

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7月1日
(第80期Ⅱ)	至	平成28年9月30日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第80期第2四半期（自平成28年7月1日 至平成28年9月30日）

四 半 期 報 告 書

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

株式会社 大和証券グループ本社

目 次

頁

第80期第2四半期 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】	10
1 【株式等の状況】	10
2 【役員の状況】	12
第4 【経理の状況】	13
1 【四半期連結財務諸表】	14
2 【その他】	29
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	30

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11月11日
【四半期会計期間】	第80期第2四半期 (自 平成28年7月1日 至 平成28年9月30日)
【会社名】	株式会社大和証券グループ本社
【英訳名】	Daiwa Securities Group Inc.
【代表者の役職氏名】	執行役社長 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 2 四半期 連結累計期間	第80期 第 2 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 9 月 30 日	自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 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)	349,515	296,977	653,711
純営業収益 (百万円)	278,242	229,145	514,815
経常利益 (百万円)	98,569	65,794	165,148
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益 (百万円)	69,183	55,014	116,848
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	43,852	5,108	57,266
純資産額 (百万円)	1,346,356	1,297,756	1,313,005
総資産額 (百万円)	23,183,711	20,021,642	20,420,818
1 株当たり四半期(当期)純利益金額 (円)	40.41	32.50	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)	40.03	32.31	67.68
自己資本比率 (%)	5.4	6.0	6.0
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△117,638	159,385	221,746
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	356,943	153,518	415,647
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	77,899	△77,195	△229,727
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高 (百万円)	3,190,837	3,494,995	3,273,640

回次	第79期 第 2 四半期 連結会計期間	第80期 第 2 四半期 連結会計期間
会計期間	自 平成27年 7 月 1 日 至 平成27年 9 月 30 日	自 平成28年 7 月 1 日 至 平成28年 9 月 30 日
1 株当たり 四半期純利益金額 (円)	14.19	17.98

(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 2 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2四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次のとおりであります。

なお、文中の将来に関する事項は、当四半期報告書提出日現在において当社グループが判断したものであります。

(1) 日本及び世界の景気、経済情勢、金融市場の変動に関するリスク

日本では、長年の懸念とされてきた社会保障の充実安定化と財政健全化の同時達成による日本経済再生を目指し、平成26年4月に17年ぶりの消費税率の上げが行われました。平成28年1月には、デフレ脱却のため、日本の金融政策史上初めてマイナス金利政策の導入が決定されました。また、平成28年6月には、平成29年4月に予定されていた消費税率10%への上げを平成31年10月まで延期することが発表されました。平成28年9月には、日銀が長短金利に操作目標を明示的に設定する「イールドカーブ・コントロール」が導入されました。消費税増税の延期により財政問題が深刻化したような場合や、金融政策の効果が期待通り得られずデフレが長期化した場合には、日本経済が再び低迷の危機に陥る可能性も否定できません。

米国では、雇用や住宅販売といった主要景気指標に改善の兆しがあるものの、量的金融緩和策の縮小による景気停滞のリスクを孕んでいるほか、新大統領就任後の政策の不透明さから世界経済の先行き不安が続く可能性があります。また、欧州地域においては、ECBによる支援策等により一時の危機的状況は脱したとみられるものの、地政学リスクやシステミックリスクの高まり等により、その先行きは依然として不透明な状況です。中国、新興国においても、依然として、経済成長率のさらなる減速懸念がくすぶっており、予断を許さない状況が続いています。再び、財政状況や経済状況が悪化した場合には、世界的な金融危機や経済危機に発展する可能性も否定できません。

このように、日本における財政政策、金融政策の効果が期待通り得られない場合や、世界景気や経済情勢の停滞若しくは悪化など、日本を取り巻く経済環境に悪影響を及ぼす事象が発生した場合には、企業業績の悪化、株価の下落、為替の変動、金利の変動等により様々なリスクが顕在化することが想定されます。このような事態は、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

2 【経営上の重要な契約等】

当第2四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2四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2四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は2,969億円（前年同期比15.0%減）となりました。受入手数料は総額で1,260億円（同19.4%減）、トレーディング損益が657億円（同9.6%減）となりました。金融収支は214億円（同13.7%減）、純営業収益は2,291億円（同17.6%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費333億円（同10.3%減）、人件費865億円（同8.8%減）などにより、合計で1,718億円（同8.1%減）となりました。

この結果、経常利益は657億円（同33.3%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550億円（同20.5%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 9月期	平成28年 9月期	対前年 増減率	平成27年 9月期	平成28年 9月期	対前年 増減率
リテール部門	121,712	88,734	△27.1%	42,206	11,163	△73.6%
ホールセール部門	95,642	89,333	△6.6%	29,615	32,101	8.4%
アセット・マネジメント部門	27,563	23,052	△16.4%	16,797	13,421	△20.1%
投資部門	5,946	10,681	79.6%	4,840	9,597	98.3%
その他・調整等	27,377	17,342	—	5,109	△489	—
連結 計	278,242	229,145	△17.6%	98,569	65,794	△33.3%

[リテール部門]

日本株取引が減少したことや、国内債券の販売は増加したものの外国債券の販売が減少したことなどから、純営業収益は887億円（前年同期比27.1%減）、経常利益は111億円（同73.6%減）となりました。

[ホールセール部門]

フィクスト・インカムの日本国債、クレジットトレーディングが堅調に推移したものの、エクイティの顧客フローの低下、引受け案件の減少が響き、純営業収益は893億円（同6.6%減）となりました。一方、円高の影響による海外子会社の経費計上額の減少等により、経常利益は321億円（同8.4%増）となりました。

[アセット・マネジメント部門]

不動産アセット・マネジメントビジネスにおける運用資産残高は増加しているものの、公募株式投信や公募公社債投信の期間平均残高が減少したことなどから、純営業収益は230億円（同16.4%減）、経常利益は134億円（同20.1%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106億円（同79.6%増）、経常利益は95億円（同98.3%増）となりました。

(2) 財政状態の分析

<資産の部>

当第2四半期連結会計期間末の総資産は20兆216億円（前連結会計年度末比3,991億円減）となりました。内訳は流動資産が19兆4,701億円（同3,813億円減）であり、このうち現金・預金が3兆5,514億円（同2,166億円増）、有価証券が1兆8,842億円（同2,068億円減）、トレーディング商品が7兆286億円（同4,726億円減）、有価証券担保貸付金が5兆3,558億円（同1,056億円増）となっております。固定資産は5,514億円（同178億円減）となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は18兆7,238億円（同3,839億円減）となりました。内訳は流動負債が16兆4,461億円（同3,816億円減）であり、このうちトレーディング商品が4兆9,132億円（同3,875億円減）、約定見返勘定が5,086億円（同813億円増）、有価証券担保借入金が6兆1,612億円（同2,594億円増）、銀行業における預金が2兆8,146億円（同1,140億円減）となっております。固定負債は2兆2,737億円（同22億円減）であり、このうち社債が1兆2,575億円（同528億円増）、長期借入金が9,580億円（同468億円減）となっております。

純資産合計は1兆2,977億円（同152億円減）となりました。株主資本については、「(8)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857億円（同127億円減）、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△325億円（同4億円増）、為替換算調整勘定は△163億円（同374億円減）となっております。

(3) 繰延税金資産の状況

① 繰延税金資産の算入根拠

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

② 過去5年間の課税所得（繰越欠損金使用前の各年度の実績値）

（単位：百万円）

回次	第75期	第76期	第77期	第78期	第79期
決算年月	平成24年3月	平成25年3月	平成26年3月	平成27年3月	平成28年3月
連結納税グループの課税所得	35,498	△12,727	16,566	△19,262	89,190

（注） 提出会社を連結納税親会社とする連結納税グループの所得を記載しております。また、記載した課税所得は法人税確定申告書上の繰越欠損金控除前の数値であり、その後の変動は反映されていません。

なお、当第2四半期連結会計期間に係る四半期連結貸借対照表上の繰延税金資産131億円のうち、提出会社を親会社とする連結納税会社の計上額合計は85億円であります。

③ 見積りの前提とした税引前当期純利益の見込額

提出会社を連結納税親会社とする連結納税グループの課税所得見積期間を3年とし、同期間の税引前当期純利益を1,496億円と見積もっております。

④ 繰延税金資産・負債の主な発生原因

当第2四半期連結会計期間末現在、四半期連結貸借対照表上の繰延税金資産及び繰延税金負債の内訳は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

当第2四半期連結会計期間 （平成28年9月30日）	
繰延税金資産	
繰越欠損金	47,087
繰延ヘッジ損益	14,235
退職給付に係る負債	12,082
減損損失	9,067
投資有価証券評価損	6,998
賞与引当金	6,225
関係会社株式評価損	6,187
営業投資有価証券関連損益	5,215
未実現利益の消去	4,373
商品有価証券・デリバティブ	4,204
減価償却超過額	3,368
貸倒引当金	1,941
事業税・事業所税	1,657
金融商品取引責任準備金	1,215
その他	9,119
繰延税金資産小計	132,980
評価性引当額	△91,234
繰延税金資産合計	41,746
繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	37,979
その他	2,895
繰延税金負債合計	40,875
繰延税金資産の純額	870

(4) キャッシュ・フローの状況

当第2四半期連結累計期間において、営業活動によるキャッシュ・フローは、トレーディング商品の増減、有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減及び銀行業における預金の増減などにより1,593億円の増加（前年同四半期は1,176億円の減少）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、有価証券の取得による支出や有価証券の売却及び償還による収入などにより1,535億円の増加（同3,569億円の増加）となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金の純増減、長期借入れによる収入や長期借入金の返済による支出、社債の発行による収入や社債の償還による支出などにより771億円の減少（同778億円の増加）となりました。これらに為替変動の影響等を加えた結果、当第2四半期連結会計期間末の現金及び現金同等物の残高は、前連結会計年度末に比べ2,213億円増加し、3兆4,949億円となりました。

(5) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第2四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。

(6) 研究開発活動

該当事項はありません。

(7) 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2四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。引き続き先進国経済が相対的に底堅く推移した一方で、新興国経済は減速基調にあります。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、グローバルな金融市場は一時的に混乱しましたが、短期的な影響は限定的であるとの見方が広がると、再び安定を取り戻しました。

米国経済は平成28年1－3月期に、設備投資、輸出、個人消費の伸びが鈍化し、実質GDP成長率が伸び悩みました。しかし、4－6月期に入ると、雇用環境は総体的に良好に推移するなか、個人消費が加速する動きが見られ、実質GDP成長率は前期比年率1.4%増と、4四半期ぶりに前期から加速しました。雇用情勢は引き続き安定しており、米国経済は個人消費をけん引役として堅調な推移を維持しています。一方、民間設備投資については、原油安やドル高などを背景に低迷してきましたが、4－6月期には前期比年率1.0%増と、3四半期ぶりに前四半期を上回るなど、エネルギー企業を中心とした設備投資の抑制に一巡の兆しが見られ始めています。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2015年12月以来、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す。雇用環境は改善しているものの、物価水準が目標としている水準に到達しておらず、FRBによる利上げ時期は徐々に後倒しとなっています。

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、個人消費を下支え役とした緩やかな回復基調が続いています。ユーロ圏の平成28年4－6月期の実質GDP成長率は、純輸出の拡大がプラスに寄与し、前期比年率1.2%増と13四半期連続のプラス成長となりました。足下でも雇用改善や金利低下など、個人消費に対する追い風が継続しており、欧州経済は底堅く推移しています。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、物価上昇率は低迷を続けており、ECBが目標とする水準には遠く及ばない状況にあります。

新興国経済は、停滞が続いています。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重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%増を下回りました。平成28年に入ってから減速傾向をたどっており、平成28年1－3月期、4－6月期の実質GDP成長率はいずれも前年比6.7%増と、リーマン・ショック後の平成21年1－3月期以来の低水準で推移しています。

<日本の状況>

日本経済は「踊り場」局面から脱却する動きが一部に見られるものの、明確なけん引役が不在ななか、海外発の景気下振れリスクを抱えた状況にあります。鉱工業生産は、内需の不振やそれに伴う在庫の積み上がり、さらに輸出の停滞などを主因として、横ばい圏での推移をたどっています。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底堅く推移し、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。労働需給がタイトな状況にあるなか、非製造業を中心とした労働需要の高まりから雇用者数が継続的に増加しており、マクロ経済全体で見た賃金は上昇基調にあります。しかし、金融市場の不安定化や将来不安などを要因として、家計は財布の紐をきつく締めたままの状態にあります。一方、住宅投資については、平成29年4月に予定されていた消費税増税を前にした駆け込み需要を見越した着工の増加に住宅ローン金利の低下などの追い風が加わり、平成28年4—6月期は前期比5.0%増と大幅に増加し、足元でも堅調な推移が続いています。

一方、企業の設備投資は停滞しています。平成28年4—6月期の民間企業設備は2四半期連続で前期比マイナス成長となりました。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見られています。

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で持ち直しの動きが見られた一方、これまで堅調に推移してきたEU向けの輸出は一時的に伸び悩みました。輸入をみると、内需の弱含みを主因として輸入金額の減少が続いています。

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2月に史上初のマイナス金利となりました。平成28年9月には、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を発表し、物価目標の早期達成に向けて、短期金利のみならず長期金利にも直接コントロールを及ぼすことにより、金融政策の軸足を「量」から「金利」へと移行させる新たな金融政策の導入に踏み切りました。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。さらに、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り、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9月末の日経平均株価は16,449円84銭（同年6月末比873円92銭高）、10年国債利回りは△0.094%（同0.128ポイントの上昇）、為替は1ドル101円35銭（同1円46銭の円高）となりました。

(8) 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2四半期月末平均のLCRは154.5%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2四半期月末平均の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7月末 至 平成28年9月末)
適格流動資産	(A)	24,282
資金流出額	(B)	34,720
資金流入額	(C)	19,006
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)	24,282
純資金流出額	(B) - (C)	15,714
連結流動性カバレッジ比率	(D) / ((B) - (C))	154.5%

<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2四半期連結会計期間末の株主資本は、前連結会計年度末比355億円増加し、1兆1,688億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,791億円となりました。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550億円計上した結果、前連結会計年度末比350億円増の7,189億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ7億円減少し、292億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2四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成28年9月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成28年11月11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株で 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7月1日～ 平成28年9月30日	—	1,749,378	—	247,397	—	226,751

(6) 【大株主の状況】

平成28年9月30日現在

氏名又は名称	住所	所有株式数 (千株)	発行済株式 総数に対する 所有株式数 の割合(%)
STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY 505223 (常任代理人 株式会社みずほ銀行)	P. O. BOX 351 BOSTON MASSACHUSETTS 02101 U. S. A. (東京都港区港南二丁目15番1号)	150,734	8.61
日本トラスティ・サービス信託 銀行株式会社(信託口)	東京都中央区晴海一丁目8番11号	65,107	3.72
日本マスタートラスト信託銀行 株式会社(信託口)	東京都港区浜松町二丁目11番3号	55,649	3.18
パークレイズ証券株式会社	東京都港区六本木六丁目10番1号	34,000	1.94
太陽生命保険株式会社	東京都中央区日本橋二丁目7番1号	31,140	1.78
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	30,328	1.73
日本トラスティ・サービス信託 銀行株式会社(信託口9)	東京都中央区晴海一丁目8番11号	26,211	1.49
STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY 505001 (常任代理人 株式会社みずほ銀行)	P. O. BOX 351 BOSTON MASSACHUSETTS 02101 U. S. A. (東京都港区港南二丁目15番1号)	25,527	1.45
日本トラスティ・サービス信託 銀行株式会社・三井住友信託退 給口	東京都中央区晴海一丁目8番11号	24,888	1.42
日本トラスティ・サービス信託 銀行株式会社(信託口7)	東京都中央区晴海一丁目8番11号	24,410	1.39
計	—	467,994	26.71

(注) 当社は、平成28年9月30日現在、自己株式55,675千株(発行済株式総数に対する所有株式数の割合は3.18%)を所有しておりますが、上記大株主から除外しております。

(7) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

平成28年9月30日現在

区分	株式数(株)	議決権の数(個)	内容
無議決権株式	—	—	—
議決権制限株式(自己株式等)	—	—	—
議決権制限株式(その他)	—	—	—
完全議決権株式(自己株式等)	(自己保有株式) 普通株式 55,675,000	—	—
	(相互保有株式) 普通株式 1,626,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,689,500,000	1,689,500	—
単元未満株式	普通株式 2,577,772	—	—
発行済株式総数	1,749,378,772	—	—
総株主の議決権	—	1,689,500	—

(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474株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成28年9月30日現在

所有者の氏名 又は名称	所有者の住所	自己名義 所有株式数 (株)	他人名義 所有株式数 (株)	所有株式数 の合計 (株)	発行済株式 総数に対する 所有株式数 の割合(%)
(自己保有株式) 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	55,675,000	—	55,675,000	3.18
計	—	55,675,000	—	55,675,000	3.18

(注) 1 当社は、単元未満自己株474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1,626,000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2四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2四半期連結会計期間（平成28年7月1日から平成28年9月30日まで）及び第2四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28年9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 2 四半期連結会計期間 (平成28年 9 月30 日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,334,784	3,551,431
預託金	323,761	327,521
受取手形及び売掛金	17,090	14,567
有価証券	2,091,090	1,884,250
トレーディング商品	7,501,242	7,028,640
商品有価証券等	4,017,267	3,630,342
デリバティブ取引	3,483,975	3,398,297
営業投資有価証券	127,210	134,148
投資損失引当金	△11,053	△11,372
営業貸付金	432,785	486,664
仕掛品	503	1,097
信用取引資産	203,376	190,714
信用取引貸付金	183,654	164,713
信用取引借証券担保金	19,722	26,000
有価証券担保貸付金	5,250,135	5,355,831
借入有価証券担保金	5,184,274	5,232,980
現先取引貸付金	65,861	122,851
立替金	20,670	16,955
短期貸付金	288	658
未収収益	33,574	29,841
繰延税金資産	9,401	7,779
その他の流動資産	517,421	452,107
貸倒引当金	△722	△645
流動資産計	19,851,563	19,470,191
固定資産		
有形固定資産	124,562	122,417
無形固定資産	84,879	86,312
のれん	7,972	6,956
その他	76,907	79,356
投資その他の資産	359,812	342,721
投資有価証券	324,456	308,501
長期貸付金	4,954	4,947
長期差入保証金	17,523	17,314
繰延税金資産	5,679	5,420
その他	※1 7,942	※1 7,288
貸倒引当金	※1 △743	※1 △751
固定資産計	569,255	551,451
資産合計	20,420,818	20,021,642

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年 3 月31日)	当第 2 四半期連結会計期間 (平成28年 9 月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	6,413	5,062
トレーディング商品	5,300,861	4,913,273
商品有価証券等	2,315,450	1,888,656
デリバティブ取引	2,985,410	3,024,616
約定見返勘定	427,257	508,631
信用取引負債	54,387	62,626
信用取引借入金	3,789	4,190
信用取引貸証券受入金	50,597	58,435
有価証券担保借入金	5,901,794	6,161,208
有価証券貸借取引受入金	5,893,795	6,088,764
現先取引借入金	7,999	72,443
銀行業における預金	2,928,630	2,814,623
預り金	214,498	242,792
受入保証金	512,426	447,058
短期借入金	820,019	827,015
コマーシャル・ペーパー	137,720	-
1年内償還予定の社債	232,594	275,339
未払法人税等	40,498	14,854
繰延税金負債	2,293	1,623
賞与引当金	30,058	23,389
その他の流動負債	218,411	148,697
流動負債計	16,827,865	16,446,195
固定負債		
社債	1,204,711	1,257,591
長期借入金	1,004,988	958,097
繰延税金負債	19,151	10,706
退職給付に係る負債	38,417	39,468
訴訟損失引当金	2,174	1,697
その他の固定負債	6,532	6,159
固定負債計	2,275,976	2,273,720
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	18,723,886

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年 3 月 31 日)	当第 2 四半期連結会計期間 (平成28年 9 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	231,754
利益剰余金	683,939	718,943
自己株式	△29,970	△29,254
自己株式申込証拠金	2	5
株主資本合計	1,133,257	1,168,845
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	85,702
繰延ヘッジ損益	△32,992	△32,547
為替換算調整勘定	21,082	△16,350
その他の包括利益累計額合計	86,574	36,805
新株予約権	8,958	8,059
非支配株主持分	84,214	84,045
純資産合計	1,313,005	1,297,756
負債・純資産合計	20,420,818	20,021,642

(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2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業収益		
受入手数料	156,502	126,067
委託手数料	39,452	27,085
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	18,591	13,640
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	20,666	13,357
その他の受入手数料	77,792	71,982
トレーディング損益	72,724	65,764
株券等トレーディング損益	12,535	7,378
債券・為替等トレーディング損益	60,188	58,386
営業投資有価証券関連損益	5,195	10,416
金融収益	73,166	68,815
その他の営業収益	41,927	25,913
営業収益計	349,515	296,977
金融費用	48,267	47,334
その他の営業費用	23,005	20,497
純営業収益	278,242	229,145
販売費・一般管理費		
取引関係費	37,175	33,364
人件費	※1 94,974	※1 86,596
不動産関係費	18,974	17,283
事務費	13,079	12,240
減価償却費	11,874	11,602
租税公課	5,044	5,026
貸倒引当金繰入れ	201	8
その他	5,531	5,680
販売費・一般管理費計	186,856	171,802
営業利益	91,386	57,342
営業外収益		
受取配当金	2,396	2,577
持分法による投資利益	3,762	4,974
為替差益	151	-
その他	1,894	1,367
営業外収益計	8,205	8,918
営業外費用		
支払利息	381	10
為替差損	-	70
社債発行費	390	241
その他	250	143
営業外費用計	1,022	466
経常利益	98,569	65,794

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	51	-
持分変動利益	3,092	768
貸倒引当金戻入額	633	-
新株予約権戻入益	-	1,228
事業再編関連費用戻入益	-	680
その他	-	158
特別利益計	3,777	2,836
特別損失		
減損損失	336	-
投資有価証券評価損	-	205
金融商品取引責任準備金繰入れ	2	-
事業再編関連費用	282	54
子会社清算損	-	769
MMF等償還関連費用	-	260
特別損失計	621	1,290
税金等調整前四半期純利益	101,725	67,340
法人税、住民税及び事業税	39,152	16,188
法人税等調整額	△8,095	△3,910
法人税等合計	31,057	12,277
四半期純利益	70,668	55,062
非支配株主に帰属する四半期純利益	1,484	47
親会社株主に帰属する四半期純利益	69,183	55,014

【四半期連結包括利益計算書】

【第2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
四半期純利益	70,668	55,062
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△30,707	△12,706
繰延ヘッジ損益	3,874	346
為替換算調整勘定	16	△36,720
持分法適用会社に対する持分相当額	0	△873
その他の包括利益合計	△26,816	△49,954
四半期包括利益	43,852	5,108
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	42,378	5,245
非支配株主に係る四半期包括利益	1,473	△137

(3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前四半期純利益	101,725	67,340
減価償却費	14,614	13,908
のれん償却額	537	560
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	△560	△4
金融商品取引責任準備金の増減額 (△は減少)	2	-
受取利息及び受取配当金	△2,420	△2,580
支払利息	381	10
持分法による投資損益 (△は益)	△3,762	△4,974
投資有価証券売却損益 (△は益)	△51	-
持分変動損益 (△は益)	△3,092	△768
減損損失	336	-
投資有価証券評価損益 (△は益)	-	205
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	22,783	△19,451
トレーディング商品の増減額	△207,936	67,968
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	2,149	△8,334
営業貸付金の増減額 (△は増加)	△89,021	△55,451
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	△22,396	20,900
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	△231,124	186,401
短期貸付金の増減額 (△は増加)	69	△13
銀行業における預金の増減額 (△は減少)	219,513	△114,006
短期差入保証金の増減額 (△は増加)	△26,272	△15,070
受入保証金の増減額 (△は減少)	32,908	△64,988
預り金の増減額 (△は減少)	55,152	30,616
その他	525	96,930
小計	△135,938	199,200
利息及び配当金の受取額	4,014	6,553
利息の支払額	△387	△11
法人税等の支払額又は還付額 (△は支払)	14,673	△46,357
営業活動によるキャッシュ・フロー	△117,638	159,385
投資活動によるキャッシュ・フロー		
定期預金の預入による支出	△110,013	△49,594
定期預金の払戻による収入	107,378	57,009
有価証券の取得による支出	△498,461	△370,958
有価証券の売却及び償還による収入	916,759	529,436
有形固定資産の取得による支出	△40,340	△2,176
有形固定資産の売却による収入	20	-
無形固定資産の取得による支出	△12,503	△14,313
投資有価証券の取得による支出	△6,973	△4,017
投資有価証券の売却及び償還による収入	1,206	7,955
関係会社株式の取得による支出	-	△1,927
貸付けによる支出	△1,241	△522
貸付金の回収による収入	1,185	2,381
その他	△74	246
投資活動によるキャッシュ・フロー	356,943	153,518

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入金の純増減額（△は減少）	△46,885	△64,059
長期借入れによる収入	202,658	97,500
長期借入金の返済による支出	△86,402	△201,200
社債の発行による収入	261,683	232,631
社債の償還による支出	△255,595	△122,312
自己株式の売却による収入	8,786	590
自己株式の取得による支出	△26	△8
配当金の支払額	△27,449	△20,308
連結の範囲の変更を伴わない子会社株式の取得 による支出	△1,464	-
非支配株主からの払込みによる収入	24,909	-
その他	△2,314	△27
財務活動によるキャッシュ・フロー	77,899	△77,195
現金及び現金同等物に係る換算差額	161	△13,315
現金及び現金同等物の増減額（△は減少）	317,366	222,392
現金及び現金同等物の期首残高	2,920,509	3,273,640
新規連結に伴う現金及び現金同等物の増加額	-	1,144
連結除外に伴う現金及び現金同等物の減少額	△47,039	△2,182
現金及び現金同等物の四半期末残高	※1 3,190,837	※1 3,494,995

【注記事項】

(追加情報)

当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9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2四半期連結会計期間 (平成28年9月30日)
投資その他の資産・その他	6,278百万円	6,310百万円

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2四半期連結会計期間 (平成28年9月30日)
従業員(借入金)	177百万円	157百万円
その他(債務)	1,749	—
計	1,927	157

(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2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
	28,957百万円	23,143百万円

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

※1 現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係は、次のとおりであります。

	前第2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
現金・預金勘定	3,248,097百万円	3,551,431百万円
預入期間が3ヶ月を 超える定期預金等	△67,260	△56,436
預入期間が3ヶ月 以内の譲渡性預金	10,000	—
現金及び現金同等物	3,190,837	3,494,995

(株主資本等関係)

前第2四半期連結累計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9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2四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2四半期連結会計期間の
末日後となるもの

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10月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	29,215	17	平成27年9月30日	平成27年12月1日

(注) 平成27年9月30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います。

当第2四半期連結累計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9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2四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2四半期連結会計期間の
末日後となるもの

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10月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	22,018	13	平成28年9月30日	平成28年12月1日

(注) 平成28年9月30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います。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

前第2四半期連結累計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9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	105,298	95,620	40,966	6,269	248,154	17,815	265,970
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	16,414	21	△13,402	△322	2,711	8,087	10,798
計	121,712	95,642	27,563	5,946	250,865	25,903	276,769
セグメント利益(経常利益)	42,206	29,615	16,797	4,840	93,460	5,412	98,872

(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	金額
報告セグメント計	93,460
「その他」の区分の利益	5,412
セグメント間取引消去	△2
のれんの償却額	△154
未実現損益の調整額	△981
その他の調整額	834
四半期連結損益計算書の経常利益	98,569

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2四半期連結累計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9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	75,829	88,876	34,794	11,021	210,520	7,473	217,994
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	12,905	457	△11,741	△339	1,281	10,027	11,309
計	88,734	89,333	23,052	10,681	211,802	17,501	229,303
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(△))	11,163	32,101	13,421	9,597	66,283	△1,449	64,833

(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	66,283
「その他」の区分の損失(△)	△1,449
セグメント間取引消去	0
のれんの償却額	△154
未実現損益の調整額	△238
その他の調整額	1,352
四半期連結損益計算書の経常利益	65,794

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2四半期連結会計期間末(平成28年9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	6,400	6,436	36
その他	—	—	—
計	6,409	6,446	36

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	81,972	148,555	66,582
債券	1,779,108	1,837,828	58,719
国債・地方債等	678,065	720,054	41,988
社債	112,114	116,572	4,457
その他	988,928	1,001,202	12,274
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	37,030	37,030	—
その他	70,269	67,195	△ 3,073
計	1,968,380	2,090,609	122,228

- (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2四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476百万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2四半期連結会計期間末(平成28年9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	3,417,986	464,292	3,773,130	392,239
為替予約取引	2,111,733	59,317	2,164,173	49,433
先物・先渡取引	3,089,615	20,859	3,269,782	17,342
スワップ取引	69,334,484	2,833,863	71,503,680	2,536,817
その他	1,987,692	25,140	2,115,048	28,784
リスクリザーブ	—	△ 5,175	—	—

(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2四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額	40.41円	32.50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)	69,183	55,014
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)	69,183	55,014
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,712,224	1,692,720
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	40.03円	32.31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)	16,174	10,126
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2四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(4,655千株)。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)

(自己株式の取得)

当社は、平成28年10月28日開催の取締役会において、会社法第459条第1項の規定による定款の定めに基づき、自己株式取得に係る事項について決議いたしました。

(1) 自己株式の取得を行う理由

昨今の株式市場の動向を踏まえ、資本効率の向上を通じて株主への利益還元を図るため、自己株式の取得をするものであります。

(2) 取得に係る事項の内容

- | | |
|-------------|--|
| ①取得する株式の種類 | 当社普通株式 |
| ②取得する株式の総数 | 3,000万株(上限)
(発行済株式総数(自己株式を除く)に対する割合1.77%) |
| ③株式の取得価額の総額 | 200億円(上限) |
| ④期間 | 平成28年10月31日から平成29年1月25日 |
| ⑤取得方法 | 信託方式による市場買付 |

2 【その他】

(剰余金の配当)

平成28年10月28日開催の取締役会において、平成28年9月30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	22,018百万円
②1株当たりの金額	13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12月1日

(注) 平成28年9月30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います。

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

平成28年11月11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2四半期連結会計期間（平成28年7月1日から平成28年9月30日まで）及び第2四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28年9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、四半期連結キャッシュ・フロー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9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する第2四半期連結累計期間の経営成績及びキャッシュ・フローの状況を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

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。

