期末残高	当期末残高	平均利率	返済期限
短期借入金	783,242	600,028	1.26%	—
長期借入金(1年以内に返済予定のものを除く)	361,557	152,324	2.06%	平成14年～20年
その他の有利子負債				
コマーシャル・ペーパー (1年内返済)	145,600	516,300	0.43%	—
貸借取引借入金(1年内返済)	24,915	14,453	0.88%	—
売渡抵当証券(1年内返済)	42,823	—	—	—
長期借入有価証券(1年超)	6,000	6,000	3.95%	平成14年～15年
合計	1,364,139	1,289,106	—	—

(注) 1. 「平均利率」については、期末借入残高に対する加重平均利率を記載しております。

2. 長期借入金及びその他の有利子負債(1年以内に返済予定のものを除く)の連結決算日後5年以内における返済予定額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

	1年超2年以内	2年超3年以内	3年超4年以内	4年超5年以内
長期借入金	23,821	74,227	45,173	5,000
その他の有利子負債 (長期借入有価証券)	6,000	—	—	—

(2) その他

該当事項はありません。

監 査 報 告 書

平成12年 6 月28日

株式会社 大和証券グループ本社
取締役社長 原 良 也 殿

朝 日 監 査 法 人

代表社員
関与社員

公認会計士

伊東健治 

代表社員
関与社員

公認会計士

河島和治 

関与社員

公認会計士

楠原利和 

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（旧社名 大和証券株式会社）の平成11年4月1日から平成12年3月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、利益処分計算書及び附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、会社の採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、かつ、前事業年度と同一の基準に従って継続して適用されており、また、財務諸表の表示方法は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の財務諸表が株式会社 大和証券グループ本社（旧社名 大和証券株式会社）の平成12年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は関与社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

（注） 会社は、当事業年度より追加情報の注記に記載のとおり、研究開発費等に係る会計基準が適用されることとなるため、当該会計基準により財務諸表を作成している。

以 上

監 査 報 告 書

平成13年 6 月27日

株式会社 大和証券グループ本社
取締役社長 原 良 也 殿

朝日監査法人

代表社員
関与社員

公認会計士

伊東健治



代表社員
関与社員

公認会計士

河合新治



代表社員
関与社員

公認会計士

森 公 高



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12年4月1日から平成13年3月31日までの第64期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、利益処分計算書及び附属明細表について監査を行った。

この監査に当たって、当監査法人は、一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠し、通常実施すべき監査手続を実施した。

監査の結果、会社の採用する会計処理の原則及び手続は、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠し、かつ、前事業年度と同一の基準に従って継続して適用されており、また、財務諸表の表示方法は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)の定めるところに準拠しているものと認められた。

よって、当監査法人は、上記の財務諸表が株式会社 大和証券グループ本社の平成13年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は関与社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

(注) 会社は、当事業年度より重要な会計方針又は追加情報の注記に記載のとおり、退職給付に係る会計基準、金融商品に係る会計基準及び改訂後の外貨建取引等会計処理基準が適用されることとなるため、これらの会計基準により財務諸表を作成している。

以 上

2. 財務諸表等

(1) 財務諸表

貸借対照表

(単位：百万円)

科目	第63期 平成12年 3月31日現在			第64期 平成13年 3月31日現在		
	金額		構成比	金額		構成比
(資産の部)			%			%
流動資産						
現金・預金		194,301			82,542	
預け金		374			374	
立替金		1,071			502	
短期貸付金	1	355,640			264,620	
前払金		45			62	
前払費用		1,997			1,912	
未収入金	1	9,329			16,933	
未収収益		5,119			2,921	
自己株式		90			46	
有価証券		—			30,000	
その他流動資産		7,091			2,246	
貸倒引当金		2,891			2,878	
流動資産計		572,168	38.2		399,284	30.2
固定資産						
有形固定資産	2	11,282			10,733	
建物		903			832	
器具備品		3,464			3,005	
土地		6,913			6,895	
無形固定資産		1,415			1,425	
ソフトウェア		387			394	
電話加入権		745			745	
その他		282			285	
投資その他の資産		913,484			909,654	
投資有価証券	3、4	148,450			153,580	
関係会社株式	4	580,707			582,186	
長期貸付金		5,050			5,019	
関係会社長期貸付金		99,200			93,600	
長期差入保証金	1	62,737			60,014	
長期前払費用		562			345	
自己株式		3,522			2,526	
その他	5	14,066			13,360	
貸倒引当金	5	812			978	
固定資産計		926,182	61.8		921,813	69.8
資産合計		1,498,350	100.0		1,321,097	100.0

(単位：百万円)

科目	第63期 平成12年 3 月31日現在			第64期 平成13年 3 月31日現在		
	金額		構成比	金額		構成比
(負債の部)			%			%
流動負債						
短期借入金		222,460			133,410	
一年以内償還社債		38,662			—	
預り金		545			315	
前受収益		1,268			1,272	
未払金		10,268			424	
未払費用		3,593			1,629	
貸付有価証券担保金	1	83,320			55,084	
未払法人税等		21			14	
賞与引当金		700			490	
新株引受権		—			501	
流動負債計		360,838	24.1		193,143	14.6
固定負債						
社債		—			108,400	
転換社債		135,697			135,695	
長期借入金		203,000			65,000	
長期受入保証金	1	50,982			48,854	
繰延税金負債		—			12,708	
退職給与引当金	7	1,000			—	
退職給付引当金		—			724	
役員退職慰労引当金		—			720	
厚生年金基金引当金		2,200			2,200	
その他固定負債		15			15	
固定負債計		392,894	26.2		374,317	28.4
負債合計		753,733	50.3		567,461	43.0
(資本の部)						
資本金	9	138,430	9.2		138,431	10.5
資本準備金		117,785	7.9		117,786	8.9
利益準備金	10	45,335	3.0		45,335	3.4
その他の剰余金						
任意積立金		317,000			417,000	
別途積立金		317,000			417,000	
当期末処分利益		126,065			17,568	
その他の剰余金計		443,065	29.6		434,568	32.9
その他有価証券評価差額金	11	—	—		17,514	1.3
資本計		744,617	49.7		753,635	57.0
負債・資本合計		1,498,350	100.0		1,321,097	100.0

損益計算書

(単位：百万円)

科目		第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日		第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日	
		金額	百分比	金額	百分比
営業収益	1		%		%
関係会社配当金		20		12,255	
関係会社貸付金利息		5,141		5,275	
商標使用料収入	2	12,914		8,947	
受入手数料		17,711		—	
委託手数料		8,244		—	
引受・売出手数料		341		—	
募集・売出しの取扱い 手数料		6,143		—	
その他		2,982		—	
トレーディング損益	3	1,874		—	
その他の商品売買損益		0		—	
金融収益	4	3,621		3,430	
営業収益計		41,283	100.0	29,909	100.0
営業費用	1				
販売費及び一般管理費		21,951		9,720	
取引関係費	5	3,037		1,619	
人件費	6	8,832		3,616	
不動産関係費	7	3,216		841	
事務費	8	2,743		1,300	
減価償却費		1,021		812	
租税公課	9	577		632	
貸倒引当金繰入		1,302		—	
その他	10	1,219		896	
金融費用	11	9,263		7,148	
営業費用計		31,214	75.6	16,868	56.4
営業利益		10,068	24.4	13,041	43.6
営業外収益					
有価証券売却益		452		—	
その他		595		244	
		1,047	2.5	244	0.8
営業外費用					
社債発行費	12	1,809		534	
その他		891		332	
		2,701	6.5	866	2.9
経常利益		8,414	20.4	12,419	41.5
特別利益					
営業権譲渡益	13	200,000		—	
固定資産売却益	14	2,224		42	
投資有価証券売却益		10,171		2,734	
子会社株式売却益	15	5,111		—	
証券取引責任準備金戻入	16	779		—	
金融先物取引責任準備金戻入	16	4		—	
特別利益計		218,291	528.8	2,776	9.3
特別損失					
固定資産評価損	17	1,264		129	
投資有価証券評価減		2,706		3,512	
関係会社株式評価減		—		77	
固定資産除売却損	14	1,128		230	
子会社支援損失	18	3,600		—	

(単位：百万円)

科目	第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日			第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日		
	金額		百分比	金額		百分比
投資有価証券売却損	884		%	1,589		%
投資有価証券評価損	1,448			—		
関係会社等再編費用	4,941			—		
厚生年金基金引当金繰入	2,200			—		
貸倒引当金繰入	1,641			781		
特別損失計		19,815	48.0		6,322	21.1
税引前当期純利益		206,891	501.2		8,873	29.7
法人税、住民税及び事業税	21			14		
法人税等調整額	81,800	81,821	198.2	—	14	0.0
当期純利益		125,070	303.0		8,859	29.7
前期繰越利益		995			8,708	
当期末処分利益		126,065			17,568	

利益処分計算書

(単位：百万円)

株主総会承認年月日	第63期 平成12年 6 月28日		第64期 平成13年 6 月27日	
科目	金額		金額	
当期末処分利益		126,065		17,568
利益処分額				
配当金 (注)	17,246		17,265	
取締役賞与金	110		135	
別途積立金	100,000	117,356	—	17,400
次期繰越利益		8,708		167

(注) 第63期 現金配当 1株につき13円
第64期 現金配当 1株につき13円

重要な会計方針

第63期 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	第64期 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法 上場有価証券については移動平均原価に基づく低 価法(洗替え方式)、非上場有価証券については移 動平均原価法を採用しております。 2. 固定資産の減価償却の方法 有形固定資産 法人税法に規定する方法と同一の基準による定 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、法人税法の規定に基づく定額法を 採用しております。 無形固定資産、投資その他の資産 法人税法に基づく定額法を採用しております。 ただし、自社利用のソフトウェアについては、 社内における見込利用可能期間(5年)に基づく 定額法によっております。 3. 繰延資産の処理方法 社債発行費は、発生した事業年度に一括して償 却しております。 4. 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、法人税法に 規定される実績繰入率による繰入限度額及び個 別に判定した必要額を計上しております。当期 より、破産更生債権等に係る貸倒引当金は、貸 借対照表において債権額と相殺して表示する方 法に変更しております。当期末の破産更生債権 等の金額は3,129百万円であり、当該債権に対 し貸倒引当金を同額計上しております。なお、 前期の債権額1,898百万円は投資その他の資産 の「その他」に含めており、当該債権に対する 貸倒引当金は投資その他の資産の「貸倒引当 金」に同額計上しております。 (2) 賞与引当金 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を計上して おります。 (3) 退職給与引当金 従業員の退職に伴う退職金の支払に備えるた め、当社の退職金規程に基づく期末退職金要 支給額を計上しております。平成11年4月の持株 会社体制への移行に伴い、従来の従業員退職金 制度を一旦精算し、適格退職年金については閉 鎖型適格退職年金に移行しております。 また、役員退職慰労金については当社の役員退 職慰労金規程に基づく期末要支給額を計上し ております。	1. 有価証券の評価基準及び評価方法 (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基 づき算定)、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。 2. 固定資産の減価償却の方法 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。 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、ソフトウェアの 耐用年数については、社内における利用可能 期間としております。 3. 繰延資産の処理方法 同左 4. 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。破産更生債権等 に係る貸倒引当金は、貸借対照表において 債権額と相殺して表示しております。当期末 の破産更生債権等の金額は2,071百万円であ り、当該債権に対し貸倒引当金を同額計上し ております。 (2) 賞与引当金 同左 (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 金規程に基づく期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各事業年度ごとに各 人別に勤務費用が確定するためです。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、当期末における退職 給付債務及び年金資産の見込額に基づき、 当期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。

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日
(4) 厚生年金基金引当金 当社は総合型基金である日本証券業厚生年金基金に加入しておりますが、将来の年金給付の確保に備えるため、同基金の予測給付債務から年金資産の公正な評価額を控除した額のうち、当社部分について合理的な方法で計算した額を計上しております。 同基金は、資産運用環境が低金利の継続等により厳しい状況にあることや加入員数の減少など、基金運営上の課題を近年有することとなりました。当期において同基金の予測給付債務から年金資産の公正な評価額を控除した額のうち、当社部分について合理的な方法で計算したところ、その額に重要性が認められました。このため、年金制度を巡る近年の環境変化という事態に対応し、将来の年金給付の確保に備えるため当該金額相当額を新たに厚生年金基金引当金として計上しております。 (適格退職年金に関する注記) 当社は、平成11年 4 月の持株会社体制移行時に、従来の退職金制度を廃止・精算いたしました。これに伴い、適格退職年金は年金受給権者のみを対象とする閉鎖型適格退職年金へ移行し、過去勤務費用については償却が完了しております。なお、当期末現在における年金資産の残高は7,396百万円となっております。 5. 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係る方法に準じた会計処理によっております。 6. 消費税及び地方消費税の会計処理方法 税抜き方式によっております。	(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当期末要支給額を計上しております。 (5) 厚生年金基金引当金 当社は総合型基金である日本証券業厚生年金基金に加入しておりますが、将来の年金給付の確保に備えるため、同基金の予測給付債務から年金資産の公正な評価額を控除した額のうち、その負担分について合理的な方法で計算した額を計上しております。 5. 外貨建資産・負債の換算基準 外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場によって換算し、換算差額は損益として処理しております。 6. リース取引の処理方法 同左 7. 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、一部の借入金等に係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。 8. 消費税及び地方消費税の会計処理方法 同左

追加情報

第63期 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	第64期 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
(貸借対照表) ソフトウェア(自社利用) 自社利用のソフトウェアについては、「研究開発費及びソフトウェアの会計処理に関する実務指針」(日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第12号 平成11年3月31日)の経過措置の適用により、従来の会計処理方法を継続しております。ただし、同報告により上記に係るソフトウェアの表示については、当期より投資その他の資産の「長期前払費用」から無形固定資産の「ソフトウェア」に変更し、減価償却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。減価償却方法の変更による利益への影響はありません。なお、期首における投資その他の資産の「長期前払費用」から無形固定資産の「ソフトウェア」への振替額は9,197百万円であります。	(金融商品会計) 当期から金融商品に係る会計基準(「金融商品に係る会計基準の設定に関する意見書」(企業会計審議会 平成11年1月22日))を適用しております。この結果、従来の方法によった場合と比較して、経常利益が440百万円減少し、税引前当期純利益が12,222百万円増加しております。 (退職給付会計) 当期から退職給付に係る会計基準(「退職給付に係る会計基準の設定に関する意見書」(企業会計審議会 平成10年6月16日))を適用しております。この結果、従来の方法によった場合と比較して、販売費及び一般管理費が193百万円増加し、経常利益及び税引前当期純利益が同額減少しております。 なお、退職給与引当金は退職給付引当金に含めて表示しているほか、従来退職給与引当金に含めていた役員退職慰労引当金は個別に表示しております。 (外貨建取引等会計基準) 当期から改訂後の外貨建取引等処理基準(「外貨建取引等会計処理基準の改訂に関する意見書」(企業会計審議会 平成11年10月22日))を適用しております。この変更による損益への影響は軽微であります。

表示方法の変更

第63期 自 平成11年4月1日 至 平成12年3月31日	第64期 自 平成12年4月1日 至 平成13年3月31日
(損益計算書) 当社は当期のうち4月25日までは証券業を営んでおりましたが、4月26日に営業譲渡し、同日以降は持株会社となりました。当社は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)に基づいて、財務諸表を作成しております。 関係会社からの受取配当金、貸付金利息については、前期までは「金融収益」に含めておりましたが、持株会社の業態に即して当期より「関係会社配当金」、「関係会社貸付金利息」として区分掲記しております。 なお、前期における「金融収益」に含まれている「関係会社配当金」及び「関係会社貸付金利息」の金額はそれぞれ2,846百万円、261百万円であります。	

注記事項

(貸借対照表関係)

第63期 平成12年 3 月31日現在	第64期 平成13年 3 月31日現在
1. 関係会社に対する資産及び負債のうち、区分掲記されたもの以外の各科目に含まれている金額は、次のとおりであります。 短期貸付金 355,640百万円 長期差入保証金 59,830 貸付有価証券担保金 83,320 長期受入保証金 50,982	1. 関係会社に対する資産及び負債のうち、区分掲記されたもの以外の各科目に含まれている金額は、次のとおりであります。 短期貸付金 264,620百万円 未収入金 1,237 長期差入保証金 60,014 貸付有価証券担保金 55,084 長期受入保証金 48,854
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額の内訳 建物 505百万円 器具備品 4,485 計 4,991	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額の内訳 建物 564百万円 器具備品 3,354 計 3,919
3. (1) 担保に供されている資産 投資有価証券 3,850百万円 (注) 1. 上記の金額は貸借対照表計上額によっております。 2. 分社に伴い大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社へ譲渡したスワップ契約の信用補完を目的としております。 (2) 担保に供されている資産を除き、所有・使用・処分が制限されている資産 投資有価証券のうち、141,638百万円を子会社に貸し付けております。	3. (1) 担保に供されている資産 投資有価証券 3,360百万円 (注) 1. 上記の金額は貸借対照表計上額によっております。 2. 分社に伴い大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社へ譲渡したスワップ契約の信用補完を目的としております。 (2) 担保に供されている資産を除き、所有・使用・処分が制限されている資産 投資有価証券のうち、104,361百万円を子会社に貸し付けております。
4. 外貨建の資産・負債のうち主な科目は次の通りであります。 (1) 資産 投資有価証券 2,386百万円 主な外貨額 7,199千米ドル 3,716千スターリングポンド 関係会社株式 87,757百万円 主な外貨額 278,864千スターリングポンド 170,173千米ドル 100,737千スイスフラン (2) 負債 なし	
5. 貸倒引当金3,129百万円は、債権額と相殺して表示しております。	5. 貸倒引当金2,071百万円は、債権額と相殺して表示しております。
6. 外貨建長期金銭債権債務の決算日の為替相場による円換算額は次の通りであります。 貸借対照表計上額 百万円 決算日の為替相場による円換算額 百万円 差額 百万円 長期金銭債権 33 29 (損) 4	
7. 役員退職慰労引当金644百万円を含めております。	

第63期 平成12年3月31日現在			第64期 平成13年3月31日現在		
8. 保証債務			8. 保証債務		
(単位：百万円)			(単位：百万円)		
保証先	保証債務残高	保証の内容	被保証者	保証債務残高	被保証債務の内容
大和土地建物株式会社	80,000	ユーロ円債	大和土地建物株式会社	80,000	ユーロ円債
大和ビル管理株式会社	30,000	借入金		2,400	借入金
	26,500	借入金	大和ビル管理株式会社	48,300	借入金
大和ヨーロッパ ファイ ナンスB.V.	38,100	メディアム・ターム・ノート	大和ヨーロッパ ファイ ナンスB.V.	23,100	メディアム・ターム・ノート
大和ヨーロッパバンク plc	17,600	メディアム・ターム・ノート	大和セキュリティーズ トラストアンド パンキ ング(ヨーロッパ)plc	11,800	メディアム・ターム・ノート
	4,000	ユーロ円債		4,000	ユーロ円債
	575	スワップ		11	スワップ
その他(4件)	241	スワップ及び借入金	エヌ・アイ・エフ ベン チャーズ株式会社	3,600	借入金
合計	197,017		従業員	6,487	借入金
(注) 1. 大和ヨーロッパバンクplcに対する保証575 百万円はbond建の保証債務(3,404千bond ド)であります。			(注) 1. 大和セキュリティーズ トラストアンド パ ンキング(ヨーロッパ)plcに対する保証11百 万円はbond建の保証債務(65千bondド)で あります。		
2. その他には、米ドル建(1,732千米ドル)の保 証債務を含んでおります。			2. その他には、米ドル建(441千米ドル)の保証 債務を含んでおります。		
9. 会社が発行する株式の総数は普通株式 4,000,000,000株、優先株式100,000,000株、発行 済株式の総数は1,331,733,430株であります。 株式消却が行われた場合には、これに相当する株 式数を減ずることとなっております。			9. 会社が発行する株式の総数は普通株式 4,000,000,000株、優先株式100,000,000株、発行 済株式の総数は1,331,735,258株であります。 株式消却が行われた場合には、これに相当する株 式数を減ずることとなっております。		
10. 当社は、平成10年3月期までは証券会社として証 券取引法第58条(平成10年12月1日改正法施行前) に基づき、金銭による利益の配当額の五分の一以 上を資本の額に達するまで利益準備金として積み 立ててきました。平成10年12月1日施行の改正証 券取引法により当該条文が削除されたこと及び平 成11年4月に当社が持株会社へ移行し証券業を廃 業したことに伴い、利益の処分として支出する金 額の十分の一以上を資本の額の四分の一に達する まで積み立てる商法第288条の規定を受けること となり、当期末における当社の利益準備金は、当 該規定額を10,727百万円超えております。			10. 同左		
			11. 当期より、投資有価証券について時価評価を行っ ており、投資有価証券の評価差額から税効果額を 控除した額をその他有価証券評価差額金として資 本の部に計上しております。これにより純資産が 17,514百万円増加しており、当該金額は商法第 290条第1項第6号の規定により配当可能利益よ り控除されております。また、ストックオプショ ン制度により取得した自己株式の金額2,526百万 円については、商法第290条第1項第5号の規定 により配当に充当することが制限されております。		

(損益計算書関係)

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日
1. 関係会社に対する営業収益及び営業費用のうち、 区分掲記されたものを含み各科目に含まれている 金額は次のとおりであります。 営業収益 20,364百万円 営業費用 6,202	1. 関係会社に対する営業収益及び営業費用のうち、 区分掲記されたものを含み各科目に含まれている 金額は次のとおりであります。 営業収益 26,634百万円 営業費用 2,664
2. 「商標使用料収入」は、子会社である大和証券株 式会社から受け取る、当社の保有する商標の使用 料収入であります。	2. 同左
3. トレーディング損益の内訳 (単位：百万円) 実現損益 評価損益 計 株券等トレー ディング損益 788 — 788 債券等トレー ディング損益 669 — 669 その他のトレー ディング損益 415 — 415 計 1,874 — 1,874	
4. 金融収益の内訳 信用取引受取利息 品貸料 126百万円 受取配当金 2,013 収益分配金 8 現先取引収益 1 受取利息 1,267 その他の金融収益 203 計 3,621	4. 金融収益の内訳 受取配当金 1,602百万円 受取利息 1,230 その他の金融収益 597 計 3,430
5. 取引関係費の内訳 支払手数料 1,113百万円 取引所・協会費 34 通信・運送費 881 旅費・交通費 361 広告宣伝費 475 交際費 171 計 3,037	5. 取引関係費の内訳 支払手数料 475百万円 通信・運送費 135 旅費・交通費 150 広告宣伝費 797 交際費 61 計 1,619
6. 人件費の内訳 報酬・給料 6,994百万円 退職金 147 福利厚生費 563 賞与引当金繰入 700 退職給与引当金繰入 428 計 8,832	6. 人件費の内訳 報酬・給料 2,040百万円 退職給付費用 514 福利厚生費 439 賞与引当金繰入 490 役員退職慰労引当金繰入 130 その他 0 計 3,616
7. 不動産関係費の内訳 不動産費 2,600百万円 器具・備品費 616 計 3,216	7. 不動産関係費の内訳 不動産費 694百万円 器具・備品費 146 計 841
8. 事務費の内訳 事務委託費 2,563百万円 事務用品費 180 計 2,743	8. 事務費の内訳 事務委託費 1,270百万円 事務用品費 29 計 1,300

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日		第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日	
9.	租税公課の内訳	9.	租税公課の内訳
	事業所税 11百万円		事業所税 17百万円
	源泉所得税・住民税利子割 117		源泉所得税・住民税利子割 453
	印紙税 88		印紙税 29
	その他 360		その他 131
	計 577		計 632
10.	その他の内訳	10.	その他の内訳
	購読費 37百万円		購読費 20百万円
	水道光熱費 178		水道光熱費 41
	諸会費・会議費 79		諸会費・会議費 47
	寄付金 64		寄付金 212
	営業資料費・消耗品費 36		教育研修費 197
	教育研修費 286		雑費 377
	雑費 535		計 896
	計 1,219		
11.	金融費用の内訳	11.	金融費用の内訳
	信用取引支払利息品借料 271百万円		支払利息 6,937百万円
	現先取引費用 6		その他の金融費用 210
	支払利息 8,872		計 7,148
	有価証券品借料 90		
	その他の金融費用 21		
	計 9,263		
12.	関係会社に対する費用1,650百万円を含んでおります。	12.	関係会社に対する費用429百万円を含んでおります。
13.	分社に伴い、営業権を子会社である大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社へ譲渡したことにより得た利益であります。		
14.	(1) 固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。関係会社に対する売却益の金額は、()に内書きしております。	14.	(1) 固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。
	建物 209 (209)百万円		器具備品 26百万円
	器具備品 40 (40)		投資その他の資産・その他 15
	土地 405 (—)		(ゴルフ会員権等)
	投資その他の資産・その他 1,568 (1,520)		
	(ゴルフ会員権等)		
	(2) 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。売却損は()に内書きしております。		(2) 固定資産除売却損の内容は、次のとおりであります。売却損は()に内書きしております。
	建物 34 (34)百万円		器具備品 207 (0)百万円
	器具備品 375 (204)		投資その他の資産・その他 22 (22)
	投資その他の資産・その他 719 (719)		(ゴルフ会員権等)
	(ゴルフ会員権等)		
15.	全額関係会社との取引により得た利益であります。		
16.	証券取引責任準備金及び金融先物取引責任準備金の戻入は、当社が証券業を廃業したことによるものであります。		
17.	固定資産評価損は、ゴルフ会員権の評価替えを行ったことにより発生した損失であります。	17.	同左

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日
18. 平成12年 1 月19日開催の当社取締役会で決議に基づき、日本インベストメント・ファイナンス株式会社及び大和ファイナンス株式会社の合併に先立ち、前倒しで両社の不良債権処理を完了するための追加支援金36億円を計上しております。 なお、連結範囲の拡大により支援対象会社が子会社となったため、従来の「関連先支援損失」は「子会社支援損失」に科目名を変更しております。 19. 関係会社等再編費用は、関係会社の清算・売却に伴い発生した損失等であります。 20. 前期までは、「証券会社に関する命令」(平成10年総理府令・大蔵省令第32号)に基づき「法人税等」として表示しておりましたが、当期においては、持株会社への移行に伴い、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)に基づき「法人税、住民税及び事業税」に科目名を変更しております。	_____ _____ _____

(リース取引関係)

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日	第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13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の以外のファイナンス・リース取引は次の通りであります。 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期末残高相当額 <table> <tr> <td></td><td>器具備品</td></tr> <tr> <td>取得価額相当額</td><td>858百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td><td>656</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>202</td></tr> </table> 2. 未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1 年以内</td><td>173百万円</td></tr> <tr> <td>1 年超</td><td>34</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>208</td></tr> </table> 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 <table> <tr> <td>支払リース料</td><td>2,245百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>1,757百万円</td></tr> <tr> <td>支払利息相当額</td><td>90百万円</td></tr> </table> 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。 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。		器具備品	取得価額相当額	858百万円	減価償却累計額相当額	656	期末残高相当額	202	1 年以内	173百万円	1 年超	34	合計	208	支払リース料	2,245百万円	減価償却費相当額	1,757百万円	支払利息相当額	90百万円	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の以外のファイナンス・リース取引は次の通りであります。 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期末残高相当額 <table> <tr> <td></td><td>器具備品</td></tr> <tr> <td>取得価額相当額</td><td>314百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td><td>167</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>147</td></tr> </table> 2. 未経過リース料期末残高相当額 <table> <tr> <td>1 年以内</td><td>47百万円</td></tr> <tr> <td>1 年超</td><td>101</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>148</td></tr> </table> 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 <table> <tr> <td>支払リース料</td><td>192百万円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>177百万円</td></tr> <tr> <td>支払利息相当額</td><td>6百万円</td></tr> </table> 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 同左		器具備品	取得価額相当額	314百万円	減価償却累計額相当額	167	期末残高相当額	147	1 年以内	47百万円	1 年超	101	合計	148	支払リース料	192百万円	減価償却費相当額	177百万円	支払利息相当額	6百万円
	器具備品																																								
取得価額相当額	858百万円																																								
減価償却累計額相当額	656																																								
期末残高相当額	202																																								
1 年以内	173百万円																																								
1 年超	34																																								
合計	208																																								
支払リース料	2,245百万円																																								
減価償却費相当額	1,757百万円																																								
支払利息相当額	90百万円																																								
	器具備品																																								
取得価額相当額	314百万円																																								
減価償却累計額相当額	167																																								
期末残高相当額	147																																								
1 年以内	47百万円																																								
1 年超	101																																								
合計	148																																								
支払リース料	192百万円																																								
減価償却費相当額	177百万円																																								
支払利息相当額	6百万円																																								

(有価証券関係)

前連結会計年度に係る「有価証券の時価等」及び当連結会計年度に係る「有価証券」(子会社株式及び関連会社株式で時価のあるものは除く)に関する注記については、連結財務諸表における注記事項として記載しております。

当事業年度(自平成12年4月1日 至平成13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
関連会社株式	951百万円	513百万円	438百万円

(税効果会計関係)

第63期 平成12年3月31日現在		第64期 平成13年3月31日現在	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	(百万円)	繰延税金資産	(百万円)
繰越欠損金	46,817	繰越欠損金	50,441
子会社株式評価減	31,873	子会社株式評価減	27,263
その他	1,303	その他	2,659
繰延税金資産小計	79,993	繰延税金資産小計	80,364
評価性引当額	79,993	評価性引当額	80,364
繰延税金資産合計	—	繰延税金資産合計	—
繰延税金負債	—	繰延税金負債	—
繰延税金資産の純額	—	その他有価証券評価差額金	12,708
		繰延税金負債合計	12,708
		繰延税金負債の純額	12,708
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の主な項目別の内訳	
法定実効税率	42.1%	法定実効税率	42.1%
(調整)		(調整)	
評価性引当額	0.3%	評価性引当額	12.6%
永久に益金に算入されない項目	0.9%	永久に益金に算入されない項目	63.8%
その他	1.3%	その他	9.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	0.2%

(1 株当たり情報)

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日		第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日	
1 株当たり純資産額	559.13円	1 株当たり純資産額	565.90円
1 株当たり当期純利益	93.91円	1 株当たり当期純利益	6.65円
潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額	89.89円	潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額	6.60円

(重要な後発事象)

第63期 自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日		第64期 自 平成12年 4 月 1 日 至 平成13年 3 月31日	
<u>発行登録及び債券発行について</u> 平成12年 5 月31日に発行登録(発行予定期間 平成12年 6 月 8 日から 2 年間、発行予定額2,000億円)を行い、平成12年 6 月 8 日開催の取締役会の決議に基づき、以下の社債を発行しております。 (1) 銘柄 : 株式会社大和証券グループ本社第 1 回無担保社債 (2) 発行登録追補書類提出日 : 平成12年 6 月14日 (3) 発行年月日 : 平成12年 6 月26日 (4) 発行総額 : 100,000百万円 (5) 発行価格 : 額面100円につき金100円 (6) 利率 : 年1.40% (7) 償還の方法 : 償還金額は、額面100円につき金100円とし、本社債の元金は、償還期限にその総額を償還する。 (8) 償還期限 : 平成17年 6 月24日 (9) 資金の用途 : 社債発行差引手取概算額99,508百万円は、転換社債償還資金に38,662百万円、借入金返済に14,000百万円及び子会社投融資に46,846百万円を充当する予定であります。		該当事項はありません。	

附属明細表

a. 有価証券明細表

(1) 流動資産に計上した有価証券

(単位：百万円)

その他有価証券	その他	種類及び銘柄	投資口数等	貸借対照表計上額
		CD	30,000口	30,000

(2) 投資有価証券

(単位：百万円)

その他有価証券	株式	銘柄	株式数	貸借対照表価額
		株式会社住友銀行	18,765,430株	21,017
		株式会社フジテレビジョン	5,500株	4,823
		京セラ株式会社	420,000株	4,783
		プロミス株式会社	471,339株	4,430
		住友信託銀行株式会社	5,635,000株	4,068
		株式会社東京三菱銀行	3,216,000株	3,608
		株式会社ディーディーアイ	7,455株	3,034
		トヨタ自動車株式会社	594,212株	2,584
		ソフトバンク・インベストメント株式会社	1,078株	2,565
		株式会社武富士	260,000株	2,475
		株式会社あさひ銀行	7,761,548株	2,460
		アイフル株式会社	215,100株	2,363
		東京海上火災保険株式会社	1,776,000株	2,225
		日本テレコム株式会社	981株	2,197
		株式会社三和銀行	3,118,204株	2,132
		三菱信託銀行株式会社	2,622,000株	1,963
		住友海上火災保険株式会社	2,497,201株	1,890
		住友商事株式会社	2,200,000株	1,740
		東宝株式会社	114,081株	1,562
		株式会社電通	4,000株	1,520
		日本レコード・キーピング・システム株式会社	28,000株	1,400
		その他(540銘柄)	143,164,346株	75,175
		計	192,877,475株	150,024
その他有価証券	その他	種類及び銘柄	投資口数等	貸借対照表価額
		全国信用金庫連合会優先出資証券	3,562口	1,371
		農林中央金庫優先出資証券	772,000口	1,999
		その他出資証券(1銘柄)	500口	37
		受益証券(2銘柄)	10,004.5口	147
		計	776,107口	3,555
その他有価証券合計				153,580

- (注) 1. 株式会社住友銀行は、平成13年4月1日をもって株式会社さくら銀行と合併し、株式会社三井住友銀行となっております。
2. 株式会社東京三菱銀行と三菱信託銀行株式会社は、平成13年4月2日をもって、日本信託銀行株式会社と共同して完全親会社となる株式会社三菱東京フィナンシャル・グループを設立しております。
3. 株式会社ディーディーアイは、平成13年4月1日をもって、ケイディーディーアイ株式会社と社名を変更しております。
4. 株式会社三和銀行は、平成13年4月2日をもって、株式会社東海銀行、東洋信託銀行株式会社と共同して完全親会社となる株式会社UFJホールディングスを設立しております。

b . 有形固定資産等明細表

(単位：百万円)

(単位：百万円)

資産の種類		前期末残高	当期増加額	当期減少額	当期末残高	減価償却累計額又は 償却累計額		差引 当期末残高	摘要
							当期償却額		
有形 固定 資産	建物	1,409	4	16	1,397	564	74	832	
	器具備品	7,950	82	1,671	6,360	3,354	285	3,005	
	土地	6,913		18	6,895	—	—	6,895	
	計	16,273	86	1,706	14,653	3,919	359	10,733	
無形 固定 資産	ソフトウェア	958	229	56	1,131	736	186	394	
	電話加入権	745	—	—	745	—	—	745	
	その他	703	70	19	754	469	48	285	
	計	2,406	300	75	2,631	1,205	235	1,425	
長期前払費用		1,183	—	—	1,183	837	217	345	
繰延資産		—	—	—	—	—	—	—	

c . 資本金等明細表

(単位：百万円)

(単位：百万円)

区分			前期末残高	当期増加額	当期減少額	当期末残高	摘要
資本金			138,430	0	—	138,431	(注)1
うち既発行株式	額面普通株式	(1,331,733,430株) 138,430	(1,828株) 0	—	(1,331,735,258株) 138,431	(注)1	
	計	(1,331,733,430株) 138,430	(1,828株) 0	—	(1,331,735,258株) 138,431		
資本準備金及び その他の資本剰余金		(資本準備金) 株式払込剰余金	117,785	0	—	117,786	(注)1
		計	117,785	0	—	117,786	
利益準備金及び 任意積立金		(利益準備金)	45,335	—	—	45,335	
		(任意積立金) 別途積立金	317,000	100,000	—	417,000	(注)2
		計	362,335	100,000	—	462,335	

(注) 1. 当期の増加は、転換社債の株式への転換によるものであります。

2. 当期の増加は、前期決算の利益処分によるものであります。

d . 引当金明細表

(単位：百万円)

区分	前期末残高	当期増加額	当期減少額		当期末残高	摘要
			目的使用	その他		
貸倒引当金	6,834	3,391	1,686	2,610	5,929	(注)1
賞与引当金	700	490	700	—	490	
役員退職慰労引当金	—	775	55	—	720	(注)2
厚生年金基金引当金	2,200	—	—	—	2,200	

(注) 1. 貸倒引当金の当期減少額のうち、「その他」欄の金額は、洗替額2,498百万円と債権回収に伴う引当金取崩額112百万円であります。なお、貸借対照表では、破産更生債権等に係る貸倒引当金 2,071百万円は、債権額と相殺しております。

2. 役員退職慰労引当金の当期増加額には、退職給与引当金からの振替額644百万円が含まれております。

(2) 主な資産及び負債の内容

平成13年3月末における主な資産及び負債の内容は次の通りであります。

なお、附属明細表において記載した項目については省略しております。

(a) 資産の部

(一) 現金・預金

(単位：百万円)

種類	金額
現金	4
当座預金	287
普通預金	25,300
通知預金	56,050
定期預金	363
その他	537
合計	82,542

(二) 短期貸付金

(単位：百万円)

種類	金額
大和土地建物株式会社	89,000
大和アメリカ Corporation	69,000
大和証券株式会社	30,000
大和ビル管理株式会社	21,850
大和住宅サービス株式会社	20,810
その他	33,960
合計	264,620

(三) 関係会社株式

(単位：百万円)

種類	金額
大和証券エスビーキャピタル・マーケット株式会社	244,806
大和証券株式会社	150,010
大和証券投資信託委託株式会社	66,257
大和ヨーロッパ プロパティ plc	30,466
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	26,112
その他	64,534
合計	582,186

(四)関係会社長期貸付金

(単位：百万円)

種類	金額
大和証券エスピーキャピタル・マーケット株式会社	60,000
大和土地建物株式会社	20,000
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	11,600
その他	2,000
合計	93,600

(b) 負債の部

(一)短期借入金

(単位：百万円)

科目	金額	摘要
短期借入金	133,410	金融機関からの短期借入金であります。

(二)貸付有価証券担保金

(単位：百万円)

科目	金額	摘要
貸付有価証券担保金	55,084	株券貸借取引に基づき貸し付けた有価証券の担保として、子会社から受け入れている取引担保金であります。

(三)社債・転換社債

1. 連結財務諸表 (1) 連結財務諸表等 連結附属明細表 a . 社債明細表参照。

(3) その他

該当事項はありません。

第6 提出会社の株式事務の概要

決算期	3月31日	定時株主総会	6月中
株主名簿閉鎖の期間	—	基準日	3月31日
株券の種類	1株券、10株券、50株券、100株券、500株券、1,000株券、5,000株券、10,000株券、50,000株券、100,000株券、及び任意の株数を表示した株券	中間配当基準日	—
		1単位の株式数	1,000株
株式の名義書換え	取扱場所	東京都港区芝三丁目33番1号 中央三井信託銀行株式会社 本店	
	代理人	東京都港区芝三丁目33番1号 中央三井信託銀行株式会社	
	取次所	中央三井信託銀行株式会社 全国各支店 日本証券代行株式会社 本支店・出張所	
	名義書換手数料	無料	新券交付手数料 不所持株券の交付及び喪失、汚損又は毀損に基づく再発行は1枚につき250円 上記以外は無料
単位未満株式の買取り	取扱場所	東京都港区芝三丁目33番1号 中央三井信託銀行株式会社 本店	
	代理人	東京都港区芝三丁目33番1号 中央三井信託銀行株式会社	
	取次所	中央三井信託銀行株式会社 全国各支店 日本証券代行株式会社 本支店・出張所 並びに当社本店及び全国各支店	
	買取手数料	株式の売買の委託に係る手数料相当額として別途定める金額	
公告掲載新聞名	東京都内において発行する日本経済新聞		
株主に対する特典	なし		

第 7 提出会社の参考情報

当事業年度の開始日から有価証券報告書提出日までの間に、次の書類を提出しております。

提出書類名		提出年月日	
1. 有価証券報告書及びその添付書類		平成12年 6 月30日	関東財務局長に提出
事業年度 (第63期)	自 平成11年 4 月 1 日 至 平成12年 3 月31日		
2. 半期報告書		平成12年12月 8 日	関東財務局長に提出
事業年度 (第64期中)	自 平成12年 4 月 1 日 至 平成12年 9 月30日		
3. 有価証券届出書及びその添付書類 (第 1 回新株引受権付社債)		平成12年 8 月 2 日	関東財務局長に提出
4. 有価証券届出書の訂正届出書		平成12年 8 月10日	関東財務局長に提出
上記 3 の有価証券届出書に係る訂正届出書であります。			
5. 発行登録書(普通社債)及びその添付書類		平成12年 5 月31日	関東財務局長に提出
6. 訂正発行登録書			
発行登録書(平成12年 5 月31日提出)に関する訂正		平成12年 6 月30日	関東財務局長に提出
発行登録書(平成12年 5 月31日提出)に関する訂正 及び訂正発行登録書(平成12年 6 月30日提出)に 関する訂正		平成12年12月 8 日	関東財務局長に提出
7. 発行登録追補書類及びその添付書類		平成12年 6 月14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。