

【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27年8月14日

【四半期会計期間】 第79期第1四半期
(自 平成27年4月1日 至 平成27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 太 田 一 成

【最寄りの連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03(5555)1111

【事務連絡者氏名】 財務部長 太 田 一 成

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

株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)

第一部 【企業情報】

第1 【企業の概況】

1 【主要な経営指標等の推移】

回次	第78期 第1四半期 連結累計期間	第79期 第1四半期 連結累計期間	第78期
会計期間	自 平成26年4月1日 至 平成26年6月30日	自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日	自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日
営業収益 (百万円)	148,701	191,389	659,396
純営業収益 (百万円)	122,490	154,663	532,220
経常利益 (百万円)	39,705	63,113	184,578
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益 (百万円)	34,380	44,836	148,490
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	34,828	61,966	217,005
純資産額 (百万円)	1,259,599	1,362,124	1,434,680
総資産額 (百万円)	22,050,990	23,451,198	23,001,585
1株当たり四半期(当期)純利益金額 (円)	20.19	26.24	87.07
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額 (円)	20.01	25.99	86.28
自己資本比率 (%)	4.9	5.4	5.4

- (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。
- 4 「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)等を適用し、当第1四半期連結累計期間より、「四半期(当期)純利益」を「親会社株主に帰属する四半期(当期)純利益」としております。

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78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。

(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、当社グループの事業活動に制約を受ける可能性や、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。

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1,913億円（前年同四半期比28.7%増）となりました。受入手数料は総額で800億円（同16.5%増）、トレーディング損益が490億円（同30.5%増）となりました。金融収支は138億円（同37.9%増）、純営業収益は1,546億円（同26.3%増）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費188億円（同5.6%増）、人件費493億円（同13.2%増）などにより、合計で955億円（同8.4%増）となりました。

この結果、経常利益は631億円（同59.0%増）となりました。

これに特別損益、法人税等及び非支配株主に帰属する四半期純利益を計上した結果、親会社株主に帰属する四半期純利益は448億円（同30.4%増）となりました。

セグメントの業績は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

	純営業収益			経常利益		
	平成26年 6月期	平成27年 6月期	対前年 増減率	平成26年 6月期	平成27年 6月期	対前年 増減率
リテール部門	53,971	64,631	19.8%	17,155	24,263	41.4%
ホールセール部門	41,426	57,174	38.0%	10,541	24,027	127.9%
アセット・マネジメント部門	12,783	15,488	21.2%	8,013	9,260	15.6%
投資部門	2,186	4,234	93.7%	1,884	3,671	94.9%
その他・調整等	12,122	13,134		2,110	1,889	
連結計	122,490	154,663	26.3%	39,705	63,113	59.0%

[リテール部門]

活況な株式相場を背景に日本株取引が拡大したことや、株式投資信託の販売が増加したことなどにより、純営業収益は646億円（前年同四半期比19.8%増）、経常利益は242億円（同41.4%増）となりました。

[ホールセール部門]

日本株の顧客フローの増加や、債券販売が好調だったことなどにより、純営業収益は571億円（同38.0%増）、経常利益は240億円（同127.9%増）となりました。

[アセット・マネジメント部門]

好調な資金流入により、公募株式投信等の運用資産残高が拡大したことなどから、純営業収益は154億円（同21.2%増）、経常利益は92億円（同15.6%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により、純営業収益は42億円（同93.7%増）、経常利益は36億円（同94.9%増）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23兆4,511億円（前連結会計年度末比4,496億円増）となりました。内訳は流動資産が22兆8,785億円（同6,878億円増）であり、このうち現金・預金が3兆4,271億円（同4,413億円増）、有価証券が2兆5,614億円（同684億円減）、トレーディング商品が8兆7,918億円（同4,874億円増）、有価証券担保貸付金が6兆6,228億円（同1,053億円減）となっております。固定資産は5,726億円（同2,382億円減）となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は22兆890億円（同5,221億円増）となりました。内訳は流動負債が20兆73億円（同6,534億円増）であり、このうちトレーディング商品が5兆2,069億円（同8,073億円減）、約定見返勘定が6,682億円（同3,799億円増）、有価証券担保借入金が8兆1,715億円（同6,184億円増）、銀行業における預金が2兆9,477億円（同2,020億円増）となっております。固定負債は2兆777億円（同1,313億円減）であり、このうち社債が1兆1,195億円（同595億円減）、長期借入金が8,856億円（同607億円減）となっております。

純資産合計は1兆3,621億円（同725億円減）となりました。株主資本については、「(6)資本の財源及び流動性に係る情報 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1,335億円（同21億円減）、非支配株主持分は815億円（同1,062億円減）となっております。また、繰延ヘッジ損益は220億円（同47億円増）、為替換算調整勘定は559億円（同128億円増）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、増勢に鈍化が見られました。先進国経済は底堅い推移を示したものの、新興国経済の減速が足かせとなりました。加えて、ギリシャでは債務の返済が延滞となり、中国では株価の急速な下落が発生するなど、金融市場での混乱が相次ぎました。

米国経済は平成27年1 - 3月期には、設備投資、政府消費、輸出の減少を主因にマイナス成長を記録したものの、4 - 6月期に入り堅調な推移を示しました。減速傾向が強まっていた個人消費が持ち直しに転じたことに加え、住宅販売が堅調な推移を示すなど、家計部門が強さを取り戻しました。一方、企業部門は生産が伸び悩んでおり、力強さに欠ける展開となっています。金融面では引き続き緩和的な状況が続いています。ただし、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）は年内の利上げ方針を明らかにしています。

欧州経済は、緩やかな回復が続きました。原油価格下落と金利の低下に加えて、就業者数の増加や賃金の伸び率の加速も個人消費を下支えしました。このような状況のなか、個人消費の回復にけん引され企業マインドは内需関連を中心に緩やかな持ち直しの動きが続いています。ただし、大幅なユーロ安の進行にもかかわらず、欧州以外からの需要が低調であることから輸出は伸び悩みが続きました。金融面では、ECB（欧州中央銀行）は緩和的な金融政策を継続しています。緩やかながらも持続的な景気の持ち直しが続いていることに加え、原油価格が反発に転じたことで、物価上昇率は僅かながら上昇幅を拡大したものの、ECBの目標とする水準には遠く及ばず、平成27年1月に決定した量的緩和政策が継続しています。緩和的な金融環境であるものの、ギリシャ問題が再発したことは市場に大きな影響を与えました。ギリシャ政府案と債権団案の折り合いがつかず、6月30日に予定されていた、IMFへの資金の返済が延滞となったことで、ギリシャのデフォルトリスクが急速に意識されるようになりました。このような状況に直面したギリシャは銀行窓口の封鎖や資本規制を実施し、資金の海外流出の防止を図った結果、同国の実体経済・金融市場は大きな打撃を受けました。

新興国では減速傾向が強まっています。中国経済の不振が各国に伝播したことが、新興国全体の景気の足取りが鈍くなっている最大の要因です。中国経済は4 - 6月期の実質GDP成長率が前年比+7.0%となり、政府目標通りの結果でありました。中国人民銀行が昨年末以降相次いで利下げを行ったことが景気を下支えしました。ただし6月以降、中国の代表的な株価指標である上海総合指数は急速に下落し、金融市場には緊張が走りました。このような株価の急落を受けて中国政府はIPOを抑制する方針を固めただけでなく、中国の大手証券会社がETFへ投資するように指導するなど、総力を挙げて株価の下支えを行いました。

< 日本の状況 >

日本経済はこれまでの緩やかな回復が一巡し、足踏み状態となっています。足下で大きく在庫が積み上がっていることや輸出の減少を主因として、鉱工業生産は減産傾向が鮮明となっています。非製造業の活動を示す第三次活動指数も今年度に入り低下が続いており、先行きへの不透明感が強まっています。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は力強さに欠ける動きとなっています。労働需給のタイト化に伴う賃金上昇圧力に加えて、企業収益の改善に伴うペースアップや特別給与の増加など、所得環境は良好である一方、4 - 6月期の後半以降は天候不順が個人消費の下押し要因として働きました。住宅投資に関しては、持ち直しの動きとなっています。所得環境が良好であることに加えて、住宅ローン金利が低水準で推移していることが住宅投資の増加を支援する材料となっています。

企業の設備投資は平成27年1 - 3月期に急増しました。足下では横ばい圏で推移しているものの、これまでの低調な推移を脱し、増加局面に入ったと見られます。日銀短観6月調査を見ると、製造業では設備の過剰感の解消、非製造業では不足感の強まりが顕著になっています。特に大企業製造業が強気の設備投資計画を示しており、設備投資意欲の高まりがみられます。公共投資についてはこれまでの増加傾向が一巡し、減少傾向が鮮明となっています。ただし、これまでの経済対策の影響が残存しているため、水準でみると高い位置を保っています。

外需に目を向けると、輸出数量の減少を主因に輸出金額は減少傾向となっています。地域別に輸出の動向をみると、米国向け輸出の弱さが目立ちます。米国の企業部門が足踏みしていることを受けて、主力商品である一般機械の輸出が減少したことが主な要因です。また、内需の縮小により輸入金額も足下で減少傾向となっています。この結果、貿易収支は小幅の赤字となっています。

金融面では、日本銀行による「量的・質的金融緩和」の下で、強力な金融緩和が続いています。日本銀行による大量の長期国債の購入を通じて、債券需給がひっ迫しているため、長期金利は水準としては低位で推移しているものの、海外経済の混乱などの影響もありボラティリティの高い状況となっています。為替レートの様子をみると、米ドル対円では5月後半から米国経済の改善が明確化してきたことなどを背景にドル高円安が進行しましたが、その後はユーロ圏や中国における金融市場での混乱に伴うリスク回避の動きにより、円高へ戻されました。

平成27年6月末の日経平均株価は20,235円73銭（同年3月末比1,028円74銭高）、10年国債利回りは0.455%（同0.055ポイントの上昇）、為替は1ドル122円25銭（同2円04銭の円安）となりました。

(6) 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、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、事業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。

また、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ほかに独自の流動性管理指標を用いた流動性管理体制を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、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)

短期無担保調達資金合計	銀行等からの短期借入金	1,309
	その他の短期借入金	6,701
	コマーシャル・ペーパー	4,453
	1年内償還予定の社債	2,958
		15,423
流動性ポートフォリオ等合計	現金・預金	17,512
	国債・政府保証債等	2,663
	流動性ポートフォリオ	20,176
	その他の債券	5,687
	上場株式等	6,904
	補完的流動性ポートフォリオ	12,591
		32,768

(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2兆176億円であります。また、補完的流動性ポートフォリオを含めた合計額は3兆2,768億円であり、この金額は同期間末の短期無担保調達資金の合計額の212.5%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。

<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。

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180億円増加し、1兆1,047億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,788億円となりました。利益剰余金は配当金支払いにより274億円減少したほか、親会社株主に帰属する四半期純利益を448億円計上した結果、前連結会計年度末比173億円増の6,411億円となりました。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、152億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
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27年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成27年8月14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 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27年4月1日～ 平成27年6月30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27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27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 33,814,000		
	(相互保有株式) 普通株式 1,916,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,710,975,000	1,710,975	
単元未満株式	普通株式 2,673,772		
発行済株式総数	1,749,378,772		
総株主の議決権		1,710,975	

- (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7,708,000株(議決権7,708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218株が含まれております。

【自己株式等】

平成27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	33,814,000		33,814,000	1.93
計		33,814,000		33,814,000	1.93

- (注) 1 当社は、単元未満自己株式218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1,916,000株(議決権1,916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27年4月1日から平成27年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成27年4月1日から平成27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27年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成27年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,985,779	3,427,134
預託金	349,094	349,727
受取手形及び売掛金	18,286	16,307
有価証券	2,629,847	2,561,423
トレーディング商品	8,304,368	8,791,825
商品有価証券等	5,192,464	5,920,180
デリバティブ取引	3,111,904	2,871,645
営業投資有価証券	156,157	146,718
投資損失引当金	36,633	36,477
営業貸付金	287,010	278,187
仕掛品	1,226	1,547
信用取引資産	240,971	237,193
信用取引貸付金	221,524	218,977
信用取引借証券担保金	19,447	18,215
有価証券担保貸付金	6,728,201	6,622,820
借入有価証券担保金	6,727,866	6,546,279
現先取引貸付金	334	76,541
立替金	29,640	46,323
短期貸付金	538	711
未収収益	36,578	35,181
繰延税金資産	11,944	10,124
その他の流動資産	447,985	390,183
貸倒引当金	323	361
流動資産計	22,190,674	22,878,572
固定資産		
有形固定資産	458,534	123,683
無形固定資産	77,082	75,228
のれん	4,820	4,835
その他	72,262	70,392
投資その他の資産	275,294	373,714
投資有価証券	241,642	341,482
長期貸付金	4,971	4,965
長期差入保証金	16,903	17,702
繰延税金資産	1,899	1,642
その他	1 11,256	1 9,301
貸倒引当金	1 1,378	1 1,379
固定資産計	810,911	572,626
資産合計	23,001,585	23,451,198

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成27年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成27年6月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	5,468	3,920
トレーディング商品	6,014,287	5,206,948
商品有価証券等	3,374,209	2,808,139
デリバティブ取引	2,640,078	2,398,808
約定見返勘定	288,309	668,221
信用取引負債	55,051	56,529
信用取引借入金	9,326	5,231
信用取引貸証券受入金	45,725	51,297
有価証券担保借入金	7,553,191	8,171,597
有価証券貸借取引受入金	7,550,001	8,111,593
現先取引借入金	3,189	60,004
銀行業における預金	2,745,681	2,947,735
預り金	249,183	308,148
受入保証金	503,974	504,490
短期借入金	1,011,879	1,148,954
コマーシャル・ペーパー	388,380	445,380
1年内償還予定の社債	264,942	295,896
未払法人税等	13,804	20,885
繰延税金負債	25,931	14,401
賞与引当金	35,438	17,229
その他の流動負債	198,359	197,037
流動負債計	19,353,884	20,007,377
固定負債		
社債	1,179,092	1,119,570
長期借入金	946,408	885,680
繰延税金負債	25,983	27,943
退職給付に係る負債	36,237	36,707
訴訟損失引当金	1,877	2,055
その他の固定負債	19,494	5,811
固定負債計	2,209,094	2,077,769
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,926	3,928
特別法上の準備金計	3,926	3,928
負債合計	21,566,904	22,089,074

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成27年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成27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	231,283	231,407
利益剰余金	623,755	641,143
自己株式	15,771	15,200
自己株式申込証拠金	3	3
株主資本合計	1,086,668	1,104,750
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	135,687	133,565
繰延ヘッジ損益	26,815	22,035
為替換算調整勘定	43,116	55,982
その他の包括利益累計額合計	151,988	167,512
新株予約権	8,205	8,310
非支配株主持分	187,818	81,550
純資産合計	1,434,680	1,362,124
負債・純資産合計	23,001,585	23,451,198

(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26年4月1日 至平成26年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)
営業収益		
受入手数料	68,686	80,041
委託手数料	14,082	21,035
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	11,172	9,031
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	10,569	11,226
その他の受入手数料	32,861	38,748
トレーディング損益	37,579	49,043
株券等トレーディング損益	5,716	10,606
債券・為替等トレーディング損益	31,862	38,437
営業投資有価証券関連損益	1,916	3,704
金融収益	26,578	37,830
その他の営業収益	13,940	20,768
営業収益計	148,701	191,389
金融費用	16,530	23,978
その他の営業費用	9,680	12,746
純営業収益	122,490	154,663
販売費・一般管理費		
取引関係費	17,870	18,871
人件費	43,618	49,358
不動産関係費	9,212	9,287
事務費	6,332	6,501
減価償却費	6,030	5,953
租税公課	1,883	2,895
貸倒引当金繰入れ	-	26
その他	3,215	2,681
販売費・一般管理費計	88,164	95,574
営業利益	34,326	59,088
営業外収益		
受取利息	11	11
受取配当金	1,881	1,300
負ののれん償却額	1,141	-
持分法による投資利益	633	2,045
その他	2,317	1,349
営業外収益計	5,985	4,706
営業外費用		
支払利息	349	375
為替差損	-	48
その他	257	256
営業外費用計	607	681
経常利益	39,705	63,113

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	-	50
持分変動利益	-	3,092
償却債権取立益	500	-
特別利益計	500	3,143
特別損失		
減損損失	-	328
投資有価証券評価損	304	-
金融商品取引責任準備金繰入れ	171	2
特別損失計	476	330
税金等調整前四半期純利益	39,728	65,926
法人税、住民税及び事業税	2,914	26,246
法人税等調整額	1,372	6,610
法人税等合計	4,286	19,636
四半期純利益	35,441	46,290
非支配株主に帰属する四半期純利益	1,061	1,453
親会社株主に帰属する四半期純利益	34,380	44,836

【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26年4月1日 至平成26年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)
四半期純利益	35,441	46,290
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	12,429	2,104
繰延ヘッジ損益	11,801	4,803
為替換算調整勘定	1,106	12,898
持分法適用会社に対する持分相当額	134	79
その他の包括利益合計	613	15,676
四半期包括利益	34,828	61,966
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	33,812	60,360
非支配株主に係る四半期包括利益	1,016	1,605

【注記事項】

(連結の範囲又は持分法適用の範囲の変更)

当第1四半期連結累計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年6月30日)

(1) 連結の範囲の重要な変更

当第1四半期連結会計期間より、大和証券オフィス投資法人は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、持分法適用の関連会社としております。

(2) 持分法適用の範囲の重要な変更

当第1四半期連結会計期間より、大和証券オフィス投資法人は連結子会社から除外し、持分法適用の関連会社としております。

(会計方針の変更等)

当第1四半期連結累計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年6月30日)

(会計方針の変更)

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。)、「連結財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第22号 平成25年9月13日。以下「連結会計基準」という。)及び「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。)等を、当第1四半期連結会計期間から適用し、支配が継続している場合の子会社に対する当社の持分変動による差額を資本剰余金として計上するとともに、取得関連費用を発生した連結会計年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当第1四半期連結会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する四半期連結会計期間の四半期連結財務諸表に反映させる方法に変更しております。加えて、四半期純利益等の表示の変更及び少数株主持分から非支配株主持分への表示の変更を行っております。当該表示の変更を反映させるため、前第1四半期連結累計期間及び前連結会計年度については、四半期連結財務諸表及び連結財務諸表の組替えを行っております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58-2項(4)、連結会計基準第44-5項(4)及び事業分離等会計基準第57-4項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当第1四半期連結会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

これにより四半期連結財務諸表に与える影響はありません。

(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27年 3月31日)	当第 1 四半期連結会計期間 (平成27年 6月30日)
投資その他の資産・その他	6,020百万円	6,018百万円

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27年 3月31日)	当第 1 四半期連結会計期間 (平成27年 6月30日)
従業員(借入金)	263百万円	243百万円
その他(債務)	1,834	1,909
計	2,097	2,153

(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26年 4月 1日 至 平成26年 6月30日)	当第 1 四半期連結累計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 6月30日)
	11,938百万円	16,039百万円

(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26年 4月 1日 至 平成26年 6月30日)	当第 1 四半期連結累計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 6月30日)
減価償却費	7,418百万円	7,498百万円
のれんの償却額	391	267
負ののれんの償却額	1,141	-

(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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26年5月16日 取締役会	普通株式	利益剰余金	29,135	17	平成26年3月31日	平成26年6月2日

(注) 平成26年5月16日取締役会決議の配当金の総額には、日本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192百万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27年4月1日 至 平成27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27年5月15日 取締役会	普通株式	利益剰余金	27,449	16	平成27年3月31日	平成27年6月1日

(注) 平成27年5月15日取締役会決議の配当金の総額には、日本スタートラスト信託銀行株式会社(従業員持株E S O P信託口・75404口)に対する123百万円が含まれております。

- 2 基準日が当第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26年4月1日 至 平成26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	46,465	41,672	19,632	2,285	110,055	6,360	116,416
セグメント間の内部純営業 収益又は振替高	7,506	245	6,849	98	312	3,743	4,055
計	53,971	41,426	12,783	2,186	110,368	10,103	120,471
セグメント利益(経常利益)	17,155	10,541	8,013	1,884	37,594	1,505	39,099

(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	金額
報告セグメント計	37,594
「その他」の区分の利益	1,505
セグメント間取引消去	8
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	7
その他の調整額	444
四半期連結損益計算書の経常利益	39,705

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27年4月1日至平成27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	56,017	57,061	21,847	4,405	139,331	9,207	148,539
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	8,613	112	6,358	170	2,197	2,936	5,133
計	64,631	57,174	15,488	4,234	141,529	12,144	153,673
セグメント利益(経常利益)	24,263	24,027	9,260	3,671	61,223	1,672	62,896

(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	金額
報告セグメント計	61,223
「その他」の区分の利益	1,672
セグメント間取引消去	-
のれんの償却額	77
未実現損益の調整額	250
その他の調整額	544
四半期連結損益計算書の経常利益	63,113

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27年3月31日)

1 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

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	75,511	175,375	99,863
債券	2,402,709	2,476,321	73,611
国債・地方債等	1,206,780	1,267,507	60,727
社債	188,510	192,698	4,188
その他	1,007,418	1,016,114	8,695
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	38,756	39,864	1,108
その他	168,609	188,045	19,435
計	2,685,587	2,879,606	194,018

- (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減損処理は行っておりません。

当第1四半期連結会計期間末(平成27年6月30日)

1 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

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	75,887	188,642	112,755
債券	2,348,607	2,408,560	59,952
国債・地方債等	1,045,487	1,096,354	50,867
社債	237,313	240,836	3,522
その他	1,065,806	1,071,369	5,563
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	39,268	40,389	1,120
その他	160,722	176,837	16,114
計	2,624,485	2,814,429	189,944

- (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27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	4,632,632	813,757	5,174,242	693,382
為替予約取引	3,666,629	105,311	4,266,966	117,838
先物・先渡取引	3,104,874	26,386	3,376,188	54,640
スワップ取引	53,370,923	2,123,678	53,336,483	1,720,948
その他	3,216,123	50,872	3,257,560	53,268
リスクリザーブ		8,101		

当第1四半期連結会計期間末(平成27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	4,152,720	842,277	4,486,555	724,036
為替予約取引	2,912,055	86,879	3,366,593	105,480
先物・先渡取引	3,909,932	30,742	2,617,466	46,577
スワップ取引	52,824,509	1,883,809	55,570,961	1,484,603
その他	2,406,840	36,006	2,471,584	38,111
リスクリザーブ		8,070		

(企業結合等関係)

当社の連結子会社である大和証券オフィス投資法人は、平成27年4月27日及び平成27年5月20日開催の役員会において決議しました平成27年6月1日を払込日とした新投資口発行及び投資口売出しを実施いたしました。これに伴い、当社グループの持分比率が低下し、同法人は当社の関連会社となりました。

(1) 異動の理由

同法人によるさらなる運用資産拡大を目的とした資金調達に伴う持分比率の低下によるものであります。なお低下後の持分比率は38.89%です。

(2) 異動日

平成27年6月1日

(3) 異動する子会社の概要

名称	大和証券オフィス投資法人
所在地	東京都中央区銀座六丁目2番1号
代表者の役職・氏名	執行役員 大村 信明
事業内容	不動産等資産に対する投資・運用を行う投資法人
資産運用会社	大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社(当社グループの100%子会社)
出資総額	219,155百万円
設立年月日	平成17年7月11日

なお、当社のセグメント情報の開示においては「アセット・マネジメント部門」に含めております。

(4) 実施した会計処理の概要

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、持分変動利益3,092百万円を特別利益に計上しております。

また、当該持分比率の低下により、同法人は当社の連結子会社から関連会社となったため、同法人の貸借対照表を当社の連結財務諸表から除外し、当社グループが保有する同法人投資口は持分法による評価額に修正しております。

(5) 当期の連結損益計算書に計上されている当該子会社に係る損益の概算額

純営業収益 3,232百万円
営業利益 2,659百万円

(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26年4月1日 至平成26年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額	20.19円	26.24円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益金額(百万円)	34,380	44,836
普通株主に帰属しない金額(百万円)		
普通株式に係る親会社株主に帰属する四半期純利益金額(百万円)	34,380	44,836
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,703,107	1,708,606
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	20.01円	25.99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)	14,674	16,812
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) 従業員持株E S O P信託口が保有する当社株式を、「1株当たり四半期純利益金額」及び「潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額」の算定上、期中平均株式数の計算において控除する自己株式に含めております(前第1四半期連結累計期間10,717千株、当第1四半期連結累計期間7,146千株)。

(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27年5月15日開催の取締役会において、平成27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 27,449百万円
1株当たりの金額 16円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成27年6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123百万円が含まれております。

2 平成27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27年8月14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27年4月1日から平成28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27年4月1日から平成27年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成27年4月1日から平成27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27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。