

【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25年8月9日

【四半期会計期間】 第77期第1四半期
(自平成25年4月1日至平成25年6月30日)

【会社名】 株式会社大和証券グループ本社

【英訳名】 Daiwa Securities Group Inc.

【代表者の役職氏名】 執行役社長 日比野 隆 司

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03(5555)1111

【事務連絡者氏名】 財務部長 佐藤 英 二

【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 佐藤 英 二

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

株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)

第一部 【企業情報】

第1 【企業の概況】

1 【主要な経営指標等の推移】

回次		第76期 第1四半期 連結累計期間	第77期 第1四半期 連結累計期間	第76期
会計期間		自平成24年4月1日 至平成24年6月30日	自平成25年4月1日 至平成25年6月30日	自平成24年4月1日 至平成25年3月31日
営業収益	(百万円)	113,897	183,082	525,411
純営業収益	(百万円)	87,003	155,272	417,308
経常利益	(百万円)	8,534	65,087	95,176
四半期(当期)純利益	(百万円)	2,678	57,297	72,909
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	26,499	66,371	139,326
純資産額	(百万円)	921,695	1,129,033	1,082,567
総資産額	(百万円)	17,827,368	19,540,864	19,049,099
1株当たり四半期(当期)純利益金額	(円)	1.58	33.72	43.00
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額	(円)	1.58	33.44	42.89
自己資本比率	(%)	4.2	4.9	4.8

- (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 1株当たり四半期(当期)純利益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。

2 【事業の内容】

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

また、主要な関係会社についても異動はありません。

第2 【事業の状況】

1 【事業等のリスク】

当第1四半期連結累計期間開始日以降、当四半期報告書提出日までの間において、第76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。

(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。

(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を任意適用する可能性もあります。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。

2 【経営上の重要な契約等】

当第1四半期連結会計期間において、経営上の重要な契約等の決定又は締結等はありません。

3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

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

(1) 業績の状況

当第1四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は1,830億円（前年同四半期比60.7%増）となりました。トレーディング損益が421億円（同72.8%増）、受入手数料は総額で903億円（同88.0%増）となりました。金融収支は116億円（同171.5%増）、純営業収益は1,552億円（同78.5%増）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費190億円（同12.7%増）、人件費466億円（同26.0%増）などにより、合計で929億円（同12.3%増）となりました。

この結果、経常利益は650億円（同662.6%増）となりました。

また、特別利益として投資有価証券売却益38億円、特別損失として減損損失20億円、移転関連費用7億円などを計上したことにより、特別損益は純額で3億円の利益となりました。これに法人税等及び少数株主利益を加味した結果、四半期純利益は572億円（前年同四半期は26億円の利益）となりました。

セグメントの業績は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

	純営業収益			経常利益又は経常損失()		
	平成24年 6月期	平成25年 6月期	対前年 増減率	平成24年 6月期	平成25年 6月期	対前年 増減率
リテール部門	39,468	78,289	98.4%	6,762	39,443	483.3%
ホールセール部門	21,759	45,153	107.5%	8,675	12,595	-
アセット・マネジメント部門	11,063	12,321	11.4%	4,826	6,301	30.5%
投資部門	5,333	8,380	57.1%	4,430	7,746	74.9%
その他	5,286	8,168	54.5%	1,024	1,717	-
調整前 計	82,911	152,314	83.7%	6,319	64,369	918.5%
調整	4,091	2,958	27.7%	2,214	718	67.6%
連結 計	87,003	155,272	78.5%	8,534	65,087	662.6%

(注) 上記の「調整前 計」に含まれる各セグメントの純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

[リテール部門]

株式市場の活況を背景とした日本株取引の拡大や、仕組債、個人向け社債の販売拡大に加え、株式投信の販売が伸長したことなどから、純営業収益は782億円（前年同四半期比98.4%増）、経常利益は394億円（同483.3%増）となりました。

[ホールセール部門]

日本株を中心とした顧客フローの拡大や、市場の動向を捉えたポジション運営が奏功したことなどから、純営業収益は451億円（同107.5%増）、経常利益は125億円（前年同四半期は86億円の損失）となりました。

[アセット・マネジメント部門]

株式投信の販売増加に加え、円安・株高により運用資産残高が拡大したことなどから、純営業収益は123億円（同11.4%増）、経常利益は63億円（同30.5%増）となりました。

[投資部門]

投資案件の回収が進んだことなどから、純営業収益は83億円（同57.1%増）、経常利益は77億円（同74.9%増）となりました。

[その他]

純営業収益は81億円（同54.5%増）、17億円の経常損失（前年同四半期は10億円の損失）となりました。

(2) 財政状態の分析

< 資産の部 >

当第1四半期連結会計期間末の総資産は19兆5,408億円（前連結会計年度末比4,917億円増）となりました。内訳は流動資産が18兆8,110億円（同4,819億円増）であり、このうち現金・預金が1兆4,556億円（同2,433億円増）、有価証券が2兆2,905億円（同1,774億円増）、トレーディング商品が8兆4,214億円（同4,276億円減）、有価証券担保貸付金が5兆4,510億円（同6,093億円増）となっております。固定資産は7,297億円（同98億円増）となっております。

< 負債の部・純資産の部 >

負債合計は18兆4,118億円（同4,452億円増）となりました。内訳は流動負債が16兆4,510億円（同3,956億円増）であり、このうちトレーディング商品が5兆838億円（同1,181億円増）、約定見返勘定が9,696億円（前連結会計年度末は資産の部に2,354億円を計上）、有価証券担保借入金が6兆3,474億円（前連結会計年度末比7,955億円減）、銀行業における預金が1兆8,934億円（同1,016億円増）となっております。固定負債は1兆9,582億円（同496億円増）であり、このうち社債が1兆2,054億円（同72億円増）、長期借入金が6,835億円（同406億円増）となっております。

純資産合計は1兆1,290億円（同464億円増）となりました。株主資本については、「(6)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574億円（同193億円減）、少数株主持分は1,667億円（同22億円増）となっております。また、繰延ヘッジ損益は11億円（同156億円増）、為替換算調整勘定は52億円（同104億円増）となっております。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

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

(4) 研究開発活動

該当事項はありません。

(5) 経営成績に重要な影響を与える要因についての分析

当第1四半期連結累計期間のマクロ経済環境

< 海外の状況 >

世界経済は、緩やかな拡大傾向が続きました。財政問題を抱える欧州では景気後退が続いていますが、米国では底堅い個人消費が牽引役となり緩やかな景気拡大が続きました。また、新興国経済も積極的な金融緩和などを背景に、総じて景気拡大が続きました。しかし、中国で経済成長率が鈍化したことに加え、米国での金融緩和縮小観測に伴う資金流出などから、新興国の一部では景気の減速が見られています。

欧州は、緊縮財政を背景とした景気悪化が続いています。周縁国を中心に、失業率は高水準で推移しており、景気の下押し材料となっています。そうした中、イタリアでは平成25年2月の大統領選挙から2ヶ月以上、政権が発足しないという状況が続き、ギリシャでは同年6月に民主左派が連立政権から離脱するなど、各地で政局不安が発生しました。また、スペインやキプロスなどでは、金融機関の不良債権が財政の健全化や金融システム強化の足かせとなるなど、欧州経済は依然不安定な状況が続いています。このように、欧州全体としては景気悪化が続いていますが、ドイツなどでは輸出が徐々に持ち直しに向かっており、それに伴って鉱工業生産指数の上昇がみられるなど、一部では下げ止まりの兆しが見られています。景気低迷の長期化を受け、ECB（欧州中央銀行）は平成25年5月に10ヶ月ぶりの利下げを行い、金融緩和が強化されました。

米国経済は、緩やかな景気拡大が続いています。平成25年年初からの増税や、同年3月からの歳出の強制削減といった財政問題が景気の下押し要因となるなか、家計部門が堅調に推移していることが経済を牽引しています。個人消費が堅調に推移している背景には、株価上昇による資産効果や、雇用環境の改善が続いていることがあります。また、住宅需要の増加を受けて、住宅市場は改善傾向にあり、家計のバランスシート調整が進展しました。金融面は引き続き緩和的な状況が続いていますが、雇用環境を中心とした国内景気の回復を受けて、FRB（連邦準備制度理事会）ではQE3（量的緩和第3弾）縮小に向けた議論が高まっています。

新興国は、総じて拡大傾向が続いていますが、一部で減速の兆しが見られています。中国では高い経済成長が続いていますが、平成25年4 - 6月期の実質GDPは前年同期比+7.5%となり、同年1 - 3月期の同+7.7%から伸び率が縮小しました。成長率の鈍化は、固定資産投資の減速が主な要因でしたが、シャドーバンキングの急増や、不動産バブルに対する懸念の高まりなど、様々なリスク要因が顕在化しつつあります。一方、他の新興国に目を向けると、先進国の金融緩和を追随する形で多くの新興国も金融緩和による景気刺激を行ってきたことから、全般的に景気は拡大傾向にあります。しかし、米国での金融緩和縮小が議論され始めたことをきっかけに、新興国からの資金流出が進んだ結果、主要な新興国の為替レートは減価し、株価も多くの国で下落しました。為替の減価による輸入物価の上昇はインフレ率の上昇を招き、ブラジルでは平成25年4月、5月と2ヶ月連続の利上げを行い、インドネシアでも同年6月に利上げを行うなど、金融引き締め舵を切る国が出てきています。利上げによる新興国景気の減速に対する懸念が高まっており、各国の政策当局は厳しい政策運営を強いられています。

<日本の状況>

日本経済は、回復傾向が続いています。これは、平成24年末の政権交代以降、安倍内閣による経済政策、いわゆる「アベノミクス」の効果が顕在化したこと等によるものです。

景気回復の最大の牽引役となったのは、個人消費の回復です。家計の所得環境の改善が遅れる中、平成24年末からの株高による資産効果とマインドの改善が、個人消費を押し上げました。なかでも、貴金属や宝飾品といった高額消費が好調に推移しました。住宅投資も、緩やかな増加傾向が続いています。低金利継続による好環境が続いていることに加えて、平成26年4月に予定される消費税率の引き上げを見据えた駆け込み需要が住宅投資を押し上げました。企業部門に関しても、平成25年度に入って持ち直しの兆しが見られています。輸出は、米国を中心に海外経済の景気拡大が続いていることに加えて、円安進行による競争力の向上から増加傾向となりました。また、こうした輸出の持ち直しや堅調な内需を受けて、生産も回復傾向にあり、設備投資にも徐々に持ち直しの動きが見られています。日銀短観によれば、これまで停滞が続いてきた製造業でも設備投資の増加が見込まれるなど、回復の兆しがみられています。こうした循環的な景気拡大に加えて、公共投資が高水準で推移したことが、景気を下支えしました。これは、安倍政権発足後、平成25年1月に「日本経済再生に向けた緊急経済対策」が策定され、同年2月に平成24年度補正予算が成立したためです。公共投資は高水準で推移してきたものの、平成24年度末にかけて減速傾向にありましたが、補正予算が執行され始めたことで平成25年4 - 6月期に入って再び加速しています。

金融面では、日本銀行が黒田新総裁の下で初となる平成25年4月の金融政策決定会合を開催し、「量的・質的金融緩和」導入を決定しました。市場予想を上回る大規模な金融緩和を受けて、株価は上昇傾向となりました。5月末から6月にかけては一時乱高下する場面もありましたが、6月の後半にかけて再び上昇傾向となりました。為替市場では、日本銀行による金融緩和を背景に円安基調で推移しました。米国の景気回復と、それに伴う金融緩和縮小観測の高まりを受け、5月半ばには4年1ヶ月ぶりに1ドル100円を上回り、一時103円台まで円安が進行しました。6月に入ると世界的株安の中で、リスク回避的に円が買われたことから、やや円高方向に押し戻されましたが、株価が再び上昇傾向となったことに伴って6月末にかけては再び円安傾向となりました。国債利回りは、上昇傾向を示しました。日本銀行が買取りの対象となる国債の年限を長期化したことを受け、10年債金利は、平成25年4月初めに一旦0.315%の過去最低水準まで低下しましたが、米国の金融緩和縮小観測が高まる中、米国で金利が上昇するのに伴って、5月から6月にかけては0.8%台に上昇して推移しました。

平成25年6月末の日経平均株価は13,677円32銭（同年3月末比1,279円41銭高）、10年国債利回りは0.855%（同0.295ポイントの上昇）、為替は1ドル98円83銭（同4円79銭の円安）となりました。

(6) 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、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、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を参考にした手法で、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1四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等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	2,039
	その他の短期借入金	4,853
	コマーシャル・ペーパー	3,196
	1年内償還予定の社債	2,779
短期無担保調達資金合計		12,868
	現金・預金	15,678
	国債・政府保証債等	1,826
	流動性ポートフォリオ	17,505
	その他の債券	4,516
	上場株式等	2,262
	その他	150
	補完的流動性ポートフォリオ	6,928
流動性ポートフォリオ等合計		24,434

(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1四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1兆7,505億円であり、また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は2兆4,434億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の189.9%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、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1四半期連結会計期間末の株主資本は、前連結会計年度末比372億円増加し、9,048億円となりました。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205億円減少したほか、四半期純利益を572億円計上した結果、前連結会計年度末比367億円増の4,453億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ5億円減少し、186億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1四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成25年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成25年8月9日)	上場金融商品取引所名 又は登録認可金融商品 取引業協会名	内容
普通株式	1,749,378,772	1,749,378,772	東京証券取引所市場第一部 名古屋証券取引所市場第一部	単元株式数は1,000株で あります。
計	1,749,378,772	1,749,378,772		

(2) 【新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

(3) 【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

(4) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

(5) 【発行済株式総数、資本金等の推移】

年月日	発行済株式 総数増減数 (千株)	発行済株式 総数残高 (千株)	資本金増減額 (百万円)	資本金残高 (百万円)	資本準備金 増減額 (百万円)	資本準備金 残高 (百万円)
平成25年4月1日～		1,749,378		247,397		226,751
平成25年6月30日						

(6) 【大株主の状況】

当四半期会計期間は第1四半期会計期間であるため、記載事項はありません。

(7) 【議決権の状況】

当第1四半期会計期間末日現在の「議決権の状況」については、株主名簿の記載内容が確認できないため、記載することができないことから、直前の基準日（平成25年3月31日）に基づく株主名簿による記載をしております。

【発行済株式】

平成25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 35,677,000		
	(相互保有株式) 普通株式 2,143,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,708,646,000	1,708,646	
単元未満株式	普通株式 2,912,772		
発行済株式総数	1,749,378,772		
総株主の議決権		1,708,646	

- (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、従業員持株E S O P信託口が所有する当社株式14,899,000株(議決権14,899個)が含まれております。
- 3 「単元未満株式」欄の株式数には、当社所有の自己株式601株が含まれております。

【自己株式等】

平成25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	35,677,000		35,677,000	2.03
計		35,677,000		35,677,000	2.03

(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2,143,000株(議決権2,143個)あります。

2 【役員の状況】

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

(1) 取締役の状況

該当事項はありません。

(2) 執行役の状況

該当事項はありません。

第4 【経理の状況】

1 四半期連結財務諸表の作成方法について

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

2 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1四半期連結会計期間(平成25年4月1日から平成25年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成25年4月1日から平成25年6月30日まで)に係る四半期連結財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による四半期レビューを受けております。

1【四半期連結財務諸表】

(1)【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成25年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成25年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,212,243	1,455,601
預託金	260,197	265,523
受取手形及び売掛金	13,675	12,847
有価証券	2,113,038	2,290,511
トレーディング商品	8,849,128	8,421,460
商品有価証券等	6,101,443	5,764,207
デリバティブ取引	2,747,684	2,657,253
約定見返勘定	235,449	-
営業投資有価証券	149,329	141,170
投資損失引当金	35,495	35,230
営業貸付金	171,843	196,399
仕掛品	574	829
信用取引資産	193,642	246,806
信用取引貸付金	182,882	237,124
信用取引借証券担保金	10,760	9,681
有価証券担保貸付金	4,841,726	5,451,033
借入有価証券担保金	4,840,106	5,448,825
現先取引貸付金	1,620	2,207
立替金	26,934	16,702
短期貸付金	10,524	6,112
未収収益	34,831	28,763
繰延税金資産	5,643	8,298
その他の流動資産	246,143	304,581
貸倒引当金	280	332
流動資産計	18,329,152	18,811,079
固定資産		
有形固定資産	407,118	413,718
無形固定資産	84,439	80,767
のれん	15,465	13,441
その他	68,974	67,325
投資その他の資産	228,389	235,299
投資有価証券	192,906	200,580
長期貸付金	5,101	5,069
長期差入保証金	19,469	19,432
繰延税金資産	3,028	2,933
その他	9,117	8,517
貸倒引当金	1,234	1,234
固定資産計	719,947	729,784
資産合計	19,049,099	19,540,864

	前連結会計年度 (平成25年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成25年6月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	3,508	3,568
トレーディング商品	4,965,693	5,083,887
商品有価証券等	2,624,241	2,884,924
デリバティブ取引	2,341,451	2,198,962
約定見返勘定	-	969,656
信用取引負債	57,762	40,443
信用取引借入金	12,617	5,307
信用取引貸証券受入金	45,145	35,135
有価証券担保借入金	7,142,965	6,347,424
有価証券貸借取引受入金	6,899,162	6,215,368
現先取引借入金	243,803	132,055
銀行業における預金	1,791,765	1,893,414
預り金	168,453	230,146
受入保証金	286,675	316,807
短期借入金	946,311	795,962
コマーシャル・ペーパー	301,711	319,622
1年内償還予定の社債	221,291	277,942
未払法人税等	3,094	5,465
繰延税金負債	13,889	12,015
賞与引当金	30,855	17,358
その他の流動負債	121,448	137,338
流動負債計	16,055,427	16,451,052
固定負債		
社債	1,198,172	1,205,403
長期借入金	642,835	683,529
繰延税金負債	10,403	12,396
退職給付引当金	31,813	32,170
訴訟損失引当金	648	643
負ののれん	7,990	6,848
その他の固定負債	16,685	17,230
固定負債計	1,908,548	1,958,222
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	2,555	2,555
特別法上の準備金計	2,555	2,555
負債合計	17,966,531	18,411,830

	前連結会計年度 (平成25年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成25年6月30日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,676	230,693
利益剰余金	408,647	445,380
自己株式	19,212	18,663
株主資本合計	867,509	904,807
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	76,740	57,413
繰延ヘッジ損益	16,765	1,152
為替換算調整勘定	15,709	5,287
その他の包括利益累計額合計	44,264	50,974
新株予約権	6,387	6,545
少数株主持分	164,406	166,705
純資産合計	1,082,567	1,129,033
負債・純資産合計	19,049,099	19,540,864

(2)【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】
【四半期連結損益計算書】
【第1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)
営業収益		
受入手数料	48,045	90,347
委託手数料	8,832	31,788
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	3,328	7,742
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	9,612	19,475
その他の受入手数料	26,272	31,340
トレーディング損益	24,395	42,163
株券等トレーディング損益	9,351	21,795
債券・為替等トレーディング損益	33,746	20,368
営業投資有価証券関連損益	4,899	7,937
金融収益	20,948	29,402
その他の営業収益	15,608	13,232
営業収益計	113,897	183,082
金融費用	16,670	17,788
その他の営業費用	10,224	10,021
純営業収益	87,003	155,272
販売費・一般管理費		
取引関係費	16,928	19,076
人件費	37,062	46,686
不動産関係費	10,101	9,031
事務費	6,149	6,105
減価償却費	7,802	7,001
租税公課	1,426	2,027
貸倒引当金繰入れ	76	142
その他	3,206	2,893
販売費・一般管理費計	82,756	92,965
営業利益	4,246	62,307
営業外収益		
受取利息	12	10
受取配当金	1,155	1,115
負ののれん償却額	1,141	1,141
持分法による投資利益	548	499
その他	2,636	778
営業外収益計	5,494	3,546
営業外費用		
支払利息	520	340
為替差損	308	209
その他	377	215
営業外費用計	1,206	766
経常利益	8,534	65,087

	前第1四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	136	3,811
特別利益計	136	3,811
特別損失		
固定資産除売却損	17	375
減損損失	-	2,053
投資有価証券評価損	428	-
移転関連費用	-	798
その他	-	258
特別損失計	445	3,486
税金等調整前四半期純利益	8,225	65,413
法人税、住民税及び事業税	930	4,896
法人税等調整額	3,036	289
法人税等合計	3,967	4,606
少数株主損益調整前四半期純利益	4,258	60,806
少数株主利益	1,579	3,509
四半期純利益	2,678	57,297

【四半期連結包括利益計算書】
【第1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)
少数株主損益調整前四半期純利益	4,258	60,806
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	10,866	20,638
繰延ヘッジ損益	7,553	15,622
為替換算調整勘定	12,415	10,352
持分法適用会社に対する持分相当額	77	227
その他の包括利益合計	30,758	5,564
四半期包括利益	26,499	66,371
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	22,970	64,006
少数株主に係る四半期包括利益	3,529	2,364

【注記事項】

(会計方針の変更等)

当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)	
(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)	
従来、当社及び主な国内連結子会社は、有形固定資産の減価償却方法について定率法を採用していましたが、当第1四半期連結会計期間より定額法に変更しております。	
この変更は、グループ内の拠点集約などを契機として減価償却方法を見直した結果、今後は有形固定資産の利用によって享受する経済的便益は耐用年数にわたりほぼ一定であることから、定額法がより実態に即した合理的な費用配分であると判断したことによります。	
この結果、従来の方法と比べて、当第1四半期連結累計期間の減価償却費は236百万円減少し、経常利益及び税金等調整前四半期純利益が236百万円増加しております。	

(四半期連結貸借対照表関係)

1 資産の金額から直接控除している貸倒引当金の額

	前連結会計年度 (平成25年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成25年6月30日)
投資その他の資産・その他	8,845百万円	8,814百万円

2 保証債務

被保証者(被保証債務の内容)は以下のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成25年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成25年6月30日)
従業員(借入金)	768百万円	723百万円
その他(債務)	1,591	1,634
計	2,359	2,357

(四半期連結損益計算書関係)

1 人件費に含まれている賞与引当金繰入額

	前第1四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)
	7,096百万円	15,282百万円

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

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

	前第1四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)
減価償却費	9,816百万円	8,685百万円
のれんの償却額	625	555
負ののれんの償却額	1,141	1,141

(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自平成24年4月1日至平成24年6月30日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年5月15日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,140	3	平成24年3月31日	平成24年6月4日

(注) 平成24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71百万円が含まれております。

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

該当事項はありません。

当第1四半期連結累計期間(自平成25年4月1日至平成25年6月30日)

1 配当金支払額

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月15日 取締役会	普通株式	利益剰余金	20,564	12	平成25年3月31日	平成25年6月3日

(注) 平成25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178百万円が含まれております。

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

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

前第1四半期連結累計期間(自平成24年4月1日至平成24年6月30日)

1 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位:百万円)

	報告セグメント					その他 (注)1	合計
	リテール 部門	ホールセー ル部門	アセット・ マネジメン ト部門	投資部門	計		
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	34,089	8,743	15,889	5,342	64,064	2,323	66,388
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	5,379	13,016	4,826	8	13,560	2,962	16,522
計	39,468	21,759	11,063	5,333	77,625	5,286	82,911
セグメント利益又はセグメント損失() (経常利益又は経常損失())	6,762	8,675	4,826	4,430	7,344	1,024	6,319

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

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

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

(単位:百万円)

利益又は損失()	金額
報告セグメント計	7,344
「その他」の区分の損失()	1,024
セグメント間取引消去	1
のれん及び負ののれんの償却額	1,077
未実現損益の調整額	247
その他の調整額	891
四半期連結損益計算書の経常利益	8,534

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

該当事項はありません。

当第1四半期連結累計期間(自平成25年4月1日至平成25年6月30日)

1 報告セグメントごとの純営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	報告セグメント					その他 (注)1	合計
	リテール 部門	ホールセー ル部門	アセット・ マネジメン ト部門	投資部門	計		
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	70,986	25,956	18,972	8,433	124,348	4,391	128,739
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	7,303	19,197	6,651	52	19,797	3,777	23,575
計	78,289	45,153	12,321	8,380	144,145	8,168	152,314
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())	39,443	12,595	6,301	7,746	66,087	1,717	64,369

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

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

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

(単位：百万円)

利益又は損失()	金額
報告セグメント計	66,087
「その他」の区分の損失()	1,717
セグメント間取引消去	
のれん及び負ののれんの償却額	1,064
未実現損益の調整額	150
その他の調整額	496
四半期連結損益計算書の経常利益	65,087

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

(固定資産に係る重要な減損損失)

海外のホールセール部門において、のれんの減損損失2,053百万円を計上しております。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成25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			
その他	2,923	2,923	0
計	2,923	2,923	0

2 その他有価証券

(単位：百万円)

種類	取得原価又は 償却原価	連結貸借 対照表計上額	差額
株券	83,542	135,411	51,869
債券	2,020,569	2,076,344	55,775
国債・地方債等	1,220,870	1,268,547	47,677
社債	264,477	268,223	3,745
その他	535,221	539,573	4,352
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	32,250	33,271	1,020
その他	78,865	88,719	9,854
計	2,215,227	2,333,747	118,519

- (注) 1 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。
2 当連結会計年度において、時価のあるその他有価証券について229百万円(うち、株券229百万円)、時価のある満期保有目的の債券について1,079百万円の減損処理を行っております。
3 満期保有目的の債券の一部について信用状態の著しい悪化により、当連結会計年度において1,079百万円の減損を行い、減損後の価額(2,420百万円)によって「満期保有目的の債券」から「その他有価証券」に保有目的を変更しております。
また、当連結会計年度に、運用方針の変更により「満期保有目的の債券」611,097百万円の保有目的を変更し「その他有価証券」に区分しております。

当第1四半期連結会計期間末(平成25年6月30日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	四半期連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等			
社債			
その他	3,057	3,057	0
計	3,057	3,057	0

2 その他有価証券

(単位：百万円)

種類	取得原価又は償却原価	四半期連結貸借対照表計上額	差額
株券	76,751	133,008	56,256
債券	2,222,754	2,238,634	15,880
国債・地方債等	1,332,840	1,349,671	16,830
社債	245,324	246,116	791
その他	644,589	642,847	1,741
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	29,223	30,886	1,662
その他	94,690	106,304	11,614
計	2,423,420	2,508,833	85,412

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

2 当第1四半期連結累計期間において、時価のあるその他有価証券及び時価のある満期保有目的の債券について減損処理は行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

前連結会計年度末(平成25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	4,509,910	544,092	5,666,036	477,925
為替予約取引	1,646,802	67,597	1,844,110	82,281
先物・先渡取引	663,731	5,672	2,051,519	14,096
スワップ取引	45,851,470	2,105,153	47,276,900	1,735,178
その他	2,353,764	34,783	2,214,669	31,968
リスクリザーブ		9,615		

当第1四半期連結会計期間末(平成25年6月30日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	4,673,249	683,656	5,612,520	587,738
為替予約取引	2,187,415	71,622	2,437,173	93,825
先物・先渡取引	1,852,772	22,404	1,762,324	34,290
スワップ取引	47,139,664	1,858,964	46,688,798	1,453,153
その他	2,223,313	31,289	2,111,468	29,954
リスクリザーブ		10,685		

(1株当たり情報)

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

項目	前第1四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額	1.58円	33.72円
(算定上の基礎)		
四半期純利益金額(百万円)	2,678	57,297
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利益金額(百万円)	2,678	57,297
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,691,761	1,699,422
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	1.58円	33.44円
(算定上の基礎)		
四半期純利益調整額(百万円)		
普通株式増加数(千株)	4,127	13,854
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額の算定に含めなかった潜在株式で、前連結会計年度末から重要な変動があったものの概要		

(注) 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25年5月15日開催の取締役会において、平成25年3月31日を基準日とする剰余金の配当に関して次のとおり決議いたしました。

配当金の総額 20,564百万円

1株当たりの金額 12円00銭

支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成25年6月3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178百万円が含まれております。

2 平成25年3月31日現在の株主名簿に記録された株主又は登録質権者に対し支払いを行っております。

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

平成25年8月9日

株式会社大和証券グループ本社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 高波博之 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣篤典 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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25年4月1日から平成26年3月31日までの連結会計年度の第1四半期連結会計期間(平成25年4月1日から平成25年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成25年4月1日から平成25年6月30日まで)に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書及び注記について四半期レビューを行った。

四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

監査人の結論

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社の平成25年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する第1四半期連結累計期間の経営成績を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

強調事項

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更に記載されているとおり、会社及び主な国内連結子会社は、有形固定資産の減価償却方法について、定率法を採用していたが、当第1四半期連結会計期間より定額法に変更している。

当該事項は、当監査法人の結論に影響を及ぼすものではない。

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。