

# 四半期報告書

(金融商品取引法第24条の4の7第1項に基づく報告書)

事業年度 自 平成28年4月1日  
(第80期 I) 至 平成28年6月30日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第80期第1四半期（自平成28年4月1日 至平成28年6月30日）

# 四半期報告書

- 本書は金融商品取引法第24条の4の7第1項に基づく四半期報告書を同法第27条の30の2に規定する開示用電子情報処理組織(EDINET)を使用し提出したデータに目次及び頁を付して出力・印刷したものであります。
- 本書には、上記の方法により提出した四半期報告書に添付された四半期レビュー報告書を末尾に綴じ込んでおります。

株式会社 大和証券グループ本社

# 目 次

	頁
第80期第1四半期 四半期報告書	
【表紙】 .....	1
第一部 【企業情報】 .....	2
第1 【企業の概況】 .....	2
1 【主要な経営指標等の推移】 .....	2
2 【事業の内容】 .....	2
第2 【事業の状況】 .....	3
1 【事業等のリスク】 .....	3
2 【経営上の重要な契約等】 .....	3
3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】 .....	3
第3 【提出会社の状況】 .....	8
1 【株式等の状況】 .....	8
2 【役員の状況】 .....	9
第4 【経理の状況】 .....	10
1 【四半期連結財務諸表】 .....	11
2 【その他】 .....	23
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】 .....	24
四半期レビュー報告書	

**【表紙】**

**【提出書類】** 四半期報告書

**【根拠条文】** 金融商品取引法第24条の4の7第1項

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成28年8月10日

**【四半期会計期間】** 第80期第1四半期  
(自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)

**【会社名】** 株式会社大和証券グループ本社

**【英訳名】** Daiwa Securities Group Inc.

**【代表者の役職氏名】** 執行役社長 日比野 隆 司

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【電話番号】** 03(5555)1111

**【事務連絡者氏名】** 財務部長 太 田 一 成

**【最寄りの連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【電話番号】** 03(5555)1111

**【事務連絡者氏名】** 財務部長 太 田 一 成

**【縦覧に供する場所】** 株式会社東京証券取引所  
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

株式会社名古屋証券取引所  
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)

## 第一部 【企業情報】

### 第1 【企業の概況】

#### 1 【主要な経営指標等の推移】

回次	第79期 第1四半期 連結累計期間	第80期 第1四半期 連結累計期間	第79期
会計期間	自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日	自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日	自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日
営業収益 (百万円)	191,389	151,859	653,711
純営業収益 (百万円)	154,663	114,049	514,815
経常利益 (百万円)	63,113	32,537	165,148
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益 (百万円)	44,836	24,571	116,848
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	61,966	△24,697	57,266
純資産額 (百万円)	1,362,124	1,267,304	1,313,005
総資産額 (百万円)	23,451,198	21,419,907	20,420,818
1株当たり四半期(当期)純利益金額 (円)	26.24	14.52	68.25
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額 (円)	25.99	14.43	67.68
自己資本比率 (%)	5.4	5.5	6.0

(注) 1 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。

2 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。

#### 2 【事業の内容】

当第1四半期連結累計期間において、当社グループ（当社及び当社の関係会社）が営む事業の内容に重要な変更はありません。

また、主要な関係会社についても異動はありません。

## 第2 【事業の状況】

### 1 【事業等のリスク】

当第1四半期連結累計期間開始日以降、当四半期報告書提出日までの間において、第79期有価証券報告書に記載した事業等のリスクについて重要な変更があった事項はありません。

### 2 【経営上の重要な契約等】

当第1四半期連結会計期間において、該当事項はありません。

### 3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

本項における将来に関する事項は、別段の記載がない限り、当第1四半期連結会計期間の末日現在において当社グループが判断したものであります。

#### (1) 業績の状況

当第1四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は1,518億円（前年同四半期比20.7%減）となりました。受入手数料は総額で616億円（同22.9%減）、トレーディング損益が333億円（同31.9%減）となりました。金融収支は90億円（同34.3%減）、純営業収益は1,140億円（同26.3%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費163億円（同13.2%減）、人件費432億円（同12.4%減）などにより、合計で860億円（同10.0%減）となりました。

この結果、経常利益は325億円（同48.4%減）となりました。

これに特別損益、法人税等及び非支配株主に帰属する四半期純利益を計上した結果、親会社株主に帰属する四半期純利益は245億円（同45.2%減）となりました。

セグメントの業績は、次のとおりであります。

（単位：百万円）

	純営業収益			経常利益		
	平成27年 6月期	平成28年 6月期	対前年 増減率	平成27年 6月期	平成28年 6月期	対前年 増減率
リテール部門	64,631	45,013	△30.4%	24,263	6,566	△72.9%
ホールセール部門	57,174	43,427	△24.0%	24,027	14,899	△38.0%
アセット・マネジメント部門	15,488	11,623	△25.0%	9,260	6,748	△27.1%
投資部門	4,234	4,956	17.0%	3,671	4,624	25.9%
その他・調整等	13,134	9,028	—	1,889	△301	—
連結計	154,663	114,049	△26.3%	63,113	32,537	△48.4%

#### [リテール部門]

株式相場の低迷を背景に日本株取引や株式投資信託の販売が減少したことなどにより、純営業収益は450億円（前年同四半期比30.4%減）、経常利益は65億円（同72.9%減）となりました。

#### [ホールセール部門]

エクイティの顧客フローの減少や、エクイティ市場での引受け案件が減少したことなどにより、純営業収益は434億円（同24.0%減）、経常利益は148億円（同38.0%減）となりました。

#### [アセット・マネジメント部門]

円高・株安により公募株式投信等の運用資産残高が減少したことなどにより、純営業収益は116億円（同25.0%減）、経常利益は67億円（同27.1%減）となりました。

#### [投資部門]

投資案件の回収などにより、純営業収益は49億円（同17.0%増）、経常利益は46億円（同25.9%増）となりました。

## (2) 財政状態の分析

### <資産の部>

当第1四半期連結会計期間末の総資産は21兆4,199億円（前連結会計年度末比9,990億円増）となりました。内訳は流動資産が20兆8,777億円（同1兆262億円増）であり、このうち現金・預金が3兆5,337億円（同1,990億円増）、有価証券が2兆332億円（同578億円減）、トレーディング商品が9兆1,467億円（同1兆6,454億円増）、有価証券担保貸付金が4兆5,753億円（同6,747億円減）となっております。固定資産は5,421億円（同271億円減）となっております。

### <負債の部・純資産の部>

負債合計は20兆1,526億円（同1兆447億円増）となりました。内訳は流動負債が17兆8,633億円（同1兆354億円増）であり、このうちトレーディング商品が5兆3,411億円（同403億円増）、約定見返勘定が1兆9,505億円（同1兆5,233億円増）、有価証券担保借入金が5兆5,770億円（同3,247億円減）、銀行業における預金が2兆8,872億円（同413億円減）となっております。固定負債は2兆2,852億円（同93億円増）であり、このうち社債が1兆2,201億円（同154億円増）、長期借入金が1兆48億円（同1億円減）となっております。

純資産合計は1兆2,673億円（同457億円減）となりました。株主資本については、「(6)資本の財源及び流動性に係る情報 ②株主資本」に記載のとおりであります。その他有価証券評価差額金は832億円（同151億円減）、非支配株主持分は840億円（同1億円減）となっております。また、繰延ヘッジ損益は△367億円（同37億円減）、為替換算調整勘定は△91億円（同301億円減）となっております。

## (3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第1四半期連結累計期間において、事業上及び財務上の対処すべき課題について、重要な変更及び新たに生じた事項はありません。

## (4) 研究開発活動

該当事項はありません。

## (5) 経営成績に重要な影響を与える要因についての分析

当第1四半期連結累計期間のマクロ経済環境

### <海外の状況>

世界経済は、緩やかな減速基調が継続しました。先進国経済は相対的に底堅く推移したものの、新興国経済の減速が重石となりました。平成28年6月にイギリスで行われた、イギリスのEU（欧州連合）からの離脱の是非を問う国民投票で、離脱派が過半数を占めた結果、為替市場において急速なポンド安が起き、株式市場では世界的に株安が広がるなど、グローバルな金融市場は混乱に見舞われました。

米国経済は平成28年1－3月期に、設備投資、輸出の減速に加えて、これまで米国経済の下支え役となってきた個人消費の伸びが鈍化し、実質GDP成長率は前期比年率1.1%にとどまりました。しかし、4－6月期に入ると、労働市場の先行きに不透明感が台頭する一方で、個人消費が再び加速する動きが見られており、住宅市場も堅調さを取り戻しています。一方、企業部門については、平成27年後半以降、ドル高などを背景に製造業を中心に低迷が続いてきましたが、足下では徐々に持ち直しつつあります。金融面では、米国国内の景気回復を受けて、FRB（連邦準備制度理事会）は金融危機後2度目となる利上げのタイミングをうかがっていましたが、平成28年5月米雇用統計や6月に実施されたイギリスの国民投票の結果を受けて、早期の利上げ機運は後退することとなりました。

欧州経済は、ECB（欧州中央銀行）によるマイナス金利政策や原油価格の低迷などを追い風に、個人消費が下支え役となり、緩やかな回復基調が続きました。ただし、ユーロ安の進行にもかかわらず、欧州以外の需要は低調であり、輸出は伸び悩みました。金融面では、ECBによる緩和的な金融政策が継続しています。しかし、物価上昇率は低迷しており、ECBが目標とする水準には遠く及ばない状況にあります。平成28年6月23日にイギリスで行われたEUからの離脱の是非を問う国民投票では、大方の予想に反して離脱派が過半数を占める結果となり、上記のように急速なポンド安や世界的な株安の要因となりました。

新興国経済は、減速傾向が続いています。中国経済の不振が各国に伝播したことが、新興国全体の景気の足取りを鈍くさせている最大の要因です。中国経済は平成27年7－9月期に実質GDP成長率が政府目標である前年比+7.0%を下回りましたが、平成28年に入ってから減速傾向をたどっており、中国経済に対する先行き不透明感は依然として払拭されずにいます。

## <日本の状況>

日本経済は依然として「踊り場」局面から抜け出せずにあります。鉱工業生産は、在庫の積み上がりや輸出の停滞などを主因として、緩やかな減産基調をたどっています。一方、非製造業の活動を示す第三次産業活動指数については、事業所向けサービスが堅調に推移し、全体として緩やかな拡大基調にあります。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は停滞が継続しています。労働需給のタイト化に伴う賃金上昇圧力に加えて、企業収益の改善に伴うベースアップや特別給与の増加など、所得環境は良好であるものの、金融市場の不安定化や景気の減速などを背景に、家計は財布の紐をきつく締めたままの状態にあります。また、住宅投資に関しても、良好な所得環境や住宅ローン金利の低下といった支援材料はあるものの、平成27年10—12月期以降2四半期連続で前期比マイナス成長が続くなど、停滞しています。

企業の設備投資は平成28年1—3月期に3四半期ぶりに減少し、これまでの増加傾向に一服感がみられました。高水準の企業収益を背景とする更新・改修投資の動きが下支え役になる一方、円高や国内景気の停滞に伴う企業収益の先行き不透明感が強まる中で、製造業を中心に設備投資を先送りする動きが出始めています。

外需に目を向けると、輸出数量の減少に円高に伴う輸出価格下落の要素が加わり、輸出金額は減少傾向にあります。地域別に輸出の動向をみると、米国やアジア向け輸出は横ばい圏で推移する一方、ECBによる金融緩和などによって個人消費が堅調に推移するEU向けの輸出は緩やかな拡大基調にあります。輸入をみると、円高に伴う輸入価格の低下が主因となり、輸入金額は大きく減少しています。

金融面では、平成28年1月に日本銀行が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を発表しました。日本銀行による大量の長期国債の購入によって債券需給が逼迫していたところに、マイナス金利導入の影響も加わり、長期金利はマイナス圏での推移が定着しています。為替レートは平成28年に入ると、海外経済に対する警戒感が強まり、円高が進行しました。更に、日本銀行が4月の金融政策決定会合において市場の期待に反して追加緩和を見送ったり、6月のイギリスの国民投票で離脱派が過半数を占めるなど、グローバルな金融市場の先行き不透明感が強まった局面では、円は対ドルで急速な円高に見舞われることとなりました。

平成28年6月末の日経平均株価は15,575円92銭（同年3月末比1,182円75銭安）、10年国債利回りは△0.217%（同0.188ポイントの低下）、為替は1ドル102円81銭（同9円54銭の円高）となりました。

(6) 資本の財源及び流動性に係る情報

① 流動性の管理

＜財務の効率性と安定性の両立＞

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めております。特に近年においては、世界的金融危機及び信用危機による不測の事態に備え、市場からの資金調達、金融機関からの借入等により、手元流動性の更なる積み増しを行っております。同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

当社は、平成26年金融庁告示第61号による連結流動性カバレッジ比率（以下、「LCR」）の最低基準（平成27年3月末から段階的に導入）の遵守が求められております。当社の当第1四半期末平均のLCRは165.7%となっており、上記金融庁告示による要件を満たしております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCRのほかに、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理体制を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当第1四半期末平均のLCRの状況は次のとおりです。

(単位：億円)

		月末平均 (自平成28年4月末 至平成28年6月末)
適格流動資産	(A)	22,309
資金流出額	(B)	29,553
資金流入額	(C)	16,095
連結流動性カバレッジ比率 (LCR)		
算入可能適格流動資産の合計額	(D)	22,309
純資金流出額	(B)-(C)	13,457
連結流動性カバレッジ比率	(D)/((B)-(C))	165.7%

#### <グループ全体の資金管理>

当社グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、当社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。当社は、当社固有のストレス又は市場全体のストレスの発生により新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、短期の無担保調達資金について、当社グループの流動性ポートフォリオが十分に確保されているかをモニタリングしております。また、当社は、必要に応じて当社からグループ各社に対し、機動的な資金の配分・供給を行うと共に、グループ内で資金融通を可能とする体制を整えることで、効率性に基づく一体的な資金調達及び資金管理を行っております。

#### <コンティンジェンシー・ファンディング・プラン>

当社グループは、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社グループは機動的な対応により流動性を確保する体制を整備しております。

当社グループのコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、グループ全体のストレスを踏まえて策定しており、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

また、金融市場の変動の影響が大きくその流動性確保の重要性の高い大和証券株式会社、株式会社大和ネクスト銀行及び海外証券子会社においては、更に個別のコンティンジェンシー・ファンディング・プランも策定し、同様に定期的な見直しを行っております。

なお、当社は、子会社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランの整備状況について定期的にモニタリングしており、必要に応じて想定すべき危機シナリオを考慮して子会社の資金調達プランやコンティンジェンシー・ファンディング・プランそのもの見直しを行い、更には流動性の積み増しを実行すると同時に資産圧縮を図るといった事前の対策を講じることとしております。

## ② 株主資本

当社グループが株式や債券、デリバティブ等のトレーディング取引、貸借取引、引受業務、ストラクチャード・ファイナンス、M&A、プリンシパル・インベストメント、証券担保ローン等の有価証券関連業を中心とした幅広い金融サービスを展開するためには、十分な資本を確保する必要があります。また、当社グループは、日本のみならず、海外においても有価証券関連業務を行っており、それぞれの地域において法規制上必要な資本を維持しなければなりません。

当第1四半期連結会計期間末の株主資本は、前連結会計年度末比45億円増加し、1兆1,378億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,792億円となりました。利益剰余金は配当金支払いにより203億円減少したほか、親会社株主に帰属する四半期純利益を245億円計上したことなどにより、前連結会計年度末比45億円増の6,884億円となりました。自己株式の控除額は、299億円となっております。

### 第3 【提出会社の状況】

#### 1 【株式等の状況】

##### (1) 【株式の総数等】

###### ① 【株式の総数】

種類	発行可能株式総数(株)
普通株式	4,000,000,000
第1種優先株式	100,000,000
第2種優先株式	100,000,000
第3種優先株式	100,000,000
計	4,000,000,000

(注) 各種類の株式の「発行可能株式総数」の欄には、定款に規定されている各種類の株式の発行可能種類株式総数を記載し、計の欄には、定款に規定されている発行可能株式総数を記載しております。

###### ② 【発行済株式】

種類	第1四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成28年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成28年8月10日)	上場金融商品取引所名 又は登録認可金融商品 取引業協会名	内容
普通株式	1,749,378,772	1,749,378,772	東京証券取引所市場第一部 名古屋証券取引所市場第一部	単元株式数は1,000株 あります。
計	1,749,378,772	1,749,378,772	—	—

##### (2) 【新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

##### (3) 【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

##### (4) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

##### (5) 【発行済株式総数、資本金等の推移】

年月日	発行済株式 総数増減数 (千株)	発行済株式 総数残高 (千株)	資本金増減額 (百万円)	資本金残高 (百万円)	資本準備金 増減額 (百万円)	資本準備金 残高 (百万円)
平成28年4月1日～ 平成28年6月30日	—	1,749,378	—	247,397	—	226,751

##### (6) 【大株主の状況】

当四半期会計期間は第1四半期会計期間であるため、記載事項はありません。

(7) 【議決権の状況】

当第1四半期会計期間末日現在の「議決権の状況」については、株主名簿の記載内容が確認できないため、記載することができないことから、直前の基準日（平成28年3月31日）に基づく株主名簿による記載をしております。

① 【発行済株式】

平成28年3月31日現在

区分	株式数(株)	議決権の数(個)	内容
無議決権株式	—	—	—
議決権制限株式(自己株式等)	—	—	—
議決権制限株式(その他)	—	—	—
完全議決権株式(自己株式等)	(自己保有株式) 普通株式 57,043,000	—	—
	(相互保有株式) 普通株式 2,463,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,687,272,000	1,687,272	—
単元未満株式	普通株式 2,600,772	—	—
発行済株式総数	1,749,378,772	—	—
総株主の議決権	—	1,687,272	—

(注) 1 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、株式会社証券保管振替機構名義の株式3,000株(議決権3個)が含まれております。

2 「単元未満株式」欄の株式数には、当社所有の自己株式140株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成28年3月31日現在

所有者の氏名 又は名称	所有者の住所	自己名義 所有株式数 (株)	他人名義 所有株式数 (株)	所有株式数 の合計 (株)	発行済株式 総数に対する 所有株式数 の割合(%)
(自己保有株式) 株式会社大和証券 グループ本社	東京都千代田区丸の内 一丁目9番1号	57,043,000	—	57,043,000	3.26
計	—	57,043,000	—	57,043,000	3.26

(注) 1 当社は、単元未満自己株式140株を保有しております。

2 上記のほか、当社の子会社が有価証券関連業務として自己の名義で保有している株式が2,463,000株あります。

2 【役員】の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当第1四半期累計期間における役員の異動は、次のとおりであります。

(1) 取締役の状況

該当事項はありません。

(2) 執行役の状況

該当事項はありません。

## 第4 【経理の状況】

### 1 四半期連結財務諸表の作成方法について

当社の四半期連結財務諸表は、「四半期連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（平成19年内閣府令第64号）並びに同規則第61条及び第82条の規定に基づき、当企業集団の主たる事業である有価証券関連業を営む会社の財務諸表に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」（昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則）に準拠して作成しております。

### 2 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1四半期連結会計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30日まで）に係る四半期連結財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による四半期レビューを受けております。

## 1 【四半期連結財務諸表】

## (1) 【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金	3,334,784	3,533,795
預託金	323,761	282,791
受取手形及び売掛金	17,090	15,186
有価証券	2,091,090	2,033,230
トレーディング商品	7,501,242	9,146,721
商品有価証券等	4,017,267	5,170,020
デリバティブ取引	3,483,975	3,976,700
営業投資有価証券	127,210	121,689
投資損失引当金	△11,053	△11,030
営業貸付金	432,785	431,895
仕掛品	503	864
信用取引資産	203,376	187,329
信用取引貸付金	183,654	168,101
信用取引借証券担保金	19,722	19,228
有価証券担保貸付金	5,250,135	4,575,351
借入有価証券担保金	5,184,274	4,575,351
現先取引貸付金	65,861	-
立替金	20,670	23,014
短期貸付金	288	514
未収収益	33,574	28,797
繰延税金資産	9,401	4,430
その他の流動資産	517,421	503,894
貸倒引当金	△722	△689
流動資産計	19,851,563	20,877,787
固定資産		
有形固定資産	124,562	123,068
無形固定資産	84,879	84,939
のれん	7,972	7,330
その他	76,907	77,608
投資その他の資産	359,812	334,112
投資有価証券	324,456	298,444
長期貸付金	4,954	4,948
長期差入保証金	17,523	17,426
繰延税金資産	5,679	6,157
その他	※1 7,942	※1 7,888
貸倒引当金	※1 △743	※1 △752
固定資産計	569,255	542,120
資産合計	20,420,818	21,419,907

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
<b>負債の部</b>		
流動負債		
支払手形及び買掛金	6,413	4,634
トレーディング商品	5,300,861	5,341,178
商品有価証券等	2,315,450	1,807,270
デリバティブ取引	2,985,410	3,533,908
約定見返勘定	427,257	1,950,572
信用取引負債	54,387	58,202
信用取引借入金	3,789	1,703
信用取引貸証券受入金	50,597	56,499
有価証券担保借入金	5,901,794	5,577,068
有価証券貸借取引受入金	5,893,795	5,521,060
現先取引借入金	7,999	56,007
銀行業における預金	2,928,630	2,887,258
預り金	214,498	266,356
受入保証金	512,426	532,946
短期借入金	820,019	749,102
コマーシャル・ペーパー	137,720	101,850
1年内償還予定の社債	232,594	209,955
未払法人税等	40,498	4,931
繰延税金負債	2,293	2,159
賞与引当金	30,058	12,314
その他の流動負債	218,411	164,810
流動負債計	16,827,865	17,863,342
固定負債		
社債	1,204,711	1,220,156
長期借入金	1,004,988	1,004,862
繰延税金負債	19,151	13,186
退職給付に係る負債	38,417	38,900
訴訟損失引当金	2,174	1,975
その他の固定負債	6,532	6,210
固定負債計	2,275,976	2,285,290
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,970	3,970
特別法上の準備金計	3,970	3,970
負債合計	19,107,812	20,152,603

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	231,889	231,884
利益剰余金	683,939	688,499
自己株式	△29,970	△29,926
自己株式申込証拠金	2	-
株主資本合計	1,133,257	1,137,854
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	98,483	83,290
繰延ヘッジ損益	△32,992	△36,718
為替換算調整勘定	21,082	△9,100
その他の包括利益累計額合計	86,574	37,471
新株予約権	8,958	7,957
非支配株主持分	84,214	84,020
純資産合計	1,313,005	1,267,304
負債・純資産合計	20,420,818	21,419,907

## (2) 【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】

## 【四半期連結損益計算書】

## 【第1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)
<b>営業収益</b>		
受入手数料	80,041	61,693
委託手数料	21,035	13,888
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	9,031	5,366
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	11,226	6,320
その他の受入手数料	38,748	36,119
トレーディング損益	49,043	33,379
株券等トレーディング損益	10,606	2,063
債券・為替等トレーディング損益	38,437	31,315
営業投資有価証券関連損益	3,704	4,802
金融収益	37,830	35,726
その他の営業収益	20,768	16,257
<b>営業収益計</b>	<b>191,389</b>	<b>151,859</b>
金融費用	23,978	26,633
その他の営業費用	12,746	11,177
純営業収益	154,663	114,049
<b>販売費・一般管理費</b>		
取引関係費	18,871	16,385
人件費	※1 49,358	※1 43,240
不動産関係費	9,287	8,744
事務費	6,501	6,233
減価償却費	5,953	5,897
租税公課	2,895	2,559
貸倒引当金繰入れ	26	5
その他	2,681	2,963
<b>販売費・一般管理費計</b>	<b>95,574</b>	<b>86,029</b>
営業利益	59,088	28,019
<b>営業外収益</b>		
受取配当金	1,300	1,238
持分法による投資利益	2,045	2,670
その他	1,360	703
<b>営業外収益計</b>	<b>4,706</b>	<b>4,613</b>
<b>営業外費用</b>		
支払利息	375	5
為替差損	48	-
社債発行費	103	21
その他	153	68
<b>営業外費用計</b>	<b>681</b>	<b>95</b>
経常利益	63,113	32,537

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	50	-
持分変動利益	3,092	-
新株予約権戻入益	-	1,228
特別利益計	3,143	1,228
特別損失		
減損損失	328	-
金融商品取引責任準備金繰入れ	2	-
事業再編関連費用	-	44
MMF等償還関連費用	-	162
特別損失計	330	207
税金等調整前四半期純利益	65,926	33,559
法人税、住民税及び事業税	26,246	5,495
法人税等調整額	△6,610	3,479
法人税等合計	19,636	8,974
四半期純利益	46,290	24,584
非支配株主に帰属する四半期純利益	1,453	13
親会社株主に帰属する四半期純利益	44,836	24,571

【四半期連結包括利益計算書】

【第1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)
四半期純利益	46,290	24,584
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△2,104	△15,134
繰延ヘッジ損益	4,803	△3,786
為替換算調整勘定	12,898	△29,940
持分法適用会社に対する持分相当額	79	△419
その他の包括利益合計	15,676	△49,281
四半期包括利益	61,966	△24,697
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	60,360	△24,531
非支配株主に係る四半期包括利益	1,605	△165

【注記事項】

(追加情報)

当第1四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)
「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当第1四半期連結会計期間から適用しております。

(四半期連結貸借対照表関係)

※1 資産の金額から直接控除している貸倒引当金の額

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
投資その他の資産・その他	6,278百万円	6,273百万円

2 保証債務

被保証者(被保証債務の内容)は以下のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
従業員(借入金)	177百万円	163百万円
その他(債務)	1,749	—
計	1,927	163

(四半期連結損益計算書関係)

※1 人件費に含まれている賞与引当金繰入額

	前第1四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)
	16,039百万円	11,248百万円

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

当第1四半期連結累計期間に係る四半期連結キャッシュ・フロー計算書は作成しておりません。なお、第1四半期連結累計期間に係る減価償却費(のれんを除く無形固定資産に係る償却費を含む。)、のれんの償却額は、次のとおりであります。

	前第1四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)
減価償却費	7,498百万円	6,839百万円
のれんの償却額	267	290

(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年5月15日 取締役会	普通株式	利益剰余金	27,449	16	平成27年3月31日	平成27年6月1日

(注) 平成27年5月15日取締役会決議の配当金の総額には、日本マスタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する123百万円が含まれております。

2 基準日が当第1四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第1四半期連結会計期間の  
末日後となるもの

該当事項はありません。

当第1四半期連結累計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年5月18日 取締役会	普通株式	利益剰余金	20,308	12	平成28年3月31日	平成28年6月6日

2 基準日が当第1四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第1四半期連結会計期間の  
末日後となるもの

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

前第1四半期連結累計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日)

1 報告セグメントごとの純営業収益及び利益の金額に関する情報

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他 (注)1	合計
	リテール 部門	ホール セール 部門	アセット・ マネジメン ト部門	投資部門	計		
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	56,017	57,061	21,847	4,405	139,331	9,207	148,539
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	8,613	112	△6,358	△170	2,197	2,936	5,133
計	64,631	57,174	15,488	4,234	141,529	12,144	153,673
セグメント利益(経常利益)	24,263	24,027	9,260	3,671	61,223	1,672	62,896

(注) 1 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントであり、子会社の統合・管理、銀行、情報サービス、事務代行及び不動産賃貸等の事業が含まれております。

2 上記の純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 報告セグメントの利益の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額及び当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益	金額
報告セグメント計	61,223
「その他」の区分の利益	1,672
のれんの償却額	△77
未実現損益の調整額	△250
その他の調整額	544
四半期連結損益計算書の経常利益	63,113

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

該当事項はありません。

当第1四半期連結累計期間(自平成28年4月1日至平成28年6月30日)

1 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他 (注)1	合計
	リテール 部門	ホール セール 部門	アセット・ マネジメン ト部門	投資部門	計		
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	38,491	43,146	17,562	5,124	104,324	4,143	108,468
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	6,522	280	△5,939	△168	695	4,804	5,499
計	45,013	43,427	11,623	4,956	105,020	8,947	113,968
セグメント利益又はセグメント損失(△)(経常利益又は経常損失(△))	6,566	14,899	6,748	4,624	32,838	△927	31,911

(注) 1 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントであり、子会社の統合・管理、銀行、情報サービス、事務代行及び不動産賃貸等の事業が含まれております。

2 上記の純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 報告セグメントの利益又は損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額及び当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益又は損失(△)	金額
報告セグメント計	32,838
「その他」の区分の損失(△)	△927
のれんの償却額	△77
未実現損益の調整額	△132
その他の調整額	835
四半期連結損益計算書の経常利益	32,537

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

該当事項はありません。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成28年3月31日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	9	10	0
社債	—	—	—
その他	—	—	—
計	9	10	0

2 その他有価証券

(単位：百万円)

種類	取得原価又は 償却原価	連結貸借 対照表計上額	差額
株券	85,905	164,953	79,048
債券	1,971,485	2,033,359	61,874
国債・地方債等	803,866	855,954	52,087
社債	152,998	159,383	6,384
その他	1,014,619	1,018,022	3,402
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	39,414	39,414	—
その他	89,415	86,485	△ 2,929
計	2,186,220	2,324,213	137,993

(注) 1 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。

2 当連結会計年度において、時価のあるその他有価証券について194百万円(うち、株券44百万円、その他150百万円)の減損処理を行っております。

当第1四半期連結会計期間末(平成28年6月30日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	四半期連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	9	10	0
社債	—	—	—
その他	—	—	—
計	9	10	0

2 その他有価証券

(単位：百万円)

種類	取得原価又は 償却原価	四半期連結貸借 対照表計上額	差額
株券	82,420	140,657	58,237
債券	1,925,741	1,993,453	67,712
国債・地方債等	688,324	735,659	47,334
社債	122,200	128,430	6,229
その他	1,115,216	1,129,364	14,148
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	36,836	36,836	—
その他	70,765	65,225	△ 5,539
計	2,115,763	2,236,173	120,409

(注) 1 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。

2 当第1四半期連結累計期間において、時価のあるその他有価証券(株券)について338百万円の減損処理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

前連結会計年度末(平成28年3月31日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,360,358	547,205	3,590,771	437,802
為替予約取引	3,554,129	88,721	3,007,791	73,740
先物・先渡取引	2,807,674	15,934	3,794,833	35,025
スワップ取引	62,211,819	2,812,682	61,767,886	2,410,479
その他	2,295,847	25,963	2,369,313	28,362
リスクリザーブ	—	△6,531	—	—

当第1四半期連結会計期間末(平成28年6月30日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,453,666	474,361	3,861,760	395,802
為替予約取引	2,524,706	124,792	1,843,966	94,863
先物・先渡取引	2,321,788	27,841	3,893,246	32,455
スワップ取引	66,296,312	3,331,207	66,653,966	2,984,045
その他	1,960,803	24,249	2,002,826	26,741
リスクリザーブ	—	△5,752	—	—

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純利益金額及び算定上の基礎並びに潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額	26.24円	14.52円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益金額(百万円)	44,836	24,571
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—	—
普通株式に係る親会社株主に帰属する四半期純利益金額(百万円)	44,836	24,571
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,708,606	1,692,253
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	25.99円	14.43円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益調整額(百万円)	—	—
普通株式増加数(千株)	16,812	10,404
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定に含めなかった潜在株式で、前連結会計年度末から重要な変動があったものの概要	—	—

(注) 前第1四半期連結累計期間において、従業員持株E S O P信託口が保有する当社株式を、「1株当たり四半期純利益金額」及び「潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額」の算定上、期中平均株式数の計算において控除する自己株式に含めております(7,146千株)。なお、当該信託は平成27年7月に終了しております。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 2 【その他】

(剰余金の配当)

平成28年5月18日開催の取締役会において、平成28年3月31日を基準日とする剰余金の配当に関して次のとおり決議いたしました。

- ①配当金の総額 20,308百万円
- ②1株当たりの金額 12円00銭
- ③支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成28年6月6日

(注) 平成28年3月31日現在の株主名簿に記録された株主又は登録質権者に対し支払いを行っております。

## 第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

# 独立監査人の四半期レビュー報告書

平成28年 8月10日

株式会社大和証券グループ本社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 高波博之 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 貞廣篤典 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小倉加奈子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、「経理の状況」に掲げられている株式会社大和証券グループ本社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの連結会計年度の第1四半期連結会計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30日まで）に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書及び注記について四半期レビューを行った。

## 四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して四半期連結財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない四半期連結財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した四半期レビューに基づいて、独立の立場から四半期連結財務諸表に対する結論を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に準拠して四半期レビューを行った。

四半期レビューにおいては、主として経営者、財務及び会計に関する事項に責任を有する者等に対して実施される質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続が実施される。四半期レビュー手続は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して実施される年度の財務諸表の監査に比べて限定された手続である。

当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

## 監査人の結論

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社の平成28年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する第1四半期連結累計期間の経営成績を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

## 利害関係

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

以上

- (注) 1. 上記は四半期レビュー報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（四半期報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは四半期レビューの対象には含まれていません。

