

【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29年2月8日

【四半期会計期間】 第80期第3四半期
(自 平成28年10月1日 至 平成28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79期 第3四半期 連結累計期間	第80期 第3四半期 連結累計期間	第79期
会計期間		自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日	自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日	自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日
営業収益	(百万円)	503,132	450,175	653,711
純営業収益	(百万円)	403,042	351,131	514,815
経常利益	(百万円)	136,519	101,229	165,148
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	95,537	81,708	116,848
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	80,984	76,025	57,266
純資産額	(百万円)	1,354,598	1,347,052	1,313,005
総資産額	(百万円)	23,026,759	20,523,661	20,420,818
1株当たり四半期(当期)純利益金額	(円)	55.73	48.26	68.25
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額	(円)	55.24	47.97	67.68
自己資本比率	(%)	5.5	6.1	6.0

回次		第79期 第3四半期 連結会計期間	第80期 第3四半期 連結会計期間
会計期間		自 平成27年10月1日 至 平成27年12月31日	自 平成28年10月1日 至 平成28年12月31日
1株当たり四半期純利益金額	(円)	15.33	15.76

- (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。

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、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79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) 日本及び世界の景気、経済情勢、金融市場の変動に関するリスク

日本では、長年の懸念とされてきた社会保障の充実安定化と財政健全化の同時達成による日本経済再生を目指し、平成26年4月に17年ぶりの消費税率の引上げが行われました。平成28年1月には、デフレ脱却のため、日本の金融政策史上初めてマイナス金利政策の導入が決定されました。また、平成28年6月には、平成29年4月に予定されていた消費税率10%への引上げを平成31年10月まで延期することが発表されました。平成28年9月には、日銀が長短金利に操作目標を明示的に設定する「イールドカーブ・コントロール」が導入されました。消費税増税の延期により財政問題が深刻化したような場合や、金融政策の効果が期待通り得られずデフレが長期化した場合には、日本経済が再び低迷の危機に陥る可能性も否定できません。

米国では、平成28年12月にFOMC（連邦公開市場委員会）の決定により利上げが実施され、今後の追加的な利上げの見通しも示されたことで、米国経済の改善が示唆されましたが、新政権の今後の政策動向次第では先行き不安が高まる可能性があります。欧州地域においては、ECB（欧州中央銀行）による支援策等により一時の危機的状況は脱したとみられるものの、地政学リスクやシステムリスクの高まり等により、その先行きは依然として不透明な状況です。中国、新興国においても、依然として、経済成長率のさらなる減速懸念がくすぶっており、予断を許さない状況が続いています。再び、財政状況や経済状況が悪化した場合には、世界的な金融危機や経済危機に発展する可能性も否定できません。

このように、日本における財政政策、金融政策の効果が期待通り得られない場合や、世界景気や経済情勢の停滞若しくは悪化など、日本を取り巻く経済環境に悪影響を及ぼす事象が発生した場合には、企業業績の悪化、株価の下落、為替の変動、金利の変動等により様々なリスクが顕在化することが想定されます。このような事態は、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

2 【経営上の重要な契約等】

当第3四半期連結会計期間において、該当事項はありません。

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4,501億円（前年同期比10.5%減）となりました。受入手数料は総額で1,968億円（同12.8%減）、トレーディング損益が997億円（同2.8%減）となりました。金融収支は355億円（同8.8%減）、純営業収益は3,511億円（同12.9%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費508億円（同7.5%減）、人件費1,314億円（同5.8%減）などにより、合計で2,621億円（同5.1%減）となりました。

この結果、経常利益は1,012億円（同25.9%減）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817億円（同14.5%減）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27年 12月期	平成28年 12月期	対前年 増減率	平成27年 12月期	平成28年 12月期	対前年 増減率
リテール部門	173,551	138,397	20.3%	55,752	20,675	62.9%
ホールセール部門	134,305	135,761	1.1%	36,046	49,008	36.0%
アセット・マネジメント部門	39,488	34,639	12.3%	23,998	19,944	16.9%
投資部門	18,573	13,252	28.7%	16,818	11,488	31.7%
その他・調整等	37,122	29,080		3,904	112	
連結計	403,042	351,131	12.9%	136,519	101,229	25.9%

[リテール部門]

米国大統領選以降、株式取引や株式投信の販売額が増加したものの、活況な株式相場であった前年同期と比べると個人投資家による取引は減少しており、純営業収益は1,383億円(前年同期比20.3%減)、経常利益は206億円(同62.9%減)となりました。

[ホールセール部門]

フィクスト・インカムにおいて日本国債等のトレーディングが堅調に推移したことや、大型PO案件・海外M&A案件の積み上げ等により、純営業収益は1,357億円(同1.1%増)、経常利益は490億円(同36.0%増)となりました。

[アセット・マネジメント部門]

不動産アセット・マネジメントビジネスにおける運用資産残高は増加しているものの、公募株式投信や公募公社債投信の期間平均残高が減少したことなどから、純営業収益は346億円(同12.3%減)、経常利益は199億円(同16.9%減)となりました。

[投資部門]

投資案件の回収等が進んだものの、純営業収益は132億円(同28.7%減)、経常利益は114億円(同31.7%減)となり、大型投資案件の回収が寄与した前年同期比では減収減益となりました。

(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20兆5,236億円（前連結会計年度末比1,028億円増）となりました。内訳は流動資産が19兆9,452億円（同937億円増）であり、このうち現金・預金が3兆6,655億円（同3,307億円増）、有価証券が1兆8,803億円（同2,107億円減）、トレーディング商品が6兆8,609億円（同6,402億円減）、有価証券担保貸付金が5兆5,709億円（同3,207億円増）となっております。固定資産は5,783億円（同91億円増）となっております。

< 負債の部・純資産の部 >

負債合計は19兆1,766億円（同687億円増）となりました。内訳は流動負債が16兆9,091億円（同812億円増）であり、このうちトレーディング商品が4兆7,483億円（同5,524億円減）、約定見返勘定が364億円（同3,907億円減）有価証券担保借入金が6兆6,841億円（同7,824億円増）、銀行業における預金が3兆814億円（同1,527億円増）となっております。固定負債は2兆2,635億円（同124億円減）であり、このうち社債が1兆2,377億円（同330億円増）、長期借入金が9,603億円（同446億円減）となっております。

純資産合計は1兆3,470億円（同340億円増）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714億円（同270億円減）、非支配株主持分は841億円となっております。また、繰延ヘッジ損益は 37億円（同292億円増）、為替換算調整勘定は132億円（同78億円減）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) 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、これまでの減速基調が一服し、緩やかながら持ち直しの兆しを見せました。米国を中心とした先進国経済が引き続き底堅く推移する中、中国をはじめとした新興国経済の成長率については減速基調が一服しています。平成28年11月に行われた米国大統領選挙の結果を受け、日本の金融市場は一時的に混乱しましたが、次期大統領の掲げる拡張的な財政政策が米国経済の拡大につながるとの見方が広がり、グローバルな金融市場では概ね好意的に捉えられました。

米国経済は平成28年1 - 3月期に、設備投資、輸出、個人消費の伸びが鈍化し、実質GDP成長率が伸び悩みました。しかし、4 - 6月期に入ると、雇用環境が相対的に良好に推移するなか、個人消費が加速する動きが見られました。さらに、7 - 9月期には輸出が大幅に拡大し、実質GDP成長率は前期比年率3.5%増と、3年ぶりの高い成長率を記録しました。雇用情勢は引き続き安定しており、米国経済は個人消費をけん引役とした堅調な推移を維持しています。金融面では、米国国内の景気回復を受けて、FRB（連邦準備制度理事会）が平成28年12月に、1年ぶりに政策金利の引き上げを実施しました。好調な米国経済やドナルド・トランプ氏による新政権成立への期待感から、米国株式市場では騰勢が続き、NYダウ平均株価は12月に過去最高値を更新しました。

欧州経済は、ECB（欧州中央銀行）によるマイナス金利政策や原油価格の低迷などを追い風に、個人消費を下支え役とした緩やかな回復基調が続いています。ユーロ圏の平成28年7 - 9月期の実質GDP成長率は、個人消費の拡大がプラスに寄与し、前期比0.3%増と14四半期連続のプラス成長となりました。足下でも雇用改善や金利低下など、個人消費に対する追い風が継続しており、欧州経済は底堅く推移しています。金融面では、ECBが12月の金融政策委員会で資産買入プログラムの9か月間の延長などの政策変更を決定しています。

新興国経済については、成長率の減速基調が一服しています。中国の実質GDP成長率は、平成28年1 - 3月期から3四半期連続で前年比6.7%増と、横ばいで推移しています。平成27年と平成28年1 - 11月の比較では、消費と固定資産投資がともに減速する中、乗用車や住宅といった産業が伸びを高めました。金融面では、人民元の急落と外貨準備の急減などを背景に、上海総合株価指数は平成28年1月に一時的に急落する場面がありましたが、その後の株式相場は徐々に落ち着きを取り戻す展開となりました。

< 日本の状況 >

日本経済は「踊り場」局面からの持ち直しの動きが出始めています。内需不振の影響はあるものの、旺盛な外需に牽引されるかたちで、鉱工業生産は夏場以降、上昇基調をたどっています。また、非製造業の活動を示す第三次産業活動指数についても、事業所向けサービスが底堅く推移し、全体として緩やかな拡大基調にあります。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は緩やかに拡大しています。労働需給がタイトな状況にあるなか、非製造業を中心とした労働需要の高まりから雇用者数が継続的に増加しており、マクロ経済全体で見た賃金が上昇基調にあることなどが背景にあります。しかし、可処分所得の伸び悩みや将来不安などを要因として、家計は依然として慎重姿勢を維持したままの状況にあります。一方、住宅投資については、住宅ローン金利の低下や、相続税対策のための貸家の建設増などを背景に、平成28年7 - 9月期は前期比2.6%増となったものの、10 - 12月期はやや一服感が見られました。

一方、企業の設備投資は停滞しています。高水準の企業収益を背景とする更新・改修投資の動きが下支え役になる一方、円高や国内景気の停滞に伴う企業収益の先行き不透明感が強まる中で、製造業を中心に設備投資を先送りする動きが見られています。

外需に目を向けると、堅調な海外経済に対して、伸び悩む国内経済という構図が継続しています。地域別に輸出の動向をみると、米国、EU及びアジア向け輸出がいずれも底堅く推移しています。また、品目別に見ると、米国向け輸出では乗用車、アジア向け輸出ではIC等の輸出数量が堅調に推移しました。一方、輸入をみると、内需の弱含みを主因として輸入金額の減少が続いています。

金融面では、平成28年1月に日本銀行が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を発表しました。日本銀行による大量の長期国債の購入によって債券需給が逼迫していたところに、マイナス金利導入の影響も加わり、長期金利は2月に史上初のマイナス金利となりました。さらに、日銀は平成28年9月に、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を発表し、物価目標の早期達成に向けて、短期金利のみならず長期金利にも直接コントロールを及ぼすことにより、金融政策の軸足を「量」から「金利」へと移行させる新たな金融政策の導入に踏み切りました。為替レートは平成28年に入ると、海外経済に対する警戒感が強まり、円高が進行しました。さらに、6月のイギリスの国民投票でEU離脱派が過半数を占めるなど、グローバルな金融市場の先行き不透明感が強

まり、円は対ドルで急速な円高に見舞われることとなりました。しかし、11月の米国大統領選挙の結果を受け、将来の米国経済回復への期待感等からドルが買われ、為替レートは円安・ドル高基調に転じました。

平成28年12月末の日経平均株価は19,114円37銭（同年9月末比2,664円53銭高）、10年国債利回りは0.041%（同0.135ポイントの上昇）、為替は1ドル116円96銭（同15円61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、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、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。

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3四半期期末平均のLCRは155.8%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体制を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当第3四半期期末平均のLCRの状況は次のとおりです。

(単位：億円)

		月末平均 (自平成28年10月末 至平成28年12月末)
適格流動資産	(A)	23,176
資金流出額	(B)	32,572
資金流入額	(C)	17,700
連結流動性カバレッジ比率 (LCR)		
算入可能適格流動資産の合計額	(D)	23,176
純資金流出額	(B)-(C)	14,871
連結流動性カバレッジ比率	(D)/((B)-(C))	155.8%

<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405億円増加し、1兆1,737億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,791億円となりました。利益剰余金は、配当金支払いにより423億円減少したほか、親会社株主に帰属する四半期純利益を817億円計上した結果、前連結会計年度末比396億円増の7,236億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ9億円減少し、289億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3四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成28年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成29年2月8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28年10月1日～ 平成28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28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28年9月30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 55,675,000		
	(相互保有株式) 普通株式 1,626,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,689,500,000	1,689,500	
単元未満株式	普通株式 2,577,772		
発行済株式総数	1,749,378,772		
総株主の議決権		1,689,500	

(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474株が含まれております。

【自己株式等】

平成28年9月30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	55,675,000		55,675,000	3.18
計		55,675,000		55,675,000	3.18

(注) 1 当社は、単元未満自己株式474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1,626,000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3四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28年10月1日から平成28年12月31日まで)及び第3四半期連結累計期間(平成28年4月1日から平成28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28年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成28年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,334,784	3,665,549
預託金	323,761	325,629
受取手形及び売掛金	17,090	15,775
有価証券	2,091,090	1,880,300
トレーディング商品	7,501,242	6,860,985
商品有価証券等	4,017,267	3,747,322
デリバティブ取引	3,483,975	3,113,663
営業投資有価証券	127,210	125,972
投資損失引当金	11,053	11,043
営業貸付金	432,785	680,483
仕掛品	503	1,109
信用取引資産	203,376	183,380
信用取引貸付金	183,654	151,124
信用取引借証券担保金	19,722	32,255
有価証券担保貸付金	5,250,135	5,570,919
借入有価証券担保金	5,184,274	5,455,434
現先取引貸付金	65,861	115,484
立替金	20,670	25,503
短期貸付金	288	1,482
未収収益	33,574	31,770
繰延税金資産	9,401	4,578
その他の流動資産	517,421	583,386
貸倒引当金	722	502
流動資産計	19,851,563	19,945,280
固定資産		
有形固定資産	124,562	125,131
無形固定資産	84,879	88,528
のれん	7,972	6,840
その他	76,907	81,687
投資その他の資産	359,812	364,721
投資有価証券	324,456	330,735
長期貸付金	4,954	4,944
長期差入保証金	17,523	17,380
繰延税金資産	5,679	4,985
その他	1 7,942	1 7,410
貸倒引当金	1 743	1 735
固定資産計	569,255	578,381
資産合計	20,420,818	20,523,661

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成28年12月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	6,413	5,767
トレーディング商品	5,300,861	4,748,362
商品有価証券等	2,315,450	1,954,341
デリバティブ取引	2,985,410	2,794,021
約定見返勘定	427,257	36,463
信用取引負債	54,387	67,843
信用取引借入金	3,789	2,606
信用取引貸証券受入金	50,597	65,236
有価証券担保借入金	5,901,794	6,684,199
有価証券貸借取引受入金	5,893,795	6,565,234
現先取引借入金	7,999	118,964
銀行業における預金	2,928,630	3,081,426
預り金	214,498	303,308
受入保証金	512,426	445,080
短期借入金	820,019	1,049,468
コマーシャル・ペーパー	137,720	-
1年内償還予定の社債	232,594	279,911
未払法人税等	40,498	4,239
繰延税金負債	2,293	1,762
賞与引当金	30,058	19,718
その他の流動負債	218,411	181,549
流動負債計	16,827,865	16,909,102
固定負債		
社債	1,204,711	1,237,741
長期借入金	1,004,988	960,302
繰延税金負債	19,151	15,456
退職給付に係る負債	38,417	40,051
訴訟損失引当金	2,174	1,789
その他の固定負債	6,532	8,193
固定負債計	2,275,976	2,263,536
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,970	3,970
特別法上の準備金計	3,970	3,970
負債合計	19,107,812	19,176,608

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成28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	231,889	231,709
利益剰余金	683,939	723,618
自己株式	29,970	28,976
自己株式申込証拠金	2	15
株主資本合計	1,133,257	1,173,764
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	98,483	71,436
繰延ヘッジ損益	32,992	3,753
為替換算調整勘定	21,082	13,208
その他の包括利益累計額合計	86,574	80,890
新株予約権	8,958	8,213
非支配株主持分	84,214	84,183
純資産合計	1,313,005	1,347,052
負債・純資産合計	20,420,818	20,523,661

(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27年4月1日 至平成27年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)
営業収益		
受入手数料	225,717	196,819
委託手数料	55,374	44,275
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	24,623	21,802
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	28,903	23,378
その他の受入手数料	116,815	107,362
トレーディング損益	102,635	99,790
株券等トレーディング損益	19,181	15,051
債券・為替等トレーディング損益	83,454	84,738
営業投資有価証券関連損益	17,523	12,839
金融収益	106,753	103,623
その他の営業収益	50,502	37,102
営業収益計	503,132	450,175
金融費用	67,819	68,112
その他の営業費用	32,270	30,931
純営業収益	403,042	351,131
販売費・一般管理費		
取引関係費	54,981	50,870
人件費	139,600	131,434
不動産関係費	28,209	26,116
事務費	20,082	20,083
減価償却費	17,913	17,450
租税公課	7,122	7,582
貸倒引当金繰入れ	158	-
その他	8,120	8,641
販売費・一般管理費計	276,187	262,179
営業利益	126,854	88,952
営業外収益		
受取配当金	2,710	2,923
持分法による投資利益	5,730	6,820
為替差益	113	129
その他	2,288	3,006
営業外収益計	10,842	12,879
営業外費用		
支払利息	386	21
社債発行費	422	263
その他	368	318
営業外費用計	1,177	602
経常利益	136,519	101,229

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)
特別利益		
投資有価証券売却益	2,731	2,515
持分変動利益	3,092	768
貸倒引当金戻入額	633	-
新株予約権戻入益	-	1,228
事業再編関連費用戻入益	-	689
その他	1,107	158
特別利益計	7,565	5,361
特別損失		
減損損失	340	-
投資有価証券評価損	8	90
金融商品取引責任準備金繰入れ	2	-
事業再編関連費用	355	76
子会社清算損	-	769
MMF等償還関連費用	-	305
特別損失計	707	1,242
税金等調整前四半期純利益	143,377	105,347
法人税、住民税及び事業税	45,221	22,723
法人税等調整額	3,512	846
法人税等合計	41,709	23,569
四半期純利益	101,668	81,777
非支配株主に帰属する四半期純利益	6,131	69
親会社株主に帰属する四半期純利益	95,537	81,708

【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27年4月1日 至平成27年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)
四半期純利益	101,668	81,777
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	24,060	26,957
繰延ヘッジ損益	4,248	29,021
為替換算調整勘定	881	6,941
持分法適用会社に対する持分相当額	9	874
その他の包括利益合計	20,684	5,752
四半期包括利益	80,984	76,025
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	75,079	76,025
非支配株主に係る四半期包括利益	5,905	0

【注記事項】

(追加情報)

当第3四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日)
「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針 第26号平成28年3月28日)を第1四半期連結会計期間から適用しております。

(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28年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成28年12月31日)
投資その他の資産・その他	6,278百万円	6,351百万円

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28年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成28年12月31日)
従業員(借入金)	177百万円	145百万円
その他(債務)	1,749	
計	1,927	145

(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3四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日)
	21,290百万円	20,771百万円

(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27年4月1日 至 平成27年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日)
減価償却費	21,387百万円	20,575百万円
のれんの償却額	803	832

(株主資本等関係)

前第3四半期連結累計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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
平成27年10月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	29,215	17	平成27年9月30日	平成27年12月1日

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

- 2 基準日が当第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28年4月1日 至 平成28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28年5月18日 取締役会	普通株式	利益剰余金	20,308	12	平成28年3月31日	平成28年6月6日
平成28年10月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	22,018	13	平成28年9月30日	平成28年12月1日

- 2 基準日が当第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27年4月1日 至 平成27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	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	150,030	134,051	59,563	19,066	362,711	22,108	384,819
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	23,521	254	20,075	492	3,208	13,655	16,864
計	173,551	134,305	39,488	18,573	365,920	35,763	401,684
セグメント利益(経常利益)	55,752	36,046	23,998	16,818	132,615	4,956	137,572

(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	金額
報告セグメント計	132,615
「その他」の区分の利益	4,956
セグメント間取引消去	2
のれんの償却額	231
未実現損益の調整額	1,871
その他の調整額	1,052
四半期連結損益計算書の経常利益	136,519

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3四半期連結累計期間(自平成28年4月1日至平成28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	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	119,028	135,147	52,195	13,747	320,119	14,522	334,641
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	19,368	614	17,556	494	1,931	12,616	14,547
計	138,397	135,761	34,639	13,252	322,050	27,138	349,189
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())	20,675	49,008	19,944	11,488	101,116	880	100,236

(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	101,116
「その他」の区分の損失()	880
セグメント間取引消去	0
のれんの償却額	231
未実現損益の調整額	482
その他の調整額	1,707
四半期連結損益計算書の経常利益	101,229

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28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			
その他			
計	9	10	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	85,905	164,953	79,048
債券	1,971,485	2,033,359	61,874
国債・地方債等	803,866	855,954	52,087
社債	152,998	159,383	6,384
その他	1,014,619	1,018,022	3,402
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	39,414	39,414	
その他	89,415	86,485	2,929
計	2,186,220	2,324,213	137,993

- (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194百万円(うち、株券44百万円、その他150百万円)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28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	9	10	0
社債	19,153	19,099	54
その他			
計	19,163	19,109	54

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	83,375	166,265	82,890
債券	1,763,843	1,781,383	17,540
国債・地方債等	640,406	673,332	32,925
社債	131,291	134,743	3,452
その他	992,145	973,307	18,837
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	32,436	32,436	
その他	98,339	95,806	2,532
計	1,977,994	2,075,892	97,897

- (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3四半期連結累計期間において、時価のあるその他有価証券(株券)について26百万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28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	3,360,358	547,205	3,590,771	437,802
為替予約取引	3,554,129	88,721	3,007,791	73,740
先物・先渡取引	2,807,674	15,934	3,794,833	35,025
スワップ取引	62,211,819	2,812,682	61,767,886	2,410,479
その他	2,295,847	25,963	2,369,313	28,362
リスクリザーブ		6,531		

当第3四半期連結会計期間末(平成28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	2,957,541	504,181	3,209,014	413,699
為替予約取引	2,169,821	95,596	2,382,715	134,535
先物・先渡取引	3,841,668	37,495	2,819,917	25,986
スワップ取引	76,484,324	2,456,643	76,730,186	2,192,404
その他	1,827,961	25,154	1,984,725	27,395
リスクリザーブ		5,407		

(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3四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額	55.73円	48.26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)	95,537	81,708
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)	95,537	81,708
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,714,414	1,693,094
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	55.24円	47.97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)	15,205	10,139
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) 前第3四半期連結累計期間において、従業員持株E S O P信託口が保有する当社株式を、「1株当たり四半期純利益金額」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(3,103千株)。なお、当該信託は平成27年7月に終了しております。

(重要な後発事象)

当社は、平成29年1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	2,700万株(上限) (発行済株式総数(自己株式を除く)に対する割合1.59%)
株式の取得価額の総額	200億円(上限)
期間	平成29年2月10日から平成29年4月25日
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28年10月28日開催の取締役会において、平成28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	22,018百万円
1株当たりの金額	13円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	平成28年12月1日

(注) 平成28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29年2月8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 小倉加奈子 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28年4月1日から平成29年3月31日までの連結会計年度の第3四半期連結会計期間（平成28年10月1日から平成28年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28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28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. 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。