

有 価 証 券 報 告 書

(金融商品取引法第24条第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) 至 平成29年3月31日

株式会社 大和証券グループ本社

(E03753)

第80期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

有 価 証 券 報 告 書

- 1 本書は金融商品取引法第24条第1項に基づく有価証券報告書を、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有価証券報告書に添付された監査報告書及び上記の有価証券報告書と併せて提出した内部統制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 有価証券報告書

【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 【沿革】	4
3 【事業の内容】	6
4 【関係会社の状況】	7
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 【経営方針、経営環境及び対処すべき課題等】	10
3 【事業等のリスク】	11
4 【経営上の重要な契約等】	19
5 【研究開発活動】	19
6 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】	19
第3 【設備の状況】	26
1 【設備投資等の概要】	26
2 【主要な設備の状況】	26
3 【設備の新設、除却等の計画】	27
第4 【提出会社の状況】	28
1 【株式等の状況】	28
2 【自己株式の取得等の状況】	67
3 【配当政策】	69
4 【株価の推移】	69
5 【役員の状況】	70
6 【コーポレート・ガバナンスの状況等】	78
第5 【経理の状況】	91
1 【連結財務諸表等】	92
2 【財務諸表等】	154
第6 【提出会社の株式事務の概要】	164
第7 【提出会社の参考情報】	166
1 【提出会社の親会社等の情報】	166
2 【その他の参考情報】	166
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	168

監査報告書

内部統制報告書

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条第1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年6月29日
【事業年度】	第80期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31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 中 田 誠 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 平 井 鉄 心
【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 平 井 鉄 心
【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】

(1) 連結経営指標等

回次	第76期	第77期	第78期	第79期	第80期
決算年月	平成25年 3 月	平成26年 3 月	平成27年 3 月	平成28年 3 月	平成29年 3 月
営業収益 (百万円)	525, 411	642, 829	659, 396	653, 711	616, 497
純営業収益 (百万円)	417, 308	541, 951	532, 220	514, 815	472, 750
経常利益 (百万円)	95, 176	197, 045	184, 578	165, 148	135, 623
親会社株主に帰属する 当期純利益 (百万円)	72, 909	169, 457	148, 490	116, 848	104, 067
包括利益 (百万円)	139, 326	221, 257	217, 005	57, 266	84, 835
純資産額 (百万円)	1, 082, 567	1, 253, 462	1, 434, 680	1, 313, 005	1, 343, 433
総資産額 (百万円)	19, 049, 099	19, 480, 863	23, 001, 585	20, 420, 818	19, 827, 296
1 株当たり純資産額 (円)	536. 72	633. 53	725. 27	720. 86	745. 80
1 株当たり当期純利益金額 (円)	43. 00	99. 63	87. 07	68. 25	61. 53
潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額 (円)	42. 89	98. 71	86. 28	67. 68	61. 14
自己資本比率 (%)	4. 8	5. 5	5. 4	6. 0	6. 3
自己資本利益率 (%)	8. 6	17. 0	12. 8	9. 5	8. 4
株価収益率 (倍)	15. 3	9. 0	10. 8	10. 1	11. 0
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	1, 795, 021	1, 123, 594	725, 966	221, 746	44, 543
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△798, 491	△448, 493	△13, 265	415, 647	307, 713
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△909, 461	25, 584	343, 385	△229, 727	143, 231
現金及び現金同等物 の期末残高 (百万円)	1, 136, 053	1, 846, 617	2, 920, 509	3, 273, 640	3, 766, 145
従業員数 [外 平均臨時従業員数] (人)	13, 426 [479]	13, 317 [666]	13, 466 [847]	13, 701 [940]	13, 836 [945]

(注) 1 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。

2 従業員数は、就業人員数を表示しております。

(2) 提出会社の経営指標等

回次	第76期	第77期	第78期	第79期	第80期
決算年月	平成25年 3 月	平成26年 3 月	平成27年 3 月	平成28年 3 月	平成29年 3 月
営業収益 (百万円)	21, 703	18, 730	165, 915	28, 238	34, 648
経常利益 又は経常損失 (△) (百万円)	1, 010	△746	146, 620	8, 084	13, 625
当期純利益 (百万円)	26, 993	4, 317	149, 071	9, 732	24, 870
資本金 (百万円)	247, 397	247, 397	247, 397	247, 397	247, 397
発行済株式総数 (千株)	1, 749, 378	1, 749, 378	1, 749, 378	1, 749, 378	1, 699, 378
純資産額 (百万円)	903, 836	872, 473	994, 703	923, 969	889, 514
総資産額 (百万円)	2, 041, 500	2, 066, 024	2, 338, 100	2, 336, 810	2, 352, 744
1 株当たり純資産額 (円)	528. 28	508. 14	577. 62	540. 68	525. 13
1 株当たり配当額 (うち 1 株当たり中間配当額) (円)	15. 00 (3. 00)	34. 00 (17. 00)	30. 00 (14. 00)	29. 00 (17. 00)	26. 00 (13. 00)
1 株当たり当期純利益金額 (円)	15. 92	2. 54	87. 41	5. 68	14. 70
潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額 (円)	15. 88	2. 51	86. 61	5. 64	14. 61
自己資本比率 (%)	44. 0	41. 9	42. 2	39. 2	37. 4
自己資本利益率 (%)	3. 1	0. 5	16. 1	1. 0	2. 8
株価収益率 (倍)	41. 2	353. 8	10. 8	121. 8	46. 1
配当性向 (%)	94. 2	1, 339. 5	34. 3	510. 2	176. 8
従業員数 (人)	8 [614]	9 [602]	6 [595]	4 [593]	4 [612]

(注) 1 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。

2 従業員数は就業人員数であり、大和証券株式会社との兼務者数は [] 内に外数で記載しております。

2 【沿革】

年月	概要
昭和18年12月27日	「藤本証券㈱」と「㈱日本信託銀行」が対等合併し、「大和証券㈱」を設立。
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6月	ニューヨーク駐在員事務所開設。
12月	「大和証券投資信託委託㈱」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4月	ロンドン駐在員事務所開設。
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。（現「大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.」）
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。
12月	香港に「大和証券国際(香港)有限公司」設立。（現「大和証券キャピタル・マーケット香港リミテッド」）
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「大和証券キャピタル・マーケットシンガポールリミテッド」）
48年6月	「大和投資顧問㈱」設立。（現「大和住銀投信投資顧問㈱」）
50年8月	「大和コンピューターサービス㈱」設立。（現「㈱大和総研ホールディングス」）
56年3月	ロンドンに「大和ヨーロッパリミテッド」設立。（現「大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパリミテッド」）
57年5月	「㈱大和証券経済研究所」設立。（現「㈱大和総研ホールディングス」）
8月	「日本インベストメント・ファイナンス㈱」設立。（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）
58年8月	「大和システムサービス㈱」設立。（現「㈱大和総研ホールディングス」）
10月	「大和ファイナンス㈱」設立。（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）
平成元年8月	「大和コンピューターサービス㈱」、「㈱大和証券経済研究所」及び「大和システムサービス㈱」が合併し、「㈱大和総研」発足。（現「㈱大和総研ホールディングス」）
2年3月	ニューヨークに「大和アメリカCorporation」設立。（現「大和証券キャピタル・マーケットアメリカホールディングスInc.」）
6年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「大和証券キャピタル・マーケットアジアホールディングB.V.」）
11年1月	台北に「大和全球証券(股)」設立。（現「大和國泰證券(股)」）
4月	「大和投資顧問㈱」、「住銀投資顧問㈱」及び「エス・ビー・アイ・エム投信㈱」が合併し、「大和住銀投信投資顧問㈱」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・マーケット㈱」へ譲渡、同社営業開始。 リテール証券業務を(新)「大和証券㈱」へ譲渡、同社営業開始。(旧)「大和証券㈱」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、「㈱大和証券グループ本社」に商号変更。
12年4月	「大和ファイナンス㈱」が「日本インベストメント・ファイナンス㈱」と合併、「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ㈱」（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）に商号変更。
13年4月	「大和証券エスビーキャピタル・マーケット㈱」がさくら証券㈱から営業全部を譲受け、「大和証券エスエムビーシー㈱」に商号変更。
10月	「大和証券エスエムビーシー㈱」の100%子会社として、「大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ㈱」を設立。（現「大和P I パートナーズ㈱」）

年月	概要
14年3月	「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ㈱」（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）株式をジャスダック市場に上場。
17年10月	「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ㈱」が「SMB Cキャピタル㈱」と合併、「エヌ・アイ・エフ SMB Cベンチャーズ㈱」（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）に商号変更。
20年10月	（旧）「㈱大和総研」が会社分割による組織再編を行い、（新）「㈱大和総研」と「㈱大和総研ビジネス・イノベーション」を子会社とする持株会社となり、「㈱大和総研ホールディングス」に商号変更。 「エヌ・アイ・エフ SMB Cベンチャーズ㈱」が「大和SMB Cキャピタル㈱」（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）に商号変更。
21年7月	「㈱ダヴィンチ・セレクト」（現「大和リアル・エステート・アセット・マネジメント㈱」）の全株式を取得し、不動産アセットマネジメントビジネスに参入。
9月	「大和SMB Cキャピタル㈱」（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）株式のジャスダック証券取引所における上場を廃止。
22年1月	㈱三井住友フィナンシャルグループ及び㈱三井住友銀行とのホールセール証券事業における合弁解消に伴い、「大和証券エスエムビーシー㈱」が「大和証券キャピタル・マーケッツ㈱」に商号変更。
2月	「大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ㈱」が「大和P I パートナーズ㈱」に商号変更。
7月	「大和SMB Cキャピタル㈱」が「大和企業投資㈱」（現「㈱大和キャピタル・ホールディングス」）に商号変更。
23年5月	「㈱大和ネクスト銀行」がお客さま向けサービスを開始。
24年1月	「大和証券キャピタル・マーケッツヨーロッパリミテッド」、「大和証券キャピタル・マーケッツアジアホールディングB.V.」、「大和証券キャピタル・マーケッツアメリカホールディングスInc.」を「㈱大和証券グループ本社」の子会社「㈱大和インターナショナル・ホールディングス」の傘下へ移管。
4月	「大和証券㈱」が「大和証券キャピタル・マーケッツ㈱」を吸収合併。

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11社）の主たる事業は有価証券関連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、有価証券の引受け及び売出し、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有価証券関連業並びに銀行業その他の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、欧州、アジア、米州の主要な金融市場に営業拠点を設置し、グローバルに展開するネットワークにより世界中のお客様の資金調達と運用の双方のニーズに対応した幅広いサービスを提供しております。

なお、当社は特定上場会社等であります。特定上場会社等に該当することにより、インサイダー取引規制の重要事実の軽微基準については連結ベースの数値に基づいて判断することとなります。

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11社）

〈持株会社〉

(株)大和証券グループ本社

〈主要セグメント〉

〈リテール部門〉

大和証券(株)

他

〈ホールセール部門〉（注）

大和証券(株)

大和証券キャピタル・マーケット
ヨーロッパリミテッド

大和証券キャピタル・マーケット
香港リミテッド

大和証券キャピタル・マーケット
シンガポールリミテッド

大和証券キャピタル・マーケット
アメリカホールディングスInc.

大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.

他

〈アセット・マネジメント部門〉

大和証券投資信託委託(株)

大和住銀投信投資顧問(株)

大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)

他

〈投資部門〉

大和企業投資(株)

大和PIパートナーズ(株)

大和証券SMBCプリンシパル・インベストメンツ(株)

他

〈その他〉

(株)大和総研ホールディングス

(株)大和総研

(株)大和総研ビジネス・イノベーション

(株)大和ネクスト銀行

(株)大和証券ビジネスセンター

大和プロパティ(株)

他

（注） ホールセール部門＝グローバル・マーケット＋グローバル・インベストメント・バンキング

4 【関係会社の状況】

名称	住所	資本金 (百万円)	主要な事業 の内容	議決権の 所有割合 (%)	関係内容
(連結子会社)					
大和証券株式会社 (注) 2、3、5	東京都千代田区	100,000	有価証券関連業 投資助言・代理業	100.0	金銭の貸借 有価証券の貸借 役員の兼任等...有
大和証券投資信託委託株式会社 (注) 5	東京都千代田区	15,174	投資運用業 投資助言・代理業	100.0	役員の兼任等...有
株式会社大和総研ホールディングス	東京都江東区	3,898	子会社の 統合・管理	100.0	役員の兼任等...有
株式会社大和証券ビジネスセンター	東京都江東区	100	事務代行業	100.0	事務代行 役員の兼任等...無
大和プロパティ株式会社 (注) 2	東京都中央区	100	不動産賃貸業	100.0 (0.6)	不動産の貸借 金銭の貸借 役員の兼任等...有
株式会社大和ネクスト銀行 (注) 2、5	東京都千代田区	50,000	銀行業	100.0	役員の兼任等...無
株式会社大和総研 (注) 2	東京都江東区	1,000	情報サービス業	100.0 (100.0)	業務委託 役員の兼任等...有
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	100.0 (100.0)	役員の兼任等...有
大和企業投資株式会社	東京都千代田区	100	投資業	100.0 (100.0)	役員の兼任等...無
大和P I パートナース株式会社	東京都千代田区	12,000	投資業	100.0 (100.0)	金銭の貸借 役員の兼任等...無
大和証券エスエムビーシープリンシ パル・インベストメンツ株式会社	東京都千代田区	100	投資業	60.0 (60.0)	役員の兼任等...無
大和リアル・エステート・アセッ ト・マネジメント株式会社	東京都中央区	200	投資運用業 投資助言・代理業	100.0	役員の兼任等...有
大和証券キャピタル・マーケットツヨ ーロッパリミテッド (注) 2	イギリス ロンドン市	732百万 スターリングポンド	有価証券関連業	100.0 (100.0)	役員の兼任等...有
大和証券キャピタル・マーケットツ香 港リミテッド (注) 2	中国 香港特别行政区	100百万 香港ドル 及び276百万 米ドル	有価証券関連業	100.0 (100.0)	役員の兼任等...無
大和証券キャピタル・マーケットツシン ガポールリミテッド	シンガポール シンガポール市	140百万 シンガポールドル	有価証券関連業	100.0 (100.0)	役員の兼任等...無
大和証券キャピタル・マーケットツア メリカホールディングスInc. (注) 2	アメリカ ニューヨーク市	621百万 米ドル	子会社の 統合・管理	100.0 (100.0)	役員の兼任等...無
大和証券キャピタル・マーケットツア メリカInc. (注) 5	アメリカ ニューヨーク市	100百万 米ドル	有価証券関連業	100.0 (100.0)	役員の兼任等...無
その他35社(注) 4					
(持分法適用関連会社)					
大和住銀投信投資顧問株式会社	東京都千代田区	2,000	投資運用業 投資助言・代理業	44.0	役員の兼任等...無
大和証券オフィス投資法人 (注) 3	東京都中央区	251,551	特定資産に対する 投資運用	37.8 (25.9)	役員の兼任等...無
その他9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 有価証券報告書の提出会社であります。

4 債務超過の状況にある株式会社大和インターナショナル・ホールディングスを含んでおります。
その債務超過額は平成29年3月末時点で14,483百万円であります。

5 営業収益（連結会社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。
各社の当連結会計年度における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	大和証券投資信託委託 株式会社	株式会社 大和ネクスト銀行	大和証券キャピタル・ マーケットツアメリカInc.
営業収益	334,911	80,474	62,821	71,812
純営業収益	314,102	80,474	13,497	29,064
経常利益	85,234	16,935	3,563	9,022
当期純利益	58,461	11,533	2,418	5,740
純資産額	839,193	39,540	133,865	61,412
総資産額	10,285,825	57,795	4,694,889	4,383,501

5 【従業員の状況】

(1) 連結会社の状況

(平成29年3月31日現在)

セグメントの名称	従業員数(人)
リテール部門	6,253
ホールセール部門	2,101
アセット・マネジメント部門	813
投資部門	95
その他	4,574
合計	13,836 [945]

(注) 従業員数は就業人員数であり、臨時従業員数は [] 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29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)
4 [612]	42.1	15.3	10,723,707

セグメントの名称	従業員数(人)
その他	4 [612]

- (注) 1 従業員数は就業人員数であり、大和証券株式会社との兼務者数は [] 内に外数で記載しております。
 2 平均年齢、平均勤続年数及び平均年間給与は大和証券株式会社との兼務者を含めた数値を記載しております。
 3 平均勤続年数は大和証券株式会社等での勤続年数を通算しております。
 4 平均年間給与には、賞与及び基準外賃金を含めております。

(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】

本項における経営目標、予測、並びにその他の将来に関する事項は、有価証券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、これらの目標や予測の達成及び将来の業績等を保証しまたは約束するものではありません。また今後、予告なしに変更されることがあります。

1 【業績等の概要】

(1) 業績

当連結会計年度の営業収益は前年度比5.7%減の6,164億円、純営業収益は同8.2%減の4,727億円となりました。販売費・一般管理費は同3.0%減の3,536億円となり、経常利益は同17.9%減の1,356億円となりました。

これに、特別損益、法人税等及び非支配株主に帰属する当期純利益を計上した結果、親会社株主に帰属する当期純利益は同10.9%減の1,040億円となりました。

セグメント別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28年 3月期	平成29年 3月期	対前年度 増減率	平成28年 3月期	平成29年 3月期	対前年度 増減率
リテール部門	217,922	188,051	△13.7%	61,080	29,375	△51.9%
ホールセール部門	178,014	182,875	2.7%	48,878	65,437	33.9%
アセット・マネジメント部門	50,528	46,438	△8.1%	29,990	26,572	△11.4%
投資部門	19,730	15,736	△20.2%	17,397	13,041	△25.0%
その他・調整等	48,618	39,647	—	7,801	1,196	—
連結計	514,815	472,750	△8.2%	165,148	135,623	△17.9%

[リテール部門]

米大統領選以降、市場環境が好転したこともあり、株式取引や株式投資信託の販売額が増加したものの、活況な株式相場であった前連結会計年度に比べると、純営業収益は前年度比13.7%減の1,880億円、経常利益は同51.9%減の293億円となりました。

[ホールセール部門]

債券トレーディング収益が堅調に推移したことに加え、M&Aアドバイザリー業務など、投資銀行業務収益が前連結会計年度に比べ増加したことから、純営業収益は同2.7%増の1,828億円、経常利益は同33.9%増の654億円となりました。

[アセット・マネジメント部門]

運用資産残高は期末にかけて増加しているものの、公募株式投資信託や公募公社債投資信託の期間平均残高が減少したことなどにより、純営業収益は同8.1%減の464億円、経常利益は同11.4%減の265億円となりました。

[投資部門]

投資案件の回収等が進んだものの、大型投資案件の回収が寄与した前連結会計年度に比べると、純営業収益は同20.2%減の157億円、経常利益は同25.0%減の130億円となりました。

(2) キャッシュ・フローの状況

当連結会計年度において、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、営業貸付金の増減、銀行業における預金の増減などにより、445億円の増加（前年度は2,217億円の増加）となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、定期預金の預入による支出や定期預金の払戻による収入、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、有形固定資産の取得による支出などにより、3,077億円の増加（同4,156億円の増加）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などにより1,432億円の増加（同2,297億円の減少）となりました。これらに為替変動の影響等を加えた結果、当連結会計年度末の現金及び現金同等物の残高は、3兆7,661億円となりました。

2 【経営方針、経営環境及び対処すべき課題等】

平成28年度は、世界の政治、経済において想定外の出来事が続き、ビジネス環境が大きく変化する中、当社グループでは、安定収益基盤の拡大・多様化、グループ全体としてバランスの取れた収益構造の構築に取り組んできた成果が現れ、相応の実績を残した1年となりました。

大和証券グループ創業115周年を迎え、中期経営計画の最終年度となる平成29年度は、「お客様に最も選ばれる総合証券グループ」の実現に向け、“クオリティNo. 1の確立”への取り組みをさらに進化させます。

内外の諸情勢に鑑みると、わが国において20年近く続いたデフレがいよいよ転換点を迎え、「貯蓄から投資」へのマネーシフトに強い追い風が吹く可能性があります。米国大統領の交代を機に、世界経済は、大きく変化する局面を迎えており、多くのお客様からプロフェッショナルとしてのアドバイスが求められております。

役職員一人ひとりが、専門性の高い金融知識“ナレッジ”、そのナレッジを使いお客様へのベストソリューションを創り上げる“テクニック”、そしてお客様を第一に考える“マインド”に徹底的に磨きをかけ、お客様のベストパートナーとなるべく取り組んでいきます。

当社グループは、誠実さと高い専門能力を兼ね揃えたクオリティNo. 1を確立し、「お客様に最も選ばれる総合証券グループ」として、「貯蓄から投資」の流れをリードし、豊かな国民生活と日本の成長戦略に貢献していきます。

平成29年度の各事業部門の事業計画は、以下のとおりであります。

(1) リテール部門

- ① 「ベストパートナー」に相応しい顧客サービスの提供
- ② 安定収益基盤の飛躍的な拡大
- ③ インバウンド、アウトバウンド両面での顧客開発力強化
- ④ ライフステージに応じた付加価値の高い商品・サービスの提供
- ⑤ 外部チャネル・外部リソースを利用した新たなビジネスモデルの構築

(2) ホールセール部門

- ① 顧客ニーズを的確に捉える商品提供能力の向上
- ② アジアを中心としたグローバル戦略の推進
- ③ 次世代成長企業の発掘・育成と成長資金の供給
- ④ 企業のグローバル化、M&Aニーズへのソリューション提供及び米州でのM&A体制の強化

(3) アセット・マネジメント部門

- ① 運用力の強化・向上、パフォーマンス追求
- ② 投資家利益の拡大及び高い外部評価の獲得を目指した商品開発
- ③ 顧客ニーズに対応した商品拡充及び情報発信・サポート力の強化
- ④ 顧客本位の業務運営の徹底
- ⑤ 不動産アセット・マネジメント事業の一層の強化

(4) 投資部門

- ① 投資運用力の強化によるリターン確保
- ② プリンシパル資金の活用によるグループビジネスと連携した投資の実行
- ③ 成長資金の供給等による企業の持続的成長及び新規産業育成支援

(5) その他（大和総研グループ）

- ① グループ各社との連携強化によるシナジー拡大
- ② 経済・金融を柱としたタイムリーな情報発信
- ③ トータルソリューションの提供に向けたコンサルティング力の強化
- ④ ユーザービジネスに貢献する、競争力の高いITを提供

(6) その他（大和ネクスト銀行）

- ① 新規顧客層の拡大（インバウンド強化）
- ② 証銀連携強化による顧客取引促進（機能・サービス拡充）
- ③ ALM（注）運営の強化（マイナス金利下における適切なALM運営）
- ④ 各種管理態勢の強化

（注） ALM（Asset Liability Management）：資産と負債の量を総合的に管理するリスク管理手法

3 【事業等のリスク】

有価証券報告書に記載した事業の状況、経理の状況等に関する事項のうち、投資家の判断に重要な影響を及ぼす可能性があると考えられる主な事項に関し、以下のようなリスクがあげられます。これらのリスクは必ずしもすべてのリスクを網羅したものではなく、現時点では想定していないリスクや重要性が乏しいと考えられるリスクも、今後当社グループの財政状態や経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

なお、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、有価証券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引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%への引上げを平成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、平成28年12月にFOMC（連邦公開市場委員会）の決定により利上げが実施され、今後の追加的な利上げの見通しも示されたことで、米国経済の改善が示唆されましたが、トランプ政権の今後の政策動向次第では先行き不安が高まる可能性があります。欧州地域においては、ECB（欧州中央銀行）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、経済成長率の減速懸念や地政学リスクがくすぶっており、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) 外的要因によるリスク

当社グループの主たる事業である有価証券関連業務は、マーケットに急激な変動を生じさせる予測不可能な出来事の発生により大きな影響を受ける傾向があります。例えば、平成13年9月に発生した米国同時多発テロや、平成23年3月に発生した東日本大震災がもたらした社会・経済・金融等の混乱や危機的状況は、いずれも当社グループの業績に重大な影響を及ぼしました。

このように、戦争・テロ行為、地震・津波・洪水等の自然災害、新型インフルエンザの大流行や情報・通信システム・電力供給といったインフラストラクチャーの障害等の外的要因は、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(3) 競争状況に伴うリスク

株式の売買委託手数料率の自由化をはじめ、ファイアーウォール規制の見直し等、一連の大幅な規制緩和を契機として、当社グループの主たる事業である有価証券関連業務における競争は、厳しいものとなっています。参入規制がほぼ撤廃されて、銀行その他の証券会社以外の国内外の金融グループは、幅広い金融商品・サービスの提供を行うことにより、顧客基盤及び店舗ネットワークを構築・強化しております。

当社グループは、これら国内外の金融グループに対して、競合する事業における価格やサービス面等の点で十分な競争力を発揮できるという保証はなく、これが発揮できない場合には、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。

(4) グループ戦略が奏功しないリスク

当社グループは、有価証券関連業務を中核に投資・金融サービスを行うグループ会社群によって構成されており、これらグループ会社が連携することで付加価値の高い投資・金融サービスを提供し、グループ全体の企業価値を最大化することを目指しております。しかしながら、①国内外の経済・金融情勢が悪化した場合、②競争環境の変化により、当社グループの期待する収益を得られない場合、③当社グループ内外との事業提携・合弁関係、業務委託関係が変動あるいは解消した場合、④当社グループ内の組織運営効率化のための施策が想定どおりに進まない場合、及び⑤法制度の大幅な変更があった場合をはじめとする様々な要因により、上記のグループ戦略に変更が生じる場合や、グループ会社間の業務、その他の連携が十分に機能しない場合には、グループ戦略が功を奏しない可能性や想定していた成果をもたらさない可能性があり、その場合、当社グループの事業、財政状態及び経営戦略に悪影響を及ぼす可能性があります。

(5) 業績の変動性に伴うリスク

当社グループの主たる事業である有価証券関連業務をはじめ、その他の主要業務であるアセット・マネジメント業務、投資業務は、お客様との取引から得られる手数料、トレーディング損益、営業投資有価証券関連損益等が大幅に変動するという特性を持っております。当社グループでは業績の安定性を向上させるべく、リテール部門における預り資産の拡大やホールセール部門の収益構造の多様化、アセット・マネジメント部門における契約資産残高の拡大、市場リスクや信用リスクをはじめとする各種リスクの管理強化、経費管理の徹底等の努力を行っておりますが、これらの施策は有価証券関連業務に伴う業績の変動性をカバーすることを保証するものではなく、とりわけ経済・金融情勢が著しく悪化した場合には、当社グループの業績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

なお、当社グループの過去3連結会計年度における連結業績の推移は次のとおりです。

(単位：百万円)

回次	第78期	第79期	第80期
決算年月	平成27年 3 月	平成28年 3 月	平成29年 3 月
営業収益	659,396	653,711	616,497
純営業収益	532,220	514,815	472,750
経常利益	184,578	165,148	135,623
親会社株主に帰属する 当期純利益	148,490	116,848	104,067

(6) リテール部門におけるビジネス・リスク

リテール部門では、市況の低迷でお客様の証券投資需要が低調となったり、日本の証券市場のリスクを避ける投資行動が強まったり、リスク資産を保有することそのものに対して消極的な傾向が強まったりすると、収益が大きく低下する可能性があります。また、店舗、営業員、オンライン取引システム等を必要とするため、不動産関係費、人件費、システム投資等に係る減価償却費等の固定的経費を要する傾向があります。したがって、上記のような要因により収益が大きく低下したときは、経費抑制努力では対応しきれず、採算割れとなるリスクがあります。

(7) ホールセール部門におけるビジネス・リスク

ホールセール部門は、グローバル・マーケットとグローバル・インベストメント・バンキングの各ビジネスにより構成されております。

グローバル・マーケットにおける現物取引やデリバティブ取引等のトレーディング業務には、市場動向や税制、会計制度の変更等の影響でお客様の取引需要が減少して収益が低下するリスクや、急激かつ大幅な市況変動でディーラーの保有ポジションの時価が不利な方向に変動して損失が発生するリスク、低流動性のポジションを保有していたため市況変動に対応して売却することができず損失が発生するリスク等があります。

これらのうち、主要なものは市場リスク（株式・金利・為替・コモディティ等の相場が変動することにより損失を被るリスク）と信用リスク（与信先の財務状況の悪化等により、資産（オフバランス資産を含む。）の価値が減少ないし消失し、あるいは債務が履行されないことにより損失を被るリスク）です。当社グループでは、各商品のトレーディングにかかるリスクを軽減するために、各商品の過去の市場価格の推移や各商品の価格変動の相関を参考に、必要に応じて様々なヘッジ取引を行っておりますが、予想を超える市場の変動や突発的に発生する個別の事象等により、ヘッジが有効に機能しない可能性もあります。さらに、トレーディング・ポジションの内容が特定の銘柄や業種等に偏ると、ポートフォリオ全体の分散効果が得られにくくなるほか、ポジションの円滑な処分も困難になるため、リスクが顕在化した場合の損失額が大きく膨らむ傾向があります。

グローバル・マーケットにおけるブローカレッジ業務では、市況の低迷でお客様の証券投資需要が低調となったり、日本の証券市場のリスクを避ける投資行動が強まったり、リスク資産を保有することそのものに対して消極的な傾向が強まったりすると、収益が大きく低下する可能性があります。また、法人のお客様向けの大規模な取引システム等を必要とするため、システム投資等に係る減価償却費等の固定的経費を要する傾向があります。したがって、上記のような要因により収益が大きく低下したときは、経費抑制努力では対応しきれず、採算割れとなるリスクがあります。

また、グローバル・インベストメント・バンキングにおいては、法人のお客様の財務面でのニーズに対応して、債券、上場株式、新規公開株式、資産流動化証券等の引受け、募集・売出しを行うほか、仕組み証券やストラクチャード・ファイナンスの組成に関する業務、M&A、事業再編や新規公開に関するアドバイザリー業務も行います。これらの業務には、概して証券市況に影響されて取引規模及び取引量が急激に変動する特性があります。また、引受業務には、引受けた証券が市況の下落等で円滑に投資家に販売できない場合、引受けた証券を保有すること等により、市場価値の下落による損失を被るリスクがあります。引受業務におけるポジション・リスクは、単一の銘柄でかつ巨額なポジションとなり、適時に効果的なリスク回避の手段をとることができないため、通常のトレーディングにおけるポジション・リスクよりも重大なリスクとなり得ます。また、引受業務には、有価証券の募集・売出しにかかる発行開示が適切になされなかった場合には、金融商品取引法に基づき引受会社として投資家から損害賠償請求を受けるリスクがあります。

(8) アセット・マネジメント部門におけるビジネス・リスク

アセット・マネジメント部門の収益は、運用資産の残高に基づく一定料率又は実績連動の報酬です。市場の変動によって運用資産の評価額が下落した場合や、お客様の資産運用の動向が変化（預金等の安定運用志向の高まりを含む。）したり、あるいは当社グループの運用実績が競合他社に比べて低迷する等して、解約等が増加し、運用資産が減少した場合には、当社グループの収益は減少します。

他方、アセット・マネジメント部門の経費構造は、システム関連経費や人件費が中心であって、固定費的な要素が強いため、収益の低下が著しい場合には採算割れとなるリスクがあります。

(9) 投資部門におけるビジネス・リスク

投資部門では、将来、株式公開が見込まれると判断したベンチャー企業等の株式等を取得し、株式公開時に当該株式を売却し利益を得ることを主たる目的とするベンチャー・キャピタル業務や、自己の資金により企業の株式等を取得・保有し、経営改善等によって投資先企業の価値を高めた上で当該株式等を転売し利益を得ることを主たる目的とするプリンシパル・インベストメント業務等を行っています。

ベンチャー企業等は、一般的に、事業運営の歴史が浅く、多くの場合事業運営モデルが確立しておらず、資金調達手法や商品・サービスに対する長期的な需要の確保に不確実性が見られ、また、優秀な人材の継続的雇用も保証されていない等、経営全体の基盤が安定していない傾向が強いといえます。さらに、創業者等の特定の人物に対する依存度が著しく高い場合が多い等、多種多様なリスク要因を包含しています。したがって、投資後に投資先企業の企業価値が低下する場合や投資先企業が倒産する場合もあり、結果として損失を被る可能性があります。

また、一般的に、ベンチャー企業等が株式公開を目指してから実際の公開に至るまでには相当の期間を要することから、投資期間も長期にわたる傾向があります。さらに、投資先企業のすべてが株式公開を実現する保証はなく、投資先企業の株式公開が実現した場合においても、当該企業の株式等の取得原価を上回る価額で当該株式等を株式市場等で売却できるとは限らないため、期待された売却益が実現しない可能性や売却損又は評価損が発生する可能性もあります。

プリンシパル・インベストメント業務は、保有する有価証券やその他の資産のポジションの流動性が低いこと、投資先の分散によるリスク抑制が行い難いこと、保有期間が長いこと、投資開始時点で経営に何らかのリスク要因のある企業を投資対象とする場合が多いこと、売却時に国内外の規制上の障害があつて処分が妨げられたり処分までに長期間を要することがありうる等から、成功した場合のリターンが大きい代わりにリスクも高いビジネスです。保有株式等を転売せずに保有継続する場合には評価損が発生する可能性があり、転売する場合において、取得原価を上回る価額で転売できるとは限らないため、期待された売却益が実現しない可能性や売却損が発生する可能性があります。

(10) 銀行業に伴うビジネス・リスク

当社グループでは、連結子会社である株式会社大和ネクスト銀行（以下、「大和ネクスト銀行」という。）が、同行の銀行代理店である大和証券株式会社（以下、「大和証券」という。）を通じて、お客様向けサービスを提供しております。

大和ネクスト銀行においては、大和証券やインターネット等を通じたお客様からの預金受入れ等により調達した資金を、貸出や債券その他有価証券投資等により運用しておりますが、銀行業は、信用リスク、市場リスク、流動性リスク、システムリスク、コンプライアンスリスク、事務リスク、情報セキュリティリスク、外部委託にかかるリスク、イベントリスク、レピュテーションリスク、自己資本比率低下リスク等、様々なリスクへの対応が必要となります。このような広範に渡るリスクの管理態勢の整備・改善等の対応を進めておりますが、これらの対応が不十分であった場合、マイナス金利政策等による運用資産の利回り低迷や調達金利の上昇等により期待された利鞘が確保できない場合、競合する他の銀行との差別化戦略が期待どおりに進まず競争力が発揮できなかった場合等においては、当社グループの業績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(11) 不動産投資法人に関するリスク

当社グループの持分法適用関連会社である大和証券オフィス投資法人は、投資信託及び投資法人に関する法律に基づく投資法人であり、株式会社東京証券取引所不動産投資信託証券市場に上場し、投資口及び投資法人債の発行並びに金融機関等からの借入れ等により資金調達をし、主としてオフィスビルを中心とした不動産及び不動産を信託財産とする信託受益権等に対して投資し、不動産の賃貸や売却等により回収することを主たる事業としております。

大和証券オフィス投資法人の事業は、市場環境や経済情勢の変動、調達金利の変動、テナントの入退去、賃料の改定・不払い、テナント・信託の受託者その他関係者の倒産等、固定資産税その他諸費用の変動、不動産に係る欠陥・瑕疵の存在、災害等による建物の滅失・劣化・毀損、所有権その他不動産の権利関係、有害物質の存在、環境汚染、行政法規・税法（投資法人と投資主の二重課税を排除するための税法上の要件を含む。）その他法令等の制定・変更、取引所規則等の制定・変更等の様々な事情により影響を受ける可能性があります。これらにより、期待する水準又は時期による賃料や売却収入が得られなかったり、評価損が発生した等の結果、大和証券オフィス投資法人が純損失を計上した場合等には、当社グループの業績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(12) 投資有価証券に関するリスク

当社グループは、提携・友好関係の維持や構築等を目的として、対象企業等の株式等を保有しております。このうち、市場性のある株式等については市場価格の下落により、それ以外の株式等については当該対象企業等の財政状態及び経営成績の悪化等に起因する減損損失あるいは評価損が発生することにより、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。また、上記株式等について、保有意義の希薄化等を理由に売却を実行する際、市場環境若しくは対象企業等の財政状態及び経営成績等によっては、期待する価格又は時期に売却できない可能性があります。

(13) 海外事業に関するリスク

当社グループは現在、アジアを中心とする新興国市場を含め、海外における事業基盤の構築に取り組んでおります。

海外の事業基盤は、国内の事業基盤と比較すると、お客様の取引ニーズの変動や市場環境、政治・金融・経済情勢の変動の影響をより強く受け易く、これらの変動の程度やリスク管理の状況によっては減収又は損失を被る可能性があります。また、海外事業については、投下した資本並びに収益が為替リスクに晒されていることや、現地における法規制等の変更により、当社グループ又は当社グループが出資する合弁会社等の事業が制約を受ける可能性があるほか、投下資本の価値が変動する可能性があります。

(14) 自己資本規制・流動性規制に関するリスク

当社グループは、当社が金融商品取引法上の最終指定親会社に該当するため、「最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成22年金融庁告示第130号）の適用を受け、同告示第2条に基づいて連結自己資本規制比率を所定の比率（連結普通株式等Tier1比率4.5%、連結Tier1比率6%、連結総自己資本規制比率8%。以下、「最低所要連結自己資本規制比率」と総称する。）以上に維持する必要があります。

また、連結子会社のなかにも同様に類似の規制を受けている会社があります。大和証券及びリテラ・クレア証券株式会社は、金融商品取引法に定める自己資本規制比率を同法に基づいて120%以上に維持する必要があります。大和ネクスト銀行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準」（平成18年金融庁告示第19号）に定める自己資本比率（国内基準）を同告示に基づいて4%以上に維持する必要があります。海外の連結子会社についても同様の会社があります。

当社グループは、平成27年3月末より「金融商品取引法第57条の17第1項の規定に基づき、最終指定親会社が当該最終指定親会社及びその子法人等の経営の健全性を判断するための基準として定める最終指定親会社及びその子法人等の経営の健全性のうち流動性に係る健全性の状況を表示する基準」（平成26年金融庁告示第61号）が適用され、同告示に基づいて連結流動性カバレッジ比率を所定の比率（平成27年は60%、以降毎年10%上昇し平成31年以降は100%）以上に維持する必要があります。

また、同時に「金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が経営の健全性の状況を記載した書面に記載すべき事項を定める件第3条第1項の規定に基づき、金融庁長官が別に定める連結レバレッジ比率」（平成27年金融庁告示第11号）が適用され、同告示に基づいて連結レバレッジ比率を算出・開示することが求められています。

また当社グループは、当社が金融商品取引法上の最終指定親会社に該当するため、上記の最低所要連結自己資本規制比率の充足に加え、平成28年3月末から、一定の最低連結資本バッファ比率を充足することも求められています。さらに、当社は平成27年12月に、国際間の合意に沿って金融庁より国内のシステム上重要な銀行（D-SIBs：Domestic Systemically Important Banks）の一つに指定されたため、最終指定親会社に関する告示（平成27年金融庁告示第81号）に基づき、追加的に0.5%を上乗せした最低連結資本バッファ比率を維持する必要があります。なお、この基準は平成28年3月末から3年を経過する日までの間は段階的に適用されることになっています。

当社グループの上記比率又は連結子会社の自己資本規制比率が著しく低下した場合には、レピュテーションリスクの波及や信用水準の低下により流動性懸念が生ずる可能性があります。さらに、上記の各規制により要請される最低基準を下回った場合に有効な対策（資本増強策等）を講じられない場合には、内外の監督当局から業務改善命令や業務の全部又は一部の停止等の措置を受ける可能性があります。

(15) 当社グループが発行する有価証券に関するリスク

当社株式は、東京及び名古屋の各金融商品取引所に上場しており、その売買については金融商品取引法をはじめとする関連法令及び各金融商品取引所が定める諸規則等に基づいて行われております。これらの規則等により、当社に係る重要情報の周知を目的として売買停止の措置がなされ、あるいは当社株式について大量の注文執行により売買が一時的に停止される等、当社株式の売買ができなくなる状況が生じる可能性があります。

当社は、ストック・オプションの目的で新株予約権を発行しておりますが、将来において新株予約権の行使がなされた場合は、1株当たり利益が希薄化する可能性があります。また、当社株式を大量に保有する株主が当社株式を売却することに伴って、株価が下落する可能性があります。

(16) 流動性リスク

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ます。このため、適切な流動性を確保し、財務の安定性を維持することが必要となります。しかし、市場環境の変化や当社グループ各社の財務内容の悪化などにより、資金繰りに支障をきたすこと、あるいは通常よりも著しく高いコストでの資金調達を余儀なくされることにより損失を被るリスクがあります。

当社グループの資金調達が困難になった場合には、保有する資産を圧縮する等の対応が必要となります。しかし、市場環境の悪化により市場全体の流動性が低下すると、当社グループが売却しようとする資産のうち信用度の低い資産の流動性はより一層低下し、保有資産の処分ができなくなったり、取得原価を大幅に下回る価格であっても売却せざるを得なくなるリスクがあります。

こうした流動性リスクが顕在化した場合、当社グループの業務継続が困難になる可能性や、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(17) オペレーショナルリスク

当社グループは、多様な業務を行うことに伴うオペレーショナルリスクに晒されており、かかるリスクが顕在化した場合には、当社グループが損失を被ること等により、当社グループの業績及び社会的信用に悪影響を及ぼす可能性があります。

当社グループは、オペレーショナルリスクを以下のように分類して管理しております。

① 事務リスク

役職員が正確な事務を怠る、あるいは事故・不正等を起こすことにより損失を被るリスク

② システムリスク

コンピュータシステムのダウン又は誤作動、システムの不備等に伴い、損失を被るリスク、さらにコンピュータが不正に使用されることにより損失を被るリスク

③ 情報セキュリティリスク

情報資産に対する脅威の発現のために、情報セキュリティ（機密性、完全性、可用性の維持）が確保されないリスク

④ コンプライアンスリスク

金融商品取引業務等に関し役職員が企業倫理及び法令諸規則等に従わないことにより損失を被るリスク及び顧客等との法的紛争により損失を被るリスク

⑤ リーガルリスク

不適切な契約締結、契約違反により損失を被るリスク

⑥ 人的リスク

労務管理や職場の安全環境上の問題が発生することにより損失を被るリスク、必要な人的資源が確保されないリスク

⑦ 有形資産リスク

自然災害や外部要因又は役職員の過失などの結果、有形資産の毀損等により損失を被るリスク

特に有価証券関連業務においては、取引の執行や決済等を処理するコンピュータシステムのダウン又は誤作動、システムの不備、システムの新規開発・統合等に起因するシステム障害、サイバー攻撃等によるデータの改竄やお客様の情報の流出等が発生した場合、業務が正常に行えなくなることによる機会損失や損害賠償責任の発生、社会的信用の低下等を通じて当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(18) 規制等に関するリスク

当社グループの各社は、その業務の種類に応じた法令や自主規制団体の規程等による規制を受けております。グループの主たる証券会社である大和証券をはじめ、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、大和企業投資株式会社等が、金融商品取引業者として金融商品取引法等の規制を受けているほか、大和ネクスト銀行が銀行法等の規制を受けております。

また、大和証券は貸金業等の兼業業務に関して関係法令上の規制にも服しております。さらに、当社グループは金融商品取引法の定めにより、親法人等・子法人等が関与する行為の弊害防止のため、当該関係を利用した一定の取引の制限や、親法人等・子法人等間での情報授受や利用の制限等を受けており、お客様の利益が不当に害されることがないよう、適切な情報管理と内部管理体制の整備が求められております。また、当社は、一部のグループ各社の主要株主として、監督当局が公益又は投資家保護のために必要かつ適当であると認めるときは報告・資料提出命令を受ける等一定の規制を受ける可能性があります。一方、海外の子会社には現地の法制上、証券会社や金融機関としての規制を受けるものもあります。

なお、当社は、特別金融商品取引業者である大和証券の最終指定親会社として監督当局の連結規制・監督の対象となっております。また、当社グループは「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」における「指定親会社グループ」に該当するとともに、大和ネクスト銀行が銀行営業免許を保有していることに伴い、「金融コングロマリット監督指針」における「事実上の持株会社グループ」に該当することとなり、連結自己資本の適切性を含む一定の事項について連結ベースでの監督を受けております。

加えて、G20（金融・世界経済に関する首脳会合）主導の下、各種金融規制・監督の強化が包括的に進捗中、これらの国際的な金融規制や各国独自の金融規制が当社グループの事業に影響を及ぼす可能性があります。

上記のように、当社グループの事業の多くは行政及び自主規制団体による監督・規制やグローバルな金融規制のもとにあり、将来における法規・規程、政策、規制の変更が当社グループの事業活動や経営体制、さらには当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(19) 法令遵守に関するリスク

当社グループは、グループ全体の内部統制機能を強化し、より充実した内部管理体制の構築に努めるとともに、役職員に対する教育・研修等を通じ、インサイダー取引規制を含め法令遵守の徹底に注力しております。しかしながら、事業を進めていく上で、その執行過程に関与する役職員の故意又は過失により法令違反行為が発生する可能性は排除し得ず、周到な隠蔽行為を伴った意図的な違法行為等については、長期間にわたって発覚しない可能性もあるため、当社グループの業績に悪影響を与えるような規模の損害賠償を取引先等から求められる可能性があります。

さらに、役職員の不正行為のみならず、法人としての当社又はグループ会社に法令違反その他の問題が認められた場合には、監督当局から課徴金の納付命令、業務の制限又は停止等の処分・命令を受ける可能性があります。また、当社グループは情報管理の徹底や「個人情報の保護に関する法律」への対応については万全の体制を敷いていると認識しておりますが、過失や不正行為等により当社グループの保有する顧客情報等各種の情報が外部に流出した場合、当社グループの信用が失墜し、クレームや損害賠償請求、監督当局からの処分等を受ける可能性があります。

当社グループの事業は、お客様からの信用に基づく部分が大きいいため、法令遵守上の問題が発生し当社グループに対する社会的信用が低下した場合には、お客様との取引が減少し、当社グループの業績に悪影響を及ぼす事態が生じる可能性もあります。

(20) 財務報告に係る内部統制に関するリスク

当社は、金融商品取引法の財務報告に係る内部統制に関する規定及び関連する諸規則の施行に伴い、財務報告に係る内部統制に必要な体制整備・運営に努めております。しかしながら、こうした取組みが有効に機能せず、監査法人による内部統制監査の結果、財務報告に係る内部統制に重要な不備が発見された場合等においては、当社グループの社会的信用が低下し、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(21) 訴訟リスク

当社グループでは、経営方針等において、お客様本位の営業姿勢を掲げており、今後もより一層のサービスの拡充に努めていく所存ではありますが、お客様に対する説明不足やお客様との認識の不一致等によってお客様に損失が発生した場合には、当社グループが訴訟の対象となることがあります。その損失が当社グループの責任に起因する場合、当社グループは民法上、金融商品取引法上、又はその他の根拠に基づく損害賠償義務を負う可能性があります。このほか当社グループは、広範な事業を行い、複雑な規制に服していることから、多数の当事者を巻き込み、多額の請求金額に上るものを含め、様々な訴訟リスクに晒されており、訴訟に伴う損害賠償そのもののみならず訴訟内容に起因する社会的信用の低下から当社グループの事業活動や経営体制、財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

また、当社グループが事業に関して使用している商標やビジネスモデル等のなかには、現在出願中のため、権利が確定していないものもあります。当社グループの確認の不備等がなかった場合においても、結果として当社グループが第三者の知的財産権を侵害し、損害賠償請求又は差止請求を受ける可能性があります。

(22) レピュテーションリスク

当社グループの事業は、法人、個人のお客様や市場関係者からの信用に大きく依存しております。「3 事業等のリスク」に記載した事象が発生した場合、特に「(17)オペレーショナルリスク」、「(19)法令遵守に関するリスク」、「(20)財務報告に係る内部統制に関するリスク」及び「(21)訴訟リスク」に記載したように、当社グループや役職員の責任に起因する法令違反や訴訟等が発生した場合には、当社グループの社会的信用が低下する可能性があります。また、憶測に基づいたり、必ずしも正確な事実に基づいていない風説・風評の流布に晒された場合、その内容が正確でないにもかかわらず、当社グループの社会的信用が低下する可能性もあります。その結果、お客様による取引停止等が生じ、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(23) リスク管理方針及び手続の有効性に関するリスク

当社グループは、リスク管理方針及び手続の強化に努めておりますが、リスク管理の有効性は事業内容やグループ内各企業の特性により異なります。また、新しい分野への急速な業務展開に際しては、必ずしも有効に機能しない可能性があります。

リスク管理の前提としては、市場や投資先に関する情報の収集・分析・評価が重要となりますが、その情報自体が不正確、不完全、あるいは最新のものではないことにより、適切な評価が行えない場合があり、また、一部のリスク管理手法においては、過去の動向に基づく定量的判断を伴うものがあるため、予想を超えた変容や突発的事象に対しては、必ずしも有効でない可能性があります。リスク管理が有効に機能しない場合には、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(24) 優秀な人材を確保できないリスク

当社グループでは、有価証券関連業務を中心に高度な専門性を必要とする業務を行っております。いずれの分野でも高いパフォーマンスを発揮するには、優秀な人材の確保が前提となるため、業務特性に応じた人事制度、研修制度の充実及びその継続的な改善に努めております。しかしながら、金融業界内外において、優秀な人材確保への競争は激しく、優秀な人材の採用が困難な状態や外部、特に競合他社への大量流出等が生じた場合には、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(25) 会計基準や税制等の変更に関するリスク

日本の会計基準は国際財務報告基準（ＩＦＲＳ）とのコンバージェンスを進めているところであり、ここ数年の間に数多くの改正が行われ、今後もさらなる改正が予定されております。また、ＩＦＲＳ任意適用を促進する方策も打ち出されており、将来日本においてＩＦＲＳが強制適用される、あるいは当社がＩＦＲＳの任意適用を行う可能性もあります。これらの改正、強制適用あるいは任意適用が行われた場合、当社グループの事業運営や業績等の実体に変動がない場合であっても、例えば収益の認識、資産・負債の評価、連結範囲の見直し等に係る会計処理方法が変更されることに伴い、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。また、税制等が変更されることとなった場合においても、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼす可能性があります。

(26) その他のリスク

当社グループでは、コンピュータシステムの取得・構築に係る投資により発生する償却コスト及び維持・運営コストの増大が業績に悪影響を及ぼす可能性があるほか、店舗・オフィス等の不動産やコンピュータシステム等について、資産の陳腐化や収益性若しくは稼働率の低下が生じた場合又はこれらの処分が行われた場合には、減損処理による損失計上や除売却損失の計上が必要となる可能性もあります。

このほか、当社グループは税効果会計に係る会計基準に基づいて、税務上の便益を将来の課税所得等に関する見積もりや仮定に基づき繰延税金資産として計上しております。実際の課税所得等は見積もりや仮定と異なる可能性があり、将来において繰延税金資産の一部又は全部の回収ができないと判断した場合には繰延税金資産は減額され、当社グループの財政状態及び経営成績に悪影響を及ぼすことになります。

4 【経営上の重要な契約等】

当連結会計年度において、該当事項はありません。

5 【研究開発活動】

該当事項はありません。

6 【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、有価証券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) 重要な会計方針及び見積り

当社の連結財務諸表は、わが国において一般に公正妥当と認められた会計基準に基づき作成されております。また、当社は、連結財務諸表を作成するにあたり、会計方針に基づいていくつかの重要な見積もりを行っており、これらの見積もりは一定の条件や仮定を前提としております。そのため、条件や仮定が変化した場合には、実際の結果が見積もりと異なることがあり、結果として連結財務諸表に重要な影響を与える場合があります。重要な会計方針のうち、特に重要と考える項目は、次の4項目です。

① 金融商品の評価

当社グループでは、トレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引は、時価をもって連結貸借対照表価額とし、評価損益はトレーディング損益として連結損益計算書に計上しております。評価に用いる時価は、市場で取引が行われている有価証券やデリバティブ取引については当連結会計年度末時点の市場価格を、市場価格のない有価証券やデリバティブ取引については理論価格を、それぞれ使用しております。理論価格を算出する際には、対象となる商品や取引について最も適切と考えられるモデルを採用しております。

② 有価証券の減損

当社グループでは、投資有価証券等のトレーディング商品に属さない有価証券を保有しております。このうち時価のある有価証券については、時価が著しく下落したときは、回復する見込みがあると認められる場合を除き、減損処理を行っております。具体的には、当連結会計年度末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合、著しい下落かつ回復する見込みがないものと判断して、減損処理を行っております。時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合、時価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復する見込みを検討し、回復する見込みがないと判断したものについては、減損処理を行っております。また、時価を把握することが極めて困難と認められる有価証券については、実質価額が著しく低下し、かつ、回復する見込みがないと判断した場合には、減損処理を行っております。

③ 固定資産の減損

当社グループでは、各資産グループにおいて、収益性が著しく低下した資産については、当該資産の帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として計上しております。なお、資産のグルーピングは、継続使用資産のうち、証券店舗等の個別性の強い資産については個別物件単位で行い、その他の事業用資産については管理会計上の区分に従って行っております。

④ 繰延税金資産の状況

(i) 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。

(ii) 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、当連結会計年度末に係る連結貸借対照表上の繰延税金資産128億円のうち、提出会社を親会社とする連結納税会社の計上額合計は88億円であります。

(iii) 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2,555億円と見積もっております。

(iv) 繰延税金資産・負債の主な発生原因

「第5 経理の状況 1 連結財務諸表等 (1) 連結財務諸表 注記事項 税効果会計関係 1」に記載のとおりであります。

(2) 当連結会計年度の経営成績の分析

当連結会計年度の営業収益は前年度比5.7%減の6,164億円、純営業収益は同8.2%減の4,727億円となりました。

受入手数料は2,733億円と、同5.2%の減収となりました。委託手数料は、株式取引が減少したことから、同13.3%減の609億円となりました。一方、引受業務では、引受け案件が増加したことにより、引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は、同4.1%増の297億円となりました。

トレーディング損益は、市場環境の悪化により顧客フローが減少したこと等から前年度比2.4%減の1,281億円となりました。

販売費・一般管理費は前年度比3.0%減の3,536億円になりました。大和投資信託の株式投信残高が減少したことによる販売会社等への支払手数料減少等により、取引関係費は同3.6%減の697億円、人件費は業績に連動する賞与の減少等により同4.1%減の1,758億円、備品費等を含む不動産関係費は同5.6%減の352億円となっております。一方、租税公課は外形標準課税の税率上昇により同18.5%増の105億円となりました。以上より、経常利益は同17.9%減の1,356億円となりました。

また、投資有価証券売却益等の計上により特別利益が173億円、MMF等償還関連費用や訴訟損失引当金繰入額等の計上により特別損失が139億円となり、法人税等および非支配株主に帰属する当期純利益を差し引いた結果、親会社株主に帰属する当期純利益は同10.9%減の1,040億円となりました。

(3) 当連結会計年度の財政状態の分析

＜資産の部＞

当連結会計年度末の総資産は前年度末比5,935億円減の19兆8,272億円となりました。内訳は流動資産が同5,926億円減の19兆2,589億円であり、このうちトレーディング商品が同9,550億円減の6兆5,462億円、有価証券が同3,489億円減の1兆7,421億円、現金・預金が同4,938億円増の3兆8,286億円、有価証券担保貸付金が同553億円増の5兆3,055億円となっております。固定資産は同8億円減の5,683億円となっております。

＜負債の部・純資産の部＞

当連結会計年度末の負債合計は前年度末比6,239億円減の18兆4,838億円となりました。内訳は流動負債が同8,199億円減の16兆78億円であり、このうちトレーディング商品が同6,422億円減の4兆6,585億円、有価証券担保借入金が同1,170億円増の6兆188億円、短期借入金が同989億円増の9,189億円、銀行業における預金が同571億円増の2兆9,857億円となっております。固定負債は同1,960億円増の2兆4,720億円であり、このうち長期借入金が同1,742億円増の1兆1,792億円、社債が同146億円増の1兆2,193億円となっております。

当連結会計年度末の純資産合計は同304億円増の1兆3,434億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は同11億円減の4,781億円となりました。利益剰余金は親会社株主に帰属する当期純利益を計上したことから、同342億円増の7,182億円となっております。自己株式の控除額は同172億円減の127億円、その他有価証券評価差額金は同385億円減の599億円、為替換算調整勘定は同141億円減の68億円、非支配株主持分は同4億円減の838億円となっております。

(4) 当連結会計年度のキャッシュ・フローの状況の分析

「第2 事業の状況 1 業績等の概要 (2) キャッシュ・フローの状況」に記載のとおりであります。

(5) 経営成績に重要な影響を与える要因についての分析

平成28年度のマクロ経済環境

<海外の状況>

世界経済は、平成28年度前半にかけて緩やかに減速した後、年末には持ち直し、緩やかに回復してきました。新興国経済の一部には弱さが残りますが、中国経済に持ち直しの動きが見られるほか、米国を中心とした先進国経済が引き続き底堅く推移しています。平成28年11月に行われた米国大統領選挙の結果を受け、次期大統領の掲げる拡張的な財政政策が米国経済の拡大につながり、グローバルにも好影響をもたらすとの見方が広がりました。ただし、平成29年年初にスタートした新政権の政策運営の不透明感から、同年3月末にかけて、世界の金融市場の期待感はやや低下しました。

米国経済は平成28年4－6月期に、雇用環境が着実に改善するなか、個人消費が加速する動きが見られました。さらに、7－9月期には輸出が大幅に拡大し、実質GDP成長率は前期比年率3.5%増と2年ぶりの高い成長率を記録しました。10－12月期の実質GDP成長率は減速したものの、個人消費や住宅投資など内需が下支え役となり、底堅く推移しました。しかし、平成29年1－3月期に入って個人消費が減速し、同1.2%増と低成長に留まりました。ただし、雇用・所得環境が安定しており、個人消費の拡大を支えるファンダメンタルズは引き続き堅固なことから、1－3月期の落ち込みは一時的である可能性が高まっています。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）は平成28年12月に続いて、平成29年3月にも政策金利を引き上げました。新政権への期待感に加えて、底堅い米国経済を材料に米国株式市場では騰勢が続く、NYダウ平均株価は3月初めに過去最高値を更新しました。

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背景に、緩やかながら安定した成長が続いています。平成28年10－12月期、平成29年1－3月期のユーロ圏の実質GDP成長率は、それぞれ前期比0.5%増と16四半期連続のプラス成長となりました。なかでも、個人消費は低金利や低インフレ、雇用環境の改善の追い風を受けて景気拡大の主役になっています。また、足下では、個人消費に比べて回復が遅れていた固定資本形成の伸びが高まるなど、企業の生産活動が加速する動きが見られます。金融面では、ECBは平成28年12月の金融政策委員会で、平成29年4月から量的緩和の規模を縮小させる一方、資産買取を少なくとも同年12月末まで継続する方針を決定しました。

新興国経済については、中国の実質GDP成長率は、平成28年度4－6月期及び7－9月期は各々前年比6.7%増でしたが、10－12月期は6.8%増、平成29年1－3月期は6.9%増と年度後半にかけて徐々に加速しました。政府が実施する様々な景気対策の効果によって、景気は持ち直しの動きが見られ、安定した成長を続けています。堅調なサービス消費に支えられた個人消費が経済全体を牽引しており、足下ではその傾向が強まっています。また、規制緩和やインフラ計画への参入といった政策効果から、民間部門の固定資産投資も増加しました。ただし、不動産価格の高騰や企業の過剰設備・過剰債務の問題などについては、金融市場のリスク要因として、引き続き留意していく必要があります。一方、中国以外の新興国では、一部に弱さが見られますが、輸出の増加や各国の景気対策によって、景気回復の兆しが見られます。

<日本の状況>

日本経済は「踊り場」局面から脱し、緩やかながらも拡大しつつあります。内需低迷の影響はあるものの、旺盛な外需に牽引される形で、鉱工業生産は平成28年の夏場以降、持ち直しています。また、非製造業の活動を示す第三次産業活動指数は、事業所向け関連サービスなどを中心に緩やかな拡大基調を辿ってきましたが、平成28年度後半には横ばいで推移しています。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は、雇用・所得環境の着実な改善を背景に、緩やかながらも拡大しています。失業率が3%を下回る水準まで低下するなど労働需給がタイトな状況にあるなか、サービス産業を中心に労働需要の高まりから雇用者数が継続的に増えており、マクロ経済全体で見た賃金は緩やかに増加ペースが高まっています。しかし、可処分所得の伸び悩みや将来不安などを要因として、家計は依然として支出に対する慎重姿勢を崩していません。また、住宅投資については、住宅ローン金利の低下や、相続税対策のための貸家建設の増加などを背景に、平成28年度前半は前期比年率で2桁成長を達成したものの、同年度後半にかけてやや一服感が見られます。

一方、企業の設備投資は一進一退の動きが続いています。企業収益が最高水準を維持しているなか、タイトな労働需給も相俟って、更新投資や省力化投資に積極的な動きが見られます。しかし、内外の先行き不透明感が払拭されないことから、総じて企業は、製造業を中心に設備投資に対する慎重な態度を変えませんでした。

外需に目を向けると、堅調な先進国経済に加えて新興国経済が回復するなど、海外経済が緩やかに拡大していることを背景に、輸出は増加基調にあります。地域別に輸出の動向を見ると、米国やEU向けが堅調に推移したほか、中国経済減速の影響で横ばいだったアジア向けも、平成28年度後半にかけて大きく持ち直しました。品目別に見ると、自動車関連やIC等電子部品といった情報関連、資本財の輸出数量が堅調に増加しました。一方、輸入金額は、内需の伸び悩みや円高の影響を受けて概ね横ばい圏で推移していましたが、平成28年度後半には持ち直しの動きが見られます。

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。マイナス金利政策を受けて、長期金利（10年国債利回り）は2月に史上初のマイナス金利となり、マイナス圏で推移し続けました。さらに、日銀が平成28年9月に、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を発表し、短期金利に加えて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。この結果、10年国債利回りはマイナス圏から脱し、概ね0%台で安定的に推移しました。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、6月、英国でEU（欧州連合）からの離脱の是非を問う国民投票で行われ、英国のEU離脱の方針が決定すると、国際金融市場の先行き警戒感が強まり、円は対ドル、対ユーロで急速に円高方向に進みました。しかし、11月の米国大統領選挙の結果を受け、将来の米国経済への期待感等から日米金利差が拡大するなか、ドルが買われ、為替レートは円安・ドル高基調に転じました。ただし平成29年1月以降、米国の新政権に対する不透明感などが意識されるに伴い、緩やかに円高が進行しました。

平成29年3月末の日経平均株価は18,909円26銭（前年3月末比2,150円59銭高）、10年国債利回りは0.067%（同0.116ポイントの上昇）、為替は1ドル111円80銭（同63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、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、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4四半期日次平均のLCRは145.3%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、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4四半期日次平均のLCRの状況は次のとおりです。

（単位：億円）

		日次平均 (自 平成29年 1 月 至 平成29年 3 月)
適格流動資産	(A)	23,658
資金流出額	(B)	34,971
資金流入額	(C)	18,694
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)	23,658
純資金流出額	(B) - (C)	16,277
連結流動性カバレッジ比率	(D) / ((B) - (C))	145.3%

<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。

平成29年3月31日現在の株主資本は、前年度末比503億円増加し、1兆1,836億円となりました。また、資本金及び資本剰余金の合計は4,781億円となっております。利益剰余金は親会社株主に帰属する当期純利益1,040億円を計上したほか、配当金423億円の支払いを行った結果、前年度末比342億円増の7,182億円となりました。自己株式の控除額は同172億円減少し、127億円となっております。

第3 【設備の状況】

1 【設備投資等の概要】

当社グループでは、幅広いニーズに対応する商品・サービスの提供によるお客様満足度の向上、営業の効率化による収益力の強化、事業継続に不可欠なインフラ基盤の整備や法制度への対応、リスク管理体制の強化などを目的とする設備投資を行っております。当連結会計年度においては、ファンドラップのラインナップやオンラインサービスの拡充などの投資を行いました。また、AI（人工知能）、ビッグデータ（注）、音声認識、ブロックチェーン等の新たな技術に対する取り組みを進めるほか、お客様にマイナンバーを安心してお届けいただくための管理体制や海外拠点を含むグループ全体としてのサイバーセキュリティ対策のさらなる強化などのためにIT関連投資を行いました。

また、店舗に関しては、リテール部門において、大和証券株式会社が草加営業所を新設しました。

（注）事業に役立つ知見を導出することを目的として、ICT（情報通信技術）の進展により生成・収集・蓄積が容易になった多種多量のデータのこと。

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

事業所名	所在地	セグメントの名称	建物 帳簿価額 (注) 1 (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数 (注) 4	摘要 (注) 5
				帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
大和証券グループ本社 本店 (注) 3	東京都 千代田区	その他	1,150	—	—	1,150	— [598]	賃借

（2）国内子会社

事業所名	所在地	セグメントの 名称	建物 帳簿価額 (注) 1 (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数	摘要 (注) 5
				帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
大和証券								
本店 (注) 3	東京都 千代田区	リテール部門 ホールセール 部門 その他	3,287	—	—	3,287	2,711	賃借
大阪支店 (注) 3	大阪市 北区		1,598	231	1,140	1,830	276	所有
名古屋支店 (注) 3	名古屋市中区		118	—	—	118	163	賃借
京都支店	京都市 下京区	リテール部門	177	2,834	745	3,011	115	所有
池袋支店	東京都 豊島区		266	3,158	638	3,425	67	所有
広島支店	広島市中区		123	1,683	433	1,806	66	所有
福岡支店 (注) 6	福岡市 中央区		578	1,477	590	2,055	97	所有
横浜支店	横浜市中区		114	129	407	243	70	所有
横浜駅西口支店	横浜市 西区		112	—	—	112	92	賃借
渋谷支店	東京都 渋谷区		40	—	—	40	108	賃借
大宮支店	さいたま市 大宮区		30	—	—	30	72	賃借
千葉支店	千葉市 中央区		76	—	—	76	61	賃借
札幌支店	札幌市 中央区		73	—	—	73	84	賃借

事業所名	所在地	セグメントの 名称	建物 帳簿価額 (注) 1 (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数	摘要 (注) 5
				帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
大和証券								
仙台支店	仙台市 青葉区	リテール部門	453	3,639	1,504	4,092	59	所有
新宿支店	東京都 新宿区		150	—	—	150	82	賃借
梅田支店	大阪市 北区		74	—	—	74	78	賃借
難波支店	大阪市 中央区		245	369	161	614	57	所有
名古屋駅前支店	名古屋市中村区		36	—	—	36	77	賃借
銀座支店	東京都 中央区		80	—	—	80	57	賃借
静岡支店	静岡市 葵区		277	1,786	526	2,064	54	所有
神戸支店	神戸市 中央区		130	652	651	782	99	所有

(3) 在外子会社

事業所名	所在地	セグメントの 名称	建物 帳簿価額 (注) 1 (百万円)	土地		合計 帳簿価額 (百万円)	従業員数	摘要 (注) 5
				帳簿価額 (百万円)	面積 (㎡)			
大和証券キャピタル・マー ケッツヨーロッパリミテッ ド	イギリス ロンドン市 他	ホールセール 部門 その他	1,493	—	—	1,493	376	賃借
大和証券キャピタル・マー ケッツ香港リミテッド	中国 香港 特別行政区		168	—	—	168	267	賃借
大和証券キャピタル・マー ケッツアメリカホールディ ングスInc.	アメリカ ニューヨーク市 他		488	—	—	488	305	賃借

- (注) 1 賃借物件の場合、建物造作工事にかかる額を記載しております。
- 2 連結会社所有の設備は主な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 従業員数は就業人員数であり、大和証券株式会社との兼務者数は〔 〕内に外数で記載しております。
- 5 当連結会計年度における上記物件にかかる支払賃借料（建物及び構築物並びに設備等を含む）は、9,720百万円であります。
- 6 土地の帳簿価額の一部は借地権であります。
- 7 帳簿価額の金額には、消費税等は含まれておりません。
- 8 建物及び土地の帳簿価額は一部を除き、信託受益権であります。また、これらの物件は一部を除き、連結会社以外の者へ賃貸しております。

3 【設備の新設、除却等の計画】

当連結会計年度末現在における重要な設備の新設、除却等の計画は、以下のとおりであります。

(1) 新設等

該当事項はありません。

(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】

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	事業年度末現在 発行数(株) (平成29年3月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成29年6月29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	1,699,378,772	1,699,378,772	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	1,699,378,772	1,699,378,772	—	—

(2) 【新株予約権等の状況】

新株予約権の状況は以下のとおりであります。

① 平成17年定時株主総会の決議によるもの

当社は、ストック・オプションの目的で「商法等の一部を改正する法律」（平成13年法律第128号）（以下、「平成13年改正旧商法」といいます）第280条ノ20及び第280条ノ21の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成17年6月24日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	244	239
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	244,000	239,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成17年7月1日から 平成37年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち 当社取締役会または取締役 会の決議による委任を受け た執行役が決定する会社の 取締役、執行役、執行役員 のいずれの地位も喪失した 日の翌日から行使できるも のとしします。 3 上記2にかかわらず、平成 37年6月1日より、他の権 利行使の条件に従い行使で きるものとします。 4 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権付 与契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

② 平成18年定時株主総会の決議によるもの

当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成18年6月24日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	154	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	154,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成18年7月1日から 平成38年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成38年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みにに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額1,363円を加算した資本組入額は682円となります。

③ 平成19年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成19年6月23日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	186	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	186,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成19年7月1日から 平成39年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成39年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額1,312円を加算した資本組入額は657円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成19年6月23日開催の株主総会及び平成19年8月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	2,569	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	257	263
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,569,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1,176	同左
新株予約権の行使期間	平成24年7月1日から 平成29年6月22日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1,176 資本組入額 588	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1,176円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額349円を加算した資本組入額は763円となります。

④ 平成20年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成20年6月21日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	235	230
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	235,000	230,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成20年7月1日から 平成40年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち 当社取締役会または取締役 会の決議による委任を受け た執行役が決定する会社の 取締役、執行役、執行役員 のいずれの地位も喪失した 日の翌日から行使できるも のとしします。 3 上記2にかかわらず、平成 40年5月31日より、他の権 利行使の条件に従い行使で きるものとします。 4 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額972円を加算した資本組入額は487円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成20年6月21日開催の株主総会及び平成20年8月28日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	2,825	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	223	229
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,825,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり881	同左
新株予約権の行使期間	平成25年7月1日から 平成30年6月20日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 881 資本組入額 441	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格881円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額243.7円を加算した資本組入額は563円となります。

⑤ 平成21年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成21年6月20日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	517	503
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	517,000	503,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成21年7月1日から 平成41年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち 当社取締役会または取締役 会の決議による委任を受け た執行役が決定する会社の 取締役、執行役、執行役員 のいずれの地位も喪失した 日の翌日から行使できるも のとしします。 3 上記2にかかわらず、平成 41年5月31日より、他の権 利行使の条件に従い行使で きるものとします。 4 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額580円を加算した資本組入額は291円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成21年6月20日開催の株主総会及び平成21年10月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	2,219	2,201
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	316	318
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,219,000	2,201,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり496	同左
新株予約権の行使期間	平成26年7月1日から 平成31年6月19日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 496 資本組入額 248	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格496円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額152円を加算した資本組入額は324円となります。

⑥ 平成22年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成22年6月26日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	926	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	926,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成22年7月1日から 平成42年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社関係会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成42年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額375円を加算した資本組入額は188円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成22年6月26日開催の株主総会及び平成22年8月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	3,971	3,939
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	486	487
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	3,971,000	3,939,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり380	同左
新株予約権の行使期間	平成27年7月1日から 平成32年6月25日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 380 資本組入額 190	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格380円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額83円を加算した資本組入額は232円となります。

⑦ 平成23年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成23年6月25日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	1,111	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	1,111,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成23年7月1日から 平成43年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち 当社取締役会または取締役 会の決議による委任を受け た執行役が決定する会社の 取締役、執行役、執行役員 のいずれの地位も喪失した 日の翌日から行使できるも のとしします。 3 上記2にかかわらず、平成 43年5月31日より、他の権 利行使の条件に従い行使で きるものとします。 4 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額358円を加算した資本組入額は180円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成23年6月25日開催の株主総会及び平成23年8月26日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	3,842	3,758
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	447	450
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	3,842,000	3,758,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり326	同左
新株予約権の行使期間	平成28年7月1日から 平成33年6月24日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 326 資本組入額 163	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格326円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額89円を加算した資本組入額は208円となります。

⑧ 平成24年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成24年6月27日開催の株主総会及び平成25年2月1日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	789	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	789,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成25年2月12日から 平成44年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成44年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額568円を加算した資本組入額は285円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成24年6月27日開催の株主総会及び平成25年2月1日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	6,333	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	357	372
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	6,333,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり598	同左
新株予約権の行使期間	平成29年7月1日から 平成34年6月26日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 598 資本組入額 299	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格598円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額193円を加算した資本組入額は396円となります。

⑨ 平成25年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成25年6月26日開催の株主総会及び平成26年1月31日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	388	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	388,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成26年2月10日から 平成45年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の 株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち 当社取締役会または取締役 会の決議による委任を受け た執行役が決定する会社の 取締役、執行役、執行役員 のいずれの地位も喪失した 日の翌日から行使できるも のとしします。 3 上記2にかかわらず、平成 45年5月31日より、他の権 利行使の条件に従い行使で きるものとします。 4 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額956円を加算した資本組入額は479円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成25年6月26日開催の株主総会及び平成26年1月31日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	3,964	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	186	196
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	3,964,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1,062	同左
新株予約権の行使期間	平成30年7月1日から 平成35年6月25日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1,062 資本組入額 531	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1,062円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額295円を加算した資本組入額は679円となります。

⑩ 平成26年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成26年6月26日開催の株主総会及び平成27年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	458	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	458,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成27年2月9日から 平成46年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社関係会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成46年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額850.7円を加算した資本組入額は426円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成26年6月26日開催の株主総会及び平成27年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	5,418	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	199	218
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	5,418,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり931	同左
新株予約権の行使期間	平成31年7月1日から 平成36年6月25日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 931 資本組入額 466	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格931円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額188.6円を加算した資本組入額は560円となります。

⑪ 平成27年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成27年6月25日開催の株主総会及び平成28年2月5日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	581	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	581,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成28年2月16日から 平成47年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社、当社子会社及び当社関連会社のうち、当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成47年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額663.4円を加算した資本組入額は333円となります。

(ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成27年6月25日開催の株主総会及び平成28年2月5日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	4,484	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	106	119
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	4,484,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり733	同左
新株予約権の行使期間	平成32年7月1日から 平成37年6月24日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 733 資本組入額 367	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格733円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額113.2円を加算した資本組入額は424円となります。

⑫ 平成28年定時株主総会の決議によるもの

(i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成28年6月28日開催の株主総会及び平成29年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	574	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	—	—
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	574,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1	同左
新株予約権の行使期間	平成29年2月8日から 平成48年6月30日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社、当社子会社及び当社関連会社のうち、当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成48年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額707.9円を加算した資本組入額は355円となります。

- (ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成28年6月28日開催の株主総会及び平成29年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

	事業年度末現在 (平成29年3月31日)	提出日の前月末現在 (平成29年5月31日)
新株予約権の数(個)	7,448	同左
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	18	32
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式	同左
新株予約権の目的となる株式の数(株)	7,448,000	同左
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり767	同左
新株予約権の行使期間	平成33年7月1日から 平成38年6月27日	同左
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 767 資本組入額 384	同左
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使は できないものとします。 2 その他の条件は当社と新株 予約権の割当の対象者との 間で締結する新株予約権割 当契約に定めるところによ るものとします。	同左
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものと します。	同左
代用払込みに関する事項	—	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に 関する事項	—	—

(注) 上記の「資本組入額」は株式の発行価格767円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額122.1円を加算した資本組入額は445円となります。

(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29年3月31日 (注)	△50,000	1,699,378	—	247,397	—	226,751

(注) 自己株式の消却による減少であります。

(6) 【所有者別状況】

(平成29年3月31日現在)

区分	株式の状況（１単元の株式数1,000株）								単元未満株式の状況（株）
	政府及び地方公共団体	金融機関	金融商品取引業者	その他の法人	外国法人等		個人その他	計	
					個人以外	個人			
株主数(人)	1	192	65	1,366	683	138	122,466	124,911	—
所有株式数(単元)	0	522,190	67,180	66,074	636,227	827	404,324	1,696,822	2,556,772
所有株式数の割合(%)	0.00	30.77	3.96	3.89	37.50	0.05	23.83	100.00	—

(注) 1 「その他の法人」の欄には、株式会社証券保管振替機構名義の株式が3単元含まれております。

2 「個人その他」の欄には22,136単元、「単元未満株式の状況」の欄には669株の自己名義株式が含まれております。

(7) 【大株主の状況】

(平成29年3月31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)	95,819	5.63
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	76,344	4.49
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	66,873	3.93
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	2.00
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口5)	東京都中央区晴海一丁目8番11号	33,928	1.99
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	1.83
STATE STREET BANK WEST CLIENT-TREATY 505234 (常任代理人 株式会社みずほ銀行)	1776 HERITAGE DRIVE, NORTH QUINCY, MA 02171, U. S. A. (東京都港区港南二丁目15番1号)	25,213	1.48
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口2)	東京都中央区晴海一丁目8番11号	24,966	1.46
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社(信託口1)	東京都中央区晴海一丁目8番11号	24,920	1.46
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	1.46
計	—	438,091	25.73

- (注) 1 平成28年10月20日付で公衆の縦覧に供されている株券等の大量保有の状況に関する「変更報告書」において、ブラックロック・ジャパン株式会社及びその共同保有者8社が平成28年10月14日現在で以下の株式を共同保有している旨が記載されているものの、当社として当事業年度末時点における実質所有株式数の確認ができませんので、上記大株主の状況には含めておりません。
- 「変更報告書」記載内容は以下のとおりです。

氏名又は名称	住所	保有株券等の数 (千株)	株券等保有割合 (%)
ブラックロック・ジャパン株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	34,598	1.98
ブラックロック・アドバイザーズ・エルエルシー	米国デラウェア州ニュー・キャッスル群ウィルミントンオレンジストリート1209 ザ・コーポレーション・トラスト・カンパニー気付	10,162	0.58
ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国ニュージャージー州プリンストンユニバーシティスクウェアドライブ1	3,015	0.17
ブラックロック (ルクセンブルグ) エス・エー	ルクセンブルク大公国 L-1855J. F. ケネディ通り 35A	3,718	0.21
ブラックロック・ライフ・リミテッド	英国ロンドン市スログモートン・アベニュー12	3,994	0.23
ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド	アイルランド共和国ダブリンインターナショナル・ファイナンシャル・サービス・センターJPモルガン・ハウス	5,938	0.34
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州サンフランシスコ市ハワード・ストリート400	19,530	1.12
ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ、エイ、	米国カリフォルニア州サンフランシスコ市ハワード・ストリート400	25,268	1.44
ブラックロック・インベストメント・マネジメント (ユーケー) リミテッド	英国ロンドン市スログモートン・アベニュー12	3,536	0.20
合計	—	109,760	6.27

- 2 平成26年3月27日付で公衆の縦覧に供されている株券等の大量保有の状況に関する「変更報告書No. 22」において、ハリス・アソシエイツ・エル・ピーが平成26年3月21日現在で10.84%の株券等保有割合の株式を所有している旨の報告を受けていたところ、その後、平成28年12月26日付で公衆の縦覧に供されている株券等の大量保有の状況に関する「変更報告書No. 29」において、平成28年12月20日現在で以下の株式を保有している旨、および平成29年3月6日付で公衆の縦覧に供されている株券等の大量保有の状況に関する「変更報告書No. 30」において、平成29年2月28日現在で以下の株式を保有している旨の報告を受けました。当社として当事業年度末時点における実質所有株式数の確認ができませんので、上記大株主の状況には含めておりません。

「変更報告書No. 29」記載内容は以下のとおりです。

氏名又は名称	住所	保有株券等の数 (千株)	株券等保有割合 (%)
ハリス・アソシエイツ・エル・ピー	米国イリノイ州シカゴ市スィート4600、 サウスワッカードライブ111番地	166,204	9.50

「変更報告書No. 30」記載内容は以下のとおりです。

氏名又は名称	住所	保有株券等の数 (千株)	株券等保有割合 (%)
ハリス・アソシエイツ・エル・ピー	米国イリノイ州シカゴ市スィート4600、 サウスワッカードライブ111番地	121,334	6.94

(8) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

(平成29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 22,136,000	—	—
	(相互保有株式) 普通株式 1,218,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,673,468,000	1,673,468	—
単元未満株式	普通株式 2,556,772	—	—
発行済株式総数	1,699,378,772	—	—
総株主の議決権	—	1,673,468	—

(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669株が含まれております。

② 【自己株式等】

(平成29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	22,136,000	—	22,136,000	1.30
計	—	22,136,000	—	22,136,000	1.30

(注) 1 当社は、単元未満自己株式669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1,218,000株あります。

(9) 【ストックオプション制度の内容】

① 平成17年定時株主総会の決議によるもの

当社は、ストック・オプションの目的で平成13年改正旧商法第280条ノ20及び第280条ノ21の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成17年6月24日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成17年6月24日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 76名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

② 平成18年定時株主総会の決議によるもの

当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成18年6月24日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成18年6月24日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の子会社の取締役及び執行役員 77名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

③ 平成19年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成19年6月23日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成19年6月23日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 16名 当社の子会社の取締役及び執行役員 79名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成19年6月23日開催の株主総会及び平成19年8月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成19年6月23日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人 88名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 1,730名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

④ 平成20年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成20年6月21日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成20年6月21日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の子会社の取締役及び執行役員 83名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成20年6月21日開催の株主総会及び平成20年8月28日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成20年6月21日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人 96名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 1,822名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑤ 平成21年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成21年6月20日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成21年6月20日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 16名 当社の子会社の取締役及び執行役員 90名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成21年6月20日開催の株主総会及び平成21年10月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成21年6月20日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人 102名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,080名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑥ 平成22年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成22年6月26日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成22年6月26日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の子会社の取締役及び執行役員 102名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成22年6月26日開催の株主総会及び平成22年8月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成22年6月26日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人 104名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,236名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑦ 平成23年定時株主総会の決議によるもの

- (i) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成23年6月25日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成23年6月25日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の子会社の取締役及び執行役員 96名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成23年6月25日開催の株主総会及び平成23年8月26日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成23年6月25日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人 230名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,059名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑧ 平成24年定時株主総会の決議によるもの

- (i) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成24年6月27日開催の株主総会及び平成25年2月1日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成24年6月27日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 18名 当社の子会社の取締役及び執行役員 85名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成24年6月27日開催の株主総会及び平成25年2月1日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成24年6月27日
付与対象者の区分及び人数	当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,719名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑨ 平成25年定時株主総会の決議によるもの

- (i) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成25年6月26日開催の株主総会及び平成26年1月31日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成25年6月26日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 22名 当社の子会社の取締役及び執行役員 81名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成25年6月26日開催の株主総会及び平成26年1月31日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成25年6月26日
付与対象者の区分及び人数	当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,881名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑩ 平成26年定時株主総会の決議によるもの

- (i) スtock・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成26年6月26日開催の株主総会及び平成27年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成26年6月26日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 21名 当社の子会社の取締役及び執行役員 85名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) スtock・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成26年6月26日開催の株主総会及び平成27年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成26年6月26日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人並びに当社関係会社の取締役、執行役員及び使用人 3,072名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑪ 平成27年定時株主総会の決議によるもの

- (i) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成27年6月25日開催の株主総会及び平成28年2月5日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成27年6月25日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 21名 当社の子会社の取締役及び執行役員 85名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成27年6月25日開催の株主総会及び平成28年2月5日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成27年6月25日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人並びに当社子会社及び当社関連会社の取締役、執行役員及び使用人 3,238名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑫ 平成28年定時株主総会の決議によるもの

- (i) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成28年6月28日開催の株主総会及び平成29年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成28年6月28日
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 19名 当社の子会社の取締役及び執行役員 90名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

- (ii) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成28年6月28日開催の株主総会及び平成29年1月30日開催の執行役会において決議されたものであります。

決議年月日	平成28年6月28日
付与対象者の区分及び人数	当社の使用人並びに当社子会社及び当社関連会社の取締役、執行役員及び使用人 3,482名
新株予約権の目的となる株式の種類	「(2) 新株予約権等の状況」に記載しております。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	同上
新株予約権の行使時の払込金額(円)	同上
新株予約権の行使期間	同上
新株予約権の行使の条件	同上
新株予約権の譲渡に関する事項	同上
代用払込みに関する事項	同上
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	同上

⑬ 平成29年定時株主総会の決議によるもの

(i) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成29年6月28日開催の株主総会において決議されております。

決議年月日	平成29年6月28日
付与対象者の区分及び人数	当社及び当社子会社の取締役、執行役員、並びに当社の執行役（注）
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式
新株予約権の目的となる株式の数(株)	上限 1,200,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり1
新株予約権の行使期間	割当日から平成49年6月30日
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社、当社子会社及び当社関連会社のうち当社取締役会又は取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成49年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

（注）詳細につきましては提出日以降、当社取締役会又は取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定するものとします。

- (ii) ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき下記の新株予約権を無償発行することが、平成29年6月28日開催の株主総会において決議されております。

決議年月日	平成29年6月28日
付与対象者の区分及び人数	当社、当社の子会社及び当社の関連会社の使用人、並びに上記（i）の新株予約権の付与対象者とならない当社子会社及び当社関連会社の取締役及び執行役員（注）1
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式
新株予約権の目的となる株式の数(株)	上限 7,500,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	(注) 2
新株予約権の行使期間	平成34年7月1日から平成39年6月27日
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	—
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	—

- (注) 1 詳細につきましては提出日以降、当社取締役会又は取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定するものとします。
- 2 新株予約権の割当日の属する月の前月の各日（取引が成立しない日を除く。）における東京証券取引所の当社普通株式の普通取引の終値の平均値、又は割当日の終値（終値がない場合は、それに先立つ直近日の終値とする。）のいずれか高い額に1.05を乗じた金額とし、1円未満の端数は切り上げます。なお、割当日後、当社が当社普通株式につき、株式分割又は株式併合を行う場合は、行使価額は、次の算式により調整されるものとし、調整により生ずる1円未満の端数は切り上げます。

$$\text{調整後行使価額} = \text{調整前行使価額} \times \frac{1}{\text{分割又は併合の比率}}$$

また、割当日後、当社が時価を下回る価額で当社普通株式につき、新株の発行を行う場合（当社普通株式に転換される証券もしくは転換できる証券又は当社普通株式の交付を請求できる新株予約権（新株予約権付社債に付されたものを含む。）の転換又は行使の場合を除く。）には、次の算式により行使価額の調整を行い、調整により生じる1円未満の端数は切り上げます。

$$\text{調整後行使価額} = \text{調整前行使価額} \times \frac{\text{既発行株式数} + \frac{\text{新規発行株式数} \times 1 \text{ 株当たり払込金額}}{\text{新規発行前の時価}}}{\text{既発行株式数} + \text{新規発行株式数}}$$

上記の算式において、「既発行株式数」とは、当社の発行済普通株式数から当社が保有する普通株式に係る自己株式数を控除した数とします。上記のほか、割当日後に当社が他社と合併、会社分割又は資本金の額の減少を行う場合、その他これらの場合に準じ行使価額の調整を必要とする場合には、合理的な範囲で、行使価額は適切に調整されるものとします。

2 【自己株式の取得等の状況】

【株式の種類等】 会社法第155条第3号及び会社法第155条第7号による普通株式の取得

(1) 【株主総会決議による取得の状況】

該当事項はありません。

(2) 【取締役会決議による取得の状況】

区分	株式数(株)	価額の総額(千円)
取締役会(平成28年10月28日)での決議状況 (取得期間平成28年10月31日～平成29年1月25日)	(上限) 30,000,000	(上限) 20,000,000
当事業年度前における取得自己株式	—	—
当事業年度における取得自己株式	—	—
残存決議株式の総数及び価額の総額	30,000,000	20,000,000
当事業年度の末日現在の未行使割合(%)	100.00	100.00
当期間における取得自己株式	—	—
提出日現在の未行使割合(%)	100.00	100.00

区分	株式数(株)	価額の総額(千円)
取締役会(平成29年1月30日)での決議状況 (取得期間平成29年2月10日～平成29年4月25日)	(上限) 27,000,000	(上限) 20,000,000
当事業年度前における取得自己株式	—	—
当事業年度における取得自己株式	18,000,000	13,063,641
残存決議株式の総数及び価額の総額	9,000,000	6,936,358
当事業年度の末日現在の未行使割合(%)	33.33	34.68
当期間における取得自己株式	9,000,000	5,935,160
提出日現在の未行使割合(%)	—	5.00

(3) 【株主総会決議又は取締役会決議に基づかないものの内容】

区分	株式数(株)	価額の総額(千円)
当事業年度における取得自己株式	34,779	23,041
当期間における取得自己株式	3,705	2,496

(注) 当期間における取得自己株式には、平成29年6月1日から有価証券報告書提出日までの単元未満株式の買取りによる株式数は含めておりません。

(4) 【取得自己株式の処理状況及び保有状況】

区分	当事業年度		当期間	
	株式数(株)	処分価額の総額 (千円)	株式数(株)	処分価額の総額 (千円)
引き受ける者の募集を行った 取得自己株式	—	—	—	—
消却の処分を行った取得自己株式	50,000,000	28,728,035	—	—
合併、株式交換、会社分割に係る 移転を行った取得自己株式	—	—	—	—
その他 (単元未満株式の売渡請求に伴う 売渡し)	4,250	2,256	970	573
(新株予約権の行使に伴う譲渡)	2,937,000	1,556,593	165,000	98,002
保有自己株式数	22,136,669	—	30,974,404	—

- (注) 1 当期間における処分自己株式には、平成29年6月1日から有価証券報告書提出日までの単元未満株式の売渡請求に伴う売渡し及び新株予約権の行使に伴う譲渡による株式数は含めておりません。
- 2 当期間における保有自己株式には、平成29年6月1日から有価証券報告書提出日までの単元未満株式の買取り、売渡し及び新株予約権の行使に伴う譲渡による株式数は含めておりません。

3 【配当政策】

当社は、利益配分を含む株主価値の持続的な向上を目指しております。

配当については、中間配当及び期末配当の年2回を基本とし、連結業績を反映して半期毎に配当性向40%程度の配当を行う方針です。但し、安定性にも配慮した上で、今後の事業展開に要する内部留保を十分確保できた場合には、自社株買入等も含めてより積極的に株主への利益還元を行う方針です。

また、当社は定款において、基準日を定めて取締役会決議により剰余金の配当をする旨を定めております。

当事業年度の期末配当につきましては、1株当たり13円といたしました。平成28年10月28日の取締役会決議に基づき同年12月に1株につき13円の間配当を実施しておりますので、年間での配当金額は1株につき26円となります。

(注) 基準日が当事業年度に属する剰余金の配当は、以下のとおりであります。

決議年月日	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)
平成28年10月28日 取締役会決議	22,018	13
平成29年5月16日 取締役会決議	21,804	13

4 【株価の推移】

(1) 【最近5年間の事業年度別最高・最低株価】

回次	第76期	第77期	第78期	第79期	第80期
決算年月	平成25年3月	平成26年3月	平成27年3月	平成28年3月	平成29年3月
最高(円)	692	1,065	1,019	1,048.5	785
最低(円)	235	600	738	590.7	496

(注) 株価は、東京証券取引所市場第一部におけるものであります。

(2) 【最近6月間の月別最高・最低株価】

月別	平成28年 10月	11月	12月	平成29年 1月	2月	3月
最高(円)	630.3	693.2	785	761.5	733.4	762.2
最低(円)	561.2	556.8	695.4	699.5	699.3	677.9

(注) 株価は、東京証券取引所市場第一部におけるものであります。

5 【役員の状況】

男性19名 女性2名 (役員のうち女性の比率9.5%)

(1) 取締役の状況

役名	氏名	生年月日	略歴	任期	所有株式数 (千株)
取締役会長	日比野 隆司	昭和30年9月27日生	昭和54年4月 当社入社 平成14年4月 当社 経営企画部長 平成14年6月 大和証券エスエムビーシー(株)執行役員 エクイティ担当 平成16年5月 当社常務執行役員 経営企画・人事・法務・秘書担当 兼 人事部長 平成16年6月 当社取締役 兼 常務執行役 企画・人事・法務担当 兼 人事部長 平成16年7月 当社 企画・人事・法務担当 平成17年4月 当社 企画・人事担当 平成19年4月 当社取締役 兼 専務執行役 平成20年7月 当社 企画・人事担当 兼 ホールセール部門副担当 大和証券エスエムビーシー(株)専務執行役員 平成21年4月 当社取締役 兼 執行役副社長 ホールセール部門副担当 平成23年4月 大和証券エスエムビーシー(株)代表取締役副社長 当社取締役 兼 代表執行役社長 最高経営責任者 (CEO) 兼 リテール部門担当 兼 ホールセール部門担当 大和証券(株)代表取締役社長 大和証券キャピタル・マーケット(株)代表取締役社長 当社最高経営責任者 (CEO) 平成25年4月 当社取締役会長 兼 執行役 平成29年4月 大和証券(株)代表取締役会長 〔主要な兼職〕 大和証券(株)代表取締役会長 (株)帝国ホテル社外取締役	(注②)	141
取締役	中田 誠司	昭和35年7月16日生	昭和58年4月 当社入社 平成11年4月 大和証券エスビーキャピタル・マーケット(株)へ転籍 平成17年4月 大和証券エスエムビーシー(株) 商品戦略部長 平成18年4月 同社執行役員 企画担当 平成19年4月 当社執行役 企画副担当 兼 人事副担当 兼 経営企画部長 平成20年10月 当社 企画副担当 兼 人事副担当 平成21年4月 当社常務執行役 平成21年6月 当社取締役 兼 常務執行役 平成22年4月 当社取締役 大和証券キャピタル・マーケット(株)常務取締役 平成22年6月 大和証券キャピタル・マーケット(株)常務取締役 法人営業上席担当 兼 事業法人上席担当 兼 法人統括担当 平成23年4月 同社 事業法人上席担当 兼 法人営業担当 兼 法人統括担当 平成24年4月 大和証券(株)専務取締役 法人本部長 平成27年4月 当社専務執行役 リテール部門副担当 平成28年4月 当社代表執行役副社長 最高執行責任者 (COO) 兼 リテール部門担当 大和証券(株)代表取締役副社長 平成28年6月 当社取締役 兼 代表執行役副社長 平成29年4月 当社取締役 兼 代表執行役社長 最高経営責任者 (CEO) 兼 リテール部門担当 大和証券(株)代表取締役社長 〔主要な兼職〕 大和証券(株)代表取締役社長	(注②)	58

役名	氏名	生年月日	略歴		任期	所有株式数 (千株)
取締役	西尾 信也	昭和32年6月5日生	昭和56年4月 平成11年4月 平成16年5月 平成17年4月 平成18年4月 平成19年4月 平成19年7月 平成19年10月 平成20年4月 平成21年4月 平成22年4月 平成23年4月 平成24年4月 平成27年4月 平成28年4月 平成28年6月 平成29年4月 〔主要な兼職〕	当社入社 大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)へ転籍 大和証券エスエムビーシー(株) 事業法人第三部長 同社執行役員 事業法人第二部担当 大和証券(株)執行役員 第四ユニット担当 兼 投資銀行第四部長 同社 プライベートバンキング担当 兼 プライベートバンキング部長 同社 プライベートバンキング担当 同社 プライベートバンキング担当 兼 ローンビジネス担当 大和証券エスエムビーシー(株)執行役員 大阪支店担当 兼 大阪副支店長 同社常務執行役員 大阪支店担当 兼 大阪支店長 大和証券キャピタル・マーケット(株)常務取締役 大阪支店上席担当 兼 大阪支店長 同社 大阪支店担当 兼 大阪支店長 大和証券(株)専務取締役 大阪法人担当 同社 法人副本部長 兼 大阪法人担当 当社執行役副社長 ホールセール部門担当 大和証券(株)代表取締役副社長 当社取締役 兼 執行役副社長 当社取締役 兼 代表執行役副社長 最高執行責任者(COO) 兼 ホールセール部門担当 兼 リテール部門副担当 大和証券(株)代表取締役副社長	(注②)	70
取締役	高橋 一夫	昭和35年1月8日生	昭和57年4月 平成11年4月 平成13年4月 平成15年2月 平成17年4月 平成19年4月 平成20年4月 平成21年4月 平成21年10月 平成22年4月 平成24年4月 平成25年4月 平成27年4月 平成29年4月 平成29年6月 〔主要な兼職〕	当社入社 大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)へ転籍 大和証券(株) 下関支店長 大和証券エスエムビーシー(株) 事業法人第二部長 同社 金融法人部長 同社執行役員 法人営業担当 同社 金融法人担当 同社 金融法人担当 兼 金融・公共ソリューション副担当 同社 金融法人担当 大和証券キャピタル・マーケット(株)常務執行役員 金融・公共法人担当 大和証券(株)常務取締役 金融・公共法人担当 同社専務取締役 同社 法人本部長 当社執行役副社長 ホールセール部門副担当 大和証券(株)代表取締役副社長 当社取締役 兼 執行役副社長 大和証券(株)代表取締役副社長	(注②)	15
取締役	松井 敏浩	昭和37年4月27日生	昭和60年4月 平成11年4月 平成19年9月 平成20年10月 平成21年4月 平成22年4月 平成23年4月 平成24年1月 平成24年4月 平成26年4月 平成28年4月 平成28年6月 〔主要な兼職〕	当社入社 大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)へ転籍 当社へ転籍 当社 経営企画部長 当社執行役 法務担当 兼 企画副担当 兼 経営企画部長 当社 企画副担当 兼 人事副担当 当社常務執行役 法務担当 兼 企画副担当 兼 人事副担当 大和証券(株)執行役員 当社常務執行役 大和証券(株)執行役員 大和証券キャピタル・マーケット(株)執行役員 当社 企画担当 兼 法務担当 兼 人事副担当 大和証券(株)常務執行役員 当社専務執行役 企画担当 兼 人事担当 大和証券(株)専務取締役 当社 企画担当 兼 ホールセール部門副担当 当社取締役 兼 専務執行役 大和証券(株)専務取締役	(注②)	76

役名	氏名	生年月日		略歴	任期	所有株式数 (千株)
取締役	田代 桂子	昭和38年8月5日生	昭和61年4月 平成11年4月 平成11年7月 平成17年9月 平成21年4月 平成21年6月 平成23年4月 平成24年4月 平成25年4月 平成25年7月 平成26年4月 平成26年6月 平成28年4月 [主要な兼職]	当社入社 大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)へ転籍 当社へ転籍 大和証券(株) ダイレクト企画部長 同社執行役員 P T S 担当 兼 ダイレクト担当 同社 オンライン商品担当 兼 ダイレクト担当 大和証券キャピタル・マーケット(株)執行役員 金融市場担当 大和証券(株)執行役員 金融市場担当 当社常務執行役員 米州担当 大和証券キャピタル・マーケットアメリカホールディングスInc. 会長 大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc. 会長 当社常務執行役 海外副担当 (米州担当) 当社取締役 兼 常務執行役 当社取締役 兼 専務執行役 海外担当 大和証券(株)専務取締役 大和証券(株)専務取締役	(注②)	27
取締役	小松 幹太	昭和37年10月12日生	昭和60年4月 平成14年2月 平成15年2月 平成20年10月 平成22年4月 平成22年10月 平成22年12月 平成23年4月 平成24年4月 平成25年4月 平成27年4月 平成28年4月 平成28年6月 [主要な兼職]	当社入社 大和証券エスエムビーシー(株)へ転籍 当社へ転籍 大和証券エスエムビーシー(株)へ転籍 (大和証券エスエムビーシーヨーロッパリミテッド社長) 大和証券キャピタル・マーケット(株)執行役員 国際企画担当 兼 国際企画部長 同社 国際企画担当 兼 企画副担当 同社 国際企画担当 兼 企画副担当 兼 アジア特別副担当 当社執行役員 財務担当 大和証券(株)執行役員 大和証券キャピタル・マーケット(株)執行役員 当社財務担当 兼 企画副担当 大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)取締役 当社常務執行役 最高財務責任者 (CFO) 兼 企画副担当 兼 海外副担当 大和証券(株)常務執行役員 当社最高財務責任者 (CFO) 兼 海外副担当 当社専務執行役 大和証券(株)専務取締役 当社取締役 兼 専務執行役 大和証券(株)専務取締役 大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)取締役	(注②)	61
取締役	松田 守正	昭和40年7月26日生	平成元年4月 平成11年4月 平成12年6月 平成15年2月 平成23年4月 平成25年4月 平成28年4月 平成28年6月 平成29年6月 [主要な兼職]	当社入社 大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)へ転籍 当社へ転籍 大和証券エスエムビーシー(株)へ転籍 当社へ転籍 当社 内部監査部長 大和証券(株) 内部監査部長 当社執行役員 大和証券(株)監査役 (株)大和総研ビジネス・イノベーション監査役 大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)監査役 当社取締役 大和証券投資信託委託(株)監査役 大和証券(株)監査役 大和証券投資信託委託(株)監査役 (株)大和総研ビジネス・イノベーション監査役 大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)監査役	(注②)	24

役名	氏名	生年月日	略歴		任期	所有株式数 (千株)
取締役	松原 亘子	昭和16年1月9日生	昭和39年4月 昭和62年3月 平成3年10月 平成9年7月 平成11年4月 平成14年9月 平成14年11月 平成18年1月 平成18年7月 平成20年6月 平成24年7月 〔主要な兼職〕	労働省（現 厚生労働省）入省 同 国際労働課長 同 婦人局長 労働事務次官 日本障害者雇用促進協会会長 駐イタリア大使 兼駐アルバニア大使 兼 駐サンマリノ大使 兼 駐マルタ大使 財団法人21世紀職業財団（現 公益財団法人21世紀職業財団）顧問 財団法人21世紀職業財団会長 当社取締役 財団法人21世紀職業財団名誉会長 公益財団法人21世紀職業財団名誉会長 ㈱荏原製作所社外取締役 ㈱電通社外取締役	(注②)	45
取締役	但木 敬一	昭和18年7月1日生	昭和44年4月 平成8年4月 平成9年7月 平成9年12月 平成14年1月 平成16年6月 平成18年6月 平成20年6月 平成20年7月 平成21年6月 〔主要な兼職〕	任 検事 大分地方検察庁検事正 最高検察庁検事 法務大臣官房長 法務事務次官 東京高等検察庁検事長 検事総長 検事総長を退官 弁護士登録 当社取締役 森・濱田松本法律事務所客員弁護士 日本生命保険（相）社外監査役 ㈱フジタ社外監査役 ㈱ミロク情報サービス社外監査役 ㈱アール・エス・シー社外取締役	(注②)	-
取締役	小野寺 正	昭和23年2月3日生	平成元年6月 平成7年6月 平成9年6月 平成13年6月 平成17年6月 平成22年12月 平成26年6月 平成27年7月 〔主要な兼職〕	第二電電㈱（現 KDDI ㈱）取締役 同社常務取締役 同社代表取締役副社長 KDDI ㈱代表取締役社長 同社代表取締役社長兼会長 同社代表取締役会長 当社取締役 KDDI ㈱取締役会長 KDDI ㈱取締役会長 京セラ㈱社外取締役 沖縄セルラー電話㈱取締役	(注②)	5
取締役	小笠原 倫明	昭和29年1月29日生	昭和51年4月 平成15年1月 平成16年1月 平成17年2月 平成17年8月 平成18年7月 平成19年7月 平成20年7月 平成22年1月 平成24年9月 平成25年10月 平成27年6月 〔主要な兼職〕	郵政省入省 総務省東北総合通信局長 総務省関東総合通信局長 総務省大臣官房審議官 総務省自治行政局公務員部長 総務省消防庁国民保護・防災部長 総務省情報通信政策局長 総務省情報通信国際戦略局長 総務審議官 総務事務次官 ㈱大和総研 顧問 当社取締役 ㈱スカパーJSATホールディングス社外取締役 一般財団法人日本ITU協会理事長 公益財団法人科学技術融合振興財団理事 一般財団法人財政金融企画事務所理事 損害保険ジャパン日本興亜㈱顧問 一般社団法人世界貿易センター東京理事 一般社団法人日本ミャンマー協会理事 住友商事㈱顧問	(注②)	4

役名	氏名	生年月日	略歴		任期	所有株式数 (千株)
取締役	竹内 弘高	昭和21年10月16日生	昭和51年9月 昭和52年12月 昭和58年4月 昭和62年4月 平成10年4月 平成22年4月 平成22年7月 平成28年6月 〔主要な兼職〕	ハーバード大学経営大学院講師 ハーバード大学経営大学院助教授 一橋大学商学部助教授 一橋大学商学部教授 一橋大学大学院国際企業戦略研究科 研究科長 一橋大学名誉教授 ハーバード大学経営大学院教授 当社取締役 ハーバード大学経営大学院教授 インテグラル㈱社外取締役 ㈱ビー・アンド・イー・ディレクションズ社外取締 役 ㈱グリーンペプタイト社外取締役 三井物産㈱社外取締役 ㈱t-lab取締役 Global Academy㈱会長	(注②)	-
取締役	西川 郁生	昭和26年7月1日生	平成2年9月 平成5年1月 平成7年7月 平成13年8月 平成19年4月 平成24年4月 平成28年6月 平成29年4月 〔主要な兼職〕	センチュリー監査法人(現 新日本有限責任監査法 人)代表社員 国際会計基準委員会JICPA代表 日本公認会計士協会常務理事 企業会計基準委員会副委員長 企業会計基準委員会委員長 慶應義塾大学商学部教授 当社取締役 慶應義塾大学大学院商学研究科客員教授 エーザイ㈱社外取締役 雪印メグミルク㈱社外取締役 三菱商事㈱社外監査役 慶應義塾大学大学院商学研究科客員教授	(注②)	-
計						526

- (注) ① 取締役松原亘子、但木敬一、小野寺正、小笠原倫明、竹内弘高及び西川郁生は、「社外取締役」であります。
- ② 取締役の任期は、平成29年3月期にかかる定時株主総会終結の時から平成30年3月期にかかる定時株主総会終結の時までであります。
- ③ 当社は指名委員会等設置会社であります。委員会体制につきましては次のとおりであります。

指名委員会 委員長 小野寺 正
 委 員 日比野 隆司
 委 員 中田 誠司
 委 員 松原 亘子
 委 員 但木 敬一
 委 員 小笠原 倫明
 委 員 竹内 弘高

監査委員会 委員長 但木 敬一
 委 員 松田 守正
 委 員 松原 亘子
 委 員 小笠原 倫明
 委 員 西川 郁生

報酬委員会 委員長 竹内 弘高
 委 員 日比野 隆司
 委 員 中田 誠司
 委 員 小野寺 正
 委 員 西川 郁生

(2) 執行役の状況

役名	職名	氏名	生年月日	略歴		任期	所有株式数 (千株)
代表執行役 社長	最高経営責任者(CEO)兼 リテール部門担当	中田 誠司	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
代表執行役 副社長	最高執行責任者(COO)兼 ホールセール部門担当 兼リテール部門副担当	西尾 信也	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
執行役 副社長	ホールセール部門副担 当	高橋 一夫	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
執行役 副社長	アセットマ ネジメント 部門担当	岩本 信之	昭和31年6月14日生	昭和55年4月 平成11年4月 平成13年4月 平成17年4月 平成18年6月 平成19年4月 平成20年4月 平成21年4月 平成23年4月 平成24年1月 平成24年4月 平成25年4月 平成26年4月 平成28年4月 平成28年6月 〔主要な兼職〕	当社入社 大和証券エスビーキャピタル・マーケット 株へ転籍 同社 国際金融部長 当社執行役 最高財務責任者 (CFO) 兼 企画副担当 当社取締役 兼 執行役 当社 最高財務責任者 (CFO) 当社取締役 兼 常務執行役 当社取締役 兼 専務執行役 最高財務責 任者 (CFO) 兼 企画担当 兼 人事担 当 当社取締役 兼 代表執行役副社長 最高 執行責任者 (COO) 兼 最高財務責任者 (CFO) 兼 企画担当 兼 人事担当 大和証券キャピタル・マーケット株代表取 締役副社長 当社 最高執行責任者 (COO) 兼 最高 財務責任者 (CFO) 兼 企画担当 兼 人 事担当 兼 海外担当 当社 最高執行責任者 (COO) 兼 最高 財務責任者 (CFO) 兼 人事担当 兼 海外担当 大和証券株代表取締役副社長 当社 最高執行責任者 (COO) 兼 人事 担当 兼 海外担当 当社 最高執行責任者 (COO) 兼 海外 担当 当社取締役 兼 執行役副社長 アセット マネジメント部門担当 大和証券投資信託委託株 代表取締役社長 当社執行役副社長 大和証券投資信託委託株 代表取締役社長	(注①)	65

役名	職名	氏名	生年月日	略歴		任期	所有株式数 (千株)
執行役 副社長	シンクタンク 部門担当	草木 頼幸	昭和33年3月31日生	昭和55年4月 平成11年4月 平成11年7月 平成14年7月 平成16年5月 平成17年4月 平成18年4月 平成18年10月 平成19年4月 平成20年4月 平成21年4月 平成24年4月 平成24年6月 平成25年4月 平成28年4月 平成28年6月 〔主要な兼職〕	当社入社 大和証券㈱へ転籍 大和証券エスビーキャピタル・マーケット ㈱へ転籍 同社 事業法人第三部長 同社執行役員 事業法人担当 同社 事業法人第三部担当 同社 事業法人第二部担当 兼 事業法人 第三部担当 同社 事業法人第三部担当 兼 事業法人 第四部担当 同社常務執行役員 同社 事業法人担当 大和証券㈱専務取締役 営業本部長 当社執行役副社長 リテール部門副担当 大和証券㈱代表取締役副社長 当社取締役 兼 執行役副社長 当社 リテール部門担当 当社 シンクタンク部門担当 ㈱大和総研ホールディングス代表取締役社 長 ㈱大和総研代表取締役社長 ㈱大和総研ビジネス・イノベーション代表 取締役社長 当社執行役副社長 ㈱大和総研ホールディングス代表取締役社 長 ㈱大和総研代表取締役社長 ㈱大和総研ビジネス・イノベーション代表 取締役社長	(注①)	71
専務執行役	企画担当 兼ホールセ ール部門副 担当	松井 敏浩	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
専務執行役	海外担当	田代 桂子	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
専務執行役	最高財務責 任者(CFO)兼 海外副担当	小松 幹太	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
専務執行役	情報技術担 当 (CIO)	中川 雅久	昭和37年6月10日生	昭和62年4月 平成16年2月 平成21年4月 平成22年4月 平成23年4月 平成25年4月 平成28年4月 平成29年4月 〔主要な兼職〕	当社入社 大和証券㈱へ転籍 同社 大宮支店長 同社執行役員 業務・システム担当 兼 制度ビジネス担当 当社執行役員 業務・システム担当 大和証券㈱執行役員 大和証券キャピタル・マーケット㈱執行役 員 当社常務執行役員 大和証券㈱常務執行役員 当社常務執行役 情報技術担当 (CIO) 大和証券㈱常務取締役 当社専務執行役 大和証券㈱専務取締役 大和証券㈱専務取締役	(注①)	27

役名	職名	氏名	生年月日	略歴		任期	所有株式数 (千株)
常務執行役	最高リスク 管理責任者 (CRO)	猪瀬 祐之	昭和35年4月8日生	昭和59年4月 平成11年4月 平成22年4月 平成23年4月 平成24年4月 平成26年4月 平成27年4月 [主要な兼職]	当社入社 大和証券エスビーキャピタル・マーケット ㈱へ転籍 当社へ転籍 グループリスクマネジメント 部長 当社執行役 グループリスクマネジメント 担当 大和証券㈱執行役員 大和証券キャピタル・マーケット㈱ 執行 役員 当社執行役員 グループリスクマネジメン ト担当 当社執行役 最高リスク管理責任者 (CRO) 大和証券㈱取締役 当社常務執行役 大和証券㈱常務取締役 大和証券㈱常務取締役	(注①)	36
常務執行役	内部監査 担当	白瀧 勝	昭和36年6月30日生	昭和60年4月 平成11年4月 平成21年10月 平成23年4月 平成25年4月 平成25年6月 平成26年4月 平成28年4月 平成28年6月	当社入社 大和証券エスビーキャピタル・マーケット ㈱へ転籍 当社へ転籍 当社 グループ内部監査部長 大和証券㈱ 内部監査部長 大和証券キャピタル・マーケット㈱ 内部 監査部長 当社執行役員 大和証券㈱監査役 大和住銀投信投資顧問㈱監査役 大和プロパティ㈱監査役 当社取締役 ㈱大和総研ビジネス・イノベーション監査 役 当社取締役 兼 常務執行役 内部監査担 当 大和証券㈱常務執行役員 当社常務執行役	(注①)	33
常務執行役	人事担当	望月 篤	昭和40年6月11日生	昭和63年4月 平成11年12月 平成23年10月 平成25年4月 平成28年4月	当社入社 大和証券㈱へ転籍 同社 横浜支店長 当社執行役員 人事副担当 大和証券㈱執行役員 当社常務執行役 人事担当 大和証券㈱常務執行役員	(注①)	22
常務執行役	法務担当 兼 企画副 担当	荻野 明彦	昭和41年1月28日生	平成元年4月 平成22年4月 平成26年4月 平成27年4月 平成28年4月 平成29年4月	当社入社 経営企画部長 当社執行役員 法務担当 兼 企画副担当 大和証券㈱執行役員 当社 法務担当 兼 企画副担当 兼 海 外副担当 当社 法務担当 兼 企画副担当 当社常務執行役 大和証券㈱常務執行役員	(注①)	30
執行役	—	日比野 隆司	(1)取締役の状況 参照	(1)取締役の状況 参照		(注①)	(1)取締役 の状況参照
計 (注②)							284

(注) ① 執行役の任期は、平成29年3月期にかかる定時株主総会終結後最初に開催される取締役会終結の時から平成30年3月期にかかる定時株主総会終結後最初に開催される取締役会終結の時までであります。

② 所有株式数の計には、取締役を兼任する執行役の持株数は算入していません。

6 【コーポレート・ガバナンスの状況等】

(1) 【コーポレート・ガバナンスの状況】

① 会社の機関の内容

持株会社体制によるグループ経営を実践する当社は、国際的な水準に適う透明性・客観性の高いガバナンス体制を目指しております。さらに、効率性・専門性の高いグループ会社監督機能を実現し、グループ各社間のシナジーを発揮する一体感のあるグループ経営体制を構築していきます。

当社は、(a) 取締役会から執行役への大幅な権限委譲及び執行役の業務分掌の明確化により意思決定の機動性を向上させること、(b) 社外取締役が過半数を占める指名委員会・監査委員会・報酬委員会の三委員会を設置することにより経営の透明性の向上を図るとともに、専門性の高い社外取締役を招聘することで取締役会の監督機能をより効果的なものとする、(c) 高い独立性と倫理観を備えた社外取締役が、各自の見識及び経験に基づき取締役会及び三委員会において第三者の視点から助言等を行うことにより経営監視機能を発揮することを目的として、指名委員会等設置会社形態を採用しております。

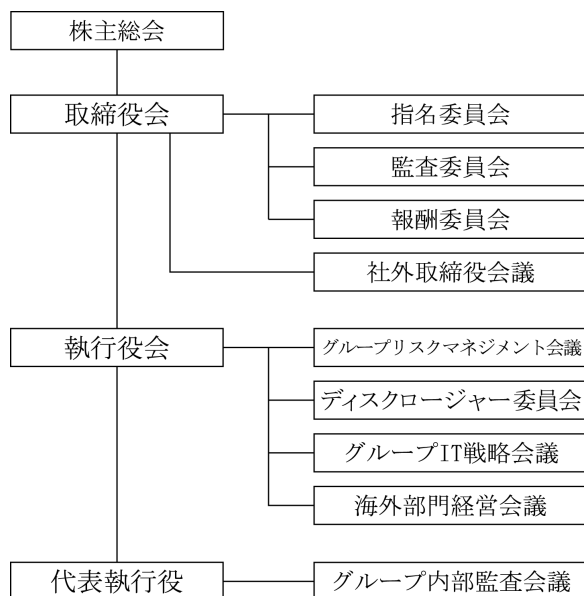
また、当社は、あらゆるステークホルダーからの信頼を獲得するため、CSRに積極的に取り組んでおります。CSRには、お客様への優れた商品・サービスの提供と誠実な対応、株主への適切な利益還元と情報開示、従業員の労働環境・人事評価上の施策、そして法令遵守・企業倫理の確立、環境マネジメント、社会貢献等の実に様々な側面があります。

それらの取組みにより、透明性、機動性、効率性を重視したコーポレート・ガバナンス体制の一層の強化が図られ、持続的な企業価値の向上につながるものと考えております。

当社のコーポレート・ガバナンス体制は、監督機関としての取締役会及び上記の指名委員会・監査委員会・報酬委員会の三委員会、業務執行機関としての執行役会及びその分科会であるグループリスクマネジメント会議・ディスクロージャー委員会・グループIT戦略会議、海外部門経営会議並びに最高経営責任者（CEO）直轄の内部監査機関であるグループ内部監査会議から構成されております。

グループ経営に、より多様な視点を取り入れるため、当社の取締役・執行役として2名、グループ全体では取締役・執行役・執行役員として7名の女性役員を登用しております。

<当社のコーポレート・ガバナンス体制>



(i) 取締役会

取締役会は、取締役会長を議長とし、3ヵ月に1回以上開催することとなっており、平成28年度には10回の取締役会が開催されました。

取締役会は、迅速な意思決定と効率的なグループ経営を推進するため業務執行の決定権限を可能な限り執行役に委譲する一方、経営の基本方針、監査委員会の職務遂行のために必要な事項、並びに執行役の選解任、職務の分掌及び指揮命令関係等に関する事項等の決定を行うことで業務執行を適切に監督しております。

取締役会の構成員は14名で、うち社外取締役が6名となっております。取締役会の構成員のうち、女性は2名です。なお、当社の取締役は20名以内とする旨を定款に定めております。

1) 指名委員会

指名委員会は1年に1回以上開催することとなっております。平成28年度については4回開催しております。

指名委員会は委員長を含む社外取締役5名と社内取締役2名で構成されております。

多角的な視点から取締役の指名を行うため、委員となる社外取締役の専門性も考慮しています。

委員会においては、コーポレート・ガバナンスに配慮した取締役会の構成及び取締役候補者の指名に関する基本的な考え方、並びに取締役候補者の選定等につき検討しております。

<取締役候補者の選定の方針について>

取締役候補者の選定の方針は以下のとおりです。

- ・大和証券グループの企業理念の実現のために最大の努力を行えること
- ・高い倫理観及び道德観を持ち、率先垂範して行動できること
- ・業務上の経験又は法律、会計、経営などの専門的な知識を有していること

社外取締役については上記に加え、独立性に関して以下の全てを満たすことを要件としております。

- ・大和証券グループの業務執行取締役、執行役、執行役員その他これに準ずる者又は従業員として勤務経験を有していないこと
- ・大和証券グループを大株主または主要な取引先とする会社の取締役、執行役、支配人その他の使用人でないこと
- ・その他、取締役としての職務を遂行する上で独立性を害するような事項がないこと

<取締役会の構成について>

取締役会の構成についての方針は以下のとおりです。

- ・原則として、取締役のうち2名以上かつ3分の1以上を独立社外取締役として選任する
- ・取締役会全体としての知識、経験及び能力のバランス並びに多様性を確保することに努める

2) 監査委員会

監査委員会は、原則として毎月1回開催しており、平成28年度については12回開催しました。監査委員会は、執行役を兼務しない取締役5名で構成され、委員長を含む4名は社外取締役で、他の1名は常勤の社内取締役です。なお、監査委員長の但木敬一は、検事総長等を歴任し、現在弁護士資格を有しており、法務に関する相当程度の知見を有しており、監査委員の西川郁生は公認会計士の資格を有し、企業会計基準委員会委員長等を歴任するなど財務及び会計に関する相当程度の知見を有しております。

監査委員会の職務は、取締役及び執行役の職務執行の監査、事業報告及び計算書類等の監査、監査報告の作成、株主総会に提出する会計監査人の選解任並びに不再任に関する議案の内容決定等であります。

監査委員が取締役会に出席することに加え、監査委員会が選定した監査委員が執行役会等の重要会議への出席や重要書類の閲覧、役職員からの報告聴取等を行い、他の監査委員に情報提供を行うことによって、監査委員会による実効的な監査の環境整備に努めております。

なお、監査委員会の業務を補佐する専任部署として監査委員会室を設置しております。

3) 報酬委員会

報酬委員会は1年に1回以上開催することとなっております。平成28年度については5回開催しております。

報酬委員会は、委員長を含む3名の社外取締役と社内取締役2名で構成されております。

合理的な報酬制度の設計・運用・検証を行うため、委員となる社外取締役の専門性も考慮しています。なお、報酬委員長の竹内弘高は、これまでの経歴を通じて、経営戦略及び報酬制度に関する相当程度の知見を有しております。

委員会においては、役員報酬に関する方針及び個別報酬内容の決定に関する事項、並びに連結業績の向上に資するグループ全体のインセンティブ・プラン等につき検討しております。

4) 社外取締役会議

社外取締役会議は、当社の社外取締役相互における情報共有を主たる目的とし、取締役会の議案の内容を含め意見交換を図っております。

同会議は、毎年1回以上開催することとなっております。

(ii) 執行役会

執行役会は、執行役全員をもって構成し、原則として毎月1回開催しております。

執行役会は、当社の重要な業務に関する事項を審議決定し、また当社グループにかかる事業戦略及びグループ各社間にまたがる構造問題等に関する基本方針を審議・決定しております。

執行役会は、経営の意思決定を迅速に行うため、取締役会から業務執行の決定権限を可能な限り委譲されております。さらに、より専門的な審議を行うため、特定の執行役等を構成員とするグループリスクマネジメント会議、ディスクロージャー委員会、グループIT戦略会議、海外部門経営会議という4つの分科会を設置しております。

また、当社執行役の一部がグループ各社の主要役員を兼務することにより、グループ経営の一体性を確保し、グループ戦略に基づいた部門戦略を効率的・効果的に実現することが可能となります。

1) グループリスクマネジメント会議

グループリスクマネジメント会議は、当社グループのリスク管理態勢及びリスクの状況等を把握し、リスク管理に係る方針及び具体的な施策を審議・決定しております。

同会議は、最高経営責任者（CEO）が議長を務め、原則として毎月1回開催しております。

2) ディスクロージャー委員会

ディスクロージャー委員会は、当社グループの経営関連情報の開示、内部統制報告制度の評価範囲、財務報告の連結範囲、重要な会計方針等に係る意思決定を担っており、原則として、四半期毎の決算発表や有価証券報告書、四半期報告書の提出に先立ち開催するほか、重要な開示事項が発生した場合等には随時開催しております。

同委員会は、上記の意思決定を行うにあたり、密接な関係のある部門を担当する執行役や部署を管轄する執行役等を構成員とし、委員長は最高経営責任者（CEO）が構成員の中から選定します。有価証券報告書提出日現在、最高財務責任者（CFO）が委員長を務めております。

3) グループIT戦略会議

グループIT戦略会議は、グループIT投資予算、グループ内のIT機能配置、グループ各社のIT投資の実行状況の評価・モニタリング並びにグループ横断的なシステムインフラ構築の実行に関する事項等を審議・決定しております。

同会議は、最高経営責任者（CEO）が議長を務め、原則として6ヵ月に1回開催しております。

4) 海外部門経営会議

海外部門経営会議は、海外店等の経営管理に関する事項その他これに関連する事項を審議・決定しております。

同会議は、最高経営責任者（CEO）が議長を務め、原則として毎月1回開催しております。

(iii) グループ内部監査会議

グループ内部監査会議は、グループの業務運営、内部監査態勢及び内部統制の適切性・有効性を確保することを目的に、グループの業務に係わる内部監査態勢の整備及び内部統制の検証に関する事項を審議・決定しております。

同会議は、最高経営責任者（CEO）が議長を務め、原則として2ヵ月に1回開催しております。

② 内部統制態勢の整備の状況等

(i) 内部統制組織

当社グループでは、業務を健全かつ適切に遂行できる内部統制態勢の維持は経営者の責任であるとの認識に立って、グループの事業に係る各種の主要なリスクについて当社を中心とする管理態勢を構築し、業務の有効性及び効率性、財務報告の信頼性、事業活動に関わる法令等の遵守、資産の保全等を図っております。

また、健全かつ効率的な内部統制態勢の構築を通じてグループの価値が高められるとの認識に基づき、内部監査は其中で重要な機能を担うものと位置付け、当社に専任の内部監査担当執行役を置き、他の部署から独立した内部監査部が内部統制態勢を検証しております。

法令・社内規程等に抵触する行為を早期に発見し、是正するための制度として、グループ横断的な「企業倫理ホットライン」（内部通報制度）も導入しております。通報者の保護や匿名性の確保に加え、通報先についても、社内担当者のみならず社外法律事務所への通報も可能にする等の配慮をしております。現在では、社員への認知度も向上し、一定の成果をあげております。

また、国内外のグループ各社の事業活動を適切に管理することを目的として、グループ会社管理規程及び海外店の運営管理に関する規程等を定め、グループ各社からの情報の徴求、承認・報告事項等の明確化を図っております。

(ii) 監査委員会監査の状況

監査委員会は、監査委員会が定めた監査委員会監査基準に準拠し、監査の方針、職務の分担等に従い、内部監査部門及び会計監査人と連携して監査を行っております。平成28年度は、①お客様からの信頼の構築に向けた取り組み、②グローバル規制に対応したリスク管理態勢、③グループ各社の内部統制、④グローバルビジネスにおける連携態勢を重点課題として、監査を行いました。

監査委員会は、当社の内部監査部から当社グループの内部監査状況について定期的に報告を受けるとともに、監査委員会が選定した監査委員は、グループ内部監査会議に出席し、必要に応じて意見を述べております。また、監査委員会は、必要に応じて内部監査部に調査を委嘱することができます。

監査委員会は、会計監査人と定期的な会合を開催し、会計監査人から監査計画及び監査の状況・結果等について報告を受けるとともに、会計監査人の独立性や品質管理体制を評価しております。また、監査委員会が選定した監査委員は、必要に応じて適宜会計監査人からヒアリングを実施しております。

さらに、監査委員会は、内部統制機能を所轄するコンプライアンス部、財務部、リスクマネジメント部、総務部等から定期的に報告を受けるとともに、監査委員会が選定した監査委員は、執行役会、グループリスクマネジメント会議等に出席して広範な情報収集を図り、取締役及び執行役の職務施行状況を監査しております。

(iii) 内部監査の状況

当社グループでは、当社内部監査部が中心となってリスクベースで内部監査を実施し、効果的な内部監査を通じて企業価値向上を図っております。

グループの事業に関して内部監査が着目する事項は、大和証券及び海外拠点におけるグローバルな金融商品取引業者としての内部統制態勢、大和ネクスト銀行における銀行としての内部統制態勢、グループ連携ビジネスの状況、グループ各社に対する当社からの統制の状況等を含みます。

グループ各社の内部監査部門との連携は、定例会議、モニタリング及び監査活動を通じて実施しております。

また、内部監査計画の承認及び監査結果報告は、グループ内部監査会議で行っております。なお、内部監査計画は、監査委員会又は監査委員会から一定の職務権限を付与された選定監査委員の同意を得るものとし、監査結果は監査委員会にも報告しております。

当社内部監査部は、監査活動を効率的に行うために監査委員会及び会計監査人と連絡、調整を行っている他、上述のとおり、監査委員会から調査の委嘱を受ける場合があります。

(iv) 会計監査の状況

当社の会計監査業務を執行した公認会計士は、高波博之氏、貞廣篤典氏、小倉加奈子氏の3名で、公認会計士法第34条の10の5に基づく、有限責任 あずさ監査法人の指定有限責任社員です。いずれの指定有限責任社員も継続監査年数は7年以内です。当社の会計監査業務に係る補助者は、公認会計士10名、公認会計士試験合格者等18名、その他15名です。

(v) 社外取締役との関係

当社の社外取締役には、公益財団法人21世紀職業財団名誉会長の松原亘子、弁護士の但木敬一、KDDI株式会社取締役会長の小野寺正、総務事務次官等を歴任した小笠原倫明、ハーバード大学経営大学院教授の竹内弘高、及び慶應義塾大学大学院商学研究科客員教授の西川郁生が就任しております。所有株式数については、「5 役員の状況 (1) 取締役の状況」に記載しております。

当社と社外取締役の間に、取締役としての職務を遂行する上で、重大な利益相反を生じさせ、また独立性を阻害するような人的・資金的関係等の利害関係はありません。

社外取締役は、当社又は当社の特定関係事業者の出身者ではなく、社外取締役としての職務を遂行する上で重大な利益相反を生じさせるような事項がないことから、高い独立性を有するものと考えており、各社外取締役を東京証券取引所及び名古屋証券取引所に対し、独立役員として届け出ております。また、各社外取締役は、それぞれ、法律、経営、会計等に関する専門的な知識・経験を有することから、社外取締役として適任であると考えております。なお、社外取締役の選定に関する当社の方針に関しましては、「① 会社の機関の内容 (i) 取締役会 1) 指名委員会」に記載のとおりです。

各自の見識及び経験に基づき、社外取締役が、取締役会並びに指名委員会、監査委員会及び報酬委員会の三委員会において、第三者の視点から助言等を行うことにより、当社のコーポレート・ガバナンス体制において、経営監視機能を発揮することが期待されております。

なお、当社は、当社の取締役が他の会社の役員に就任するに際しては、競業取引の可能性等について検討し、取締役会での承認等の適切な措置を講じております。

社外取締役4名が構成員に含まれる監査委員会から一定の職務権限を付与された選定監査委員が、当社グループの業務に係わる内部監査態勢の整備及び内部統制の検証に関する事項について審議・決定するグループ内部監査会議に出席し、説明を求め意見を述べるができることに加え、執行役員及びその分科会に出席することができます。選定監査委員は、これらの会議において役職員からの報告聴取等を行い、他の監査委員に情報提供を行うことにより、監査委員会の実効的な監査の環境整備に努めております。さらに、監査委員会は会計監査人より会計監査の状況について定期的に報告を受けております。

また、当社は、各社外取締役との間で、会社法第423条第1項の責任を限定する契約を締結しており、当該契約に基づく賠償責任限度額は、金1,000万円又は会社法第425条第1項に定める最低責任限度額のいずれか高い額となります。

③ リスクアペタイト・フレームワーク

(i) リスクアペタイト・フレームワーク

平成20年の世界的な金融危機を背景に国際的な金融規制の強化が進展する中、グローバルに活動する金融機関は、経済や市場のストレス時においても十分な金融仲介機能を発揮できるだけの健全性の確保が求められています。当社グループでは、経営レベルでのリスクガバナンスの強化を目的に、リスクアペタイト・フレームワークを導入しています。

リスクアペタイト・フレームワークとは、ビジネス戦略達成のために進んで受け入れるべきリスクの種類と総量をリスクアペタイトとして定め、リスクテイク方針全般に関する社内の共通言語として用いる経営管理の枠組みのことをいいます。リスクアペタイトについては、流動性、自己資本等の観点からリスクアペタイト指標を選定し、受け入れるリスクの水準を設定し、管理・モニタリングしています。

当社グループでは、このような枠組みをリスクアペタイト・ステートメントとして文書化し、グループ内へのリスクアペタイトの浸透と経営管理態勢・リスク管理態勢の水準向上を図り、リスク文化の醸成に努めています。

(ii) リスクアペタイト・フレームワークの運営体制

当社グループでは、CEO、COO、CFO及びCROが協力してリスクアペタイト・フレームワークを構築しています。

取締役会は、流動性と自己資本に係るリスクアペタイトの定量指標を含め、リスクアペタイト・ステートメントを審議・決定しています。

リスクアペタイト・フレームワークに関する取締役会及び経営の職務執行の監査は、監査委員会が行います。

④ リスク管理体制の整備の状況

(i) 当社グループのリスク管理

当社は、リスクアペタイト・フレームワークに基づいて当社グループ全体のリスク管理を行う上で、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスクごとの担当役員・所管部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定しています。さらに、実効的なリスクガバナンス態勢を構築するため、「3つの防衛線」に係るガイドラインを定め、リスク管理の枠組みを整備しています。「3つの防衛線」とは、リスク管理における機能と役割・責任を明確にし、健全な管理を行う考え方であり、「第1の防衛線」はフロント部門自身による業務上の各種リスク認識と管理、「第2の防衛線」はリスク管理部門・コンプライアンス部門等による全社的リスク管理、「第3の防衛線」は内部監査部門により「第1・第2の防衛線」が有効に機能しているかについて検証・評価等を行うことをいいます。

子会社はリスク管理の基本方針に基づき、各事業のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行い、当社は子会社のリスク管理態勢及びリスクの状況をモニタリングしております。子会社のモニタリングを通して掌握した子会社のリスクの状況のほか、各社におけるリスク管理態勢上の課題等については、当社の執行役会の分科会であるグループリスクマネジメント会議に報告し、審議・決定しています。主要な子会社においてもリスクマネジメント会議等を定期的で開催し、リスク管理の強化を図っております。

(ii) 管理の対象となるリスク

<市場リスク>

市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等の相場が変動することにより、損失を被るリスクです。

当社グループのトレーディング業務では、損益変動の抑制のために適宜ヘッジを実施していますが、ストレス時にはヘッジが有効に機能しなくなる可能性があるため、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案した上で、VaR（一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額）、及び各種ストレステストによる損失見積りが自己資本の範囲内に収まるように、それぞれ限度枠を設定しています。その他、ポジション、感応度等にも限度枠を設定しております。当社のリスク管理部署ではグループ全体の市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

<信用リスク>

信用リスクとは、金融取引の取引先や保有する金融商品の発行体のデフォルト、あるいは信用力の変化等により損失を被るリスクです。当社グループのトレーディング業務における信用リスクには取引先リスクと発行体リスクがあります。

取引先リスクについては、当社グループが一取引先グループに対して許容できる与信相当額の上限を設定し、定期的にモニタリングしています。加えて、取引先リスク全体のリスク量にも限度額を設定しています。また、マーケットメイクにより保有する金融商品の発行体リスクについてもリスク量をモニタリングしています。

当社グループは、商品提供や資産運用・投資を行うことに伴い、様々な商品・取引のエクスポージャーが特定の取引先グループに集中するリスクがあります。当該取引先グループの信用状況が悪化した場合、大幅な損失が発生する可能性があるため、一取引先グループに対するエクスポージャーの合計に対し限度額を設定し、定期的にモニタリングしています。

<トレーディング業務以外の市場リスク及び信用リスク>

当社グループはトレーディング業務以外にも、投資業務における営業投資有価証券等、銀行業務における貸出金・有価証券等の他、取引関係上の目的等で投資有価証券等の資産を保有しております。これらの資産についても、市場リスク、信用リスクが生じますが、各事業において特有のリスク特性があるため、それらのリスク特性に応じたリスク管理を行っております。

<流動性リスク>

流動性リスクとは、市場環境の変化、当社グループ各社の財務内容の悪化などにより資金繰りに支障をきたすリスク、あるいは通常よりも著しく高いコストでの資金調達を余儀なくされることにより損失を被るリスクです。本項につきましては、「第2 事業の状況 6 財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析 (6) 資本の財源及び流動性に係る情報」をご覧ください。

<オペレーショナルリスク>

オペレーショナルリスクとは、内部プロセス・人・システムが不適切であることもしくは機能しないこと、又は外生的事象が生じることから生じる損失に係るリスクです。当社グループでは、オペレーショナルリスクを事務リスク、システムリスク、情報セキュリティリスク、コンプライアンスリスク、リーガルリスク、人的リスク、有形資産リスクに分類し、各リスクを所管する部署を定めて管理しています。

業務の高度化・多様化、システム化の進展等に伴い様々なリスクが生じており、オペレーショナルリスク管理の重要性は年々高まっています。

当社グループの主要なグループ各社では、当社のオペレーショナルリスク管理に関する規程に基づき、RCSA（リスク・コントロール・セルフアセスメント）を実施する等、適切なオペレーショナルリスク管理を行っております。加えて、権限の厳正化、人為的ミス削減のための事務処理の機械化、業務マニュアルの整備等の必要な対策を講じており、グループ各社の事業特性に応じたオペレーショナルリスクの削減に努めております。

<レピュテーションリスク>

レピュテーションリスクとは、当社グループに関する風評や、誤った情報等により当社グループの信用・評判・評価が低下し、不測の損失並びに当社取引先の動向への悪影響等が生じるリスクです。様々な事象に起因するため、その管理手法は必ずしも一律のものではありません。

当社グループでは、特に情報管理と情報提供の観点からディスクロージャー・ポリシーに基づく各種規程を整備し、当社にディスクロージャー委員会を設置しております。

当社グループ各社においては、ディスクロージャー委員会にレピュテーションリスクの発生が想定される情報を報告することが義務付けられており、当社での情報の把握、一元管理と、同委員会決定によるタイムリーで正確な情報発信を行っております。

また、当該リスクが発生した場合には、当社グループへの影響を最小限に留めるため、レピュテーションリスクにかかる問題・事象の状況把握に努め、誤りや不正確な情報については的確に是正し、誹謗中傷等に対しては、適切な対処を講じる等、リスクの未然防止及び極小化を図る広報・IR活動体制をとっております。

<会計・税務リスク>

会計・税務リスクとは、会計又は税務における基準・法令諸規則等に照らし適正な会計処理・開示、又は適正な税務申告・納付が行われないリスク、及びそれらに伴い損失を被るリスクです。

当社グループでは、財務報告に係る内部統制に関する基本規程に則り、財務報告に係る内部統制の整備及び運用並びに改善を図ることで会計リスクの削減に努めております。

また、主要なグループ会社に対して税務リスク管理として報告が必要な事項を通知し、適時に受領することで、当社グループ全体の税務リスク管理態勢及びリスク状況を適切に把握し、税務リスクを削減することに努めております。

⑤ 役員の報酬等

(i) 提出会社の役員区分ごとの報酬等の総額、報酬等の種類別の総額及び対象となる役員の員数

役員区分	報酬等の総額 (百万円)	報酬等の種類別の総額(百万円)				対象となる 役員の員数 (名)
		基本報酬	ストック・ オプション	業績連動型 報酬	退職慰労金	
取締役	27	24	3	—	—	2
執行役	1,219	553	87	578	—	14
社外取締役	105	105	—	—	—	7

(注) 取締役と執行役の兼任者(7名)の報酬は、執行役に対する報酬等の支給額の欄に記載しております。

(ii) 提出会社の役員ごとの連結報酬等の総額等

氏名	連結報酬等の 総額 (百万円)	役員区分	会社区分	連結報酬等の種類別の額(百万円)			
				基本報酬	ストック・ オプション	業績連動型 報酬	退職慰労金
鈴木 茂晴	213	執行役	提出会社	69	11	85	—
			大和証券	46	—	—	—
日比野 隆司	252	執行役	提出会社	69	11	124	—
			大和証券	46	—	—	—
中田 誠司	172	執行役	提出会社	60	8	77	—
			大和証券	25	—	—	—
西尾 信也	123	執行役	提出会社	19	6	—	—
			大和証券	46	—	51	—
松井 敏浩	101	執行役	提出会社	42	5	42	—
			大和証券	10	—	—	—
田代 桂子	102	執行役	提出会社	43	5	42	—
			大和証券	10	—	—	—
小松 幹太	101	執行役	提出会社	42	5	42	—
			大和証券	10	—	—	—

(注) 1 連結報酬等の総額が1億円以上である者に限定して記載しております。

2 役員区分は提出会社における役員区分を記載しております。

3 役員区分は取締役と執行役の兼任者については執行役と記載しております。

(iii) 役員の報酬等の額の決定に関する方針

取締役及び執行役の報酬については、

- ・健全なビジネス展開を通じて株主価値の増大に寄与し、短期及び中長期の業績向上へ結びつくインセンティブが有効に機能すること
 - ・グローバルに展開する証券グループとして、国内はもとより、国際的にも競争力のある水準であること
 - ・指名委員会等設置会社として、執行と監督が有効に機能すること
- を基本方針としております。

取締役及び執行役の報酬は、基本報酬、業績連動型報酬、株価連動型報酬で構成され、具体的には以下のとおりであります。

○ 基本報酬

- ・基本報酬は、役職、職責、役割に応じた固定報酬とする。

○ 業績連動型報酬

- ・業績連動型報酬は、連結ROE、連結経常利益を基準に、中期経営計画における経営目標の達成状況等を総合的に加味した上で、個人の貢献度合に応じて決定する。
- ・執行役を兼務しない取締役に対しては、業績連動型報酬を設定しない。

○ 株価連動型報酬

- ・株価連動型報酬として、株主価値との連動性を高めるために、基本報酬の一定割合に相当する価値のストック・オプション等を付与する。
- ・社外取締役に対しては、株価連動型報酬を設定しない。

⑥ 株式の保有状況

(i) 保有目的が純投資目的以外の目的である投資株式

銘柄数 256銘柄
 貸借対照表計上額の合計額 138,391百万円

(ii) 保有目的が純投資目的以外の目的である投資株式の銘柄、保有区分、株式数、貸借対照表計上額及び保有目的
 (前事業年度)

特定投資株式

銘柄	株式数 (株)	貸借対照表計上額 (百万円)	保有目的
日本航空株式会社	5,000,000	20,610	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
KDDI株式会社	4,501,800	13,532	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
GMOクリックホールディングス株式会社	11,100,000	8,136	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社帝国ホテル	3,045,520	7,424	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
Saigon Securities Inc.	57,271,471	6,042	アジアにおける証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社小糸製作所	1,000,000	5,100	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
カシオ計算機株式会社	2,036,000	4,623	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
電源開発株式会社	1,257,000	4,418	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	1,280,543	4,369	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
京セラ株式会社	840,000	4,163	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社フジ・メディア・ホールディングス	2,790,000	3,448	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
東宝株式会社	1,140,810	3,377	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
住友商事株式会社	2,200,000	2,460	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
横河電機株式会社	2,069,000	2,406	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
小野薬品工業株式会社	500,000	2,382	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社千葉銀行	4,053,000	2,273	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社バンダイナムコホールディングス	864,000	2,120	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
アサヒグループホールディングス株式会社	600,000	2,104	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社T&Dホールディングス	1,745,060	1,831	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社横浜銀行	3,249,000	1,689	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
MS&ADインシュアランスグループホールディングス株式会社	494,234	1,549	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社九州フィナンシャルグループ	2,126,309	1,379	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	3,926,150	1,294	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
キッセイ薬品工業株式会社	493,880	1,281	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化

銘柄	株式数 (株)	貸借対照表計上額 (百万円)	保有目的
J Xホールディングス株式会社	2,749,900	1,192	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
第一生命保険株式会社	800,000	1,090	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社京都銀行	1,452,000	1,065	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社乃村工藝社	612,000	999	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
損保ジャパン日本興亜ホールディングス株式会社	306,469	977	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社百五銀行	2,296,000	968	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化

(注) 住友商事株式会社以降に記載した銘柄は、貸借対照表計上額が資本金額の100分の1以下ですが、上位30銘柄について記載しております。

(当事業年度)

特定投資株式

銘柄	株式数 (株)	貸借対照表計上額 (百万円)	保有目的
日本航空株式会社	5,000,000	17,630	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
KDDI株式会社	4,501,800	13,154	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
GMOクリックホールディングス株式会社	11,100,000	8,658	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社帝国ホテル	3,045,520	6,352	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
京セラ株式会社	840,000	5,209	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社フジ・メディア・ホールディングス	2,790,000	4,285	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	896,443	3,626	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
住友商事株式会社	2,200,000	3,294	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
電源開発株式会社	1,257,000	3,274	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社千葉銀行	4,053,000	2,897	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社小糸製作所	500,000	2,895	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社バンダイナムコホールディングス	864,000	2,877	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社T&Dホールディングス	1,745,060	2,820	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
アサヒグループホールディングス株式会社	600,000	2,524	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
中信建投証券股份有限公司 (CSC Financial Co., Ltd.)	22,775,000	2,367	アジアにおける証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
Mirae Asset Daewoo Securities Co., Ltd.	2,363,485	2,145	アジアにおける証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
東宝株式会社	689,810	2,035	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
カシオ計算機株式会社	1,018,000	1,576	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	392,615	1,515	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
J Xホールディングス株式会社	2,749,900	1,503	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
キッセイ薬品工業株式会社	493,880	1,441	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化

銘柄	株式数 (株)	貸借対照表計上額 (百万円)	保有目的
MS & AD インシュアランスグループホールディングス株式会社	370,734	1,312	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
住友金属鉱山株式会社	774,000	1,225	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社京都銀行	1,452,000	1,177	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社九州フィナンシャルグループ	1,701,109	1,158	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
トヨタ自動車株式会社	184,700	1,115	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社百五銀行	2,296,000	1,019	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社北國銀行	2,276,502	962	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社阿波銀行	1,338,000	944	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化
株式会社コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,624,500	837	証券関連ビジネス拡大の為に関係維持・強化

(注) 中信建投証券股份有限公司 (CSC Financial Co., Ltd.) 以降に記載した銘柄は、貸借対照表計上額が資本金額の100分の1以下ではありますが、上位30銘柄について記載しております。

(iii) 保有目的が純投資目的である投資株式

該当事項はありません。

⑦ 剰余金の配当等の決定機関

当社は、会社法第459条に基づき、剰余金の配当等同条第1項各号に定める事項について、法令に別段の定めがある場合を除き、株主総会の決議によらず取締役会の決議により定める旨を定款で定めております。これは、剰余金の配当等に関する事項の決定を取締役会の権限とすることにより、株主への機動的な利益還元を行うことを目的とするものであります。

⑧ 取締役の選任の決議要件

当社は、取締役を選任する株主総会決議について、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行う旨を定款に定めております。

また、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとする旨を定款に定めております。

⑨ 株主総会の特別決議要件

当社は、株主総会を円滑に運営するため、会社法第309条第2項に定める株主総会の特別決議について、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行う旨を定款に定めております。

⑩ 取締役及び執行役の責任免除

当社は、取締役及び執行役が職務の遂行にあたり期待される役割を十分に発揮できるようにするため、会社法第426条第1項の規定により、取締役会の決議によって、会社法第423条第1項の取締役（取締役であった者を含む）及び執行役（執行役であった者を含む）の責任を、法令の限度において免除することができる旨を定款に定めております。

⑪ 種類株式

当社は、平成26年6月26日開催の定時株主総会において、国内外の法規制改正の流れを受け、新たに整備された「金融機関の秩序ある処理の枠組み」への対応を行うために、第1種優先株式、第2種優先株式及び第3種優先株式の発行を可能とする定款変更を決議しておりますが、有価証券報告書提出日現在、優先株式の発行は行っておりません。第1種優先株式、第2種優先株式及び第3種優先株式は、剰余金の配当及び残余財産の分配について普通株式に優先する等の株式の内容を有しており、法令に別段の定めがある場合を除き、当該優先株式の株主は株主総会において議決権を有していません。ただし、優先配当金が発行条件通り支払われない場合には、配当の支払いが再開されるまで議決権が発生することとなります。第1種優先株式及び第2種優先株式の株主は、普通株式を対価とする取得請求権を有しています。当社は、取得請求期間中に取得請求のなかった第1種優先株式及び第2種優先株式の全部を、普通株式を対価として取得します。また、当社は、一定の場合に、金銭を対価として第1種優先株式及び第3種優先株式を取得できることを定めています。さらに、当社は、各優先株式について定める一定の事由が生じた場合に、普通株式を対価として又は無償で、各当該優先株式の全部を取得することを定めています。

(2) 【監査報酬の内容等】

① 【監査公認会計士等に対する報酬の内容】

区分	前連結会計年度		当連結会計年度	
	監査証明業務に基づく報酬(百万円)	非監査業務に基づく報酬(百万円)	監査証明業務に基づく報酬(百万円)	非監査業務に基づく報酬(百万円)
提出会社	120	8	121	16
連結子会社	302	60	295	62
計	422	68	416	78

② 【その他重要な報酬の内容】

(前連結会計年度)

大和証券キャピタル・マーケットズヨーロッパリミテッド、大和証券キャピタル・マーケットズアメリカInc.等の当社の連結子会社の一部は、当社の監査公認会計士等と同様にKPMGグループに属する監査法人に対して、監査証明業務に基づく報酬及び税務業務等の非監査業務に基づく報酬を支払っております。

(当連結会計年度)

大和証券キャピタル・マーケットズヨーロッパリミテッド、大和証券キャピタル・マーケットズアメリカInc.等の当社の連結子会社の一部は、当社の監査公認会計士等と同様にKPMGグループに属する監査法人に対して、監査証明業務に基づく報酬及び税務業務等の非監査業務に基づく報酬を支払っております。

③ 【監査公認会計士等の提出会社に対する非監査業務の内容】

(前連結会計年度)

当社が監査公認会計士等に対して報酬を支払っている非監査業務の内容としては、コンフォートレターの作成等があります。

(当連結会計年度)

当社が監査公認会計士等に対して報酬を支払っている非監査業務の内容としては、コンフォートレターの作成等があります。

④ 【監査報酬の決定方針】

該当事項はありませんが、当社の監査公認会計士等に対する報酬は、監査日数・業務の内容等を勘案した上で定めております。

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) 当社の連結財務諸表は、「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）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) 当社の財務諸表は、「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。）に基づいて作成しております。

なお、当社は、特例財務諸表提出会社に該当し、財務諸表等規則第127条の規定により財務諸表を作成しております。

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、連結会計年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の連結財務諸表並びに事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

3 連結財務諸表等の適正性を確保するための特段の取組みについて

当社は、連結財務諸表等の適正性を確保するための特段の取組みを行っております。具体的には、会計基準等の内容を適切に把握し、又は会計基準等の変更等についての的確に対応することができる体制を整備するため、公益財団法人財務会計基準機構へ加入しております。また、同機構や監査法人等の開催するセミナーに参加しております。

1 【連結財務諸表等】

(1) 【連結財務諸表】

① 【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)	当連結会計年度 (平成29年 3 月31 日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	※3 3,334,784	※3 3,828,674
預託金	323,761	336,338
受取手形及び売掛金	17,090	16,649
有価証券	※3 2,091,090	※3 1,742,127
トレーディング商品	※3 7,501,242	※3 6,546,229
商品有価証券等	4,017,267	3,853,260
デリバティブ取引	3,483,975	2,692,968
営業投資有価証券	127,210	125,040
投資損失引当金	△11,053	△11,052
営業貸付金	432,785	655,709
仕掛品	503	1,285
信用取引資産	203,376	202,530
信用取引貸付金	183,654	174,524
信用取引借証券担保金	19,722	28,006
有価証券担保貸付金	5,250,135	5,305,518
借入有価証券担保金	5,184,274	5,005,170
現先取引貸付金	65,861	300,347
立替金	20,670	26,345
短期貸付金	288	606
未収収益	33,574	35,380
繰延税金資産	9,401	8,023
その他の流動資産	517,421	440,034
貸倒引当金	△722	△502
流動資産計	19,851,563	19,258,940
固定資産		
有形固定資産	※1 124,562	※1 124,980
建物	49,362	46,294
器具備品	17,287	19,949
土地	57,911	58,736
無形固定資産	84,879	90,596
のれん	7,972	6,103
借地権	3,222	3,219
ソフトウェア	51,899	63,443
その他	21,785	17,830
投資その他の資産	359,812	352,779
投資有価証券	※2, ※3 324,456	※2, ※3 318,751
長期貸付金	4,954	4,939
長期差入保証金	17,523	17,298
繰延税金資産	5,679	4,796
その他	※7 7,942	※7 7,655
貸倒引当金	※7 △743	※7 △661
固定資産計	569,255	568,356
資産合計	20,420,818	19,827,296

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年 3 月31日)	当連結会計年度 (平成29年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	6,413	8,166
トレーディング商品	5,300,861	4,658,595
商品有価証券等	2,315,450	2,261,720
デリバティブ取引	2,985,410	2,396,874
約定見返勘定	427,257	216,836
信用取引負債	54,387	62,377
信用取引借入金	※3 3,789	※3 3,086
信用取引貸証券受入金	50,597	59,290
有価証券担保借入金	5,901,794	6,018,813
有価証券貸借取引受入金	5,893,795	5,909,682
現先取引借入金	7,999	109,130
銀行業における預金	2,928,630	2,985,733
預り金	214,498	256,873
受入保証金	512,426	418,039
短期借入金	※3 820,019	※3 918,954
コマーシャル・ペーパー	137,720	-
1年内償還予定の社債	232,594	278,237
未払法人税等	40,498	15,084
繰延税金負債	2,293	1,790
賞与引当金	30,058	30,872
その他の流動負債	218,411	137,494
流動負債計	16,827,865	16,007,868
固定負債		
社債	1,204,711	1,219,344
長期借入金	※3 1,004,988	※3 1,179,264
繰延税金負債	19,151	10,234
退職給付に係る負債	38,417	39,791
訴訟損失引当金	2,174	15,903
その他の固定負債	6,532	7,527
固定負債計	2,275,976	2,472,065
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,970	3,929
特別法上の準備金計	※8 3,970	※8 3,929
負債合計	19,107,812	18,483,863

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年 3 月31日)	当連結会計年度 (平成29年 3 月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	231,889	230,712
利益剰余金	683,939	718,238
自己株式	△29,970	△12,719
自己株式申込証拠金	2	7
株主資本合計	1,133,257	1,183,636
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	59,922
繰延ヘッジ損益	△32,992	435
為替換算調整勘定	21,082	6,896
その他の包括利益累計額合計	86,574	67,254
新株予約権	8,958	8,729
非支配株主持分	84,214	83,813
純資産合計	1,313,005	1,343,433
負債・純資産合計	20,420,818	19,827,296

②【連結損益計算書及び連結包括利益計算書】

【連結損益計算書】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月 31 日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月 31 日)
営業収益		
受入手数料	288,418	273,335
委託手数料	70,325	60,947
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	28,553	29,729
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	34,743	34,287
その他の受入手数料	154,796	148,370
トレーディング損益	131,324	128,120
株券等トレーディング損益	23,430	21,471
債券・為替等トレーディング損益	107,893	106,649
営業投資有価証券関連損益	18,502	14,846
金融収益	149,451	143,241
その他の営業収益	66,014	56,953
営業収益計	653,711	616,497
金融費用	89,530	98,725
その他の営業費用	49,366	45,022
純営業収益	514,815	472,750
販売費・一般管理費		
取引関係費	72,339	69,754
人件費	※1 183,292	※1 175,830
不動産関係費	37,360	35,267
事務費	26,771	27,047
減価償却費	23,833	23,406
租税公課	8,887	10,530
貸倒引当金繰入れ	673	-
その他	11,358	11,852
販売費・一般管理費計	364,517	353,687
営業利益	150,297	119,062
営業外収益		
受取配当金	5,261	4,753
持分法による投資利益	6,959	8,412
投資事業組合運用益	840	2,076
為替差益	43	62
その他	3,051	2,481
営業外収益計	16,156	17,786
営業外費用		
支払利息	392	42
社債発行費	446	371
その他	466	811
営業外費用計	1,305	1,225
経常利益	165,148	135,623

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)
特別利益		
投資有価証券売却益	3,284	13,137
関係会社株式売却益	1,116	-
子会社清算益	-	1,310
持分変動利益	3,092	768
金融商品取引責任準備金戻入	-	28
償却債権取立益	232	-
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	-	700
その他	1,102	203
特別利益計	9,462	17,377
特別損失		
減損損失	※2 1,728	※2 430
関係会社株式売却損	-	651
投資有価証券評価損	462	51
子会社清算損	-	769
金融商品取引責任準備金繰入れ	43	-
事業再編関連費用	※3 1,688	※3 206
MMF等償還関連費用	-	305
訴訟損失引当金繰入額	-	※4 11,230
その他	774	351
特別損失計	4,698	13,996
税金等調整前当期純利益	169,912	139,004
法人税、住民税及び事業税	57,739	39,977
法人税等調整額	△10,803	△5,250
法人税等合計	46,935	34,726
当期純利益	122,977	104,278
非支配株主に帰属する当期純利益	6,128	210
親会社株主に帰属する当期純利益	116,848	104,067

【連結包括利益計算書】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)
当期純利益	122,977	104,278
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△37,462	△38,656
繰延ヘッジ損益	△5,820	33,183
為替換算調整勘定	△22,183	△13,926
持分法適用会社に対する持分相当額	△243	△43
その他の包括利益合計	※1 △65,710	※1 △19,442
包括利益	57,266	84,835
(内訳)		
親会社株主に係る包括利益	51,434	84,747
非支配株主に係る包括利益	5,832	88

③【連結株主資本等変動計算書】

前連結会計年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式 申込証拠金	株主資本合計
当期首残高	247,397	231,283	623,755	△15,771	3	1,086,668
当期変動額						
剰余金の配当			△56,664			△56,664
親会社株主に帰属する 当期純利益			116,848			116,848
自己株式の取得				△18,633		△18,633
自己株式の処分		498		4,433		4,932
非支配株主との取引に 係る親会社の持分変動		106				106
その他					△0	△0
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	—	605	60,183	△14,199	△0	46,588
当期末残高	247,397	231,889	683,939	△29,970	2	1,133,257

	その他の包括利益累計額			新株予約権	非支配株主持分
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	為替換算調整勘定		
当期首残高	135,687	△26,815	43,116	8,205	187,818
当期変動額					
剰余金の配当					
親会社株主に帰属する 当期純利益					
自己株式の取得					
自己株式の処分					
非支配株主との取引に 係る親会社の持分変動					
その他					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△37,203	△6,177	△22,033	753	△103,603
当期変動額合計	△37,203	△6,177	△22,033	753	△103,603
当期末残高	98,483	△32,992	21,082	8,958	84,214

当連結会計年度(自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)

(単位：百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式 申込証拠金	株主資本合計
当期首残高	247,397	231,889	683,939	△29,970	2	1,133,257
当期変動額						
剰余金の配当			△42,326			△42,326
親会社株主に帰属する 当期純利益			104,067			104,067
自己株式の取得				△13,086		△13,086
自己株式の処分		△186		1,610		1,424
自己株式の消却		△990	△27,737	28,728		—
連結範囲の変動			296			296
その他		0			4	4
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	—	△1,176	34,299	17,251	4	50,379
当期末残高	247,397	230,712	718,238	△12,719	7	1,183,636

	その他の包括利益累計額			新株予約権	非支配株主持分
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	為替換算調整勘定		
当期首残高	98,483	△32,992	21,082	8,958	84,214
当期変動額					
剰余金の配当					
親会社株主に帰属する 当期純利益					
自己株式の取得					
自己株式の処分					
自己株式の消却					
連結範囲の変動					
その他					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△38,561	33,427	△14,186	△229	△401
当期変動額合計	△38,561	33,427	△14,186	△229	△401
当期末残高	59,922	435	6,896	8,729	83,813

④【連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)
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	169,912	139,004
減価償却費	29,891	28,436
のれん償却額	1,048	1,108
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	△202	△47
金融商品取引責任準備金の増減額 (△は減少)	43	△28
受取利息及び受取配当金	△5,310	△4,760
支払利息	392	42
持分法による投資損益 (△は益)	△6,959	△8,412
投資有価証券売却損益 (△は益)	△3,284	△13,137
関係会社株式売却損益 (△は益)	△1,116	651
持分変動損益 (△は益)	△3,092	△768
減損損失	1,728	430
投資有価証券評価損益 (△は益)	462	51
訴訟損失引当金繰入額	-	11,230
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	13,873	△34,302
トレーディング商品の増減額	150,712	103,442
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	18,329	2,388
営業貸付金の増減額 (△は増加)	△146,319	△222,215
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	36,930	6,967
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	△147,485	65,627
短期貸付金の増減額 (△は増加)	132	△42
銀行業における預金の増減額 (△は減少)	182,949	57,103
短期差入保証金の増減額 (△は増加)	△85,844	25,270
受入保証金の増減額 (△は減少)	8,606	△93,845
預り金の増減額 (△は減少)	△33,519	48,937
その他	27,191	△5,472
小計	209,071	107,658
利息及び配当金の受取額	7,906	10,585
利息の支払額	△399	△42
法人税等の支払額又は還付額 (△は支払)	5,167	△73,657
営業活動によるキャッシュ・フロー	221,746	44,543

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)
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	△124,161	△100,112
定期預金の払戻による収入	119,008	108,290
有価証券の取得による支出	△813,080	△871,555
有価証券の売却及び償還による収入	1,326,499	1,195,447
有形固定資産の取得による支出	△46,761	△8,707
有形固定資産の売却による収入	149	129
無形固定資産の取得による支出	△30,113	△31,322
投資有価証券の取得による支出	△32,364	△15,070
投資有価証券の売却及び償還による収入	17,338	32,512
関係会社株式の取得による支出	△1,279	△4,083
関係会社株式の売却による収入	3,228	-
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の取得による支出	△3,180	-
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の売却による収入	-	2,791
貸付けによる支出	△1,682	△524
貸付金の回収による収入	1,687	526
その他	356	△607
投資活動によるキャッシュ・フロー	415,647	307,713
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)	△499,955	60,762
長期借入れによる収入	468,258	374,719
長期借入金の返済による支出	△161,402	△299,625
社債の発行による収入	422,967	395,705
社債の償還による支出	△414,540	△334,206
自己株式の売却による収入	9,130	1,315
自己株式の取得による支出	△18,633	△13,086
配当金の支払額	△56,664	△42,326
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	△2,331	△26
財務活動によるキャッシュ・フロー	△229,727	143,231
現金及び現金同等物に係る換算差額	△7,495	△1,836
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	400,170	493,651
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	※2 △47,039	△2,291
現金及び現金同等物の期末残高	※1 3,273,640	※1 3,766,145

【注記事項】

(連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項)

1 連結の範囲に関する事項

(1) 連結子会社の数 52社

主要な連結子会社の名称は、「第1 企業の概況 4 関係会社の状況」に記載のとおりであります。

当連結会計年度において、連結財務諸表に及ぼす重要性が高まったことにより6社を連結の範囲に含めております。また、株式の譲渡により1社、清算決議に伴い、連結財務諸表に及ぼす重要性が低下したことにより2社、清算終了により1社を連結の範囲から除外しております

(2) 主要な非連結子会社の名称等

主要な非連結子会社の名称

D I R インフォメーションシステムズ株式会社

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）及び利益剰余金（持分に見合う額）等それぞれの合計額は、いずれも連結財務諸表に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

(3) 議決権の過半数を自己の計算において所有している会社等のうち子会社としなかった会社等の名称等

当該会社等の数 9社

子会社としなかった主要な会社の名称

株式会社F-Power

株式会社三池火力発電所

株式会社Optimized Energy

子会社としなかった理由

当社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等の意思決定機関を支配していないことが明らかであると認められるためであります。

(4) 開示対象特別目的会社

開示対象特別目的会社の概要、開示対象特別目的会社を利用した取引の概要及び開示対象特別目的会社との取引金額等については、「開示対象特別目的会社関係」に記載のとおりであります。

2 持分法の適用に関する事項

(1) 持分法を適用した非連結子会社及び関連会社の数並びに主要な会社等の名称

持分法適用の非連結子会社数 0社

持分法適用の関連会社数 11社

主要な持分法適用の関連会社の名称

大和住銀投信投資顧問株式会社

大和証券オフィス投資法人

当連結会計年度において、株式の新規取得により1社、株式の追加取得による持分比率増加により1社を持分法の適用範囲に含めております。また、合併消滅により1社を持分法の適用範囲から除外しております。

持分法適用会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、5社については連結決算日又はその他の基準日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、その他の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。

(2) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の名称等

持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社のうち主要な会社の名称

D I R インフォメーションシステムズ株式会社

持分法を適用しない理由

持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の当期純損益（持分に見合う額）、利益剰余金（持分に見合う額）等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。

(3) 議決権の20%以上、50%以下を自己の計算において所有している会社等のうち関連会社としなかった会社等の名称等

当該会社等の数 8 社

関連会社としなかった主要な会社の名称

アルメックス P E 株式会社

関連会社としなかった理由

当社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等に重要な影響を与えることができないことが明らかであると認められるためであります。

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 48 社

12 月 4 社

連結子会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、2 社については当該会社の決算日現在の財務諸表を使用し、他の 2 社については連結決算日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、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 会計方針に関する事項

(1) 重要な資産の評価基準及び評価方法

① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法

連結子会社におけるトレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引等については時価法で計上しております。

② トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及び評価方法

トレーディング商品に属さない有価証券等については以下のとおりであります。

ア 売買目的有価証券

時価法（売却原価は移動平均法により算定）によっております。

イ 満期保有目的の債券

償却原価法によっております。

ウ その他有価証券

時価のあるものについては連結決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定）、時価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移動平均法による原価法で計上しております。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券または投資有価証券として計上しております（組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております）。また、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。

エ デリバティブ

時価法によっております。

③ たな卸資産の評価基準及び評価方法

仕掛品は、主として個別法による原価法（収益性の低下による簿価切下げの方法）で計上しております。

(2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法

① 有形固定資産

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。

② 無形固定資産、投資その他の資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

(3) 重要な引当金の計上基準

① 貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

② 投資損失引当金

一部の連結子会社において、当連結会計年度末に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資先会社の実情を勘案の上、その損失見込額を計上しております。

③ 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、各社所定の計算基準による支払見積額の当連結会計年度負担分を計上しております。

④ 訴訟損失引当金

証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当連結会計年度末における支払見積額を計上しております。

(4) 退職給付に係る会計処理の方法

退職給付に係る負債は、当社及び国内連結子会社については、従業員の退職給付に備えるため、社内規程に基づく当連結会計年度末における退職金要支給額を計上しております。これは、当該各社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別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。

(5) 重要な収益及び費用の計上基準

完成工事高及び完成工事原価の計上基準

一部の国内連結子会社における受注制作ソフトウェアに係る収益については、当連結会計年度末までの進捗部分について成果の確実性が認められる場合については工事進行基準（工事の進捗率の見積もりは原価比例法）を、その他の場合については工事完成基準を適用しております。

(6) 重要なヘッジ会計の方法

原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。

当社及び一部の連結子会社は、一部の有価証券、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。なお、一部の連結子会社においては、相場変動を相殺するヘッジのうちヘッジ対象とヘッジ手段に関する重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているものは、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えております。また、特例処理及び振当処理を採用しているものについては、その判定をもってヘッジの有効性の判定に代えております。

また、銀行業務を行う子会社では、外貨建金融資産・負債から生じる為替変動リスクに対するヘッジ会計の方法は、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」（日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号 平成14年7月29日。）に規定する繰延ヘッジによっております。ヘッジ有効性評価の方法については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを減殺する目的で行う通貨スワップ取引及び為替スワップ取引

をヘッジ手段とし、ヘッジ対象である外貨建金銭債権債務等に見合うヘッジ手段の外貨ポジション相当額が存在することを確認することによりヘッジの有効性を評価しております。

(7) のれんの償却方法及び償却期間

のれんについては、発生の都度、子会社等の実態に基づいて償却期間を見積り、20年以内の年数で均等償却しております。なお、のれんの金額に重要性が乏しい場合には、発生した連結会計年度に一括して償却しております。

(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、取得日から3ヶ月以内に満期日が到来する短期投資からなっております。

(9) その他連結財務諸表作成のための重要な事項

① 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

② 連結納税制度の適用

当社及び株式会社大和キャピタル・ホールディングスをそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(連結キャッシュ・フロー計算書関係)

前連結会計年度において、「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に含めていた「短期差入保証金の増減額(△は増加)」及び「受入保証金の増減額(△は減少)」は、重要性が増したため、当連結会計年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前連結会計年度の連結財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前連結会計年度の連結キャッシュ・フロー計算書において、「営業活動によるキャッシュ・フロー」の「その他」に表示していた△50,047百万円は、「短期差入保証金の増減額(△は増加)」△85,844百万円、「受入保証金の増減額(△は減少)」8,606百万円、「その他」27,191百万円として組み替えております。

(追加情報)

「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）を当連結会計年度から適用しております。

(連結貸借対照表関係)

※ 1 有形固定資産より控除した減価償却累計額の内訳

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
建物	70,521百万円	72,618百万円
器具備品	40,384	38,709
計	110,905	111,327

※ 2 非連結子会社及び関連会社に対するもの

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
投資有価証券	120,935百万円	129,138百万円
(うち、共同支配企業に対する 投資の金額)	13,515	13,953

※ 3 担保に供されている資産

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
定期預金	200百万円	200百万円
有価証券	315,203	387,904
トレーディング商品	480,978	488,099
投資有価証券	9,558	16,402
計	805,940	892,605

被担保債務

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
信用取引借入金	3,789百万円	3,053百万円
短期借入金	321,780	107,900
長期借入金	300,100	358,200
計	625,670	469,153

(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。なお、上記担保資産のほかに、借り入れた有価証券等を担保として、前連結会計年度は165,351百万円、当連結会計年度は154,337百万円差し入れております。

4 差し入れた有価証券等の時価

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
消費貸借契約により 貸し付けた有価証券	7,027,625百万円	7,230,775百万円
その他	475,787	628,904
計	7,503,412	7,859,679

(注) ※ 3 担保に供されている資産に属するものは除いております。

5 差し入れを受けた有価証券等の時価

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
消費貸借契約により 借り入れた有価証券	6,499,237百万円	6,513,334百万円
その他	364,120	589,547
計	6,863,357	7,102,881

6 貸出コミットメントにかかる貸付未実行残高

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
貸出コミットメントの総額	378,539百万円	351,067百万円
貸付実行残高	118,282	102,112
貸付未実行残高	260,256	248,954

なお、上記の貸出コミットメントの総額は、貸付実行されずに終了するものを含んでいるため、必ずしも貸付未実行残高全額が貸付実行されるものではありません。

※7 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)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
投資その他の資産・その他	6,278百万円	6,313百万円

※8 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項

金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5第1項

9 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)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
従業員(借入金)	177百万円	135百万円
その他(債務)	1,749	—
計	1,927	135

10 借入コミットメントにかかる借入未実行残高

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
	11,268百万円	11,219百万円

(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

前連結会計年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
32,825百万円	32,922百万円

※2 前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

以下の資産グループについて減損損失を計上しております。

	用途	地域	減損損失(百万円)
処分予定資産	低稼働資産	関東	1,728

資産のグルーピングは、管理会計上の区分に従い行っております。また、処分予定資産については個別物件単位で行っております。

収益性の著しい低下及び用途の変更に伴い、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失(1,728百万円)として特別損失に計上しております。

金額の内訳は、処分予定資産1,728百万円(うち、建物51百万円、器具備品183百万円、ソフトウェア1,476百万円、その他17百万円)であります。

なお、処分予定資産の回収可能価額は正味売却価額により測定しており、鑑定評価額等により評価しております。

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

以下の資産グループについて減損損失を計上しております。

	用途	地域	減損損失(百万円)
継続使用資産	低収益性資産	欧州	430

資産のグルーピングは、管理会計上の区分に従い行っております。

収益性の著しい低下に伴い、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失(430百万円)として特別損失に計上しております。

金額の内訳は、継続使用資産430百万円(のれん430百万円)であります。

なお、のれんの回収可能価額は再評価した企業価値により測定しております。

※3 前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

事業再編関連費用には、海外子会社の人員削減等に伴う費用が含まれております。

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

事業再編関連費用には、海外子会社の人員削減等に伴う費用が含まれております。

※4 当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

訴訟損失引当金繰入額には、当社の英国現地法人である大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパリミテッドに対するSingularis Holdings Limitedから平成26年7月に提起された訴訟に関する費用等が含まれております。

(連結包括利益計算書関係)

※ 1 その他の包括利益に係る組替調整額及び税効果額

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31 日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31 日)
その他有価証券評価差額金		
当期発生額	△31,869百万円	△27,683百万円
組替調整額	△23,786	△27,596
税効果調整前	△55,656	△55,280
税効果額	△18,193	△16,624
その他有価証券評価差額金	△37,462	△38,656
繰延ヘッジ損益		
当期発生額	△17,781百万円	37,548百万円
組替調整額	10,398	10,298
税効果調整前	△7,382	47,847
税効果額	△1,561	14,663
繰延ヘッジ損益	△5,820	33,183
為替換算調整勘定		
当期発生額	△21,816百万円	△13,384百万円
組替調整額	△366	△541
税効果調整前	△22,183	△13,926
税効果額	—	—
為替換算調整勘定	△22,183	△13,926
持分法適用会社に対する持分相当額		
当期発生額	△293百万円	△154百万円
組替調整額	49	111
持分法適用会社に対する 持分相当額	△243	△43
その他の包括利益合計	△65,710	△19,442

(連結株主資本等変動計算書関係)

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当連結会計年度期首	増加	減少	当連結会計年度末
普通株式(千株)	1,749,378	—	—	1,749,378

2 自己株式に関する事項

株式の種類	当連結会計年度期首	増加	減少	当連結会計年度末
普通株式(千株)	41,531	27,056	11,399	57,189

(注) 1 普通株式の株式数の増加27,056千株は、平成28年1月28日開催の取締役会決議による自己株式取得27,000千株、単元未満株式の買取請求56千株によるものであります。

2 普通株式の株式数の減少11,399千株は、単元未満株式の売渡請求による譲渡3千株、新株予約権の行使に伴う譲渡3,681千株、従業員持株E S O P信託口から従業員持株会への譲渡1,216千株、従業員持株E S O P信託終了による残余株式の処分6,492千株などであります。なお、当該E S O P信託は平成27年7月に終了しております。

3 新株予約権等に関する事項

会社名	内訳	目的となる株式の種類	目的となる株式の数(株)				当連結会計年度末残高(百万円)
			当連結会計年度期首	増加	減少	当連結会計年度末	
提出会社	ストック・オプションとしての新株予約権	—	—	—	—	—	8,958
合計		—	—	—	—	—	8,958

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年5月15日取締役会	普通株式	27,449	16	平成27年3月31日	平成27年6月1日
平成27年10月28日取締役会	普通株式	29,215	17	平成27年9月30日	平成27年12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) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの

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

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 発行済株式に関する事項

株式の種類	当連結会計年度期首	増加	減少	当連結会計年度末
普通株式(千株)	1,749,378	—	50,000	1,699,378

(注) 普通株式の株式数の減少50,000千株は、自己株式の消却によるものであります。

2 自己株式に関する事項

株式の種類	当連結会計年度期首	増加	減少	当連結会計年度末
普通株式(千株)	57,189	18,034	53,078	22,146

(注) 1 普通株式の株式数の増加18,034千株は、平成29年1月30日開催の取締役会決議による自己株式取得18,000千株、単元未満株式の買取請求34千株であります。

2 普通株式の株式数の減少53,078千株は、自己株式消却50,000千株、単元未満株式の売渡請求による譲渡4千株、新株予約権の行使に伴う譲渡2,937千株などであります。

3 新株予約権等に関する事項

会社名	内訳	目的となる株式の種類	目的となる株式の数(株)				当連結会計年度末残高(百万円)
			当連結会計年度期首	増加	減少	当連結会計年度末	
提出会社	ストック・オプションとしての新株予約権	—					8,729
合計		—					8,729

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年5月18日 取締役会	普通株式	20,308	12	平成28年3月31日	平成28年6月6日
平成28年10月28日 取締役会	普通株式	22,018	13	平成28年9月30日	平成28年12月1日

(2) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの

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29年5月16日 取締役会	普通株式	利益剰余金	21,804	13	平成29年3月31日	平成29年6月5日

(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

	前連結会計年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
現金・預金勘定	3,334,784百万円	3,828,674百万円
預入期間が3ヶ月を超える定期 預金等	△66,143	△62,529
預入期間が3ヶ月以内の譲渡性 預金	5,000	—
現金及び現金同等物	3,273,640	3,766,145

※2 持分比率の低下により連結子会社でなくなった会社の資産及び負債の主な内訳

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

大和証券オフィス投資法人の新投資口発行及び投資口売出しに伴い、当社グループの持分比率が低下したため、連結子会社から除外したことにより減少した同法人の資産及び負債の内訳は次のとおりであります。

流動資産	47,790百万円
固定資産	375,415
資産合計	423,205
流動負債	25,290
固定負債	189,492
負債合計	214,783

(リース取引関係)

<借手側>

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものにかかる未経過リース料

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
1年内	12,003	11,757
1年超	21,892	82,586
合計	33,896	94,344

<貸手側>

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものにかかる未経過リース料

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
1年内	811	917
1年超	1,579	200
合計	2,391	1,118

(金融商品関係)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社グループは有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業を行っております。具体的には、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、有価証券の引受け及び売出し、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、その他有価証券関連業並びに銀行業務、金融業等を営んでおります。

これらの業務において、当社グループでは商品有価証券等、デリバティブ取引、営業投資有価証券、貸出金、投資有価証券等の金融資産・負債を保有する他、社債、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、預金等による資金調達を行っております。資金調達を行う際には、ビジネスを継続するうえで十分な流動性を効率的に確保するという資金調達の基本方針の下、調達手段及び償還期限の多様化を図りながら、資産と負債の適正なバランスの維持に努め、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。また、主に金利スワップ及び通貨スワップ等を金融資産・負債に関する金利変動及び為替変動の影響をヘッジする目的で利用しております。

当社グループでは保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクをその特性に応じて適切に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社グループはトレーディング業務において、①有価証券等（株券・ワラント、債券及び受益証券等）、有価証券担保貸付金・借入金、信用取引資産・負債等、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引のデリバティブ商品、③金利スワップ及び通貨スワップ・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デリバティブ商品（店頭デリバティブ取引）等の金融商品を保有しております。また、投資業務において営業投資有価証券等、銀行業務において貸出金・有価証券等を保有する他、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。

これらの金融商品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す。市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等の市場で取引される商品の価格やレートが変化することによって、保有する金融商品又は金融取引により損失を被るリスク及び市場の流動性の著しい低下により市場における取引が成立せず、又は著しく不利な条件での取引を余儀なくされることにより、損失を被るリスクを指します。また、信用リスクとは、金融取引の取引先や保有する金融商品の発行体のデフォルト、あるいは信用力の変化等によって損失を被るリスクを指します。

なお、トレーディング業務において、顧客のニーズに対応するために行っている単独又は仕組債等に組込まれたデリバティブ取引の中には、対象資産である株式・金利・為替・コモディティ等の変動並びにそれらの相関に対する変動率が大きいものや、複雑な変動をするものが含まれており、対象資産に比べたリスクが高くなっております。これらのデリバティブ取引は、連結貸借対照表のトレーディング商品等に含めており、また、時価変動による実現・未実現の損益は、トレーディング損益として計上しております。

また、当社グループは金融商品を保有するとともに、社債、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、預金等による資金調達を行っており、流動性リスクに晒されております。流動性リスクとは、市場環境の変化や当社グループの財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、あるいは通常よりも著しく高い調達コストを余儀なくされることにより損失を被るリスクを指します。

トレーディング業務を行う証券子会社では、デリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者としてデリバティブ取引を利用しております。デリバティブ商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば、顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供等があります。最終利用者としては、当社グループの金融資産・負債に係る金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスク毎の担当役員・部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定し、グループ全体のリスク管理を行っております。子会社はリスク管理の基本方針に基づき、各事業のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行い、当社は子会社のリスク管理体制及びリスクの状況をモニタリングしております。また、子会社のモニタリングを通して掌握した子会社のリスクの状況の他、各社におけるリスク管理体制上の課題等については、当社の執行役会の分科会であるグループリスクマネジメント会議に報告し、審議しております。主要な子会社においてもリスクマネジメント会議等を定期的に開催し、リスク管理の強化を図っております。

① トレーディング目的の金融商品に係るリスク管理

(i) 市場リスクの管理

当社グループのトレーディング業務では、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案したうえで、バリュー・アット・リスク（一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額。以下「VaR」という。）、ポジション、感応度等に限度枠を設定しております。当社のリスク管理部署では市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出したVaRの限界を補うべく、過去的大幅なマーケット変動に基づくシナリオや、仮想的なストレスイベントに基づくシナリオを用いて、ストレステストを実施しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

当社グループにおける主要な証券子会社は、トレーディング商品に関するVaRの算定にあたって、ヒストリカル・シミュレーション法（保有期間1日、信頼区間99%、観測期間520営業日）を採用しております。

連結決算日における当社グループのトレーディング業務のVaRは、全体で23億円であります。

なお、当社グループでは算出されたVaRと損益を比較するバックテストを実施し、モデルの有効性を検証しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

(ii) 信用リスクの管理

当社グループのトレーディング業務における信用リスクには取引先リスクと発行体リスクがあります。取引先リスクについては、事前に取引先の格付等に基づく与信枠を設定し、当該与信枠の遵守状況をモニタリングしております。また、マーケットメイクにより保有する金融商品の発行体リスクについては、クレジットスプレッドの変動リスクを中心にモニタリングしております。さらに、大口与信の影響についても定期的なモニタリングをしております。

信用取引においては顧客への与信が発生しますが、担保として定められた委託保証金を徴求しております。また、有価証券貸借取引については、取引先に対する与信枠を設定したうえで、必要な担保を徴求するとともに日々の値洗い等を通じて信用リスクの削減を図っております。

② トレーディング目的以外の金融商品に係るリスク管理

当社グループはトレーディング業務以外でも、投資業務における営業投資有価証券等、銀行業務における貸出金・有価証券等の他、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。これらの金融商品についても市場リスク、信用リスクが生じますが、各業務における特有のリスク特性があるため、それらに応じたリスク管理を行っております。

投資業務を行う子会社では、投資委員会等で投資案件を精査したうえで投資の可否を判断しております。投資後は、投資先の状況を定期的にモニタリングし、リスクマネジメント会議等に報告しています。

銀行業務を行う子会社では、管理すべきリスクカテゴリーを特定し、その管理方針及び管理体制を定めています。また、リスク管理の協議・決定機関として、取締役会の下部組織であるリスクマネジメント委員会（信用・市場・流動性リスク等の管理・運営に関する重要事項を審議）等を設置しています。取締役会やリスクマネジメント委員会等で各種限度額を設定し、その範囲内で業務運営を行うことによりリスクをコントロールしております。

取引関係上の目的等の投資有価証券等は、関連規程等に定められた方針に基づき取得・売却の決定を行います。また、定期的にリスクの状況をモニタリングし、経営陣に報告しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

(ア) 金融資産及び金融負債（銀行業務を行う子会社が保有する金融資産及び金融負債を除く）

市場リスクの影響を受ける主たる金融資産は投資業務で保有する「営業投資有価証券」、取引関係上の目的で保有する「投資有価証券」となります。なお、平成29年3月31日現在、指標となる東証株価指数（TOPIX）等が10%変動したものと想定した場合には「営業投資有価証券」及び「投資有価証券」のうち、時価のある株式等において時価が137億円変動するものと把握しております。

また、市場リスクの影響を受ける主たる金融負債は「社債」及び「長期借入金」であります。なお、平成29年3月31日現在、その他全てのリスク変数が一定であると仮定し、金利が10ベース・ポイント（0.1%）変動したものと想定した場合、「社債」の時価が21億円、「長期借入金」の時価が3億円それぞれ変動するものと把握しております。

(イ) 銀行業務を行う子会社で保有する金融資産及び金融負債

銀行業務を行う子会社では、金融資産及び金融負債について、市場リスク（金利、為替、株式等の様々な市場のリスク・ファクターの変動により、資産・負債（オフ・バランスを含む。）の価値が変動し損失を被るリスク、資産・負債から生み出される収益が変動し損失を被るリスク）の管理にあたり、VaRを用いております。

VaR計測の方法は、ヒストリカル・シミュレーション法（信頼区間99%、観測期間750営業日）を採用しており、売買目的の金融商品は保有期間1日で算出した値を保有期間10日に、売買目的以外の金融商品は保有期間20日で算出した値を保有期間125日に換算した値をVaRとして利用しております。平成29年3月31日現在における当該数値は、売買目的の金融商品は2億円、売買目的以外の金融商品は88億円であります。

なお、当該子会社では、リスク計測モデルによって算出されたVaRと仮想損益額との比較を行うバックテストを定期的実施し、当該モデルの有効性を検証しております。平成28年度に実施したバックテストの結果、当該子会社で使用するリスク計測モデルは市場リスクを捕捉しているものと認識しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

このようなVaRによる管理の限界を補完するため、各種シナリオを用いた損失の計測（ストレステスト）を実施しております。

③ 流動性の管理

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、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、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、当社グループに適用される規制上の連結流動性カバレッジ比率の遵守が求められています。また、当社は、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上で、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。これにより、当社グループでは、今後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体制を構築しております。

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。

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。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額の他、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が変動することもあります。

2 金融商品の時価等に関する事項

連結会計年度末における連結貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（(注)2に記載のとおりであります）。

前連結会計年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	連結貸借対 照表計上額	時価	差額
資産			
(1) 現金・預金	3,334,784	3,334,784	—
(2) 預託金	323,761	323,761	—
(3) トレーディング商品			
①商品有価証券等	4,017,267	4,017,267	—
②デリバティブ取引	3,483,975	3,483,975	—
(4) 営業貸付金	432,785		
貸倒引当金	△374		
	432,411	432,212	△198
(5) 信用取引資産			
信用取引貸付金	183,654	183,654	—
信用取引借証券担保金	19,722	19,722	—
(6) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	5,184,274	5,184,274	—
現先取引貸付金	65,861	65,861	—
(7) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	9	9	0
②子会社株式及び関連会社株式	111,238		
投資損失引当金	△6,910		
	104,327	157,197	52,869
③その他有価証券	2,324,213	2,324,213	—
資産計	19,474,264	19,526,934	52,670
負債			
(1) トレーディング商品			
①商品有価証券等	2,315,450	2,315,450	—
②デリバティブ取引	2,985,410	2,985,410	—
(2) 約定見返勘定	427,257	427,257	—
(3) 信用取引負債			
信用取引借入金	3,789	3,789	—
信用取引貸証券受入金	50,597	50,597	—
(4) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	5,893,795	5,893,795	—
現先取引借入金	7,999	7,999	—
(5) 銀行業における預金	2,928,630	2,929,888	△1,258
(6) 預り金	214,498	214,498	—
(7) 受入保証金	512,426	512,426	—
(8) 短期借入金	820,019	820,019	—
(9) コマーシャル・ペーパー	137,720	137,720	—
(10) 1年内償還予定の社債	232,594	232,594	—
(11) 社債	1,204,711	1,214,625	△9,913
(12) 長期借入金	1,004,988	1,003,942	1,045
負債計	18,739,890	18,750,016	△10,126
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	2,637	2,637	—
ヘッジ会計が適用されているもの	△25,457	△19,993	5,464
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引計	△22,820	△17,355	5,464

※トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

当連結会計年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	連結貸借対 照表計上額	時価	差額
資産			
(1) 現金・預金	3,828,674	3,828,674	—
(2) 預託金	336,338	336,338	—
(3) トレーディング商品			
①商品有価証券等	3,853,260	3,853,260	—
②デリバティブ取引	2,692,968	2,692,968	—
(4) 営業貸付金	655,709		
貸倒引当金	△360		
	655,349	656,148	798
(5) 信用取引資産			
信用取引貸付金	174,524	174,524	—
信用取引借証券担保金	28,006	28,006	—
(6) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	5,005,170	5,005,170	—
現先取引貸付金	300,347	300,347	—
(7) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券			
①売買目的有価証券	11,927	11,927	—
②満期保有目的の債券	56,230	56,193	△36
③子会社株式及び関連会社株式	120,580		
投資損失引当金	△6,910		
	113,670	140,940	27,270
④その他有価証券	1,869,676	1,869,676	—
資産計	18,926,145	18,954,177	28,032
負債			
(1) トレーディング商品			
①商品有価証券等	2,261,720	2,261,720	—
②デリバティブ取引	2,396,874	2,396,874	—
(2) 約定見返勘定	216,836	216,836	—
(3) 信用取引負債			
信用取引借入金	3,086	3,086	—
信用取引貸証券受入金	59,290	59,290	—
(4) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	5,909,682	5,909,682	—
現先取引借入金	109,130	109,130	—
(5) 銀行業における預金	2,985,733	2,985,730	3
(6) 預り金	256,873	256,873	—
(7) 受入保証金	418,039	418,039	—
(8) 短期借入金	918,954	918,954	—
(9) コマーシャル・ペーパー	—	—	—
(10) 1年内償還予定の社債	278,237	278,237	—
(11) 社債	1,219,344	1,223,448	△4,104
(12) 長期借入金	1,179,264	1,177,574	1,690
負債計	18,213,068	18,215,479	△2,410
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	3,596	3,596	—
ヘッジ会計が適用されているもの	17,976	18,959	983
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引計	21,573	22,556	983

※トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法

(ア) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(イ) 預託金

主に顧客分別金信託で構成され、国債等の有価証券投資を行っているものについては類似の債券を含めた直前の取引値段から計算される各期間に応じた指標金利との利回り格差を用いて合理的に算出する価格に基づいて算定しております。その他運用商品については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ウ) トレーディング商品

① 商品有価証券等

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段（当社店頭、ブローカーズスクリーン等）や市場価格情報（売買参考統計値等）から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額

② デリバティブ取引

取引所取引のデリバティブ取引	主に取引所の清算値段又は証拠金算定基準値段
金利スワップ取引等	イールドカーブより算出される予想キャッシュ・フロー、原債券の価格・クーポンレート、金利、ディスカントレート、ボラティリティ、コリレーション等を基に、価格算定モデル（市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル）により算出した価格
店頭エクイティ・デリバティブ取引	株価又は株価指数、金利、配当、ボラティリティ、ディスカントレート、コリレーション等を用いて、価格算定モデル（市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル）により算出した価格
クレジット・デリバティブ取引	金利、参照先の信用スプレッド等を用いて、価格算定モデル（市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル）により算出した価格

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先の信用リスク相当額及び流動性リスク相当額を必要に応じて時価に追加しております。

(エ) 約定見返勘定

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(オ) 営業貸付金

主に銀行業における貸出金や顧客から保護預かりしている有価証券を担保として金銭を貸付する証券担保ローンであります。

銀行業における貸出金のうち、変動金利によるものは、短期間で市場金利を反映するため、貸出先の信用状態が実行後大きく異なっていない限り、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。ただし、一部の貸出金については、取引金融機関等から提示された価格により算定しております。また、固定金利によるものは、貸出金の種類及び期間等に基づき、元利金の合計額を同様の新規貸付を行った場合に想定される利率で割り引いて時価を算定しております。

証券担保ローンについては、返済見込期間及び金利条件等から、時価は帳簿価額と近似しているものと想定されるため、帳簿価額を時価としております。

(カ) 信用取引資産、信用取引負債

信用取引資産は顧客の信用取引に伴う顧客への貸付金と証券金融会社への担保金であり、前者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われ、後者は貸借取引業務において値洗いされる担保金であることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

信用取引負債は顧客の信用取引に伴う証券金融会社からの借入金と顧客の信用取引に係る有価証券の売付代金相当額であり、前者は値洗いされ、後者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

(キ) 有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金

そのほとんどが短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ク) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段（当社店頭、ブローカーズスクリーン等）や市場価格情報（売買参考統計値等）から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格、又は裏付資産の価値から合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額
組合出資金	組合出資金のうち、不動産による回収見込額等に基づき投資損失引当金を算定しているものについては、時価は連結決算日における貸借対照表価額から現在の投資損失引当金を控除した金額に近似しており、当該金額をもって時価としている

(ケ) 銀行業における預金

預金のうち、要求払預金については、決算日に要求された場合の支払額（帳簿価額）を時価とみなしております。

また、定期預金の時価は、将来のキャッシュ・フローを見積り、一定の割引率で割り引いて時価を算定しております。

割引率は当社の信用スプレッドを加味したイールドカーブから算出しております。

(コ) 預り金

主として顧客から受入れている預り金であり、当連結会計年度末に決済された場合の支払額（帳簿価額）を時価とみなしております。その他の預り金については短期間に支払いが行われるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(サ) 受入保証金

主としてデリバティブ取引における保証金であり、取引に応じて値洗いされる特性から、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。その他の顧客からの保証金については、当連結会計年度末に決済された場合の支払額（帳簿価額）を時価とみなしております。

(シ) 短期借入金、コマーシャル・ペーパー、1年内償還予定の社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ス) 社債

償還まで1年超の社債の時価について、市場価格（売買参考統計値等）が入手可能な場合には、その時価を市場価格から算定しております。市場価格が入手不可能な場合は、発行時からの金利変動及び当社自身の信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(セ) 長期借入金

借入当初からの金利変動及び信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(ソ) トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引

「(ウ) トレーディング商品 ②デリバティブ取引」と同様となっております。

(注) 2 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、資産(7)「③子会社株式及び関連会社株式」及び「④その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)

区分	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	37,575	36,431
その他有価証券		
非上場株式	28,994	33,412
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	32,485	48,818
その他	8,238	8,841

(注) ア 市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

イ 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には、子会社等に該当する投資事業有限責任組合等への出資が、前連結会計年度においては12,358百万円、当連結会計年度においては27,357百万円含まれております。

(注) 3 金銭債権及び満期のある有価証券の連結決算日後の償還予定額

前連結会計年度（平成28年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	3,334,784	—	—	—
預託金	323,761	—	—	—
営業貸付金	116,628	83,947	221,618	10,591
信用取引資産	203,376	—	—	—
有価証券担保貸付金	5,250,135	—	—	—
有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	—	9	—	—
国債・地方債等	—	9	—	—
社債	—	—	—	—
その他	—	—	—	—
その他有価証券のうち満期があるもの	236,397	553,607	1,107,904	140,552
債券	231,295	553,607	1,107,904	140,552
国債・地方債等	—	—	855,954	—
社債	1,106	32,210	—	126,065
その他	230,188	521,396	251,950	14,487
その他	5,102	—	—	—
合計	9,465,084	637,564	1,329,522	151,144

(注) ア 預託金については、主に顧客分別金信託で構成されており1年以内とみなして開示しております。

イ 信用取引資産及び有価証券担保貸付金については、短期間で決済されるものとみなして1年以内を含めて開示しております。

当連結会計年度（平成29年 3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	3,828,674	—	—	—
預託金	336,338	—	—	—
営業貸付金	113,152	70,860	464,333	7,363
信用取引資産	202,530	—	—	—
有価証券担保貸付金	5,305,518	—	—	—
有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	—	9	—	56,220
国債・地方債等	—	9	—	—
社債	—	—	—	56,220
その他	—	—	—	—
その他有価証券のうち満期があるもの	147,016	842,951	446,337	207,939
債券	147,016	842,951	446,337	207,939
国債・地方債等	—	524,699	—	140,066
社債	22,440	54,457	—	67,873
その他	124,576	263,794	446,337	—
その他	—	—	—	—
合計	9,933,230	913,821	910,671	271,523

（注）ア 預託金については、主に顧客分別金信託で構成されており 1年以内とみなして開示しております。

イ 信用取引資産及び有価証券担保貸付金については、短期間で決済されるものとみなして 1年以内を含めて開示しております。

（注）4 社債、長期借入金及びその他の有利子負債の連結決算日後の返済予定額

前連結会計年度（平成28年 3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
信用取引借入金	3,789	—	—	—
銀行業における預金	2,869,298	59,332	—	—
コマーシャル・ペーパー	137,720	—	—	—
社債	232,594	851,015	220,748	132,948
長期借入金	206,926	673,260	213,928	117,800
合計	3,450,329	1,583,607	434,676	250,748

（注）ア 信用取引借入金については、短期間で決済されるものとみなして 1年以内を含めて開示しております。

イ 銀行業における預金のうち、要求払預金については、1年以内を含めて開示しております。

当連結会計年度（平成29年 3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
信用取引借入金	3,086	—	—	—
銀行業における預金	2,949,133	36,600	—	—
コマーシャル・ペーパー	—	—	—	—
社債	278,237	696,558	387,823	134,962
長期借入金	107,503	726,464	288,000	164,800
合計	3,337,960	1,459,623	675,823	299,762

（注）ア 信用取引借入金については、短期間で決済されるものとみなして 1年以内を含めて開示しております。

イ 銀行業における預金のうち、要求払預金については、1年以内を含めて開示しております。

(有価証券関係)

1 トレーディング商品

商品有価証券等

前連結会計年度（平成28年3月31日）

(単位：百万円)

種類	時価	
	資産	負債
株券・ワラント	315,981	127,485
債券	2,921,648	2,169,942
コマーシャル・ペーパー及び譲渡性預金	9,324	—
受益証券	151,967	132
その他	618,345	17,891
連結会計年度の損益に含まれた評価差額	33,622	△22,997

当連結会計年度（平成29年3月31日）

(単位：百万円)

種類	時価	
	資産	負債
株券・ワラント	275,938	247,222
債券	2,649,544	2,002,770
コマーシャル・ペーパー及び譲渡性預金	—	—
受益証券	177,549	800
その他	750,228	10,927
連結会計年度の損益に含まれた評価差額	3,407	△7,920

2 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券

① 売買目的有価証券

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
連結会計年度の損益に含まれた評価差額	—	△120

② 満期保有目的の債券

前連結会計年度（平成28年3月31日）

(単位：百万円)

種類	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	9	10	0
国債・地方債等	9	10	0
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	—	—	—
国債・地方債等	—	—	—
社債	—	—	—
その他	—	—	—

当連結会計年度（平成29年 3月31日）

（単位：百万円）

種類	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	20,872	20,922	50
国債・地方債等	9	10	0
社債	20,862	20,912	49
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額を 超えないもの	35,357	35,270	△86
国債・地方債等	—	—	—
社債	35,357	35,270	△86
その他	—	—	—

③ その他有価証券

前連結会計年度（平成28年 3月31日）

（単位：百万円）

種類	連結貸借対照表 計上額	取得原価又は 償却原価	差額
連結貸借対照表計上額が取得原価又は 償却原価を超えるもの	1,755,197	1,602,558	152,638
株券	144,615	61,428	83,187
債券	1,576,988	1,511,169	65,818
国債・地方債等	855,954	803,866	52,087
社債	159,283	152,898	6,384
その他	561,750	554,403	7,347
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	—	—	—
その他	33,593	29,960	3,632
連結貸借対照表計上額が取得原価又は 償却原価を超えないもの	569,016	583,662	△14,645
株券	20,338	24,476	△4,138
債券	456,371	460,316	△3,944
国債・地方債等	—	—	—
社債	100	100	—
その他	456,271	460,216	△3,944
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	52,892	59,454	△6,562

- （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。（（金融商品関係） 2 金融商品の時価等に関する事項（注）2に記載のとおりであります。）
- 2 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には、子会社等に該当する投資事業有限責任組合等への出資が39,414百万円含まれております。

当連結会計年度（平成29年 3月31日）

（単位：百万円）

種類	連結貸借対照表 計上額	取得原価又は 償却原価	差額
連結貸借対照表計上額が取得原価又は 償却原価を超えるもの	1, 193, 848	1, 090, 299	103, 548
株券	133, 763	61, 988	71, 775
債券	1, 034, 005	1, 003, 309	30, 696
国債・地方債等	651, 679	626, 994	24, 684
社債	99, 525	96, 408	3, 116
その他	282, 801	279, 905	2, 895
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	—	—	—
その他	26, 078	25, 001	1, 077
連結貸借対照表計上額が取得原価又は 償却原価を超えないもの	675, 828	697, 499	△21, 670
株券	14, 634	17, 058	△2, 423
債券	610, 239	627, 497	△17, 257
国債・地方債等	13, 086	13, 100	△13
社債	45, 246	45, 299	△53
その他	551, 907	569, 097	△17, 189
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	32, 907	32, 907	—
その他	18, 046	20, 036	△1, 989

- （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。（（金融商品
関係） 2 金融商品の時価等に関する事項（注）2に記載のとおりであります。）
- 2 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には、子会社等に該当する投資事業有限責任組合等
への出資が32,907百万円含まれております。

④ 連結会計年度中に売却した満期保有目的の債券

前連結会計年度（自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日）

該当事項はありません。

当連結会計年度（自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日）

該当事項はありません。

⑤ 連結会計年度中に売却したその他有価証券

前連結会計年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計	売却損の合計
株券	59,489	17,842	1,098
債券	881,267	22,788	3,332
国債・地方債等	446,152	18,744	—
社債	99,781	2,518	—
その他	335,333	1,524	3,332
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	—	—	—
その他	194,885	4,702	12,127
合計	1,135,642	45,333	16,558

当連結会計年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計	売却損の合計
株券	30,319	21,113	373
債券	508,245	19,241	3,968
国債・地方債等	227,808	17,707	104
社債	9,330	1,206	—
その他	271,106	327	3,863
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	—	—	—
その他	28,817	2,197	8,213
合計	567,383	42,552	12,555

3 減損処理を行った有価証券

前連結会計年度において、その他有価証券について2,129百万円（うち、株券54百万円、投資事業組合1,924百万円、その他150百万円）の減損処理を行っております。

当連結会計年度において、その他有価証券について6百万円（うち、株券6百万円）の減損処理を行っております。

なお、時価のある有価証券の減損にあたって、当連結会計年度末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は、著しい下落かつ回復する見込みがないと判断して、減損処理を行っております。また、時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、時価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復可能性を検討し、回復見込みがないと判断されたものについては、減損処理を行っております。

4 保有目的を変更した有価証券

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1 トレーディングに係るもの

前連結会計年度（平成28年3月31日）

(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	—	—

(注) 時価の算定方法については、「(金融商品関係) 2 金融商品の時価等に関する事項 (注) 1 金融商品の時価の算定方法(ウ) トレーディング商品 ②デリバティブ取引」に記載のとおりであります。

当連結会計年度（平成29年3月31日）

(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	3,198,443	455,875	3,376,422	370,000
為替予約取引	1,896,320	56,372	1,675,688	52,311
先物・先渡取引	3,794,512	26,624	2,911,364	18,735
スワップ取引	82,096,964	2,131,829	82,158,316	1,925,183
その他	2,028,618	27,982	2,163,102	30,643
リスクリザーブ	—	△5,717	—	—

(注) 時価の算定方法については、「(金融商品関係) 2 金融商品の時価等に関する事項 (注) 1 金融商品の時価の算定方法(ウ) トレーディング商品 ②デリバティブ取引」に記載のとおりであります。

2 トレーディングに係るもの以外

①ヘッジ会計が適用されていないもの

契約額または契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益は次のとおりであります。

前連結会計年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

種類	契約額等	時価	評価損益
為替予約取引	735,538	1,116	1,116
通貨スワップ取引	67,608	1,521	1,521

（注）時価の算定方法については、「（金融商品関係）2 金融商品の時価等に関する事項（注）1 金融商品の時価の算定方法（ウ）トレーディング商品 ②デリバティブ取引」に記載のとおりであります。

当連結会計年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

種類	契約額等	時価	評価損益
為替予約取引	610,356	1,628	1,628
株価指数先物取引	10,865	140	140
金利スワップ取引	147,000	△1	△1
通貨スワップ取引	112,146	1,829	1,829

（注）時価の算定方法については、「（金融商品関係）2 金融商品の時価等に関する事項（注）1 金融商品の時価の算定方法（ウ）トレーディング商品 ②デリバティブ取引」に記載のとおりであります。

②ヘッジ会計が適用されているもの

主なヘッジ対象、契約額または契約において定められた元本相当額及び時価は次のとおりであります。

前連結会計年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

種類	ヘッジ会計の方法	主なヘッジ対象	契約額等	時価
金利スワップ取引	原則的処理方法	借入金及び国債	1,017,882	△25,457
通貨スワップ取引	為替予約等の振当処理	借入金	31,550	△2,215
金利通貨スワップ取引	金利通貨スワップの一体処理（特例処理・振当処理）	社債	85,140	7,679

当連結会計年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

種類	ヘッジ会計の方法	主なヘッジ対象	契約額等	時価
金利スワップ取引	原則的処理方法	借入金及び国債	1,276,178	17,061
通貨スワップ取引	為替予約等の振当処理	借入金	31,413	△1,893
	原則的処理方法（注）	外貨建の貸出金、有価証券	197,692	914
金利通貨スワップ取引	金利通貨スワップの一体処理（特例処理・振当処理）	社債	13,462	2,876

（注）銀行業を行う子会社において、主として業種別監査委員会報告第25号に基づき、繰延ヘッジによっております。

(退職給付関係)

1 採用している退職給付制度の概要

当社及び主な国内連結子会社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

なお、一部の在外連結子会社も確定拠出制度を採用しております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前連結会計年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	36,237百万円	38,417百万円
勤務費用	4,116	3,870
退職給付の支払額	△2,057	△2,141
その他	120	△355
退職給付債務の期末残高	38,417	39,791

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と連結貸借対照表に計上された退職給付に係る負債及び退職給付に係る資産の調整表

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	一百万円	一百万円
年金資産	—	—
	—	—
非積立型制度の退職給付債務	38,417	39,791
連結貸借対照表に計上された 負債と資産の純額	38,417	39,791
退職給付に係る負債	38,417百万円	39,791百万円
連結貸借対照表に計上された 負債と資産の純額	38,417	39,791

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前連結会計年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	4,116百万円	3,870百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	4,116	3,870

3 確定拠出制度

当社及び連結子会社の確定拠出制度への要拠出額は、前連結会計年度4,540百万円、当連結会計年度4,266百万円であります。

(ストック・オプション等関係)

1 スtock・オプションにかかる費用計上額及び科目名

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31 日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31 日)
販売費・一般管理費の人件費	1,317	1,356

2 スtock・オプションの権利不行使による失効により利益として計上した金額

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31 日)	当連結会計年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31 日)
営業外収益のその他	61	—
特別利益	—	1,228

3 スtock・オプションの内容、規模及びその変動状況

(1) スtock・オプションの内容

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2005年 6 月発行新株予約権	
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 76名	
株式の種類及び付与数 (株)	普通株式 538,000	
付与日	平成17年 6 月24日	
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	
権利行使期間	平成17年 7 月 1 日～平成37年 6 月30日	

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2006年 7 月発行新株予約権	第 3 回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の子会社の取締役及び執行役員 77名	当社の使用人 86名 当社の関係会社の取締役、執行役員 及び使用人 1,744名
株式の種類及び付与数 (株)	普通株式 301,000	普通株式 2,593,000
付与日	平成18年 7 月 1 日	平成18年 9 月 4 日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成23年 6 月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成18年 9 月 4 日～平成23年 6 月30日
権利行使期間	平成18年 7 月 1 日～平成38年 6 月30日	平成23年 7 月 1 日～平成28年 6 月23日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2007年7月発行新株予約権	第4回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 16名 当社の子会社の取締役及び執行役員 79名	当社の使用人 88名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 1,730名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 309,000	普通株式 2,570,000
付与日	平成19年7月1日	平成19年9月3日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成24年6月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成19年9月3日～平成24年6月30日
権利行使期間	平成19年7月1日～平成39年6月30日	平成24年7月1日～平成29年6月22日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2008年7月発行新株予約権	第5回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 15名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 83名	当社の使用人 96名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 1,822名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 350,000	普通株式 3,099,000
付与日	平成20年7月1日	平成20年9月8日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成25年6月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成20年9月8日～平成25年6月30日
権利行使期間	平成20年7月1日～平成40年6月30日	平成25年7月1日～平成30年6月20日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2009年7月発行新株予約権	第6回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役 16名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 90名	当社の使用人 102名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,080名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 664,000	普通株式 4,413,000
付与日	平成21年7月1日	平成21年11月9日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成26年6月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成21年11月9日～平成26年6月30日
権利行使期間	平成21年7月1日～平成41年6月30日	平成26年7月1日～平成31年6月19日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2010年7月発行新株予約権	第7回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役員 15名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 102名	当社の使用人 104名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,236名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 1,056,000	普通株式 7,399,000
付与日	平成22年7月1日	平成22年9月1日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成27年6月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成22年9月1日～平成27年6月30日
権利行使期間	平成22年7月1日～平成42年6月30日	平成27年7月1日～平成32年6月25日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2011年7月発行新株予約権	第8回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役及び執行役員 15名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 96名	当社の使用人 230名 当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,059名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 1,211,000	普通株式 5,855,000
付与日	平成23年7月1日	平成23年9月5日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成28年6月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成23年9月5日～平成28年6月30日
権利行使期間	平成23年7月1日～平成43年6月30日	平成28年7月1日～平成33年6月24日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2013年2月発行新株予約権	第9回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役員及び執行役員 18名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 85名	当社の関係会社の取締役、執行役員及び使用人 2,719名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 831,000	普通株式 6,333,000
付与日	平成25年2月12日	平成25年2月12日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成29年6月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成25年2月12日～平成29年6月30日
権利行使期間	平成25年2月12日～平成44年6月30日	平成29年7月1日～平成34年6月26日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2014年 2 月発行新株予約権	第10回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 22名 当社の関係会社の取締役及び執行役員 81名	当社の関係会社の取締役、執行役員 及び使用人 2,881名
株式の種類及び付与数 (株)	普通株式 404,000	普通株式 3,964,000
付与日	平成26年 2 月10日	平成26年 2 月10日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成30年 6 月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成26年 2 月10日～平成30年 6 月30日
権利行使期間	平成26年 2 月10日～平成45年 6 月30日	平成30年 7 月 1 日～平成35年 6 月25日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2015年 2 月発行新株予約権	第11回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 21名 当社の子会社の取締役及び執行役員 85名	当社の使用人並びに当社関係会社の 取締役、執行役員及び使用人 3,072名
株式の種類及び付与数 (株)	普通株式 461,000	普通株式 5,418,000
付与日	平成27年 2 月 9 日	平成27年 2 月 9 日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成31年 6 月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成27年 2 月 9 日～平成31年 6 月30日
権利行使期間	平成27年 2 月 9 日～平成46年 6 月30日	平成31年 7 月 1 日～平成36年 6 月25日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2016年 2 月発行新株予約権	第12回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 21名 当社の子会社の取締役及び執行役員 85名	当社の使用人並びに当社子会社及び関連会 社の取締役、執行役員及び使用人 3,238名
株式の種類及び付与数 (株)	普通株式 581,000	普通株式 4,484,000
付与日	平成28年 2 月16日	平成28年 2 月16日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日（平成32年 6 月30日）まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成28年 2 月16日～平成32年 6 月30日
権利行使期間	平成28年 2 月16日～平成47年 6 月30日	平成32年 7 月 1 日～平成37年 6 月24日

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2017年2月発行新株予約権	第13回新株予約権
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役、執行役及び執行役員 19名 当社の子会社の取締役及び執行役員 90名	当社の使用人並びに当社子会社及び関連会社の取締役、執行役員及び使用人 3,482名
株式の種類及び付与数(株)	普通株式 574,000	普通株式 7,448,000
付与日	平成29年2月8日	平成29年2月8日
権利確定条件	権利確定条件は付されていません	付与日以降、権利確定日(平成33年6月30日)まで継続して勤務していること
対象勤務期間	対象勤務期間の定めはありません	平成29年2月8日～平成33年6月30日
権利行使期間	平成29年2月8日～平成48年6月30日	平成33年7月1日～平成38年6月27日

(2) ストック・オプションの規模及びその変動状況

当連結会計年度(平成29年3月期)において存在したストック・オプションを対象とし、ストック・オプションの数については株式数に換算して記載しております。

① ストック・オプションの数

会社名	提出会社
新株予約権の名称	2005年6月発行 新株予約権
権利確定前(株)	
期首	—
付与	—
失効	—
権利確定	—
未確定残	—
権利確定後(株)	
期首	265,000
権利確定	—
権利行使	26,000
失効	—
未行使残	239,000

提出会社	
2006年7月発行 新株予約権	第3回 新株予約権
—	—
—	—
—	—
—	—
—	—
171,000	2,331,000
—	—
17,000	—
—	2,331,000
154,000	—

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2007年7月発行 新株予約権	第4回 新株予約権
権利確定前（株）		
期首	—	—
付与	—	—
失効	—	—
権利確定	—	—
未確定残	—	—
権利確定後（株）		
期首	194,000	2,331,000
権利確定	—	—
権利行使	8,000	1,000
失効	—	18,000
未行使残	186,000	2,312,000

提出会社	
2008年7月発行 新株予約権	第5回 新株予約権
—	—
—	—
—	—
—	—
—	—
245,000	2,620,000
—	—
10,000	—
—	18,000
235,000	2,602,000

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2009年7月発行 新株予約権	第6回 新株予約権
権利確定前（株）		
期首	—	—
付与	—	—
失効	—	—
権利確定	—	—
未確定残	—	—
権利確定後（株）		
期首	540,000	2,115,000
権利確定	—	—
権利行使	23,000	187,000
失効	—	25,000
未行使残	517,000	1,903,000

提出会社	
2010年7月発行 新株予約権	第7回 新株予約権
—	—
—	—
—	—
—	—
—	—
954,000	4,082,000
—	—
28,000	553,000
—	44,000
926,000	3,485,000

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2011年7月発行 新株予約権	第8回 新株予約権
権利確定前（株）		
期首	—	5,466,000
付与	—	—
失効	—	—
権利確定	—	5,466,000
未確定残	—	—
権利確定後（株）		
期首	1,167,000	—
権利確定	—	5,466,000
権利行使	56,000	2,013,000
失効	—	58,000
未行使残	1,111,000	3,395,000

提出会社	
2013年2月発行 新株予約権	第9回 新株予約権
—	6,053,000
—	—
—	77,000
—	—
—	5,976,000
807,000	—
—	—
18,000	—
—	—
789,000	—

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2014年2月発行 新株予約権	第10回 新株予約権
権利確定前（株）		
期首	—	3,830,000
付与	—	—
失効	—	52,000
権利確定	—	—
未確定残	—	3,778,000
権利確定後（株）		
期首	394,000	—
権利確定	—	—
権利行使	6,000	—
失効	—	—
未行使残	388,000	—

提出会社	
2015年2月発行 新株予約権	第11回 新株予約権
—	5,311,000
—	—
—	92,000
—	—
—	5,219,000
458,000	—
—	—
—	—
—	—
458,000	—

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2016年2月発行 新株予約権	第12回 新株予約権
権利確定前（株）		
期首	—	4,470,000
付与	—	—
失効	—	92,000
権利確定	—	—
未確定残	—	4,378,000
権利確定後（株）		
期首	581,000	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
未行使残	581,000	—

提出会社	
2017年2月発行 新株予約権	第13回 新株予約権
—	—
574,000	7,448,000
—	18,000
574,000	—
—	7,430,000
—	—
574,000	—
—	—
—	—
574,000	—

② 単価情報

会社名	提出会社
新株予約権の名称	2005年6月発行 新株予約権
権利行使価格(円)	1
行使時平均株価(円)	731
付与日における公正な 評価単価(円)	—

提出会社	
2006年7月発行 新株予約権	第3回 新株予約権
1	1,455
731	権利行使なし
1,363	499.8

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2007年7月発行 新株予約権	第4回 新株予約権
権利行使価格(円)	1	1,176
行使時平均株価(円)	723	588
付与日における公正な 評価単価(円)	1,312	349

提出会社	
2008年7月発行 新株予約権	第5回 新株予約権
1	881
723	権利行使なし
972	243.7

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2009年7月発行 新株予約権	第6回 新株予約権
権利行使価格(円)	1	496
行使時平均株価(円)	691	709
付与日における公正な 評価単価(円)	580	152

提出会社	
2010年7月発行 新株予約権	第7回 新株予約権
1	380
637	685
375	83

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2011年7月発行 新株予約権	第8回 新株予約権
権利行使価格(円)	1	326
行使時平均株価(円)	654	637
付与日における公正な 評価単価(円)	358	89

提出会社	
2013年2月発行 新株予約権	第9回 新株予約権
1	598
618	権利行使なし
568	193

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2014年2月発行 新株予約権	第10回 新株予約権
権利行使価格(円)	1	1,062
行使時平均株価(円)	571	権利行使なし
付与日における公正な 評価単価(円)	956	295

提出会社	
2015年2月発行 新株予約権	第11回 新株予約権
1	931
権利行使なし	権利行使なし
850.7	188.6

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2016年2月発行 新株予約権	第12回 新株予約権
権利行使価格(円)	1	733
行使時平均株価(円)	権利行使なし	権利行使なし
付与日における公正な 評価単価(円)	663.4	113.2

提出会社	
2017年2月発行 新株予約権	第13回 新株予約権
1	767
権利行使なし	権利行使なし
707.9	122.1

4 スtock・オプションの公正な評価単価の見積方法

当連結会計年度において付与されたStock・オプションについての公正な評価単価の見積方法は以下のとおりであります。

会社名	提出会社	
新株予約権の名称	2017年2月発行新株予約権	第13回新株予約権
使用した評価技法	二項格子モデル	ブラック・ショールズ式
主な基礎数値及び見積方法		
株価変動性(注) 1	42.6%	33.5%
予想残存期間(注) 2	1日	6.9年
予想配当(注) 3	29円/株	
無リスク利子率(注) 4	0.71%	△0.01%

- (注) 1 2017年2月発行新株予約権については、付与日からStock・オプションの満期までの期間19.4年を遡った平成9年9月からの株価実績に基づき算定しております。第13回新株予約権については、付与日から予想残存期間6.9年遡った平成22年3月からの株価実績に基づき算定しております。
- 2 2017年2月発行新株予約権については、対象勤務期間がないものとし、付与日のみを予想残存期間としております。第13回新株予約権については、十分なデータの蓄積がなく、合理的な見積もりが困難なため、権利行使期間の中間点において行使されるものと推定して見積もっております。
- 3 平成28年3月期の配当実績によっております。
- 4 2017年2月発行新株予約権についてはStock・オプションの満期までの期間、第13回新株予約権については予想残存期間に対応する期間の国債の利回りであります。

5 Stock・オプションの権利確定数の見積方法

将来の失効数の合理的な見積もりは困難であるため、実績の失効数のみ反映させる方法を採用しております。

(税効果会計関係)

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

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
繰延税金資産		
繰越欠損金	53,166百万円	46,395百万円
退職給付に係る負債	11,787	12,273
減損損失	9,433	8,605
関係会社株式評価損	—	7,563
賞与引当金	6,578	6,736
投資有価証券評価損	7,985	6,379
営業投資有価証券関連損益	4,934	5,183
商品有価証券・デリバティブ	5,206	4,863
未実現利益の消去	2,816	4,581
減価償却超過額	4,330	4,088
訴訟損失引当金	665	2,908
貸倒引当金	2,026	1,917
事業税・事業所税	3,737	1,547
金融商品取引責任準備金	1,215	1,203
繰延ヘッジ損益	14,398	—
その他	9,572	8,395
繰延税金資産小計	137,856	122,643
評価性引当額	△98,616	△93,138
繰延税金資産合計	39,239	29,505
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	41,957	25,059
その他	3,646	3,650
繰延税金負債合計	45,603	28,710
繰延税金資産の純額	△6,363	794

(表示方法の変更)

前連結会計年度において、繰延税金資産の「その他」に含めておりました「訴訟損失引当金」は、金額的重要性が増したため、当連結会計年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前連結会計年度の注記の組替えを行っております。

この結果、前連結会計年度の繰延税金資産の「その他」に表示していた10,238百万円は、「訴訟損失引当金」665百万円、「その他」9,572百万円として組み替えております。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当連結会計年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率	33.06%	30.86%
(調整)		
評価性引当額	△1.92%	△1.45%
永久に益金に算入されない項目	△1.92%	△1.11%
永久に損金に算入されない項目	1.23%	1.18%
外国子会社との税率差異	0.91%	0.36%
未実現利益に係る調整額	△0.16%	△0.16%
のれんの償却	0.14%	0.20%
税率変更による期末繰延税金資産 の減額修正	0.42%	0.04%
持分法による投資損益	△1.35%	△1.88%
特別税額控除	△1.87%	△0.13%
子会社の清算決議による影響	—%	△4.45%
その他	△0.93%	1.53%
税効果会計適用後の法人税等の 負担率	27.62%	24.98%

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「社会保障の安定財源の確保等を図る税制の抜本的な改革を行うための消費税法の一部を改正する等の法律等の一部を改正する法律」及び「社会保障の安定財源の確保等を図る税制の抜本的な改革を行うための地方税法及び地方交付税法の一部を改正する法律等の一部を改正する法律」が平成28年11月18日に国会で成立したことに伴い、当連結会計年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前連結会計年度のものから変更されております。

なお、この税率変更による影響は軽微であります。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

1 報告セグメントの概要

当社グループの報告セグメントは、当社グループの構成単位のうち分離された財務情報が入手可能であり、当社の最高経営意思決定機関が、経営資源の配分の決定及び業績を評価するために、定期的に検討を行う対象となっているものであります。

当社グループは有価証券関連業を中核とし、これを支えるグループサポート事業との連携により総合的な投資・金融サービスを提供しており、大和証券グループ本社において、連結子会社及び持分法適用関連会社の行う事業について、顧客マーケット・業態に応じた経営管理上の組織別に国内及び海外の包括的な戦略を決定し、事業活動を展開しております。

従って、当社グループは個々の連結子会社及び持分法適用関連会社を基礎とした顧客マーケット・業態別のセグメントから構成されており、経済的特徴が概ね類似しているセグメントを集約した「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」及び「投資部門」の4つを報告セグメントとしております。

リテール部門は、主に個人や未上場法人のお客様に幅広い金融商品・サービスを提供しております。ホールセール部門は、グローバル・マーケットとグローバル・インベストメント・バンキングで構成されており、グローバル・マーケットは、主に国内外の機関投資家や事業法人、金融法人、公共法人等のお客様向けに、株式、債券・為替及びそれらの派生商品のセールスとトレーディングを行っております。グローバル・インベストメント・バンキングは、国内外における有価証券の引受け、M&Aアドバイザー等、多様なインベストメント・バンキング・サービスを提供しております。アセット・マネジメント部門は、さまざまな資産を投資対象とした投資信託の設定・運用を行っているほか、国内外の機関投資家に対し年金資産に関する投資助言・運用サービスを提供しております。投資部門は、既存案件における投資回収を極大化しつつ、新規投資ファンドの組成を中心としたビジネスを行っております。

2 報告セグメントごとの純営業収益、利益又は損失、その他の項目の金額の算定方法

報告されている事業セグメントの会計処理の方法は、「連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項」における記載と概ね同一であります。

セグメント間の内部純営業収益は、第三者間取引価格に基づいております。

3 報告セグメントごとの純営業収益、利益又は損失及びその他の項目の金額に関する情報

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(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	190,179	177,681	77,806	20,404	466,072	22,287	488,360
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	27,743	333	△27,277	△674	124	25,628	25,752
計	217,922	178,014	50,528	19,730	466,197	47,915	514,113
セグメント利益（経常利益）	61,080	48,878	29,990	17,397	157,347	9,864	167,211
その他の項目							
減価償却費	9,430	8,059	1,897	21	19,408	13,922	33,331
のれん償却額	—	740	—	—	740	—	740
受取利息	—	—	26	143	169	5	175
支払利息	—	—	377	8	386	334	720
持分法投資利益	—	38	5,235	—	5,274	—	5,274

(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、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。

3 資産についてのセグメント情報は、経営者が経営の意思決定上当該情報を各セグメントに配分していないことから開示しておりません。

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(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	162,226	182,186	69,771	16,340	430,525	20,258	450,784
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	25,825	688	△23,333	△603	2,577	16,828	19,405
計	188,051	182,875	46,438	15,736	433,102	37,087	470,189
セグメント利益（経常利益）	29,375	65,437	26,572	13,041	134,426	628	135,055
その他の項目							
減価償却費	10,212	7,645	1,072	39	18,969	13,860	32,830
のれん償却額	—	578	221	—	800	—	800
受取利息	—	—	12	28	41	4	45
支払利息	—	—	—	10	10	298	308
持分法投資利益	—	668	6,183	—	6,851	—	6,851

(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、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。

3 資産についてのセグメント情報は、経営者が経営の意思決定上当該情報を各セグメントに配分していないことから開示しておりません。

4 報告セグメント合計額と連結財務諸表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）

純営業収益	前連結会計年度	当連結会計年度
報告セグメント計	466,197	433,102
「その他」の区分の純営業収益	47,915	37,087
セグメント間の取引消去	△25,752	△19,405
純営業収益から控除する支払手数料	24,445	22,484
その他の調整額	2,009	△518
連結財務諸表の純営業収益	514,815	472,750

（単位：百万円）

利益	前連結会計年度	当連結会計年度
報告セグメント計	157,347	134,426
「その他」の区分の利益	9,864	628
セグメント間の取引消去	20	0
のれん及び負ののれんの償却額	△308	△308
未実現利益の調整額	△2,916	△768
その他の調整額	1,142	1,645
連結財務諸表の経常利益	165,148	135,623

（単位：百万円）

その他の項目	報告セグメント計		その他		調整額		連結財務諸表計上額	
	前連結 会計年度	当連結 会計年度	前連結 会計年度	当連結 会計年度	前連結 会計年度	当連結 会計年度	前連結 会計年度	当連結 会計年度
減価償却費	19,408	18,969	13,922	13,860	△3,439	△4,393	29,891	28,436
のれんの償却額	740	800	—	—	308	308	1,048	1,108
受取利息	169	41	5	4	△126	△38	48	6
支払利息	386	10	334	298	△328	△266	392	42
持分法投資利益	5,274	6,851	—	—	1,685	1,560	6,959	8,412

【関連情報】

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 サービスごとの情報

当社グループは、有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業という単一のサービスを行っているため、記載を省略しております。

2 地域ごとの情報

(1) 純営業収益

(単位：百万円)

日本	欧州	アジア・オセアニア	アメリカ	合計
457,522	21,702	12,479	23,110	514,815

(注) 純営業収益は主として顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が連結貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への純営業収益のうち、連結損益計算書の純営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 サービスごとの情報

当社グループは、有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業という単一のサービスを行っているため、記載を省略しております。

2 地域ごとの情報

(1) 純営業収益

(単位：百万円)

日本	欧州	アジア・オセアニア	アメリカ	合計
408,963	26,298	11,949	25,538	472,750

(注) 純営業収益は主として顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が連結貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への純営業収益のうち、連結損益計算書の純営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

【報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報】

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他	全社・ 消去	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			
減損損失	17	—	—	—	17	1,993	△282	1,728

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他	全社・ 消去	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			
減損損失	—	430	—	—	430	—	—	430

【報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報】

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他	全社・ 消去	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			
(のれん)								
当期償却額	—	740	—	—	740	—	308	1,048
当期末残高	—	2,531	4,439	—	6,970	—	1,001	7,972

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他	全社・ 消去	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			
(のれん)								
当期償却額	—	578	221	—	800	—	308	1,108
当期末残高	—	1,192	4,217	—	5,409	—	693	6,103

【報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報】

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

【関連当事者情報】

1 関連当事者との取引

連結財務諸表提出会社の連結子会社と関連当事者との取引

連結財務諸表提出会社の非連結子会社及び関連会社等

前連結会計年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連当事者との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
関連 会社	東京短資 株式会社	東京都 中央区	10,000	短資業	(所有) — [100%] (注)3	担保金の受入	担保金の受入 (注)1	1,081,796	有価証券貸借 取引受入金	749,817
							利息の支払 (注)2	1,132	借入有価証券 担保金	390,445
						有価証券の貸付	有価証券の貸付 (注)1	1,080,722	未収収益	34
							品貸料の受取 (注)2	840	その他の 流動負債	27
						担保金の差入	担保金の差入 (注)1	378,012		
							利息の受取 (注)2	585		
						有価証券の借入	有価証券の借入 (注)1	377,550		
							品借料の支払 (注)2	707		
						役員の転籍				

(注) 1 取引金額には、貸付有価証券及び借入有価証券の時価並びに受入担保金額及び差入担保金額の月末平均残高を記載しております。

2 品貸料率、品借料率及び担保金金利は市場実勢を勘案して決定しております。

3 議決権等の所有割合の[]内は、緊密な者の所有割合で外数であります。なお、当社は当該緊密な者の議決権の17.43%を直接所有しております。

当連結会計年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連当事者との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
関連 会社	東京短資 株式会社	東京都 中央区	10,300	短資業	(所有) 17.43	担保金の受入	担保金の受入 (注)1	659,590	有価証券貸借 取引受入金	590,438
							利息の支払 (注)2	570	借入有価証券 担保金	163,880
						有価証券の貸付	有価証券の貸付 (注)1	657,874	未収収益	50
							品貸料の受取 (注)2	1,427	その他の 流動負債	20
						担保金の差入	担保金の差入 (注)1	306,576		
							利息の受取 (注)2	312		
						有価証券の借入	有価証券の借入 (注)1	306,351		
							品借料の支払 (注)2	1,006		
						役員の転籍				

(注) 1 取引金額には、貸付有価証券及び借入有価証券の時価並びに受入担保金額及び差入担保金額の月末平均残高を記載しております。

2 品貸料率、品借料率及び担保金金利は市場実勢を勘案して決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

重要な関連会社の要約財務情報

当連結会計年度において、重要な関連会社は東京短資株式会社であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	東京短資株式会社	
	前連結会計年度	当連結会計年度
流動資産合計	21,869,152	25,732,324
固定資産合計	1,312	21,959
流動負債合計	21,827,471	25,679,048
固定負債合計	45	833
純資産合計	42,947	74,401
営業収益	27,111	30,590
税引前当期純利益	1,266	1,466
当期純利益	1,168	1,383

(開示対象特別目的会社関係)

開示対象特別目的会社の概要及び開示対象特別目的会社を利用した取引の概要等

一部の連結子会社は、顧客の資金運用ニーズに応える目的で仕組債を販売しており、仕組債の組成に際し特別目的会社を利用しております。この取引において、当該連結子会社は、取得した債券をケイマン法人の特別目的会社に譲渡し、当該特別目的会社は取得した債券を担保とする仕組債を発行しております。いずれの特別目的会社についても、当社及び当該連結子会社は議決権のある出資等は有しておらず、役員や従業員の派遣もありません。なお、特別目的会社の会社数及び債券の発行額は以下のとおりとなっております。

	前連結会計年度末	当連結会計年度末
特別目的会社数	6 社	6 社
債券の発行額	842,172百万円	648,694百万円

(1株当たり情報)

	前連結会計年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	720.86円	745.80円
1株当たり当期純利益金額	68.25円	61.53円
潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額	67.68円	61.14円

(注) 算定上の基礎は次のとおりであります。

(1) 1株当たり純資産額

	前連結会計年度末 (平成28年3月31日)	当連結会計年度末 (平成29年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	1,313,005	1,343,433
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	93,175	92,549
(うち新株予約権(百万円))	(8,958)	(8,729)
(うち非支配株主持分(百万円))	(84,214)	(83,813)
(うち自己株式申込証拠金(百万円))	(2)	(7)
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	1,219,829	1,250,883
1株当たり純資産額の算定に用いられた 期末の普通株式の数(千株)	1,692,189	1,677,232

(2) 1株当たり当期純利益金額及び潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額

	前連結会計年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当連結会計年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
親会社株主に帰属する 当期純利益(百万円)	116,848	104,067
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 当期純利益	116,848	104,067
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,712,050	1,691,386
潜在株式調整後1株当たり 当期純利益金額		
親会社株主に帰属する 当期純利益調整額(百万円)	—	—
普通株式増加数(千株)	14,500	10,635
(うち新株予約権(千株))	(14,500)	(10,635)
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に 含めなかった潜在株式の概要	新株予約権方式によるストック・オプション6種類。 新株予約権等の概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況 (2) 新株予約権等の状況及び(9) スtockオプション制度の内容」に記載のとおりであります。	新株予約権方式によるストック・オプション6種類。 新株予約権等の概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況 (2) 新株予約権等の状況及び(9) スtockオプション制度の内容」に記載のとおりであります。

(注) 前連結会計年度において、従業員持株E S O P信託口が保有する当社株式を、「1株当たり当期純利益金額」及び「潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額」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(2,327千株)。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。

⑤ 【連結附属明細表】

【社債明細表】

会社名	銘柄	発行年月日	当期首残高 (百万円)	当期末残高 (百万円)	利率 (%)	担保	償還期限
(注) 1	第12回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成25年 4 月19日	30,000 (30,000)	—	0.59	無し	平成28年 4 月19日
(注) 1	第13回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成25年 5 月31日	40,000	40,000	0.93	無し	平成30年 5 月31日
(注) 1	第14回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成25年 5 月27日	30,000	30,000	1.25	無し	平成32年 5 月27日
(注) 1	第15回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成25年 9 月 2 日	30,000	30,000 (30,000)	0.60	無し	平成29年 9 月 1 日
(注) 1	第16回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成26年 5 月21日	30,000	30,000	0.69	無し	平成33年 5 月21日
(注) 1	第17回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成26年 8 月28日	20,000	20,000	0.40	無し	平成31年 8 月28日
(注) 1	第18回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成26年 8 月28日	12,000	12,000	0.87	無し	平成36年 8 月28日
(注) 1	第19回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成27年 2 月25日	25,000	25,000	0.41	無し	平成32年 2 月25日
(注) 1	第20回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成27年 2 月25日	20,000	20,000	0.89	無し	平成37年 2 月25日
(注) 1	第21回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成27年 5 月29日	20,000	20,000	0.40	無し	平成32年 5 月29日
(注) 1	第22回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成27年 8 月12日	45,000	45,000	0.40	無し	平成32年 8 月12日
(注) 1	第23回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成27年 8 月12日	25,000	25,000	0.91	無し	平成37年 8 月12日
(注) 1	第24回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成27年11月12日	30,000	30,000	0.67	無し	平成34年11月11日
(注) 1	第25回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成28年 2 月25日	13,000	13,000	0.40	無し	平成35年 2 月24日
(注) 1	第26回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成28年 2 月25日	11,000	11,000	0.56	無し	平成38年 2 月25日
(注) 1	第27回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成28年 4 月25日	—	50,000	0.40	無し	平成35年 4 月25日
(注) 1	第28回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成28年 8 月25日	—	30,000	0.40	無し	平成38年 8 月25日
(注) 1	第29回無担保社債 (社債間限定同順位 特約付)	平成28年12月 1 日	—	22,000	0.35	無し	平成35年12月 1 日

会社名	銘柄	発行年月日	当期首残高 (百万円)	当期末残高 (百万円)	利率 (%)	担保	償還期限
(注) 1	第4回無担保変動利付社債 (適格機関投資家限定)	平成24年12月14日	30,000 (30,000)	—	0.41	無し	平成28年12月14日
(注) 1	第5回無担保社債 (適格機関投資家限定)	平成25年3月29日	8,000 (8,000)	—	0.18	無し	平成29年3月31日
(注) 1	第6回無担保変動利付社債 (適格機関投資家限定)	平成25年12月24日	40,000	40,000 (40,000)	0.31	無し	平成29年12月25日
(注) 1	第7回無担保社債 (適格機関投資家限定)	平成26年2月28日	40,000	40,000 (40,000)	0.26	無し	平成30年2月28日
(注) 1	第8回無担保変動利付社債 (適格機関投資家限定、SMB Cサステイナビリティ評価付)	平成26年5月30日	40,000	40,000 (40,000)	0.31	無し	平成29年5月31日
(注) 1	第9回無担保社債 (適格機関投資家限定)	平成26年7月31日	20,000	20,000	0.25	無し	平成30年7月31日
(注) 1	第10回無担保変動利付社債 (適格機関投資家限定、SMB Cなでしこ診断付)	平成27年6月30日	20,000	20,000	0.26	無し	平成34年6月30日
(注) 1	第11回期限前償還条項付無担保変動利付社債 (適格機関投資家限定)	平成28年9月15日	—	30,000	0.29	無し	平成38年9月15日
(注) 1	第12回無担保社債 (適格機関投資家限定)	平成28年9月21日	—	30,000	0.21	無し	平成34年9月21日
(注) 1	第13回期限前償還条項付無担保変動利付社債 (適格機関投資家限定)	平成29年1月20日	—	20,000	0.29	無し	平成39年1月20日
(注) 1	第14回無担保社債 (適格機関投資家限定)	平成29年2月28日	—	15,000	0.23	無し	平成36年2月29日
(注) 1	第1回適格機関投資家限定無担保社債 (米ドル建て)	平成27年2月27日	16,902	16,828	1.61	無し	平成30年11月30日
(注) 1	第2回適格機関投資家限定無担保社債 (米ドル建て)	平成27年2月27日	16,902	16,828	1.61	無し	平成31年5月31日
(注) 1	第3回適格機関投資家限定無担保社債 (米ドル建て)	平成27年9月30日	28,170	28,047	1.69	無し	平成32年9月30日
(注) 2 ※	第4回無担保社債 (社債間限定同順位特約付)	平成22年7月21日	19,800	19,800 (19,800)	1.26	無し	平成29年7月21日
(注) 2 ※	第5回無担保社債 (社債間限定同順位特約付)	平成22年7月21日	18,400	18,400	1.72	無し	平成32年7月21日
(注) 2 ※	第6回無担保社債 (社債間限定同順位特約付)	平成22年12月17日	7,800	7,800	2.16	無し	平成37年12月9日

会社名	銘柄	発行年月日	当期首残高 (百万円)	当期末残高 (百万円)	利率 (%)	担保	償還期限
(注) 2 ※	第2回期限前償還条 項付無担保社債 (社債間限定同順位 特約付・少人数限 定)	平成23年4月25日	3,000	3,000	2.41	無し	平成38年4月24日
(注) 2 ※	第3回期限前償還条 項付無担保社債 (社債間限定同順位 特約付・少人数限 定)	平成23年8月30日	5,000	5,000	2.24	無し	平成38年8月28日
(注) 2	第3回期限前償還条 項付無担保社債 (社債間限定同順位 特約付・分割制限 付・少人数限定)	平成26年6月30日	5,000	5,000	0.15	無し	平成46年6月30日
(注) 2	第4回期限前償還条 項付無担保社債 (社債間限定同順位 特約付・分割制限 付・少人数限定)	平成27年10月29日	3,200	—	△0.01	無し	平成47年10月29日
(注) 3	普通社債(ユーロ債)	平成16年～29年	734,132 (164,594)	668,876 (108,437)	△0.22 ～6.65	無し	平成28年～59年
合計	—	—	1,437,306 (232,594)	1,497,581 (278,237)	—	—	—

(注) 1 当社についての記載であります。

2 大和証券株式会社についての記載であります(※ 大和証券キャピタル・マーケット株式会社において発行したものであります)。

3 当社及び大和証券株式会社が発行した社債残高の集約となっております。

なお、当期末残高のうち外貨建てによる金額は713,429千米ドル、3,000千豪ドルであります。

4 「利率」については、当期末の値を記載しております。

5 1年内償還予定の金額は、当期首残高欄及び当期末残高欄の()に内書きしております。

6 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
278,237	242,953	138,889	229,582	85,132

【借入金等明細表】

区分	当期首残高 (百万円)	当期末残高 (百万円)	平均利率 (%)	返済期限
短期借入金	613,092	811,450	0.11	—
1年内返済予定の長期借入金	206,926	107,503	0.81	—
1年内返済予定のリース債務	582	1,032	1.10	—
長期借入金(1年内返済予定のものを除く)	1,004,988	1,179,264	0.27	平成30年～平成59年
リース債務(1年内返済予定のものを除く)	1,420	2,586	1.05	平成30年～平成35年
その他有利子負債				
コマーシャル・ペーパー (1年内返済予定)	137,720	—	—	—
信用取引借入金(1年内返済予定)	3,789	3,086	0.60	—
合計	1,968,520	2,104,924	—	—

(注) 1 「平均利率」については、借入金等の当期末残高に対する加重平均利率を記載しております。

2 長期借入金及びリース債務(1年内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	138,300	324,247	232,770	31,147
リース債務	776	765	563	410

【資産除去債務明細表】

当連結会計年度期首及び当連結会計年度末における資産除去債務の金額が当連結会計年度期首及び当連結会計年度末における負債及び純資産の合計額の100分の1以下であるため、記載を省略しております。

(2) 【その他】

当連結会計年度における四半期情報等

(累計期間)	第 1 四半期	第 2 四半期	第 3 四半期	当連結会計年度
営業収益 (百万円)	151, 859	296, 977	450, 175	616, 497
純営業収益 (百万円)	114, 049	229, 145	351, 131	472, 750
税金等調整前四半期 (当期)純利益金額 (百万円)	33, 559	67, 340	105, 347	139, 004
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益 金額 (百万円)	24, 571	55, 014	81, 708	104, 067
1 株当たり四半期 (当期)純利益金額 (円)	14. 52	32. 50	48. 26	61. 53

(会計期間)	第 1 四半期	第 2 四半期	第 3 四半期	第 4 四半期
1 株当たり四半期 純利益金額 (円)	14. 52	17. 98	15. 76	13. 26

2 【財務諸表等】

(1) 【財務諸表】

① 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成28年 3 月31 日)	当事業年度 (平成29年 3 月31 日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	※1 79,776	※1 94,675
短期貸付金	※1 413,256	※1 441,929
未収入金	※1 21,850	※1 14,847
未収収益	※1 4,702	※1 3,095
その他の流動資産	※1 1,130	※1 7,917
流動資産計	520,717	562,466
固定資産		
有形固定資産	44,931	45,372
建物	549	965
器具備品	2,299	2,325
土地	42,082	42,082
無形固定資産	5,997	7,858
ソフトウェア	5,072	5,183
その他	924	2,675
投資その他の資産	1,765,164	1,737,047
投資有価証券	※2 170,731	※2 160,278
関係会社株式	843,306	843,811
その他の関係会社有価証券	※1 13,199	※1 13,135
長期貸付金	※1 731,083	※1 712,818
長期差入保証金	※1 4,853	※1 4,840
その他	※1 2,252	※1 2,409
貸倒引当金	△263	△248
固定資産計	1,816,093	1,790,278
資産合計	2,336,810	2,352,744

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成28年 3 月31日)	当事業年度 (平成29年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
短期借入金	153,226	137,379
1年内償還予定の社債	136,055	156,376
未払費用	※1 3,154	※1 3,444
有価証券担保借入金	※1 61,076	※1 51,169
未払法人税等	3,684	532
賞与引当金	1,193	1,111
繰延税金負債	324	222
その他の流動負債	※1 8,143	※1 4,928
流動負債計	366,859	355,165
固定負債		
社債	584,640	624,993
長期借入金	441,488	464,464
繰延税金負債	17,871	16,517
その他の固定負債	※1 1,982	※1 2,088
固定負債計	1,045,981	1,108,064
負債合計	1,412,840	1,463,230
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金		
資本準備金	226,751	226,751
その他資本剰余金	1,233	-
資本剰余金合計	227,985	226,751
利益剰余金		
利益準備金	45,335	45,335
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	377,435	332,241
利益剰余金合計	422,771	377,577
自己株式	△29,919	△12,718
自己株式申込証拠金	2	7
株主資本合計	868,237	839,014
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46,773	41,770
評価・換算差額等合計	46,773	41,770
新株予約権	8,958	8,729
純資産合計	923,969	889,514
負債・純資産合計	2,336,810	2,352,744

②【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)
営業収益		
関係会社受取配当金	※1 22,622	※1 29,102
関係会社貸付金利息	※1 5,504	※1 5,467
その他	※1 111	※1 77
営業収益計	28,238	34,648
営業費用		
販売費・一般管理費		
取引関係費	※1 1,992	※1 2,055
人件費	※1, ※2 6,866	※1, ※2 6,691
不動産関係費	※1 1,683	※1 1,663
事務費	※1 2,375	※1 2,695
減価償却費	1,312	1,623
租税公課	1,272	1,641
その他	※1 968	※1 1,108
販売費・一般管理費計	16,471	17,481
金融費用	※1, ※3 7,361	※1, ※3 6,726
営業費用合計	23,833	24,208
営業利益	4,404	10,439
営業外収益		
受取配当金	3,680	3,596
その他	※1 1,444	※1 746
営業外収益計	5,125	4,343
営業外費用		
社債発行費	※1 1,052	※1 844
為替差損	341	-
その他	※1 52	※1 313
営業外費用計	1,445	1,157
経常利益	8,084	13,625
特別利益		
投資有価証券売却益	1,203	12,071
新株予約権戻入益	-	1,228
特別利益計	1,203	13,300
特別損失		
関係会社株式売却損	-	1,820
投資有価証券評価損	441	-
関係会社支援損	※1 3,020	-
その他	-	51
特別損失計	3,461	1,872
税引前当期純利益	5,826	25,053
法人税、住民税及び事業税	△8,568	242
法人税等調整額	4,662	△58
法人税等合計	△3,906	183
当期純利益	9,732	24,870

③【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	利益準備金	その他利益剰余金
					繰越利益剰余金
当期首残高	247,397	226,751	677	45,335	424,367
当期変動額					
剰余金の配当					△56,664
当期純利益					9,732
自己株式の取得					
自己株式の処分			556		
その他					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	556	-	△46,932
当期末残高	247,397	226,751	1,233	45,335	377,435

	株主資本			評価・換算差額等	新株予約権
	自己株式	自己株式 申込証拠金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	△15,770	3	928,762	57,736	8,205
当期変動額					
剰余金の配当			△56,664		
当期純利益			9,732		
自己株式の取得	△18,633		△18,633		
自己株式の処分	4,485		5,041		
その他		△0	△0		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				△10,962	753
当期変動額合計	△14,148	△0	△60,525	△10,962	753
当期末残高	△29,919	2	868,237	46,773	8,958

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金
当期首残高	247,397	226,751	1,233	45,335	377,435
当期変動額					
剰余金の配当					△42,326
当期純利益					24,870
自己株式の取得					
自己株式の処分			△243		
自己株式の消却			△990		△27,737
その他					
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	△1,233	-	△45,193
当期末残高	247,397	226,751	-	45,335	332,241

	株主資本			評価・換算差額等	新株予約権
	自己株式	自己株式 申込証拠金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	△29,919	2	868,237	46,773	8,958
当期変動額					
剰余金の配当			△42,326		
当期純利益			24,870		
自己株式の取得	△13,086		△13,086		
自己株式の処分	1,558		1,315		
自己株式の消却	28,728		-		
その他		4	4		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				△5,002	△229
当期変動額合計	17,200	4	△29,222	△5,002	△229
当期末残高	△12,718	7	839,014	41,770	8,729

【注記事項】

(重要な会計方針)

1 資産の評価基準及び評価方法

(1) 売買目的有価証券

時価法（売却原価は移動平均法により算定）によっております。

(2) 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。

(3) 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（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）、時価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移動平均法による原価法で計上しております。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております（組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております）。

(4) デリバティブ

時価法によっております。

2 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定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。

(2) 無形固定資産、投資その他の資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

(2) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、当社所定の計算基準による支払見積額の当期負担分を計上しております。

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 繰延資産の処理

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。

(2) ヘッジ会計の処理

原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。

当社は、一部の借入金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。なお、特例処理及び振当処理を採用しているものについては、その判定をもってヘッジの有効性の判定に代えております。

(3) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(4) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

※1 関係会社に対する金銭債権及び金銭債務

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
短期金銭債権	469,081百万円	502,396百万円
長期金銭債権	735,743	717,351
短期金銭債務	68,580	56,001
長期金銭債務	1,523	1,859

※2 子会社に貸し付けている有価証券の時価

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
投資有価証券	102,517百万円	80,605百万円

3 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。

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
従業員(借入金)	142百万円	106百万円
関係会社(デリバティブ債務)	2,952	3,461
計	3,094	3,568

(損益計算書関係)

※1 関係会社との取引高

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業取引高	39,534百万円	44,817百万円
営業取引以外の取引による 取引高	6,278	3,667

※2 人件費に含まれている賞与引当金繰入額

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
	1,193百万円	1,111百万円

※3 金融費用の内訳

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
支払利息	7,361百万円	6,726百万円

(有価証券関係)

子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成28年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 関係会社株式			
関連会社株式	1,412	5,449	4,036
(2) その他の関係会社有価証券			
関連会社	11,720	41,524	29,804
計	13,132	46,974	33,841

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 関係会社株式			
関連会社株式	8,498	13,850	5,351
(2) その他の関係会社有価証券			
関連会社	11,720	33,753	22,033
計	20,219	47,604	27,385

(注) 時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 関係会社株式		
子会社株式	828,922	821,262
関連会社株式	12,971	14,050
(2) その他の関係会社有価証券		
子会社	—	1,415
関連会社	1,479	—
計	843,373	836,728

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

(税効果会計関係)

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

	前事業年度 (平成28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
繰延税金資産		
関係会社株式評価損	16,590百万円	17,578百万円
繰越欠損金	13,057	12,991
投資有価証券評価損	7,228	5,761
貸倒引当金	1,128	1,128
その他	2,505	3,392
繰延税金資産小計	40,511	40,853
評価性引当額	△40,163	△40,512
繰延税金資産合計	347	340
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	17,940	16,543
その他	602	536
繰延税金負債合計	18,542	17,079
繰延税金資産の純額	△18,195	△16,739

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
法定実効税率	33.06%	30.86%
(調整)		
評価性引当額	△10.32%	1.32%
永久に益金に算入されない項目	△159.43%	△34.43%
永久に損金に算入されない項目	73.73%	2.26%
税率変更による影響	△0.43%	0.08%
その他	△3.66%	0.65%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	△67.04%	0.73%

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「社会保障の安定財源の確保等を図る税制の抜本的な改革を行うための消費税法の一部を改正する等の法律等の一部を改正する法律」及び「社会保障の安定財源の確保等を図る税制の抜本的な改革を行うための地方税法及び地方交付税法の一部を改正する法律等の一部を改正する法律」が平成28年11月18日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、前事業年度のものから変更されております。

なお、この税率変更による影響は軽微であります。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

④ 【附属明細表】

【有形固定資産等明細表】

(単位：百万円)

資産の種類	当期首残高	当期増加額	当期減少額	当期末残高	当期末減価償却累計額又は償却累計額	当期償却額	差引当期末残高
有形固定資産							
建物	—	—	—	2,440	1,475	23	965
器具備品	—	—	—	2,788	462	17	2,325
土地	—	—	—	42,082	—	—	42,082
有形固定資産計	—	—	—	47,310	1,937	40	45,372
無形固定資産							
ソフトウェア	—	—	—	11,968	6,785	1,489	5,183
その他	—	—	—	3,495	819	46	2,675
無形固定資産計	—	—	—	15,463	7,605	1,535	7,858

- (注) 1 有形固定資産は当事業年度における増加額及び減少額がいずれも当事業年度末における有形固定資産の総額の5%以下であるため、「当期首残高」、「当期増加額」及び「当期減少額」の記載を省略しております。
- 2 無形固定資産の当期末残高は資産の総額の1%以下であるため、「当期首残高」、「当期増加額」及び「当期減少額」の記載を省略しております。

【引当金明細表】

(単位：百万円)

区分	当期首残高	当期増加額	当期減少額 (目的使用)	当期減少額 (その他)	当期末残高
貸倒引当金	3,731	8	23	0	3,715
賞与引当金	1,193	1,111	1,193	—	1,111

- (注) 1 貸倒引当金の当期減少額の「その他」は、債権の回収による戻入額であります。
- 2 貸借対照表では貸倒引当金 3,467百万円を債権額から直接控除しております。

(2) 【主な資産及び負債の内容】

連結財務諸表を作成しているため、記載を省略しております。

(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】

事業年度	4月1日から3月31日まで
定時株主総会	6月中
基準日	3月31日
剰余金の配当の基準日	9月30日、3月31日
1単元の株式数	1,000株
単元未満株式の買取り	
取扱場所	(特別口座) 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 三井住友信託銀行株式会社 証券代行部
株主名簿管理人	(特別口座) 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 三井住友信託銀行株式会社
取次所	—
買取手数料	当社が別途定める金額
単元未満株式の売渡し	
取扱場所	(特別口座) 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 三井住友信託銀行株式会社 証券代行部
株主名簿管理人	(特別口座) 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 三井住友信託銀行株式会社
取次所	—
取扱手数料	当社が別途定める金額

(注) 当社定款の定めにより、当社の株主は、その有する単元未満株式について、次に掲げる権利以外の権利を行使することができません。

- ① 会社法第189条第2項各号に掲げる権利
- ② 会社法第166条第1項の規定による請求をする権利
- ③ 株主の有する株式数に応じて募集株式の割当て及び募集新株予約権の割当てを受ける権利
- ④ その有する単元未満株式の数と併せて単元株式数となる数の株式の売渡請求をする権利

公告掲載方法	当社の公告は電子公告の方法により行っております。 http://www.daiwa-grp.jp/ir/shareholders/ 但し、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行います。		
株主に対する特典	9 月末株主優待制度 (1) 対象株主：毎年 9 月 30 日現在の株主名簿に記録された 1 単元（1,000 株）以上を保有する株主又は登録株式質権者 (2) 優待内容：「株主優待品カタログの中から選択」		
	株主優待品カタログの中から選択可能な内容		
	株主優待品	1,000 株～2,999 株 保有	3,000 株～4,999 株 保有
	① 名産品等（2,000 円相当） ② 寄付（2,000 円） ③ 「会社四季報」（1 冊） ④ 「ダイワのポイントプログラム」交換ポイント（2,000 ポイント）※	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 1 点</u> を選択	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 2 点（同一の品を選択可）</u> を選択
	株主優待品	5,000 株～9,999 株 保有	10,000 株以上 保有
	① 名産品等（5,000 円相当） ② 寄付（5,000 円） ③ 「会社四季報」（2 冊） ④ 「ダイワのポイントプログラム」交換ポイント（5,000 ポイント）※	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 1 点</u> を選択	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 2 点（同一の品を選択可）</u> を選択
	3 月末株主優待制度 (1) 対象株主：毎年 3 月 31 日現在の株主名簿に記録された 1 単元（1,000 株）以上を保有する株主又は登録株式質権者 (2) 優待内容：「株主優待品カタログの中から選択」及び「ご希望いただいた方に壁掛けカレンダー（1 本）を贈呈」		
	株主優待品カタログの中から選択可能な内容		
	株主優待品	1,000 株～2,999 株 保有	3,000 株～4,999 株 保有
	① 名産品等（2,000 円相当） ② 寄付（2,000 円） ③ 「会社四季報」（1 冊） ④ 「ダイワのポイントプログラム」交換ポイント（2,000 ポイント）※	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 1 点</u> を選択	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 2 点（同一の品を選択可）</u> を選択
株主優待品	5,000 株～9,999 株 保有	10,000 株以上 保有	
① 名産品等（5,000 円相当） ② 寄付（5,000 円） ③ 「会社四季報」（2 冊） ④ 「ダイワのポイントプログラム」交換ポイント（5,000 ポイント）※	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 1 点</u> を選択	左記株主優待品①から④の中から <u>いずれか 2 点（同一の品を選択可）</u> を選択	
※大和証券株式会社が提供する「ダイワの証券総合サービス」の特典である「ダイワのポイントプログラム」において様々な商品に交換いただけるポイントです。			
株主優待の内容については今後変更となる可能性があります。			

第7 【提出会社の参考情報】

1 【提出会社の親会社等の情報】

当社は、親会社等は有しておりません。

2 【その他の参考情報】

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。

1	有価証券届出書（ストックオプション制度に伴う新株予約権発行）及びその添付書類		平成29年1月30日 関東財務局長に提出
2	有価証券届出書	有価証券届出書（平成29年1月30日提出）に関する訂正の訂正届出書	平成29年1月31日 平成29年2月8日 平成29年2月9日 関東財務局長に提出
3	発行登録書（普通社債）及びその添付書類		平成28年7月15日 関東財務局長に提出
4	発行登録追補書類及びその添付書類	発行登録書（平成28年7月15日提出）に関する提出 同上	平成28年8月19日 平成28年11月25日 関東財務局長に提出
5	訂正発行登録書	発行登録書（平成28年7月15日提出）に関する提出 同上 同上	平成28年12月27日 平成29年1月30日 平成29年3月8日 関東財務局長に提出
6	有価証券報告書及びその添付書類並びに確認書	事業年度 自平成27年4月1日 （第79期）至平成28年3月31日	平成28年6月29日 関東財務局長に提出
7	内部統制報告書	事業年度 自平成27年4月1日 （第79期）至平成28年3月31日	平成28年6月29日 関東財務局長に提出
8	四半期報告書及び確認書	第80期第1四半期報告書 自平成28年4月1日 至平成28年6月30日 第80期第1四半期確認書 自平成28年4月1日 至平成28年6月30日 第80期第2四半期報告書 自平成28年7月1日 至平成28年9月30日 第80期第2四半期確認書 自平成28年7月1日 至平成28年9月30日 第80期第3四半期報告書 自平成28年10月1日 至平成28年12月31日 第80期第3四半期確認書 自平成28年10月1日 至平成28年12月31日	平成28年8月10日 関東財務局長に提出 平成28年8月10日 関東財務局長に提出 平成28年11月11日 関東財務局長に提出 平成28年11月11日 関東財務局長に提出 平成29年2月8日 関東財務局長に提出 平成29年2月8日 関東財務局長に提出

9	臨時報告書	企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2 (株主総会における議決権行使の結果)に基づくもの	平成28年7月1日 関東財務局長に提出
		企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第4号 (主要株主の異動)に基づくもの	平成28年12月26日 関東財務局長に提出
		企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号 (代表執行役の異動)に基づくもの	平成29年1月30日 関東財務局長に提出
		企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号 (代表執行役の異動)に基づくもの	平成29年3月7日 関東財務局長に提出
10	自己株券買付状況報告書		平成28年11月11日
			平成28年12月2日
			平成29年1月5日
			平成29年2月13日
			平成29年3月2日
			平成29年4月4日
			平成29年5月2日 関東財務局長に提出

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書及び内部統制監査報告書

平成29年 6 月29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	㊞
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞 廣 篤 典	㊞
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小 倉 加奈子	㊞

<財務諸表監査>

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、連結包括利益計算書、連結株主資本等変動計算書、連結キャッシュ・フロー計算書、連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項、その他の注記及び連結附属明細表について監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して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監査に基づいて、独立の立場から連結財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国にお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監査を行った。監査の基準は、当監査法人に連結財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、連結財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による連結財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、連結財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての連結財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社の平成29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・フローの状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

<内部統制監査>

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第2項の規定に基づく監査証明を行うため、株式会社大和証券グループ本社の平成29年3月31日現在の内部統制報告書について監査を行った。

内部統制報告書に対する経営者の責任

経営者の責任は、財務報告に係る内部統制を整備及び運用し、我が国において一般に公正妥当と認められる財務報告に係る内部統制の評価の基準に準拠して内部統制報告書を作成し適正に表示することにある。

なお、財務報告に係る内部統制により財務報告の虚偽の記載を完全には防止又は発見することができない可能性がある。

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内部統制監査に基づいて、独立の立場から内部統制報告書に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる財務報告に係る内部統制の監査の基準に準拠して内部統制監査を行った。財務報告に係る内部統制の監査の基準は、当監査法人に内部統制報告書に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき内部統制監査を実施することを求めている。

内部統制監査においては、内部統制報告書における財務報告に係る内部統制の評価結果について監査証拠を入手するための手続が実施される。内部統制監査の監査手続は、当監査法人の判断により、財務報告の信頼性に及ぼす影響の重要性に基づいて選択及び適用される。また、内部統制監査には、財務報告に係る内部統制の評価範囲、評価手続及び評価結果について経営者が行った記載を含め、全体としての内部統制報告書の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、株式会社大和証券グループ本社が平成29年3月31日現在の財務報告に係る内部統制は有効であると表示した上記の内部統制報告書が、我が国において一般に公正妥当と認められる財務報告に係る内部統制の評価の基準に準拠して、財務報告に係る内部統制の評価結果について、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

※1 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が連結財務諸表及び内部統制報告書に添付する形で別途保管しております。

2 XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年 6 月29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	㊞
--------------------	-------	---------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞 廣 篤 典	㊞
--------------------	-------	---------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小 倉 加奈子	㊞
--------------------	-------	---------	---

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28年4月1日から平成29年3月31日までの第80期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針、その他の注記及び附属明細表について監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して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監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国にお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監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社の平成29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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

※ 1 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2 XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

【表紙】

【提出書類】	内部統制報告書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条の4の4第1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年6月29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 中 田 誠 司
【最高財務責任者の役職氏名】	専務執行役 小 松 幹 太
【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
【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)

1 【財務報告に係る内部統制の基本的枠組みに関する事項】

当社執行役社長中田誠司及び最高財務責任者小松幹太は、当社の財務報告に係る内部統制の整備及び運用に責任を有しており、企業会計審議会の公表した「財務報告に係る内部統制の評価及び監査の基準並びに財務報告に係る内部統制の評価及び監査に関する実施基準の設定について（意見書）」に示されている内部統制の基本的枠組みに準拠して財務報告に係る内部統制を整備及び運用しております。

なお、内部統制は、内部統制の各基本的要素が有機的に結びつき、一体となって機能することで、その目的を合理的な範囲で達成しようとするものです。このため、財務報告に係る内部統制により財務報告の虚偽の記載を完全には防止又は発見することができない可能性があります。

2 【評価の範囲、基準日及び評価手続に関する事項】

財務報告に係る内部統制の評価は、当事業年度の末日である平成29年3月31日を基準日として行われており、評価に当たっては、一般に公正妥当と認められる財務報告に係る内部統制の評価の基準に準拠いたしました。

本評価においては、連結ベースでの財務報告全体に重要な影響を及ぼす内部統制（全社的な内部統制）の評価を行った上で、その結果を踏まえて、評価対象とする業務プロセスを選定しています。当該業務プロセスの評価においては、選定された業務プロセスを分析した上で、財務報告の信頼性に重要な影響を及ぼす統制上の要点を識別し、当該統制上の要点について整備及び運用状況を評価することによって、内部統制の有効性に関する評価を行いました。

財務報告に係る内部統制の評価の範囲は、当社並びに連結子会社及び持分法適用関連会社について、財務報告の信頼性に及ぼす影響の重要性の観点から必要な範囲を決定いたしました。財務報告の信頼性に及ぼす影響の重要性は、金額的及び質的影響の重要性を考慮して決定しており、当社並びに連結子会社及び持分法適用関連会社を対象として行った全社的な内部統制の評価結果を踏まえ、業務プロセスに係る内部統制の評価範囲を合理的に決定いたしました。なお、金額的及び質的重要性の観点から僅少であると判断した連結子会社及び持分法適用関連会社は、全社的な内部統制の評価範囲に含めておりません。

業務プロセスに係る内部統制の評価範囲については、各事業拠点の過去5年の連結会計年度の平均並びに当連結会計年度の純営業収益（連結会社間配当金消去後）の金額の高い拠点から合算していき、過去5年の連結会計年度の平均並びに当連結会計年度の連結純営業収益の概ね2/3に達している2事業拠点を「重要な事業拠点」といたしました。選定した重要な事業拠点においては、企業の事業目的に大きく関わる勘定科目として、受入手数料、トレーディング損益、トレーディング商品、信用取引資産・負債、有価証券担保貸付金・借入金を選定し、それに至る業務プロセスを評価対象といたしました。さらに、選定した重要な事業拠点にかかわらず、それ以外の事業拠点をも含めた範囲について、重要な虚偽記載の発生可能性が高く、見積りや予測を伴う重要な勘定科目に係る業務プロセスやリスクの大きい取引を行っている事業又は業務に係る業務プロセスを財務報告への影響を勘案して重要性の大きい業務プロセスとして評価対象に追加しております。

3 【評価結果に関する事項】

上記の評価の結果、当事業年度末日時点において、当社の財務報告に係る内部統制は有効であると判断いたしました。

4 【付記事項】

該当事項はございません。

5 【特記事項】

該当事項はございません。