

【表紙】

【提出書類】 四半期報告書

【根拠条文】 金融商品取引法第24条の4の7第1項

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年2月13日

【四半期会計期間】 第75期第3四半期
(自平成23年10月1日至平成23年12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 日比野 隆 司

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内1丁目9番1号

【電話番号】 03(5555)1111

【事務連絡者氏名】 財務部長 阪上 光

【最寄りの連絡場所】 東京都千代田区丸の内1丁目9番1号

【電話番号】 03(5555)1111

【事務連絡者氏名】 財務部長 阪上 光

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

株式会社大阪証券取引所
(大阪市中央区北浜1丁目8番16号)

株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄3丁目8番20号)

第一部 【企業情報】

第1 【企業の概況】

1 【主要な経営指標等の推移】

| 回次 | | 第74期 第3四半期 連結累計期間 | 第75期 第3四半期 連結累計期間 | 第74期 |
|------------------------------|-------|----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| 会計期間 | | 自平成22年4月1日 至平成22年12月31日 | 自平成23年4月1日 至平成23年12月31日 | 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日 |
| 営業収益 | (百万円) | 319,603 | 309,025 | 403,042 |
| 純営業収益 | (百万円) | 256,566 | 245,048 | 318,564 |
| 経常損失() | (百万円) | 2,010 | 21,883 | 32,602 |
| 四半期(当期)純損失() | (百万円) | 4,202 | 50,355 | 37,331 |
| 四半期包括利益又は包括利益 | (百万円) | 38,526 | 109,582 | 45,049 |
| 純資産額 | (百万円) | 927,158 | 806,065 | 921,398 |
| 総資産額 | (百万円) | 16,867,587 | 17,220,452 | 16,842,411 |
| 1株当たり四半期(当期)純損失 金額() | (円) | 2.45 | 29.91 | 21.90 |
| 潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額 | (円) | | | |
| 自己資本比率 | (%) | 5.0 | 4.2 | 5.0 |

| 回次 | | 第74期 第3四半期 連結会計期間 | 第75期 第3四半期 連結会計期間 |
|--------------------------------|-----|-----------------------------|-----------------------------|
| 会計期間 | | 自平成22年10月1日 至平成22年12月31日 | 自平成23年10月1日 至平成23年12月31日 |
| 1株当たり四半期純利益金額 又は四半期純損失金額() | (円) | 0.70 | 12.79 |

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

- 2 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。
- 3 第74期第3四半期連結累計期間の四半期包括利益の算定にあたり、「包括利益の表示に関する会計基準」(企業会計基準第25号 平成22年6月30日)を適用し、遡及処理しております。
- 4 1株当たり四半期(当期)純損失金額の算定における期末株式数及び期中平均株式数については、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式を四半期連結貸借対照表において自己株式として表示していることから、当該株式の数を控除しております。
- 5 潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)純利益金額については、1株当たり四半期(当期)純損失を計上しているため記載しておりません。

2 【事業の内容】

当第3四半期連結累計期間において、当社グループ(当社及び当社の関係会社)が営む事業の内容に重要な変更はありません。

また、重要な関係会社についても異動はありません。

第2 【事業の状況】

1 【事業等のリスク】

当第3四半期連結累計期間開始日以降、当四半期報告書提出日までの間において、第74期有価証券報告書に記載した事業等のリスクについて重要な変更があった事項は次のとおりであります。

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

(1) 世界的金融危機及び信用危機に関するリスク

世界的金融危機や信用危機は、世界各国の実体経済に重大な影響を与える中で、日本国内の金融・経済情勢にも多大な影響を与えます。

世界経済は、米国及び欧州に端を発した金融危機や信用危機から一旦は回復の傾向がみられたものの、ギリシャを含む欧州周縁国の信用不安の拡大により欧州財政問題は再び予断を許さぬ状況が続いています。今後、欧州連合や欧州各国が、取り決めた対応策を迅速かつ十分に実施できない場合には、一部金融機関の破綻や金融システムの安定性に対する信頼感の喪失、資本市場の機能不全といった市場の混乱が拡大し、再び世界的な金融危機が深刻化する可能性も否定できません。

また、欧州以外においても、高い成長率を維持してきた中国などの新興国において、インフレ抑制のための金融引き締め姿勢等により、経済成長の鈍化が見受けられます。さらに、米国においても、依然として高い水準の失業率と個人消費の低迷等の要因により景気減速の懸念が払拭されておらず、引き続き世界的な景気の下振れリスクが存在しています。

このような状況の下、金融危機や信用危機がさらに深刻化した場合、日本においてもさらなる株価の下落や円高の進行、企業業績の悪化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。

(5) 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、国内外の経済・金融情勢が一層悪化した場合、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、当社グループ内外との事業提携・合併関係、業務委託関係が変動あるいは解消した場合、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ます。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。

なお、グループ戦略の一貫として、当社は平成23年7月29日に開催された当社執行役会において、当社グループの証券業務の中核をなす連結子会社である大和証券株式会社（以下、「大和証券」という。）及び大和証券キャピタル・マーケッツ株式会社（以下、「大和証券キャピタル・マーケッツ」という。）が平成24年4月1日付で経営統合を行うことを内容とする基本合意書を締結することを承認し、同日、大和証券及び大和証券キャピタル・マーケッツは基本合意書を締結しております。

(6) 業績の変動性に伴うリスク

当社グループのコア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グローバル・マーケット部門やグローバル・インベストメント・バンキング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。

また、上記に記載した大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットの経営統合が行われた場合には、かかる経営統合は、当社グループの業績に一時的に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。

| | (百万円) | | |
|-----------------|---------|---------|---------|
| 回次 | 第72期 | 第73期 | 第74期 |
| 決算年月 | 平成21年3月 | 平成22年3月 | 平成23年3月 |
| 営業収益 | 413,936 | 537,915 | 403,042 |
| 純営業収益 | 199,544 | 458,105 | 318,564 |
| 経常利益又は経常損失() | 141,150 | 102,917 | 32,602 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 85,039 | 43,429 | 37,331 |

2 【経営上の重要な契約等】

当社は、平成23年7月29日開催の執行役会において、当社子会社である大和証券及び大和証券キャピタル・マーケットが平成24年4月1日に合併の方法により統合することに関する基本合意書を締結することを承認いたしました。

その主な内容は以下のとおりです。

(1) 合併の目的

当社グループでは、収支構造の抜本的改善による「強靱な経営基盤の確立」のため、現在、安定収益拡大、本社機能集約化による人員再配置及び各種販売費・一般管理費削減等により、中期的に収支の改善を目指しています。

その中で、今般大和証券と大和証券キャピタル・マーケットを合併の方法により統合することで、更なる組織運営の効率化、多様化する顧客ニーズの対応力強化、を図り「強靱な経営基盤の確立」を一層磐石なものとするを目的とします。

(2) 合併の方法、合併に係る割当ての内容及びその算定根拠等

詳細については未定であり、今後検討の上決定いたします。

(3) 合併の期日

平成24年4月1日(予定)

(4) 合併後の状況

合併後の会社の商号は、大和証券株式会社(英文 Daiwa Securities Co. Ltd.)となる予定です。詳細については未定であり、今後検討の上決定いたします。

3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

本項における将来に関する事項は、別段の記載がない限り、当第3四半期連結会計期間の末日現在において当社グループが判断したものであります。

(1) 業績の状況

当第3四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は3,090億円（前年同四半期比3.3%減）となりました。トレーディング損益が497億円（同35%減）と減少したものの、受入手数料は総額で1,637億円（同2.4%増）となり、金融収支は163億円（同68.9%増）、純営業収益は2,450億円（同4.5%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費524億円（同1.4%増）、人件費1,220億円（同2.8%増）、不動産関係費338億円（同1.2%増）などにより、合計で2,741億円（同1.8%増）となりました。

この結果、218億円の経常損失（前年同四半期は20億円の経常損失）となりました。

特別利益に投資有価証券売却益13億円、特別損失に固定資産除売却損69億円、投資有価証券評価損25億円、事業再編関連費用32億円等を計上したことなどにより、特別損益は純額で130億円の損失となりました。これに法人税等及び少数株主損益を加味した結果、当第3四半期連結累計期間は503億円の四半期純損失（前年同四半期は42億円の四半期純損失）となりました。

セグメントの業績は、次のとおりであります。

（単位：百万円）

| | 報告セグメント | | | | | | その他 | 合計 |
|---------------|---------|----------------|------------------------|---------------|-------|---------|--------|---------|
| | リテール部門 | グローバル・マーケットツ部門 | グローバル・インベストメント・バンキング部門 | アセット・マネジメント部門 | 投資部門 | 計 | | |
| 純営業収益 | 126,119 | 32,090 | 19,702 | 28,298 | 4,039 | 210,250 | 24,284 | 234,535 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 26,096 | 51,138 | 12,987 | 11,414 | 1,360 | 25,254 | 1,100 | 26,354 |

（注）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。

[リテール部門]

株式投資信託の販売が堅調であったものの、株券等の委託手数料が減少したことなどにより、純営業収益は1,261億円（前年同四半期比5.3%減）となり、経常利益は260億円（同9.7%減）となっております。

[グローバル・マーケットツ部門]

純営業収益は320億円（同38.2%減）、経常利益は511億円の損失（前年同四半期は306億円の損失）となっております。

[グローバル・インベストメント・バンキング部門]

エクイティ・ファイナンスの引受額が減少したことなどにより、純営業収益は197億円（同10.7%減）となり、経常利益は129億円の損失（前年同四半期は107億円の損失）となっております。

[アセット・マネジメント部門]

純営業収益は282億円（同4.1%増）、経常利益は114億円（同5.2%減）となっております。

[投資部門]

純営業収益は40億円（同13.4%減）、経常利益は13億円（前年同四半期は6億円の損失）となっております。

[その他]

純営業収益は242億円（同66.8%増）、経常利益は11億円の損失（前年同四半期は62億円の損失）となっております。

(2) 財政状態の分析

< 資産の部 >

当第3四半期連結会計期間末の総資産は17兆2,204億円（前連結会計年度末比3,780億円増）となりました。内訳は流動資産が16兆7,305億円（同4,191億円増）であり、このうち有価証券が1兆2,162億円（同1兆1,317億円増）、トレーディング商品が7兆8,943億円（同1兆1,238億円増）、有価証券担保貸付金が5兆2,814億円（同2兆464億円減）となっております。固定資産は4,899億円（同410億円減）となっております。

< 負債の部・純資産の部 >

負債合計は16兆4,143億円（同4,933億円増）となりました。内訳は流動負債が14兆4,303億円（同4,912億円増）であり、このうちトレーディング商品が5兆1,233億円（同3,065億円増）、有価証券担保借入金が4兆8,400億円（同4,988億円減）、短期借入金が2兆2,604億円（同4,000億円減）となっております。固定負債は1兆9,810億円（同21億円増）であり、このうち社債が1兆3,513億円（同171億円増）、長期借入金が5,809億円（同116億円減）となっております。

純資産合計は8,060億円（同1,153億円減）となりました。株主資本については、「(7)資本の財源及び資金の流動性に係る情報 株主資本」に記載のとおりであります。その他有価証券評価差額金は1億円（同232億円減）、為替換算調整勘定は580億円（同220億円減）、少数株主持分は708億円（同122億円減）となっております。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第3四半期連結累計期間において、事業上及び財務上の対処すべき課題について、重要な変更及び新たに生じた事項はありません。

(4) 研究開発活動

該当事項はありません。

(5) 従業員数

提出会社の状況

当第3四半期連結累計期間において、提出会社の従業員数は521人増加し、742人となっております。

これは主に、グループ内組織再編による本社機能の集約化に伴い、当第3四半期累計期間において大和証券及び大和証券キャピタル・マーケッツの本社部門に属する従業員を提出会社の所属とし、上記2社の職務を兼務することとなったためであります。

なお、従業員数は就業人員数であります。また、当社グループのセグメント情報において、持株会社である提出会社は「その他」の事業セグメントのみに属しております。

(6) 経営成績に重要な影響を与える要因についての分析

当第3四半期連結累計期間のマクロ経済環境

< 海外の状況 >

世界経済は、平成21年半ばから比較的堅調な成長を続けてきましたが、平成23年7 - 9月期に入ると先進国を中心に成長の減速傾向が強まりました。この背景には、欧米の財政問題の深刻化に起因する国際金融市場の混乱、先進国の企業・消費者マインドの軟化、米国の雇用環境の改善の遅れなどがあるとされています。また、それまで世界経済を牽引してきた新興国の経済も、金融引き締め政策や先進国向け輸出が頭打ち傾向となった影響により、変調の兆しが見え始めました。さらに、世界経済の減速に伴って資源需要が縮小するとの観測が高まったことに加え、投資家のリスク回避的な動きが強まる中で商品市場から投機資金が流出したため、資源価格は下落基調が続きました。平成23年10 - 12月においても、欧州財政問題の先行きに対する不透明感により世界経済は不安定な状況に置かれ、また平成23年10月にタイで発生した大洪水の被害により、世界的に自動車や電気機器など幅広い分野の生産に影響が出ました。

欧州では、周縁諸国の債務危機に対して国際的な支援策が相次いで打ち出されました。平成23年5月には、欧州連合（EU）及び国際通貨基金（IMF）が、ポルトガル政府に対する金融支援を行うことを決定し、平成23年6月のユーロ圏首脳会談では、欧州金融安定化基金（EFSF）の政府保証枠を4,400億ユーロから7,800億ユーロへ拡大させることで合意がなされ、金融支援規模が拡大されました。さらに、平成23年7月には、ユーロ圏首脳会議においてギリシャに対する追加支援が決定されました。しかし、これらの支援策は債務問題への対症療法に過ぎず、欧州各国の財政悪化という本質的な問題が解消されていないとの見方もあり、欧州財政問題が経済成長の妨げとなる状況が続きました。その後も、格付会社による欧州各国の国債の相次ぐ格下げ、ギリシャ政府の財政再建計画の実効性に対する懸念の高まり、ユーロ圏諸国の政治的な足並みの乱れなどによって、欧州財政問題は抜本的な解決には至っておりません。欧州中央銀行（ECB）は、欧州経済の減速感が高まったため、平成23年11月と12月に政策金利を2ヶ月連続で引き下げましたが、引き続き欧州財政問題の先行きは不透明な状況です。

米国では、平成23年8月まで、厳しい雇用環境や不動産市場の低迷などによって、経済の回復テンポが緩やかなものに留まりました。しかし、平成23年の9月以降は、堅調な個人消費が景気回復を下支えたため、米国経済は他の先進国よりも底堅く推移しました。一方で、平成23年7月頃には、米国においても財政問題に対する懸念が高まりました。米国の財政問題は、平成23年8月、連邦政府の債務上限の引き上げを盛り込んだ法律が成立したことで、一旦沈静化に向かうとみられましたが、法律成立直後に、米国の格付会社が米国長期国債の格付を最上位から引き下げたことで再燃し、金融市場が大きく動揺する事態になりました。しかし、米国連邦準備制度理事会（FRB）が、平成23年6月末の「量的緩和策第2弾（QE2）」の終了後も、財政問題に起因する金融市場の動揺などによる米国景気の腰折れを防ぐため、平成23年8月の米国連邦公開市場委員会（FOMC）において、現在の超低金利政策を少なくとも平成25年半ばまで継続する可能性が高いとの見方を表明したことにより、FRBの金融緩和スタンスがより鮮明になったことから、金融市場は徐々に落ち着きを取り戻しました。

新興国では、金融引き締め政策や先進国の景気減速の影響で、経済の成長ペースが鈍化し始める国が出てきましたが、全体的には先進国よりも高い成長率を維持しました。一方で、新興国においては、金融引き締め政策にもかかわらず物価上昇率が高い水準に留まっている国が多く、インフレの抑制が引き続き重要な政策課題となっています。他方、先進国の景気鈍化に伴って国内経済の成長ペースが急減速することを回避するために、金融引き締めスタンスを転換する国も現れました。主要新興国の中では、ブラジルが平成23年8月、10月及び11月に利下げに踏み切り、中国が同年12月に預金準備率を引き下げました。新興国においては、インフレを抑制しながら、経済をいかにソフトランディングさせるかという点が引き続き課題となっています。また、タイで10月に発生した大洪水によって、アジアの新興国では、生産や輸出などの経済活動が影響を受けており、経済成長の減速要因となっています。

<日本の状況>

日本経済は、平成23年3月11日に発生した東日本大震災によって大きな被害を受けましたが、製造業を中心に復旧活動が着実に進展し、平成23年8月頃までは持ち直しの動きが続きしました。しかし、その後は震災からの復旧の動きが一巡したことに加えて、海外経済の減速と円高の進行により国内企業の輸出が減速に転じたため、日本経済の回復ペースは徐々に緩やかなものになりました。平成23年9月の日銀短観では、震災からの復旧を背景に企業の業況判断が大幅に改善しましたが、同年12月の日銀短観では、海外需要と為替変動の影響を受けやすい製造業の業績判断が悪化に転じています。今後の日本経済の先行きは、引き続き復興需要を支えにして緩やかに改善傾向が続くことが見込まれていますが、平成23年7 - 9月期以降に世界経済の減速や円高などのリスク要因が顕在化したため、平成23年10月 - 12月期も日本経済の先行きに対する不透明感が払拭されない状況が長引いています。

生産活動は、東日本大震災によるサプライチェーンの寸断や計画停電の実施など供給面の制約を受けて、震災後に大きく低下しました。その結果、製品の出荷が滞ったため、輸出が大幅に減少しました。しかし、かかる状況の中でも、企業が生産ラインの修復活動が前倒しで進み、供給能力が改善に向かったことで、鉱工業生産については平成23年4月に増加へ転じて以降回復基調を続けています。企業が生産活動については、夏場に電力の供給が不足することが危惧されましたが、電力会社による電力供給能力の増強や企業及び家計の節電の努力によって、生産活動への影響は限定的なものに留まりました。輸出は生産の改善に伴って増加傾向を続けましたが、世界経済の成長ペースの減速や円高の進行によって、平成23年9月以降は横ばいで推移しています。また、タイの大洪水が一部業種の生産と輸出を低下させましたが、洪水からの復旧活動に伴ってそれらは徐々に持ち直し始めています。個人消費は、消費者マインドの回復や雇用環境の改善を受けて、平成23年10月頃までは全体的に持ち直し傾向を続けました。しかし、その後は消費者マインドの回復が一服したことにより、個人消費は伸び悩んでいます。

東日本大震災は日本の金融市場にも動揺をもたらしましたが、日本銀行による政策対応などによって、金融システム全体を麻痺させるような事態にはなりませんでしたが、平成23年7 - 9月期には、欧米の財政問題の深刻化などを背景とする国際金融市場の混乱を受けて、株価が大きく下落しました。また、海外投資家がリスク回避の姿勢を強め、為替市場において相対的に安全な通貨と評価された円を買う動きが広がったため、円高が進みました。こうした事態を受けて、政府・日銀は平成23年8月、円売り・ドル買いの単独介入を実施し、また、平成23年10月下旬に円ドル・レートが戦後最高値を更新した際にも、再び円売り・ドル買い介入を実施しましたが、円高傾向が転換するまでには至りませんでした。さらに、欧州財政問題の先行き不透明感から、ユーロを売って円を買う動きが平成23年11月以降に加速したため、平成23年の年末には一時1ユーロ100円を割り込みました。そのため、円高に関しては、引き続き日本経済のリスク要因として注視すべき状況が続いています。国債市場においては、平成23年12月下旬に日本の格付会社が日本国債の格付を最上位から引き下げました。しかし、格付会社が、事前アナウンスに時間をかけていたことや今後の格付の方向性を安定的に設定したため、市場への影響は限定的でした。なお、平成23年12月末の日経平均株価は8,455円35銭（同年3月末比1,299円75銭安）、10年国債利回りは0.980%（同0.275ポイントの低下）、為替は1ドル77円57銭（同5円27銭の円高）となりました。

東日本大震災からの復興については、震災によって甚大な被害を受けた地域の復興に遅れが出ています。その背景としては、今回の震災の被害が過去に前例のない大規模なものであったこと、加えて原子力発電所の事故による放射性物質の拡散などの問題が解決されていないこと、国内の不安定な政治情勢に起因して復興計画策定に遅れが生じていることなどが指摘されています。東日本大震災復興基本法が成立したのは、震災から3ヶ月以上も経過した平成23年6月であり、平成23年度第2次補正予算も、成立は平成23年7月となりました。大規模な公共投資案件が盛り込まれた平成23年度第3次補正予算も、平成23年8月に菅内閣が総辞職するなど不安定な政治情勢の影響を受けて、同年11月までずれ込みました。一般的に予算の成立から執行までには数ヶ月程度の時間を要することを考慮すると、第3次補正予算による復興需要が本格化するのには、平成24年に入ってからとなることを見込まれます。

(7) 資本の財源及び資金の流動性に係る情報

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に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー等の無担保調達、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、事業の継続に支障を来すことのないよう、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。

また、当社は、パーゼル委員会が提示した流動性カバレッジ比率に準拠した手法で、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、複数の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毎日確認しております。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。

なお、当第3四半期連結会計期間末における当社グループの短期無担保調達資金及び流動性ポートフォリオの状況は次のとおりです。

(単位：億円)

| | | |
|---------------|---------------|--------|
| | 銀行等からの短期借入金 | 2,204 |
| | その他の短期借入金 | 5,484 |
| | コマーシャル・ペーパー | 4,271 |
| | 1年内償還予定の社債 | 1,435 |
| 短期無担保調達資金合計 | | 13,396 |
| | 現金・預金 | 15,400 |
| | 国債・政府保証債等 | 2,125 |
| | 流動性ポートフォリオ | 17,525 |
| | その他の債券 | 6,224 |
| | 上場株式等 | 1,574 |
| | その他 | 70 |
| | 補完的流動性ポートフォリオ | 7,868 |
| 流動性ポートフォリオ等合計 | | 25,394 |

(注) 上記には銀行業にかかる資産及び負債は含めておりません。

当第3四半期連結会計期間末における当社グループの流動性ポートフォリオの合計額は1兆7,525億円であります。また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は2兆5,394億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の189.6%に相当します。

< 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。

< 資金流動性コンティンジェンシー・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、資金流動性コンティンジェンシー・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。

当社グループの当該コンティンジェンシー・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資金流動性確保の重要性の高い大和証券及び大和証券キャピタル・マーケット（傘下の海外現地法人も勘案）においては、さらに個別のコンティンジェンシー・プランも制定し、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・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資金調達プランやコンティンジェンシー・プランそのものの見直しを行い、さら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。

株主資本

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

当第3四半期連結会計期間末の株主資本は、前連結会計年度末比569億円減少し、7,897億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,780億円となりました。利益剰余金は配当金支払いにより102億円減少したほか、四半期純損失を503億円計上した結果、前連結会計年度末比606億円減の3,350億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ37億円減少し、233億円となっております。

第3 【提出会社の状況】

1 【株式等の状況】

(1) 【株式の総数等】

【株式の総数】

| 種類 | 発行可能株式総数(株) |
|------|---------------|
| 普通株式 | 4,000,000,000 |
| 計 | 4,000,000,000 |

【発行済株式】

| 種類 | 第3四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成23年12月31日) | 提出日現在 発行数(株) (平成24年2月13日) | 上場金融商品取引所 名又は登録認可金融 商品取引業協会名 | 内容 |
|------|---|---------------------------------|--|------------------------|
| 普通株式 | 1,749,378,772 | 1,749,378,772 | 東京証券取引所 大阪証券取引所 名古屋証券取引所 各市場第一部 | 単元株式数は1,000株で あります。 |
| 計 | 1,749,378,772 | 1,749,378,772 | | |

(注) 「提出日現在発行数」には、平成24年2月1日からこの四半期報告書提出日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれておりません。

(2) 【新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

(3) 【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

(4) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

(5) 【発行済株式総数、資本金等の推移】

| 年月日 | 発行済株式 総数増減数 (千株) | 発行済株式 総数残高 (千株) | 資本金増減額 (百万円) | 資本金残高 (百万円) | 資本準備金 増減額 (百万円) | 資本準備金 残高 (百万円) |
|--------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------|----------------|-----------------------|----------------------|
| 平成23年10月1日～ 平成23年12月31日 | | 1,749,378 | | 247,397 | | 226,751 |

(6) 【大株主の状況】

当四半期会計期間は第3四半期会計期間であるため、記載事項はありません。

(7) 【議決権の状況】

当第3四半期会計期間末日現在の「議決権の状況」については、株主名簿の記載内容が確認できないため、記載することができないことから、直前の基準日（平成23年9月30日）に基づく株主名簿による記載をしております。

【発行済株式】

平成23年12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 35,800,000 | | |
| 完全議決権株式(その他) | 普通株式 1,710,566,000 | 1,708,502 | |
| 単元未満株式 | 普通株式 3,012,772 | | |
| 発行済株式総数 | 1,749,378,772 | | |
| 総株主の議決権 | | 1,708,502 | |

- (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 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、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2,064,000株(議決権2,064個)が含まれております。
なお、当該株式は議決権の数から除いております。
- 3 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、従業員持株ESOP信託口が所有する当社株式29,547,000株(議決権29,547個)が含まれております。
- 4 「単元未満株式」欄の株式数には、当社所有の自己株式354株が含まれております。

【自己株式等】

平成23年12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 1丁目9番1号 | 35,800,000 | | 35,800,000 | 2.05 |
| 計 | | 35,800,000 | | 35,800,000 | 2.05 |

- (注) 上記のほか、当社の子会社が有価証券関連業務として自己の名義で保有している株式が2,064,000株(議決権2,064個)あります。なお、当該株式数は上記「発行済株式」の「完全議決権株式(その他)」欄の株式数に含めております。

2 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当四半期累計期間における役員の異動は、次のとおりであります。

(1) 取締役の状況

該当事項はありません。

(2) 執行役の状況

該当事項はありません。

第4 【経理の状況】

1．四半期連結財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3四半期連結会計期間(平成23年10月1日から平成23年12月31日まで)及び第3四半期連結累計期間(平成23年4月1日から平成23年12月31日まで)に係る四半期連結財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による四半期レビューを受けております。

1【四半期連結財務諸表】

(1)【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

| | 前連結会計年度 (平成23年3月31日) | 当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日) |
|--------------|-------------------------|-------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 1,025,239 | 1,417,209 |
| 預託金 | 241,697 | 193,558 |
| 受取手形及び売掛金 | 11,538 | 11,072 |
| 有価証券 | 84,435 | 1,216,229 |
| トレーディング商品 | 6,770,478 | 7,894,305 |
| 商品有価証券等 | 4,549,799 | 5,007,451 |
| デリバティブ取引 | 2,220,679 | 2,886,853 |
| 約定見返勘定 | 102,010 | - |
| 営業投資有価証券 | 219,523 | 181,180 |
| 投資損失引当金 | 41,962 | 41,860 |
| 営業貸付金 | 72,090 | 109,297 |
| 仕掛品 | 506 | 884 |
| 信用取引資産 | 147,847 | 138,321 |
| 信用取引貸付金 | 114,479 | 115,923 |
| 信用取引借証券担保金 | 33,368 | 22,397 |
| 有価証券担保貸付金 | 7,327,845 | 5,281,421 |
| 借入有価証券担保金 | 7,326,791 | 5,275,500 |
| 現先取引貸付金 | 1,054 | 5,921 |
| 立替金 | 13,577 | 15,644 |
| 短期貸付金 | 5,051 | 953 |
| 未収収益 | 34,153 | 22,407 |
| 繰延税金資産 | 10,590 | 6,400 |
| その他の流動資産 | 287,106 | 283,890 |
| 貸倒引当金 | 300 | 376 |
| 流動資産計 | 16,311,431 | 16,730,542 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 133,226 | 132,224 |
| 無形固定資産 | 135,680 | 115,896 |
| のれん | 26,659 | 21,943 |
| その他 | 109,020 | 93,952 |
| 投資その他の資産 | 262,073 | 241,788 |
| 投資有価証券 | 188,856 | 175,820 |
| 長期貸付金 | 10,530 | 9,928 |
| 長期差入保証金 | 23,941 | 23,438 |
| 繰延税金資産 | 23,217 | 17,584 |
| その他 | 16,438 | 15,878 |
| 貸倒引当金 | 910 | 862 |
| 固定資産計 | 530,980 | 489,909 |
| 資産合計 | 16,842,411 | 17,220,452 |

| | 前連結会計年度 (平成23年3月31日) | 当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日) |
|-------------|-------------------------|-------------------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 支払手形及び買掛金 | 5,869 | 3,863 |
| トレーディング商品 | 4,816,854 | 5,123,378 |
| 商品有価証券等 | 3,012,792 | 2,615,432 |
| デリバティブ取引 | 1,804,062 | 2,507,945 |
| 約定見返勘定 | - | 134,630 |
| 信用取引負債 | 61,397 | 50,600 |
| 信用取引借入金 | 4,774 | 2,247 |
| 信用取引貸証券受入金 | 56,622 | 48,352 |
| 有価証券担保借入金 | 5,338,881 | 4,840,081 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 5,213,298 | 4,456,238 |
| 現先取引借入金 | 125,583 | 383,843 |
| 預り金 | 149,427 | 121,663 |
| 受入保証金 | 249,362 | 253,231 |
| 短期借入金 | 2,660,492 | 2,260,485 |
| コマーシャル・ペーパー | 395,195 | 427,163 |
| 1年内償還予定の社債 | 155,056 | 143,568 |
| 未払法人税等 | 2,241 | 3,182 |
| 繰延税金負債 | 1,012 | 296 |
| 賞与引当金 | 23,152 | 13,870 |
| その他の流動負債 | 80,197 | 1,054,329 |
| 流動負債計 | 13,939,141 | 14,430,344 |
| 固定負債 | | |
| 社債 | 1,334,141 | 1,351,317 |
| 長期借入金 | 592,640 | 580,964 |
| 繰延税金負債 | 631 | 107 |
| 退職給付引当金 | 29,948 | 29,701 |
| 訴訟損失引当金 | 503 | 438 |
| 偶発損失引当金 | 960 | - |
| 負ののれん | 17,121 | 13,697 |
| その他の固定負債 | 2,902 | 4,791 |
| 固定負債計 | 1,978,849 | 1,981,019 |
| 特別法上の準備金 | | |
| 金融商品取引責任準備金 | 3,022 | 3,022 |
| 特別法上の準備金計 | 3,022 | 3,022 |
| 負債合計 | 15,921,013 | 16,414,387 |

| | 前連結会計年度 (平成23年3月31日) | 当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日) |
|----------------------|-------------------------|-------------------------------|
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 247,397 | 247,397 |
| 資本剰余金 | 230,632 | 230,655 |
| 利益剰余金 | 395,751 | 335,065 |
| 自己株式 | 27,054 | 23,333 |
| 株主資本合計 | 846,725 | 789,785 |
| その他の包括利益累計額 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 23,135 | 133 |
| 繰延ヘッジ損益 | 85 | 1,606 |
| 為替換算調整勘定 | 36,013 | 58,066 |
| その他の包括利益累計額合計 | 12,793 | 59,807 |
| 新株予約権 | 4,385 | 5,249 |
| 少数株主持分 | 83,080 | 70,837 |
| 純資産合計 | 921,398 | 806,065 |
| 負債・純資産合計 | 16,842,411 | 17,220,452 |

(2)【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】

【四半期連結損益計算書】

【第3四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

| | 前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日) | 当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日) |
|----------------------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受入手数料 | 159,867 | 163,767 |
| 委託手数料 | 35,415 | 28,967 |
| 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料 | 17,451 | 16,710 |
| 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料 | 24,257 | 36,782 |
| その他の受入手数料 | 82,743 | 81,307 |
| トレーディング損益 | 76,490 | 49,712 |
| 株券等トレーディング損益 | 20,497 | 19,040 |
| 債券・為替等トレーディング損益 | 96,988 | 68,753 |
| 営業投資有価証券関連損益 | 2,895 | 4,614 |
| 金融収益 | 52,889 | 60,852 |
| その他の営業収益 | 27,459 | 30,078 |
| 営業収益計 | 319,603 | 309,025 |
| 金融費用 | 43,197 | 44,484 |
| その他の営業費用 | 19,839 | 19,492 |
| 純営業収益 | 256,566 | 245,048 |
| 販売費・一般管理費 | | |
| 取引関係費 | 51,705 | 52,441 |
| 人件費 | 118,793 | 122,078 |
| 不動産関係費 | 33,462 | 33,851 |
| 事務費 | 20,044 | 20,307 |
| 減価償却費 | 29,107 | 30,268 |
| 租税公課 | 5,551 | 5,038 |
| 貸倒引当金繰入れ | - | 8 |
| その他 | 10,556 | 10,107 |
| 販売費・一般管理費計 | 269,222 | 274,103 |
| 営業損失() | 12,655 | 29,054 |
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 156 | 111 |
| 受取配当金 | 3,952 | 1,589 |
| 負ののれん償却額 | 3,424 | 3,424 |
| 持分法による投資利益 | 2,007 | 1,023 |
| その他 | 2,516 | 2,850 |
| 営業外収益計 | 12,056 | 8,998 |
| 営業外費用 | | |
| 支払利息 | 82 | 52 |
| 為替差損 | 727 | 1,209 |
| その他 | 602 | 565 |
| 営業外費用計 | 1,411 | 1,828 |
| 経常損失() | 2,010 | 21,883 |

| | 前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日) | 当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日) |
|--------------------------------------|--|--|
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 3,499 | 1,330 |
| 関係会社株式売却益 | 1,571 | - |
| その他 | 962 | - |
| 特別利益計 | 6,033 | 1,330 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除売却損 | 627 | 6,975 |
| 投資有価証券売却損 | 1 | 265 |
| 減損損失 | 49 | 757 |
| 投資有価証券評価損 | 828 | 2,514 |
| 事業再編関連費用 | - | 3,245 |
| 資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額 | 603 | - |
| その他 | 255 | 658 |
| 特別損失計 | 2,365 | 14,416 |
| 税金等調整前四半期純利益又は税金等調整前四半期純損失() | 1,657 | 34,969 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,876 | 4,969 |
| 法人税等調整額 | 1,254 | 10,767 |
| 法人税等合計 | 5,131 | 15,736 |
| 少数株主損益調整前四半期純損失() | 3,473 | 50,705 |
| 少数株主利益又は少数株主損失() | 728 | 350 |
| 四半期純損失() | 4,202 | 50,355 |

【四半期連結包括利益計算書】
【第3四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

| | 前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日) | 当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日) |
|--------------------|--|--|
| 少数株主損益調整前四半期純損失() | 3,473 | 50,705 |
| その他の包括利益 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 14,666 | 34,960 |
| 繰延ヘッジ損益 | 52 | 1,691 |
| 為替換算調整勘定 | 20,091 | 22,192 |
| 持分法適用会社に対する持分相当額 | 346 | 33 |
| その他の包括利益合計 | 35,052 | 58,877 |
| 四半期包括利益 | 38,526 | 109,582 |
| (内訳) | | |
| 親会社株主に係る四半期包括利益 | 37,750 | 97,369 |
| 少数株主に係る四半期包括利益 | 775 | 12,213 |

【会計方針の変更等】

当第3四半期連結累計期間
(自平成23年4月1日
至平成23年12月31日)

(会計方針の変更)

第1四半期連結会計期間より、「1株当たり当期純利益に関する会計基準」(企業会計基準第2号平成22年6月30日)及び「1株当たり当期純利益に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第4号平成22年6月30日)を適用しております。

潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定にあたり、一定期間の勤務後に権利が確定するストック・オプションについて、権利の行使により払い込まれると仮定した場合の入金額に、ストック・オプションの公正な評価額のうち、将来提供されるサービスに係る分を含める方法に変更しております。

なお、前第3四半期連結累計期間及び当第3四半期連結累計期間の潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については、潜在株式は存在するものの、1株当たり四半期純損失を計上しているため開示しておりません。

【追加情報】

当第3四半期連結累計期間
(自平成23年4月1日
至平成23年12月31日)

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準)

第1四半期連結会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日)を適用しております。

なお、第1四半期連結累計期間より、四半期連結損益計算書における従来の「その他の売上高」は「その他の営業収益」、「売上原価」は「その他の営業費用」に勘定科目をそれぞれ変更しております。

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

| 前連結会計年度 (平成23年3月31日) | | | 当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日) | | |
|-------------------------------------|----------|-------------|-------------------------------------|----------|-------------|
| 1 貸倒引当金10,687百万円は、債権額と相殺して表示しております。 | | | 1 貸倒引当金10,807百万円は、債権額と相殺して表示しております。 | | |
| 2 保証債務 | | | 2 保証債務 | | |
| 被保証者 | 被保証債務の内容 | 金額 (百万円) | 被保証者 | 被保証債務の内容 | 金額 (百万円) |
| 従業員 | 借入金 | 1,675 | 従業員 | 借入金 | 1,298 |
| その他 | 債務 | 1,384 | その他 | 債務 | 1,255 |
| 合計 | | 3,059 | 合計 | | 2,553 |

(四半期連結損益計算書関係)

| 前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日) | 当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日) |
|--|--|
| 1 人件費には、賞与引当金繰入額18,474百万円が含まれております。 | 1 人件費には、賞与引当金繰入額14,676百万円が含まれております。 |

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

当第3四半期連結累計期間に係る四半期連結キャッシュ・フロー計算書は作成しておりません。なお、第3四半期連結累計期間に係る減価償却費(のれんを除く無形固定資産に係る償却費を含む。)、のれん及び負ののれんの償却額は、次のとおりであります。

| | 前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日) | 当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日) |
|-----------|--|--|
| 減価償却費 | 32,067百万円 | 31,781百万円 |
| のれんの償却額 | 1,036 | 2,074 |
| 負ののれんの償却額 | 3,424 | 3,424 |

(株主資本等関係)

前第3四半期連結累計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)

1. 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成22年5月19日 取締役会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 13,987 | 8 | 平成22年3月31日 | 平成22年6月7日 |
| 平成22年10月29日 取締役会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 5,245 | 3 | 平成22年9月30日 | 平成22年12月1日 |

(注) 平成22年10月29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117百万円が含まれております。

2. 基準日が当第3四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第3四半期連結会計期間の末日後となるもの

該当事項はありません。

当第3四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)

1. 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成23年5月17日 取締役会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 5,140 | 3 | 平成23年3月31日 | 平成23年6月6日 |
| 平成23年10月28日 取締役会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 5,140 | 3 | 平成23年9月30日 | 平成23年12月1日 |

(注) 1 平成23年5月17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104百万円が含まれております。

2 平成23年10月28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88百万円が含まれております。

2. 基準日が当第3四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第3四半期連結会計期間の末日後となるもの

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

前第3四半期連結累計期間(自平成22年4月1日至平成22年12月31日)

1. 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位: 百万円)

| | 報告セグメント | | | | | | その他 (注)1 | 合計 |
|-------------------------------------|------------|---------------------------|--|---------------------------|-------|---------|-------------|---------|
| | リテール 部門 | グローバ ル・マー ケッツ部 門 | グローバ ル・イン ベストメ ント・バ ンキング 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 | 99,529 | 65,916 | 26,968 | 44,155 | 4,745 | 241,316 | 4,484 | 236,831 |
| セグメント間の内部純営業収益又は振替高 | 33,642 | 13,956 | 4,898 | 16,982 | 77 | 2,272 | 19,045 | 16,772 |
| 計 | 133,171 | 51,960 | 22,070 | 27,173 | 4,667 | 239,043 | 14,560 | 253,603 |
| セグメント利益又はセグメント損失() (経常利益又は経常損失()) | 28,915 | 30,617 | 10,700 | 12,045 | 620 | 978 | 6,215 | 7,193 |

- (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、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。

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

(単位: 百万円)

| 利益又は損失() | 金額 |
|--------------------|-------|
| 報告セグメント計 | 978 |
| 「その他」の区分の損失() | 6,215 |
| セグメント間取引消去 | 174 |
| のれん及び負ののれんの償却額 | 3,176 |
| 未実現損益の調整額 | 1,713 |
| その他の調整額 | 468 |
| 四半期連結損益計算書の経常損失() | 2,010 |

当第3四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)

1. 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

| | 報告セグメント | | | | | | その他 (注)1 | 合計 |
|-------------------------------------|------------|-------------------------------|--|-------------------------------|----------|---------|-------------|---------|
| | リテール部 門 | グローバル ・マ ーケッ ツ部 門 | グローバ ル・イン ベストメ ント・バ ンキング 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 | 100,820 | 31,850 | 21,906 | 43,824 | 5,974 | 204,375 | 3,259 | 207,635 |
| セグメント間の内部純営業収益又は振替高 | 25,298 | 239 | 2,203 | 15,525 | 1,934 | 5,874 | 21,025 | 26,900 |
| 計 | 126,119 | 32,090 | 19,702 | 28,298 | 4,039 | 210,250 | 24,284 | 234,535 |
| セグメント利益又はセグメント損失() (経常利益又は経常損失()) | 26,096 | 51,138 | 12,987 | 11,414 | 1,360 | 25,254 | 1,100 | 26,354 |

- (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、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。

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

(単位：百万円)

| 利益又は損失() | 金額 |
|--------------------|--------|
| 報告セグメント計 | 25,254 |
| 「その他」の区分の損失() | 1,100 |
| セグメント間取引消去 | 370 |
| のれん及び負ののれんの償却額 | 3,193 |
| 未実現損益の調整額 | 3,002 |
| その他の調整額 | 1,354 |
| 四半期連結損益計算書の経常損失() | 21,883 |

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成23年3月31日)

1. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

| 種類 | 連結貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---------|------------|----|----|
| 国債・地方債等 | | | |
| 社債 | 100 | 98 | 1 |
| その他 | | | |
| 計 | 100 | 98 | 1 |

2. その他有価証券

(単位:百万円)

| 種類 | 取得原価 | 連結貸借対照表計上額 | 差額 |
|-------------------------------|---------|------------|--------|
| 株券 | 99,795 | 141,499 | 41,703 |
| 債券 | 9,701 | 9,704 | 2 |
| 国債・地方債等 | | | |
| 社債 | 5,553 | 5,553 | |
| その他 | 4,148 | 4,151 | 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 | 45,760 | 47,173 | 1,412 |
| その他 | 123,549 | 121,562 | 1,986 |
| 計 | 278,807 | 319,939 | 41,132 |

(注) その他有価証券で時価のあるものにつき、当連結会計年度において3,667百万円の減損処理を行っております。

当第3四半期連結会計期間末(平成23年12月31日)

1. 満期保有目的の債券

(単位:百万円)

| 種類 | 四半期連結貸借 対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---------|-------------------|---------|-------|
| 国債・地方債等 | 85,707 | 85,926 | 218 |
| 社債 | 82,669 | 83,353 | 684 |
| その他 | 242,162 | 239,222 | 2,940 |
| 計 | 410,539 | 408,502 | 2,037 |

2. その他有価証券

(単位:百万円)

| 種類 | 取得原価 | 四半期連結貸借 対照表計上額 | 差額 |
|-------------------------------|---------|-------------------|-------|
| 株券 | 95,631 | 99,297 | 3,665 |
| 債券 | 784,931 | 788,425 | 3,493 |
| 国債・地方債等 | 629,302 | 633,071 | 3,768 |
| 社債 | 117,544 | 117,819 | 275 |
| その他 | 38,084 | 37,534 | 549 |
| 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 | 38,807 | 40,152 | 1,345 |
| その他 | 75,571 | 72,128 | 3,442 |
| 計 | 994,941 | 1,000,004 | 5,062 |

(注) その他有価証券で時価のあるものにつき、当第3四半期連結累計期間において2,478百万円の減損処理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

前連結会計年度末(平成23年3月31日)

トレーディングに係るもの

(単位:百万円)

| 種類 | 資産 | | 負債 | |
|---------|------------|-----------|------------|-----------|
| | 契約額等 | 時価 | 契約額等 | 時価 |
| オプション取引 | 4,580,458 | 394,028 | 5,441,001 | 396,975 |
| 為替予約取引 | 878,225 | 20,461 | 1,635,048 | 41,333 |
| 先物・先渡取引 | 1,270,552 | 11,103 | 191,717 | 5,816 |
| スワップ取引 | 53,605,445 | 1,777,083 | 52,302,110 | 1,325,955 |
| その他 | 1,330,902 | 33,065 | 1,293,787 | 33,981 |
| リスクリザーブ | | 15,063 | | |

当第3四半期連結会計期間末(平成23年12月31日)

トレーディングに係るもの

(単位:百万円)

| 種類 | 資産 | | 負債 | |
|---------|------------|-----------|------------|-----------|
| | 契約額等 | 時価 | 契約額等 | 時価 |
| オプション取引 | 4,363,130 | 363,313 | 5,231,561 | 394,208 |
| 為替予約取引 | 1,413,909 | 30,004 | 1,688,928 | 40,311 |
| 先物・先渡取引 | 484,803 | 11,118 | 1,017,591 | 3,648 |
| スワップ取引 | 58,236,721 | 2,444,266 | 58,084,521 | 2,025,846 |
| その他 | 1,603,219 | 50,632 | 1,580,476 | 43,930 |
| リスクリザーブ | | 12,481 | | |

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純損失金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目 | 前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日) | 当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日) |
|---|---|---|
| 1株当たり四半期純損失金額() | 2.45円 | 29.91円 |
| (算定上の基礎) | | |
| 四半期純損失金額()(百万円) | 4,202 | 50,355 |
| 普通株主に帰属しない金額(百万円) | | |
| 普通株式に係る四半期純損失金額()(百万円) | 4,202 | 50,355 |
| 普通株式の期中平均株式数(千株) | 1,712,999 | 1,683,333 |
| 希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定に含めなかった潜在株式で、前連結会計年度末から重要な変動があったものの概要 | 潜在株式の種類 新株予約権方式によるストック・オプション 潜在株式の数 2010年7月発行新株予約権 1,056千株 第7回新株予約権 7,399千株 | 潜在株式の種類 新株予約権方式によるストック・オプション 潜在株式の数 2011年7月発行新株予約権 1,211千株 第8回新株予約権 5,855千株 |

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については、1株当たり四半期純損失であるため、記載しておりません。

2 普通株式の期中平均株式数については、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式について四半期連結貸借対照表において自己株式として表示していることから、当該株式の数を控除しております。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

2 【その他】

(剰余金の配当)

平成23年10月28日開催の取締役会において、平成23年9月30日を基準日とする剰余金の配当に関して次のとおり決議いたしました。

配当金の総額 5,140百万円
1株当たりの金額 3円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成23年12月1日

(注) 1 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88百万円が含まれております。

2 平成23年9月30日現在の株主名簿に記録された株主又は登録質権者に対し支払いを行っております。

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

平成24年2月13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 森 公高 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞 廣 篤 典 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 内 田 和 男 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、「経理の状況」に掲げられている株式会社大和証券グループ本社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの連結会計年度の第3四半期連結会計期間（平成23年10月1日から平成23年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成23年4月1日から平成23年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書及び注記について四半期レビューを行った。

四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

監査人の結論

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社の平成23年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する第3四半期連結累計期間の経営成績を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

利害関係

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

- (注) 1 上記は、四半期レビュー報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(四半期報告書提出会社)が別途保管しております。
2 四半期連結財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。