

【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30年8月3日

【四半期会計期間】 第82期第1四半期  
(自 平成30年4月1日 至 平成30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 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】

回次	第81期 第1四半期 連結累計期間	第82期 第1四半期 連結累計期間	第81期
会計期間	自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30日	自 平成30年4月1日 至 平成30年6月30日	自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
営業収益 (百万円)	159,652	175,175	712,601
純営業収益 (百万円)	108,543	115,606	505,350
経常利益 (百万円)	25,153	25,860	155,676
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益 (百万円)	19,395	18,534	110,579
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	24,504	25,434	111,626
純資産額 (百万円)	1,340,130	1,371,244	1,370,520
総資産額 (百万円)	19,815,830	20,853,852	21,135,041
1株当たり四半期(当期)純利益 (円)	11.63	11.45	66.88
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益 (円)	11.55	11.38	66.45
自己資本比率 (%)	6.3	6.1	6.0

- (注) 1 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。
- 2 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。
- 3 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当第1四半期連結会計期間の期首から適用しており、前連結会計年度に係る主要な経営指標等については、当該会計基準等を遡って適用した後の指標等となっております。

#### 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81期有価証券報告書に記載した事業等のリスクについて重要な変更があった事項はありません。

### 2 【経営者による財政状態、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) 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前年度末比2,811億円(1.3%)減少の20兆8,538億円となりました。内訳は流動資産が同3,199億円(1.6%)減少の20兆1,585億円であり、このうち現金・預金が同4,305億円(11.7%)増加の4兆1,248億円、有価証券が同849億円(8.6%)増加の1兆721億円、トレーディング商品が同7,371億円(11.1%)増加の7兆4,041億円、営業貸付金が同1,632億円(11.3%)増加の1兆6,061億円、有価証券担保貸付金が同1兆7,310億円(26.6%)減少の4兆7,656億円となっております。固定資産は同387億円(5.9%)増加の6,953億円となっております。

##### <負債の部・純資産の部>

負債合計は前年度末比2,819億円(1.4%)減少の19兆4,826億円となりました。内訳は流動負債が同4,030億円(2.4%)減少の16兆6,320億円であり、このうちトレーディング商品が同2,759億円(5.5%)減少の4兆7,548億円、有価証券担保借入金が同4,597億円(8.0%)減少の5兆3,161億円、銀行業における預金が同1,477億円(4.4%)増加の3兆5,362億円、短期借入金が同1,424億円(13.0%)増加の1兆2,341億円となっております。固定負債は同1,211億円(4.4%)増加の2兆8,466億円であり、このうち社債が同126億円(1.0%)増加の1兆3,279億円、長期借入金が同1,005億円(7.6%)増加の1兆4,283億円となっております。

純資産合計は同7億円(0.1%)増加の1兆3,712億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は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四半期純利益を185億円計上したほか、総額242億円の配当金の支払いなどにより、同57億円(0.7%)減少の7,799億円となっております。自己株式の控除額は同86百万円(0.2%)減少の542億円、その他有価証券評価差額は同37億円(6.1%)増加の649億円、為替換算調整勘定は同25億円(99.9%)増加の50億円、非支配株主持分は同96百万円(0.1%)減少の885億円となっております。

#### (2) 経営成績の分析

##### 事業全体の状況

当第1四半期連結累計期間の営業収益は前年同期比9.7%増の1,751億円、純営業収益は同6.5%増の1,156億円となりました。

受入手数料は738億円と、同5.8%の増収となりました。委託手数料は、株式取引が増加したことにより、同2.2%増の165億円となりました。引受業務では、複数の大型エクイティ募集案件等が貢献し、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99.7%増の114億円となりました。

トレーディング損益は、エクイティにおける顧客フローが増加したこと等により前年同期比10.6%増の266億円となりました。

販売費・一般管理費は前年同期比7.3%増の934億円となりました。取引関係費は販売促進に関連する費用の増加により同8.0%増の179億円、人件費は国内における給与の増加及び米国のSagent Holdings, Inc.とSignal Hill Holdings LLCを買収統合して昨年度発足させたDCS Advisory Holdings Inc.を連結子会社化したことにより同8.5%増の469億円、減価償却費は新システムの稼働等により同2.8%増の62億円となっております。

以上より、経常利益は同2.8%増の258億円となりました。

これに特別損益、法人税等及び非支配株主に帰属する四半期純利益を差し引いた結果、親会社株主に帰属する四半期純利益は前年同期比4.4%減の185億円となりました。

セグメント情報に記載された区分ごとの状況  
純営業収益及び経常利益をセグメント別に分析した状況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29年 6月期	平成30年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率	平成29年 6月期	平成30年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率
リテール部門	48,833	50,609	3.6%	43.8%	10,391	9,894	4.8%	38.3%
ホールセール 部門	35,280	39,798	12.8%	34.4%	6,438	6,996	8.7%	27.1%
アセット・マネ ジメント部門	12,011	12,268	2.1%	10.6%	7,200	7,488	4.0%	29.0%
投資部門	1,801	2,435	35.2%	2.1%	1,417	1,760	24.2%	6.8%
その他・調整等	10,618	10,494		9.1%	294	278		1.1%
連結計	108,543	115,606	6.5%	100.0%	25,153	25,860	2.8%	100.0%

[リテール部門]

リテール部門の主な収益源は、国内の個人投資家及び未上場会社の顧客の資産管理・運用に関する商品・サービスの手数料であり、経営成績に重要な影響を与える要因には、顧客動向を左右する国内外の金融市場及び経済環境の状況に加え、顧客のニーズに合った商品の開発状況や引受け状況及び販売戦略が挙げられます。

当第1四半期連結累計期間においては、昨年4月より取り組んでいるお客様目線をより重視した営業推進体制を継続し、営業員がより多くの時間を、お客様のニーズやマーケット動向を的確に捉えた提案に割けるようになりました。その結果、米国株式を中心に外国株式の売買金額が大幅に増加したほか、大型エクイティ募集により新規口座開設件数も大幅に増加となりました。

また、ラップ口座サービスの拡充にも継続的に取り組んでおり、当第1四半期連結会計期間末のラップ口座契約資産残高は2兆円を超え、過去最高水準となりました。

市場環境は良好と言えない中で、これらの取り組みにより、当第1四半期連結累計期間のリテール部門における純営業収益は前年同期比3.6%増の506億円、経常利益は同4.8%減の98億円となりました。リテール部門の当第1四半期連結累計期間の純営業収益及び経常利益のグループ全体の連結純営業収益及び連結経常利益に占める割合は、それぞれ43.8%及び38.3%でした。

[ホールセール部門]

ホールセール部門は、機関投資家等を対象に有価証券のセールス及びトレーディングを行うグローバル・マーケットと、事業法人、金融法人等が発行する有価証券の引き受け、M&Aアドバイザー業務や上場コンサルティング業務を行うグローバル・インベストメント・バンキングによって構成されます。グローバル・マーケットの主な収益源は、機関投資家に対する有価証券の売買に伴って得る取引手数料及びトレーディング収益です。グローバル・インベストメント・バンキングの主な収益源は、引受業務やM&Aアドバイザー業務によって得る引受け・売出し手数料とM&A手数料です。グローバル・マーケットにおいては、国際的な地政学リスクや経済状況等で変化する市場の動向や、それに伴う顧客フローの変化が、経営成績に重要な影響を与える要因となります。グローバル・インベストメント・バンキングにおいては、顧客企業の資金調達手段の決定やM&Aの需要を左右する国内外の経済環境等に加え、当社が企業の需要を捉え、案件を獲得できるかどうかを経営成績に重要な影響を与える要因となります。

グローバル・マーケットにおいては、当第1四半期連結累計期間半ば以降の顧客フロー回復や、株式市場における売買金額の増加により、エクイティ収益は前年同期比で増加しました。金融市場では、顧客フローはクレジットを中心に堅調を維持しましたが、国内長期金利が狭いレンジで推移する難しい環境が継続したことを受け、ポジション運営では厳しい状況となりました。これらの結果、当第1四半期連結累計期間の純営業収益は前年同期比2.6%増の280億円、経常利益は同9.0%増の58億円となりました。

グローバル・インベストメント・バンキングにおいては、複数の大型エクイティ募集・売出し案件でジョイント・グローバル・コーディネーターや主幹事を務めたこと等により、当第1四半期連結累計期間の引受け・売出し手数料は、前年同期比99.7%増の114億円と大幅な増加となりました。その結果、純営業収益は同47.9%増の117億円となりました。M&Aビジネスにおいては、欧州のDC Advisoryや、米国のDCS Advisoryが関与する海外・クロスボーダー案件や、国内の事業再編案件等が収益に貢献しました。これらの結果、グローバル・インベストメント・バンキングの経常利益は前年同期比10.1%増の8億円となりました。

当第1四半期連結累計期間のホールセール部門における純営業収益は前年同期比12.8%増の397億円、経常利益は同8.7%増の69億円となりました。ホールセール部門の当第1四半期累計期間の純営業収益及び経常利益のグループ全体の連結純営業収益及び連結経常利益に占める割合は、それぞれ34.4%及び27.1%でした。

#### [アセット・マネジメント部門]

アセット・マネジメント部門の収益は、主に当社連結子会社の和和証券投資信託委託における投資信託の組成と運用に関する報酬と、連結子会社の和和リアル・エステート・アセット・マネジメントの不動産運用収益によって構成されます。また、当社持分法適用関連会社である和和住銀投信投資顧問の投資信託の組成と運用及び投資顧問業務に関する報酬からの利益及び同じく持分法適用関連会社である和和証券オフィス投資法人の不動産運用収益からの利益は、それぞれ当社の持分割合に従って経常利益に計上されます。経営成績に重要な影響を与える要因としては、マーケット環境によって変動する顧客の投資信託及び投資顧問サービスへの需要と、マーケット環境に対するファンドの運用パフォーマンスや、顧客の関心を捉えたテーマ性のある商品開発等による商品自体の訴求性が挙げられます。和和リアル・エステート・アセット・マネジメント及び和和証券オフィス投資法人の経営成績は、国内の不動産市場・オフィス需要の動向に左右されます。

当第1四半期連結累計期間において、和和証券投資信託委託では、R&Iファンド大賞において複数のファンドが表彰を受けたことに示される運用力の高い商品、NISA、iDeCo向け資産形成型商品やETFなど、投資家の資産形成ステージに応じた商品の提供を通じて運用資産残高を拡大させ、公募投資信託の運用資産残高は前年同期比6.7%増の15.9兆円となりました。和和住銀投信投資顧問では、アクティブ運用力を生かしたファンドの設定や投資一任において新規の年金顧客との取引を開始したことにより、公募株式投資信託及び投資顧問の運用資産残高は前年同期比0.7%増の4.8兆円となりました。不動産アセット・マネジメントでは、和和リアル・エステート・アセット・マネジメントが運用する不動産及びインフラ資産はホテル私募リートの運用開始に伴う物件取得等により拡大した一方で、和和証券オフィス投資法人における運用資産残高は保有物件の入替えにより減少したため、運用資産残高は前年同期比1.5%減の8,163億円となりました。その結果、当第1四半期連結累計期間のアセット・マネジメント部門の純営業収益は前年同期比2.1%増の122億円、経常利益は同4.0%増の74億円となりました。アセット・マネジメント部門の当第1四半期連結累計期間の純営業収益及び経常利益のグループ全体の連結純営業収益及び連結経常利益に占める割合は、それぞれ10.6%及び29.0%でした。

#### [投資部門]

投資部門は主に、連結子会社である和和企業投資と和和PIパートナーズで構成されます。投資部門の主な収益源は、投資先の新規上場（IPO）・M&A等による売却益や、投資事業組合への出資を通じたキャピタルゲインのほか、契約に基づきファンドから受領する、管理運営に対する管理報酬や投資成果に応じた成功報酬です。

当第1四半期連結累計期間においては、和和企業投資において国内外の成長企業への投資を積極的に実行するとともに、投資先企業と大手企業とのマッチングを実施したほか、和和PIパートナーズは、昨年に引き続き、重点地域であるミャンマーへの投資を実行しながら、複数のエクイティ投資先の売却益により、着実に収益を確保しました。

その結果、投資部門の純営業収益は前年同期比35.2%増の24億円、経常利益は同24.2%増の17億円となりました。投資部門の純営業収益及び経常利益のグループ全体の連結純営業収益及び連結経常利益に占める割合は、それぞれ2.1%及び6.8%でした。

#### [その他]

その他の事業には、主に和和総研と和和総研ビジネス・イノベーションからなる和和総研グループによるリサーチ・コンサルティング業務及びシステム業務のほか、和和ネクスト銀行による銀行業務などが含まれます。

和和総研は、当社グループのシステム開発を着実に遂行したほか、高付加価値のソリューション提案により、顧客との関係を強化し、当社グループのビジネスに貢献しました。

和和総研ビジネス・イノベーションは、大口顧客向けシステム開発案件を手掛けたこと等により、当社グループの収益に貢献しました。

和和ネクスト銀行では、外貨建てローン債権を裏付資産とする資産流動化ローンの積み増しにより貸出金利が増加しました。また昨年11月より定期預金に「金利」以外の魅力を付加するため、企業・団体とタイアップした預金商品である「えらべる預金」の提供を開始し、6月末時点の累計預入件数は11,808件、累計預入金額は140億円となりました。

その結果、その他・調整等に係る純営業収益は104億円（前年同期106億円）、経常損失は2億円（前年同期2億円）となりました。その他・調整等の当第1四半期累計期間の純営業収益のグループ全体の連結純営業収益に占める割合は、9.1%でした。

経営方針・経営戦略等及び経営上の目標の達成状況を判断するための客観的な指標等

当社グループでは、当第1四半期連結累計期間より3カ年の中期経営計画“Passion for the Best”2020を新たにスタートさせております。前連結会計年度を最終年度とする中期経営計画“Passion for the Best”2017においては、数値目標として連結自己資本利益率（ROE）10%以上と固定費カバー率75%以上の指標を掲げておりましたが、“Passion for the Best”2020においては、お客様本位を起点として健全な利益の確保を通じた持続的成長を図るべく、「お客様本位」、「業績」、「財務」の3つのキー・パフォーマンス・インディケーター（KPI）を設定しています。お客様本位KPIでは、お客様本位の業務運営をさらに進化させるため、「お客様満足度」をKPIのメインフレームに据えています。具体的には、ネット・プロモーター・スコア（NPS）という、お客様のロイヤリティを数値化した指標を本格的にKPIとして導入します。また、お客様からの信頼の証しである預り資産についてもKPIとして設定し、2020年度に80兆円以上を目指します。業績KPIでは、これまでの取組みにより安定的に収益を上げる基盤ができてきたことから、大きな成長を目指す次なるステージに入ってきたと捉え、従来より掲げておりますROE10%以上に加えて、2020年度における連結経常利益2,000億円以上を新たに設定しました。財務KPIについては、当社グループとしてのハイブリッド化を進める中でも、強固な財務基盤を維持することを示すべく、連結総自己資本規制比率18%以上を掲げています。

経営成績の前提となる当第1四半期連結累計期間のマクロ経済環境

< 海外の状況 >

世界経済は緩やかに拡大しているものの、先行き不透明なリスク要因が浮上しています。米国では、雇用・所得環境が引き続き安定しており、平成29年末に成立した税制改革などの拡張的な財政政策もあって、米国景気は着実に拡大しています。しかし、内外の政治的な混乱に対する懸念を払拭できず、特に、米国のトランプ大統領が保護主義的な通商政策を強力に推進していることは、米国だけでなく、中国や欧州など世界全体に対して不確実性をもたらしています。

米国経済は平成30年1 - 3月期に、これまで景気を牽引してきた個人消費が約5年ぶりの低い伸びに鈍化し、実質GDP成長率は前期比年率2.2%増と低成長に留まりました。もっとも、消費の裏付けとなる雇用・所得環境が安定し、消費者マインドも高水準を維持していることから、4 - 6月期の成長率は個人消費を中心に再び加速し、同4.1%増と約4年ぶりの高成長となりました。また、税制改革の恩恵は、企業業績や企業マインドの改善にも及んでおり、設備投資は堅調に推移しています。ただ、平成30年に入ってから、トランプ大統領は保護主義的な通商政策を強力に推進しており、その矛先は、鉄鋼・アルミニウムにとどまらず、自動車・同部品などにも及ぶほか、対象となる国についても、中国にとどまらず、EU（欧州連合）、カナダ、メキシコ、日本などにも拡大させています。これらの国々が対抗措置を取ることであれば、米国からの輸出量は減少し、企業の生産活動や投資計画に悪影響が及ぶ恐れがあります。

金融面では、底堅い景気拡大を受けて、FRB（連邦準備制度理事会）は平成29年の計3回の利上げに続いて、平成30年3月と6月にも政策金利を引き上げました。一方、平成29年10月からは、FRBが保有する資産の規模縮小も開始しています。また、4 - 6月期の米国株式市場では、底堅い米国経済や好調な企業決算を背景に、NYダウ平均株価は緩やかに上昇し、6月中旬の米朝首脳会談の開催前後には約3ヵ月ぶりの高値を付けました。しかし、6月後半にかけては、貿易摩擦激化への懸念が広がるとともに、株価は大きく下落しました。

欧州経済（ユーロ圏経済）は、緩やかながら安定した成長が続き、2017年の実質GDP成長率は2.4%と10年ぶりの高成長になりました。ユーロ圏の雇用情勢は改善傾向にあり、賃金上昇など家計の所得環境も良好なことから個人消費が底堅く、内需を中心にバランスの取れた形で、1%程度とされる潜在成長率を上回る成長が続くとみられます。もっとも、平成30年1 - 3月期のユーロ圏は、悪天候等の幾つかの一時的な要因に下押しされたこともあり、成長率が前期比年率1.5%増となり、過去3四半期平均の前期比年率2.9%増から大きく鈍化しました。また、4 - 6月期も同1.4%増と2年ぶりの低成長にとどまりました。高成長だった2017年に比べると、2018年は、原油価格の上昇やユーロ高、金利先高観の台頭などの要因によって、成長が抑制されることが想定されます。3月の総選挙後、政権樹立協議が難航したイタリアでは、漸く6月になって連立政権が発足し、政局不安が後退しました。ただ、EUに懐疑的なポピュリスト新政権がイタリアに誕生したことに加えて、6月下旬にドイツでも政局不安を招く原因になった移民問題がEU内の対立を生じさせており、米国との貿易摩擦問題とともに、欧州経済にとって重荷になっています。

一方、金融面では、デフレ懸念の後退を受けて、ECB（欧州中央銀行）は非伝統的な金融緩和政策の軌道修正を進めています。平成29年4月から量的緩和の規模を縮小させたのに続き、平成30年1月以降、資産買取額を毎月300億ユーロに半減させました。そして、平成30年6月には、同年10月からさらに減額した上で、同年12月末で新規の資産買取を停止することを決定しました。同時に、残高を維持するための再投資を継続する他、政策金利は少なくとも平成31年夏まで現行水準に据え置く方針を示しました。穏健なスタンスを示したECBは、急激な金利上昇や通貨高を回避するため、非伝統的な金融緩和政策の修正を慎重に進めていくとみられます。

新興国経済は、平成27年をボトムにして成長率が加速しており、平成29年は4年ぶりの高成長となりました。中国は、平成30年4 - 6月期の実質GDP成長率が前年比6.7%増と、平成30年1 - 3月期の同6.8%成長から僅かに減速したものの、堅調に成長を続けています。固定資産投資は、インフラ投資が大幅に減速する一方、過剰生産能力が懸念される製造業はやや加速しています。能力拡張投資が抑制される中、技術革新を促す投資が大きく増えているという特徴が見られます。また、貿易摩擦の一方の当事者である中国は、米国側の動きに対して、即座に対抗措置を講じる姿勢を示すなど、互いに制裁を発動し合う状況にエスカレートしつつあります。実際に平成30年4 - 6月期に実施された追加関税の規模は限定的ですが、7月以降、制裁が順次発動されれば経済への影響は徐々に大きくなるとみられ、米国との通商問題は長期的なリスク要因になることが懸念されます。一方、中国以外の新興国を見ると、原油などの資源価格の上昇は資源国経済にとって追い風になっています。もっとも、平成30年6月のOPEC総会後も原油価格は高止まりしており、資源の乏しい国々には大きな負担になっています。また、米国など先進国の金利上昇の影響から資本が国外に流出し、通貨安に伴う高インフレや通貨防衛のために、政策金利を引き上げざるを得ないケースも散見されます。さらに、米中を中心とした貿易摩擦が、貿易数量の鈍化を通じて世界全体に及ぶことになれば、新興国経済への影響も避けられないとみられます。

#### <日本の状況>

日本経済は、平成28年半ば以降、内需を中心に緩やかな回復基調が続きましたが、平成30年1 - 3月期の実質GDP成長率は前期比年率0.6%減と9四半期ぶりのマイナス成長に陥り、過去4四半期の平均年率2%弱の成長から大幅に減速しました。背景には、個人消費や住宅投資が軟調であったことに加えて、これまで堅調に拡大してきた設備投資や輸出の伸びも鈍化したことがあります。内需の弱さを反映して輸入も減速したために、外需の寄与度はプラスとなったものの、内需の寄与度のマイナス幅が上回ったことから、経済全体ではマイナス成長となり、景気拡大の足跡が見られました。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は、平成30年1 - 3月期に小幅ながらも2四半期ぶりに減少しました。天候不順による生鮮食品の高騰や原油価格の上昇、人手不足などに伴うコスト増などを受けて、消費者が直面する物価上昇率は高止まり、消費者の生活に影響を及ぼしているとみられます。もっとも、失業率が2%台前半まで低下するなど企業の採用意欲は引き続き強く、賃金も緩やかに増加するなど、雇用・所得環境の着実な改善が個人消費を下支えすることが期待されます。

住宅投資については、低い住宅ローン金利が下支え要因となったものの、建材コストや人件費の上昇もあって、大都市圏を中心に住宅価格が上昇したことが需要を抑制したほか、相続税対策などの特殊要因によって押し上げられてきた貸家建設の減速感が強まりました。この結果、平成29年7 - 9月期以降、3四半期連続で前期比マイナス成長となりました。4 - 5月の新設住宅着工はやや持ち直していますが、住宅投資の緩やかな減速は継続するとみられます。

一方、企業の設備投資は、平成30年1 - 3月期もプラス成長を維持したものの、生産活動が一服したこともあって、伸び率は鈍化しています。もっとも、企業収益が高水準にあることや労働需給の逼迫を背景に、深刻な人手不足に対応した合理化・省人化投資や、競争力を維持するための設備の更新、研究開発投資などに対する企業の意欲は強いものと見込まれます。また、日銀短観（6月調査）の平成30年度の設備投資計画をみても、設備過剰感が解消されている大企業の場合、製造業や非製造業ともに高い伸びが示されています。

外需に目を向けると、海外経済が堅調に推移してきたことから、輸出は増加基調にありました。もっとも、EU向けやアジア向けの輸出数量は平成29年末頃から頭打ちになっており、米国向けの輸出数量も平成30年に入り足踏みしています。一旦減速局面を迎えた後は、海外経済の成長に合わせて拡大傾向に復することも予想されますが、米国の保護主義的な通商政策によって、世界貿易の縮小につながるリスクがある点には留意が必要です。一方、輸入金額に関しては、好調な内需を背景に輸入数量が拡大していること、円安と原油高が前年比で見た輸入価格を押し上げていることから、持ち直しの動きが見られます。

金融面では、日本銀行による強力な金融緩和措置が続いています。「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の一環として、イールドカーブ・コントロールを導入し、短期金利と長期金利の両方を事実上管理するという政策を実行しています。米国の市場金利に連動して、日本の国債利回りが上昇する局面もありましたが、平成30年

4 - 6月期の長期金利（10年国債利回り）は0.02%～0.07%という狭いレンジで安定的に推移し、期間平均では0.046%になりました。なお、日本銀行は、4月末に公表した展望レポートの中で、インフレ率が2%程度に達する具体的な時期に関する表記を削除しています。一方、為替レートは、平成30年2月に世界的な株安が進み、さらに米中の貿易摩擦激化への警戒感が強まると、リスク回避の動きから円高が加速し、平成30年3月下旬には、1年4ヵ月ぶりの円高水準となる104円台を記録しました。ただ、4月に入ると、緩やかに円安・ドル高に転じ、5月以降は概ね109円～111円というレンジで推移しました。また、対ユーロでは、欧州の景気減速やイタリアの政局不安を背景に、4～5月にかけて円高・ユーロ安が進展し、5月末には平成29年6月以来となる高値を付けました。6月に入ると、政治リスクが後退したことから、ユーロは上昇基調となったものの、ECBの金融政策発表を受けて再び円高に振れるなど、6月全体で見ると、円は対ユーロで概ね横ばいで推移しました。

平成30年6月末の日経平均株価は22,304円51銭（同年3月末比850円21銭高）、10年国債利回りは0.04%（同0.003ポイントの低下）、為替は1ドル110円64銭（同4円45銭の円安）となりました。

(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) 資本の財源及び流動性に係る情報

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かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

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

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

当社は、平成26年金融庁告示第61号による連結流動性カバレッジ比率（以下、「LCR」）の最低基準（平成27年3月末から段階的に導入）の遵守が求められております。当社の当第1四半期日次平均のLCRは141.7%となっており、上記金融庁告示による要件を満たしております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCRのほかに、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理態勢を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当第1四半期日次平均のLCRの状況は次のとおりです。

(単位：億円)

		日次平均 (自平成30年4月 至平成30年6月)
適格流動資産	(A)	26,880
資金流出額	(B)	37,621
資金流入額	(C)	18,659
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)	26,880
純資金流出額	(B)-(C)	18,962
連結流動性カバレッジ比率	(D)/((B)-(C))	141.7%

#### <グループ全体の資金管理>

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

#### 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56億円減少し、1兆2,038億円となりました。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四半期純利益を185億円計上したほか、配当金242億円の支払いを行った結果、前連結会計年度末比57億円減少の7,799億円となりました。自己株式の控除額は、542億円となっております。

### 3 【経営上の重要な契約等】

当第1四半期連結会計期間において、該当事項はありません。

### 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
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。

###### 【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30年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成30年8月3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100株であります。(注)
計	1,699,378,772	1,699,378,772		

(注) 平成30年4月27日開催の取締役会決議により、平成30年6月1日付で単元株式数を1,000株から100株に変更しております。

##### (2) 【新株予約権等の状況】

###### 【ストックオプション制度の内容】

該当事項はありません。

###### 【その他の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) 【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30年4月1日～ 平成30年6月30日		1,699,378		247,397		226,751

##### (5) 【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。

(6) 【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30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30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 80,765,000		
	(相互保有株式) 普通株式 1,561,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,614,551,000	1,614,551	
単元未満株式	普通株式 2,501,772		一単元(1,000株)未満の株式(注3)
発行済株式総数	1,699,378,772		
総株主の議決権		1,614,551	

- (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494株が含まれております。  
3 平成30年4月27日開催の取締役会決議により、平成30年6月1日付で単元株式数を1,000株から100株に変更しております。

【自己株式等】

平成30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	80,765,000		80,765,000	4.75
計		80,765,000		80,765,000	4.75

- (注) 1 当社は、単元未満自己株式494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1,561,000株あります。

2 【役員の状況】

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

(1) 取締役の状況

該当事項はありません。

(2) 執行役の状況

該当事項はありません。

## 第4 【経理の状況】

### 1 四半期連結財務諸表の作成方法について

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

### 2 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1四半期連結会計期間(平成30年4月1日から平成30年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成30年4月1日から平成30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30年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成30年6月30日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	3,694,283	4,124,838
預託金	348,912	329,698
受取手形及び売掛金	19,479	18,200
有価証券	987,210	1,072,150
トレーディング商品	6,667,033	7,404,147
商品有価証券等	4,170,557	4,828,285
デリバティブ取引	2,496,475	2,575,861
営業投資有価証券	115,332	104,613
投資損失引当金	505	472
営業貸付金	1,442,939	1,606,169
仕掛品	479	1,145
信用取引資産	262,963	240,099
信用取引貸付金	231,486	214,492
信用取引借証券担保金	31,476	25,606
有価証券担保貸付金	6,496,752	4,765,672
借入有価証券担保金	6,472,791	4,508,201
現先取引貸付金	23,961	257,471
立替金	17,549	43,470
短期貸付金	388	1,127
未収収益	35,880	41,481
その他の流動資産	390,020	406,417
貸倒引当金	244	246
流動資産計	20,478,476	20,158,513
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	124,190	147,335
無形固定資産	105,776	107,752
のれん	11,170	10,977
その他	94,605	96,775
投資その他の資産	426,598	440,249
投資有価証券	367,196	380,724
長期貸付金	4,932	4,926
長期差入保証金	17,527	17,595
繰延税金資産	6,162	4,921
その他	1 31,450	1 32,749
貸倒引当金	1 671	1 667
固定資産計	656,565	695,338
資産合計	21,135,041	20,853,852

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成30年 3月31日)	当第 1 四半期連結会計期間 (平成30年 6月30日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
支払手形及び買掛金	7,065	5,437
トレーディング商品	5,030,817	4,754,866
商品有価証券等	2,830,472	2,446,189
デリバティブ取引	2,200,345	2,308,677
約定見返勘定	407,184	478,964
信用取引負債	71,344	70,677
信用取引借入金	3,007	2,194
信用取引貸証券受入金	68,336	68,483
有価証券担保借入金	5,775,897	5,316,158
有価証券貸借取引受入金	5,645,028	4,915,268
現先取引借入金	130,868	400,890
銀行業における預金	3,388,444	3,536,229
預り金	256,858	338,002
受入保証金	420,039	388,122
短期借入金	1,091,771	1,234,195
コマーシャル・ペーパー	105,000	150,000
1年内償還予定の社債	261,494	228,870
未払法人税等	9,211	3,074
賞与引当金	34,862	11,882
その他の流動負債	175,115	115,530
流動負債計	17,035,108	16,632,012
<b>固定負債</b>		
社債	1,315,349	1,327,988
長期借入金	1,327,780	1,428,330
繰延税金負債	9,203	15,272
退職給付に係る負債	41,758	42,262
訴訟損失引当金	24,485	25,098
その他の固定負債	6,889	7,696
固定負債計	2,725,467	2,846,648
<b>特別法上の準備金</b>		
金融商品取引責任準備金	3,945	3,945
特別法上の準備金計	3,945	3,945
負債合計	19,764,521	19,482,607

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成30年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成30年6月30日)
<b>純資産の部</b>		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,713	230,713
利益剰余金	785,730	779,965
自己株式	54,310	54,223
自己株式申込証拠金	3	46
株主資本合計	1,209,535	1,203,899
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	61,176	64,908
繰延ヘッジ損益	129	551
為替換算調整勘定	2,550	5,097
その他の包括利益累計額合計	63,597	70,557
新株予約権	8,790	8,286
非支配株主持分	88,596	88,500
純資産合計	1,370,520	1,371,244
負債・純資産合計	21,135,041	20,853,852



(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29年4月1日 至平成29年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年6月30日)
<b>営業収益</b>		
受入手数料	69,746	73,813
委託手数料	16,214	16,566
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	5,740	11,466
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	11,143	7,669
その他の受入手数料	36,648	38,111
<b>トレーディング損益</b>	24,068	26,610
株券等トレーディング損益	7,775	11,732
債券・為替等トレーディング損益	16,293	14,878
営業投資有価証券関連損益	1,746	2,045
<b>金融収益</b>	43,835	62,070
その他の営業収益	20,255	10,635
<b>営業収益計</b>	159,652	175,175
<b>金融費用</b>	39,566	50,559
<b>その他の営業費用</b>	11,542	9,009
<b>純営業収益</b>	108,543	115,606
<b>販売費・一般管理費</b>		
取引関係費	16,638	17,961
人件費	1 43,215	1 46,903
不動産関係費	8,818	9,260
事務費	6,450	6,519
減価償却費	6,117	6,290
租税公課	2,754	2,637
貸倒引当金繰入れ	0	10
その他	3,126	3,871
<b>販売費・一般管理費計</b>	87,121	93,454
<b>営業利益</b>	21,422	22,151
<b>営業外収益</b>		
受取配当金	1,073	1,115
持分法による投資利益	2,140	2,473
為替差益	61	70
その他	1,178	676
<b>営業外収益計</b>	4,454	4,335
<b>営業外費用</b>		
支払利息	8	6
投資事業組合運用損	-	330
社債発行費	635	-
その他	79	288
<b>営業外費用計</b>	723	626
<b>経常利益</b>	25,153	25,860

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年6月30日)
<b>特別利益</b>		
固定資産売却益	814	-
投資有価証券売却益	813	221
新株予約権戻入益	894	688
移転補償金	-	347
特別利益計	2,522	1,256
<b>特別損失</b>		
固定資産除売却損	118	-
移転関連費用	-	115
事業再編関連費用	39	-
特別損失計	158	115
税金等調整前四半期純利益	27,516	27,002
法人税、住民税及び事業税	1,682	3,220
法人税等調整額	6,424	5,249
法人税等合計	8,106	8,470
四半期純利益	19,410	18,531
非支配株主に帰属する四半期純利益 又は非支配株主に帰属する四半期純損失( )	14	2
親会社株主に帰属する四半期純利益	19,395	18,534

【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29年4月1日 至平成29年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年6月30日)
四半期純利益	19,410	18,531
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	2,590	3,848
繰延ヘッジ損益	658	657
為替換算調整勘定	2,662	2,999
持分法適用会社に対する持分相当額	499	602
その他の包括利益合計	5,093	6,903
四半期包括利益	24,504	25,434
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	24,519	25,494
非支配株主に係る四半期包括利益	15	60

【注記事項】

(追加情報)

当第1四半期連結累計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年6月30日)	
「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当第1四半期連結会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。	

(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30年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成30年6月30日)
投資その他の資産・その他	6,296百万円	6,022百万円

2 保証債務

被保証者(被保証債務の内容)は次のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成30年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成30年6月30日)
従業員(借入金)	90百万円	80百万円

(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29年4月1日 至 平成29年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年6月30日)
	10,274百万円	10,497百万円

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

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

	前第1四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年6月30日)
減価償却費	6,988百万円	7,310百万円
のれんの償却額	248	414

(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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

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  
未日後となるもの

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30年4月1日 至 平成30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30年5月17日 取締役会	普通株式	利益剰余金	24,279	15	平成30年3月31日	平成30年6月4日

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

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29年4月1日至平成29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	42,365	35,243	17,747	1,923	97,280	6,308	103,589
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	6,467	36	5,736	122	644	3,712	4,357
計	48,833	35,280	12,011	1,801	97,925	10,021	107,947
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( ))	10,391	6,438	7,200	1,417	25,447	141	25,306

(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	25,447
「その他」の区分の損失( )	141
のれんの償却額	77
未実現損益の調整額	215
その他の調整額	139
四半期連結損益計算書の経常利益	25,153

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30年4月1日至平成30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	44,173	39,729	17,547	2,568	104,020	6,826	110,846
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	6,436	68	5,279	133	1,091	3,321	4,413
計	50,609	39,798	12,268	2,435	105,112	10,148	115,260
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( ))	9,894	6,996	7,488	1,760	26,139	144	25,995

(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	26,139
「その他」の区分の損失( )	144
のれんの償却額	77
未実現損益の調整額	35
その他の調整額	22
四半期連結損益計算書の経常利益	25,860

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

該当事項はありません。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成30年3月31日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	9	10	0
社債	111,535	111,951	415
その他			
計	111,545	111,961	415

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	103,227	173,514	70,286
債券	595,189	598,056	2,867
国債・地方債等	38,361	38,701	340
社債	118,963	121,496	2,532
その他	437,864	437,858	6
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	28,157	28,157	
その他	272,735	283,216	10,480
計	999,310	1,082,945	83,634

- (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45百万円(うち、株券45百万円)の減損処理を行っております。

当第1四半期連結会計期間末(平成30年6月30日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	四半期連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等	9	10	0
社債	116,729	117,304	575
その他			
計	116,739	117,314	575

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	90,269	165,119	74,849
債券	669,716	673,167	3,450
国債・地方債等	11,154	11,497	342
社債	85,065	87,541	2,475
その他	573,496	574,128	632
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	27,011	27,011	
その他	278,370	287,940	9,570
計	1,065,367	1,153,238	87,870

- (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30年3月31日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,429,539	424,829	3,600,144	375,239
為替予約取引	1,666,515	39,888	1,478,493	34,652
先物・先渡取引	1,905,111	21,605	2,861,828	28,151
スワップ取引	96,882,331	1,990,964	95,886,681	1,738,921
その他	1,651,359	23,956	1,641,390	23,379
リスクリザーブ		4,769		

当第1四半期連結会計期間末(平成30年6月30日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,245,271	468,831	3,334,636	437,359
為替予約取引	1,675,250	35,704	1,758,580	35,546
先物・先渡取引	2,381,675	24,937	3,157,965	22,577
スワップ取引	97,139,491	2,028,513	97,381,456	1,791,291
その他	1,296,021	22,452	1,337,873	21,901
リスクリザーブ		4,575		

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純利益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及び算定上の基礎は、次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29年4月1日 至平成29年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益	11.63円	11.45円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益(百万円)	19,395	18,534
普通株主に帰属しない金額(百万円)		
普通株式に係る親会社株主に帰属する四半期純利益 (百万円)	19,395	18,534
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,668,395	1,618,691
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	11.55円	11.38円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益調整額(百万円)		
普通株式増加数(千株)	10,546	10,036
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		

(重要な後発事象)

当社は、平成30年7月30日開催の取締役会において、会社法第459条第1項の規定による定款の定めに基づき、自己株式取得に係る事項について決議いたしました。

(1) 自己株式の取得を行う理由

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

(2) 取得に係る事項の内容

取得する株式の種類	当社普通株式
取得する株式の総数	5,500万株(上限) (発行済株式総数(自己株式を除く)に対する割合3.40%)
株式の取得価額の総額	400億円(上限)
期間	平成30年8月22日から平成31年3月22日 (但し、各四半期末日の最終5営業日及び各四半期決算発表の翌営業日より10営業日の間は取得を行わない)
取得方法	信託方式による市場買付

2 【その他】

(剰余金の配当)

平成30年5月17日開催の取締役会において、平成30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	24,279百万円
1株当たりの金額	15円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	平成30年6月4日

(注) 平成30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30年8月3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 小 倉 加奈子 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 間 瀬 友 未 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深 井 康 治 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30年4月1日から平成31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30年4月1日から平成30年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成30年4月1日から平成30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30年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する第1四半期連結累計期間の経営成績を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

### 利害関係

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

以 上

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