

【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8月9日

【四半期会計期間】 第81期第1四半期  
(自 平成29年4月1日 至 平成29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80期 第1四半期 連結累計期間	第81期 第1四半期 連結累計期間	第80期
会計期間	自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日	自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30日	自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日
営業収益 (百万円)	151,859	159,652	616,497
純営業収益 (百万円)	114,049	108,543	472,750
経常利益 (百万円)	32,537	25,153	135,623
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益 (百万円)	24,571	19,395	104,067
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	24,697	24,504	84,835
純資産額 (百万円)	1,267,304	1,340,130	1,343,433
総資産額 (百万円)	21,419,907	19,815,830	19,827,296
1株当たり四半期(当期)純利益金額 (円)	14.52	11.63	61.53
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額 (円)	14.43	11.55	61.14
自己資本比率 (%)	5.5	6.3	6.3

(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80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。

### 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1,596億円（前年同四半期比5.1%増）となりました。受入手数料は総額で697億円（同13.1%増）、トレーディング損益が240億円（同27.9%減）となりました。金融収支は42億円（同53.1%減）、純営業収益は1,085億円（同4.8%減）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費166億円（同1.5%増）、人件費432億円（同0.1%減）などにより、合計で871億円（同1.3%増）となりました。

この結果、経常利益は251億円（同22.7%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193億円（同21.1%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28年 6月期	平成29年 6月期	対前年 増減率	平成28年 6月期	平成29年 6月期	対前年 増減率
リテール部門	45,013	48,833	8.5%	6,566	10,391	58.2%
ホールセール部門	43,427	35,280	18.8%	14,899	6,438	56.8%
アセット・マネジメント部門	11,623	12,011	3.3%	6,748	7,200	6.7%
投資部門	4,956	1,801	63.7%	4,624	1,417	69.4%
その他・調整等	9,028	10,618		301	294	
連結計	114,049	108,543	4.8%	32,537	25,153	22.7%

#### [リテール部門]

外国株式の取引が拡大したことや、株式投資信託の販売額が増加したことなどにより、純営業収益は488億円（前年同四半期比8.5%増）、経常利益は103億円（同58.2%増）となりました。

#### [ホールセール部門]

投資銀行部門において国内外のM&A案件を積み上げたものの、債券トレーディング収益が減少したことなどにより、純営業収益は352億円（同18.8%減）、経常利益は64億円（同56.8%減）となりました。

#### [アセット・マネジメント部門]

株高基調や堅調な資金流入により公募株式投資信託等の運用資産残高が増加したことに加え、不動産アセットマネジメントビジネスにおいても運用資産残高を拡大したことなどから、純営業収益は120億円（同3.3%増）、経常利益は72億円（同6.7%増）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18億円（同63.7%減）、経常利益は14億円（同69.4%減）となり、大型投資案件の回収が寄与した前年同四半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1四半期連結会計期間末の総資産は19兆8,158億円（前連結会計年度末比114億円減）となりました。内訳は流動資産が19兆2,371億円（同217億円減）であり、このうち現金・預金が4兆1,488億円（同3,202億円増）、有価証券が1兆6,541億円（同879億円減）、トレーディング商品が6兆5,281億円（同181億円減）、有価証券担保貸付金が5兆20億円（同3,034億円減）となっております。固定資産は5,786億円（同103億円増）となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は18兆4,757億円（同81億円減）となりました。内訳は流動負債が15兆8,726億円（同1,352億円減）であり、このうちトレーディング商品が4兆2,136億円（同4,449億円減）、有価証券担保借入金が6兆520億円（同331億円増）、銀行業における預金が3兆1,765億円（同1,908億円増）、短期借入金が1兆193億円（同1,004億円増）となっております。固定負債は2兆5,991億円（同1,270億円増）であり、このうち社債が1兆2,966億円（同772億円増）、長期借入金が1兆2,222億円（同429億円増）となっております。

純資産合計は1兆3,401億円（同33億円減）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633億円（同34億円増）、非支配株主持分は837億円（同28百万円減）となっております。また、繰延ヘッジ損益は2億円（同6億円減）、為替換算調整勘定は92億円（同24億円増）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>

世界経済は安定感を増しつつあります。米国では、トランプ政権の政権運営能力に対する懸念が払拭されないものの、米国は政策に依存しない景気拡大局面にあるように見えます。また、欧州では、ユーロ圏の景気拡大がより確実性を増しており、足下でEUの政治安定化が進展したことも、世界経済にとってプラスの材料になっています。現在の世界経済の好調さは、米国・ユーロ圏・中国の三極に支えられていますが、ユーロ圏は、米国と比べ景気循環面で成熟化が進んでいるとは言えず、また中国と比べ経済政策への依存度は低いと言えます。

米国経済は平成29年1 - 3月期に、これまで米国経済を牽引してきた個人消費の伸びが鈍化し、実質GDP成長率は前期比年率1.2%増と低成長に留まりました。しかし、雇用・所得環境は引き続き安定しており、4 - 6月期の成長率は個人消費を中心に再び加速し、1 - 3月期の落ち込みは一時的なものであったと見られます。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）は平成28年12月に続いて、平成29年3月と6月にも政策金利を引き上げました。さらに、平成29年内にはFRBが保有する資産の規模縮小を開始することを明言し、具体的な縮小ペースを示しました。一方、米国株式市場では、4月にかけて調整する局面が見られたものの、底堅い米国経済を材料に騰勢が続ぎ、NYダウ平均株価は6月半ば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などを背景に、緩やかながら安定した成長が続いています。平成29年1 - 3月期のユーロ圏の実質GDP成長率は、前期比0.6%増と16四半期連続のプラス成長となりました。個人消費は低金利や低インフレ、雇用環境の改善の追い風を受けて景気拡大の主役になる一方、消費に比べて回復が遅れていた固定資本形成の伸びが足下では高まるなど、内需中心にバランスの取れた形で成長しています。また、フランスでは大統領選挙に続いて6月の議会選挙においても、マクロン大統領が勝利したことで、政治リスクへの懸念が後退しました。他方、イギリスの総選挙では、メイ首相率いる保守党が予想外の過半数割れとなり、6月に始まったイギリスとEU（欧州連合）との離脱交渉の行方は混沌としています。金融面では、ECBが平成29年4月から量的緩和の規模を縮小させる一方、資産買取を少なくとも同年12月末まで継続する方針を確認しています。

新興国経済についても、平成28年をボトムにして経済成長率が加速しています。中国の実質GDP成長率は、平成28年は前年比6.7%増でしたが、平成29年1 - 3月期及び4 - 6月期は各々6.9%増と平成29年に入って徐々に加速しました。政府が実施する政策効果によって、景気は安定した成長を続けています。足下では、サービス消費を中心に堅調な個人消費が景気を下支えする一方、固定資産投資の伸びはやや減速しています。4月以降の金

利上昇や大型国有企業への優先的な貸出によって、民間部門、特に中小企業の資金調達が難しくなっています。具体的には、インフラ投資や不動産開発投資の上昇ペースが鈍化しています。また、アジアを中心とした新興国の貿易量（特に輸入サイド）が、平成29年1 - 3月期にかけて大きく加速しており、新興国の景気は持ち直しの動きが見られます。

#### <日本の状況>

日本経済は「踊り場」局面から脱し、緩やかに回復を続けています。堅調な外需に加えて個人消費の底入れ等に押し上げられて、鉱工業生産は平成28年度の夏場以降、持ち直しています。一方、非製造業の活動を示す第三次産業活動指数は、足下で対個人サービスや対事業所サービスに改善の兆しは見られますが、平成28年度後半以降、概ね横ばいで推移しています。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は、雇用・所得環境の着実な改善を背景に、緩やかに拡大しています。失業率が3%前後まで低下する一方、求人倍率が歴史的な高水準で推移するなど労働需給は一段とタイトになっており、非製造業を中心に人手不足感は依然として強く、今後もタイトな状況は続く見通しです。マクロ経済全体で見た賃金は緩やかに増加し、消費者マインドは持ち直しているものの、可処分所得の伸び悩みや将来不安などを背景に、家計は引き続き支出に対する慎重姿勢を崩していません。また、住宅投資については、低い住宅ローン金利や、相続税対策などの特殊要因を受けて、高水準を維持しつつも、平成28年度後半以降は横ばいで推移しています。

一方、企業の設備投資は、平成29年1 - 3月期に前期比+0.6%と2四半期連続で増加するなど持ち直しています。企業収益が過去最高水準を維持しているなか、人手不足に対応した合理化・省力化投資や、更新投資に積極的な動きが見られます。また、日銀短観（6月調査）によると、平成29年度の設備投資計画は、大企業製造業を中心に増加が見込まれる一方、中小企業は、引き続き設備投資に対する慎重な姿勢を示しています。

外需に目を向けると、海外経済が緩やかに拡大していることを背景に、輸出は増加基調にあります。地域別に輸出の動向を見ると、米国向けが横ばいで推移しているほか、EU向けは堅調に持ち直している一方、アジア向けは、足下で弱い動きとなっています。米国の自動車販売に弱さが見られることのほか、アジアにおいては、世界的なITサイクルによる電子部品や半導体製造装置、中国向けの建機等が堅調に推移してきたものの、足下で一服感が見られることが懸念されます。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、平成28年度後半から持ち直しの動きが見られます。ただ、足下では横ばいで推移しています。

金融面では、日本銀行が、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、短期金利に加えて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。この結果、長期金利（10年国債利回り）はマイナス圏から脱し、0.0%台で安定的に推移しました。平成29年4月半ばから長期金利は上昇基調にあるものの、0.0%~0.1%という狭いレンジに留まっており、日本銀行の積極的な関与の下で推移しています。為替レートは、平成29年に入ると、米国の新政権に対する不透明感などが意識されるに伴い、4月半ばにかけて緩やかに円高が進行しました。その後、円は対ドルで円安・ドル高基調に転じる場面も見られたものの、4 - 6月期で見れば、108円台~114円台という範囲で推移しました。また、対ユーロでは、懸念されていた欧州の政治リスクが後退したことから、対ドルを上回るペースで円安が進行しました。

平成29年6月末の日経平均株価は20,033円43銭（同年3月末比1,124円17銭高）、10年国債利回りは0.086%（同0.019ポイントの上昇）、為替は1ドル112円06銭（同26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、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145.8%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29年4月 至平成29年6月)
適格流動資産	(A)	24,995
資金流出額	(B)	33,696
資金流入額	(C)	16,553
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)	24,995
純資金流出額	(B)-(C)	17,142
連結流動性カバレッジ比率	(D)/((B)-(C))	145.8%

#### <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77億円減少し、1兆1,758億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,780億円となりました。利益剰余金は親会社株主に帰属する四半期純利益を193億円計上したほか、配当金支払いにより218億円減少したことなどにより、前連結会計年度末比19億円減の7,163億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ57億円増加し、185億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29年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成29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	1,699,378,772	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1,000株 あります。
計	1,699,378,772	1,699,378,772		

##### (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29年4月1日～ 平成29年6月30日		1,699,378		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29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29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 22,136,000		
	(相互保有株式) 普通株式 1,218,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,673,468,000	1,673,468	
単元未満株式	普通株式 2,556,772		
発行済株式総数	1,699,378,772		
総株主の議決権		1,673,468	

- (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669株が含まれております。

【自己株式等】

平成29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	22,136,000		22,136,000	1.30
計		22,136,000		22,136,000	1.30

- (注) 1 当社は、単元未満自己株式669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1,218,000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29年4月1日から平成29年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(平成29年4月1日から平成29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29年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成29年6月30日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	3,828,674	4,148,881
預託金	336,338	319,731
受取手形及び売掛金	16,649	15,970
有価証券	1,742,127	1,654,188
トレーディング商品	6,546,229	6,528,126
商品有価証券等	3,853,260	3,818,337
デリバティブ取引	2,692,968	2,709,789
営業投資有価証券	125,040	162,675
投資損失引当金	11,052	10,976
営業貸付金	655,709	667,442
仕掛品	1,285	2,388
信用取引資産	202,530	196,752
信用取引貸付金	174,524	169,087
信用取引借証券担保金	28,006	27,664
有価証券担保貸付金	5,305,518	5,002,031
借入有価証券担保金	5,005,170	4,992,859
現先取引貸付金	300,347	9,172
立替金	26,345	23,583
短期貸付金	606	368
未収収益	35,380	34,050
繰延税金資産	8,023	7,602
その他の流動資産	440,034	484,862
貸倒引当金	502	505
流動資産計	19,258,940	19,237,173
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	124,980	125,090
無形固定資産	90,596	91,655
のれん	6,103	5,900
その他	84,493	85,755
投資その他の資産	352,779	361,909
投資有価証券	318,751	327,815
長期貸付金	4,939	4,935
長期差入保証金	17,298	17,312
繰延税金資産	4,796	4,716
その他	1 7,655	1 7,804
貸倒引当金	1 661	1 673
固定資産計	568,356	578,656
資産合計	19,827,296	19,815,830

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成29年 3月31日)	当第 1 四半期連結会計期間 (平成29年 6月30日)
<b>負債の部</b>		
流動負債		
支払手形及び買掛金	8,166	5,109
トレーディング商品	4,658,595	4,213,673
商品有価証券等	2,261,720	1,816,218
デリバティブ取引	2,396,874	2,397,454
約定見返勘定	216,836	150,369
信用取引負債	62,377	71,475
信用取引借入金	3,086	3,309
信用取引貸証券受入金	59,290	68,166
有価証券担保借入金	6,018,813	6,052,005
有価証券貸借取引受入金	5,909,682	5,844,395
現先取引借入金	109,130	207,610
銀行業における預金	2,985,733	3,176,583
預り金	256,873	314,434
受入保証金	418,039	406,227
短期借入金	918,954	1,019,371
1年内償還予定の社債	278,237	303,421
未払法人税等	15,084	3,384
繰延税金負債	1,790	1,489
賞与引当金	30,872	11,652
その他の流動負債	137,494	143,436
流動負債計	16,007,868	15,872,634
固定負債		
社債	1,219,344	1,296,626
長期借入金	1,179,264	1,222,212
繰延税金負債	10,234	16,821
退職給付に係る負債	39,791	40,421
訴訟損失引当金	15,903	15,867
その他の固定負債	7,527	7,186
固定負債計	2,472,065	2,599,135
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,929	3,929
特別法上の準備金計	3,929	3,929
負債合計	18,483,863	18,475,700

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成29年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成29年6月30日)
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,712	230,682
利益剰余金	718,238	716,320
自己株式	12,719	18,509
自己株式申込証拠金	7	4
株主資本合計	1,183,636	1,175,894
<b>その他の包括利益累計額</b>		
その他有価証券評価差額金	59,922	63,327
繰延ヘッジ損益	435	247
為替換算調整勘定	6,896	9,297
その他の包括利益累計額合計	67,254	72,377
新株予約権	8,729	8,072
非支配株主持分	83,813	83,785
純資産合計	1,343,433	1,340,130
負債・純資産合計	19,827,296	19,815,830

(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28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第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)
<b>営業収益</b>		
受入手数料	61,693	69,746
委託手数料	13,888	16,214
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	5,366	5,740
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	6,320	11,143
その他の受入手数料	36,119	36,648
トレーディング損益	33,379	24,068
株券等トレーディング損益	2,063	7,775
債券・為替等トレーディング損益	31,315	16,293
営業投資有価証券関連損益	4,802	1,746
金融収益	35,726	43,835
その他の営業収益	16,257	20,255
営業収益計	151,859	159,652
金融費用	26,633	39,566
その他の営業費用	11,177	11,542
純営業収益	114,049	108,543
<b>販売費・一般管理費</b>		
取引関係費	16,385	16,638
人件費	43,240	43,215
不動産関係費	8,744	8,818
事務費	6,233	6,450
減価償却費	5,897	6,117
租税公課	2,559	2,754
貸倒引当金繰入れ	5	0
その他	2,963	3,126
販売費・一般管理費計	86,029	87,121
営業利益	28,019	21,422
<b>営業外収益</b>		
受取配当金	1,238	1,073
持分法による投資利益	2,670	2,140
為替差益	-	61
その他	703	1,178
営業外収益計	4,613	4,454
<b>営業外費用</b>		
支払利息	5	8
社債発行費	21	635
その他	68	79
営業外費用計	95	723
経常利益	32,537	25,153

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第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)
<b>特別利益</b>		
固定資産売却益	-	814
投資有価証券売却益	-	813
新株予約権戻入益	1,228	894
特別利益計	1,228	2,522
<b>特別損失</b>		
固定資産除売却損	-	118
事業再編関連費用	44	39
MMF等償還関連費用	162	-
特別損失計	207	158
税金等調整前四半期純利益	33,559	27,516
法人税、住民税及び事業税	5,495	1,682
法人税等調整額	3,479	6,424
法人税等合計	8,974	8,106
四半期純利益	24,584	19,410
非支配株主に帰属する四半期純利益	13	14
親会社株主に帰属する四半期純利益	24,571	19,395

【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28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第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)
四半期純利益	24,584	19,410
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	15,134	2,590
繰延ヘッジ損益	3,786	658
為替換算調整勘定	29,940	2,662
持分法適用会社に対する持分相当額	419	499
その他の包括利益合計	49,281	5,093
四半期包括利益	24,697	24,504
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	24,531	24,519
非支配株主に係る四半期包括利益	165	15



【注記事項】

(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29年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成29年6月30日)
投資その他の資産・その他	6,313百万円	6,300百万円

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29年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成29年6月30日)
従業員(借入金)	135百万円	123百万円

(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28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第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)
	11,248百万円	10,274百万円

(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28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第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)
減価償却費	6,839百万円	6,988百万円
のれんの償却額	290	248

(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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

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  
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28年4月1日至平成28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	38,491	43,146	17,562	5,124	104,324	4,143	108,468
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	6,522	280	5,939	168	695	4,804	5,499
計	45,013	43,427	11,623	4,956	105,020	8,947	113,968
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( ))	6,566	14,899	6,748	4,624	32,838	927	31,911

(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	32,838
「その他」の区分の損失( )	927
のれんの償却額	77
未実現損益の調整額	132
その他の調整額	835
四半期連結損益計算書の経常利益	32,537

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。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成29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	56,220	56,183	37
その他			
計	56,230	56,193	36

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	79,046	148,398	69,351
債券	1,630,806	1,644,245	13,438
国債・地方債等	640,094	664,765	24,670
社債	141,708	144,771	3,062
その他	849,003	834,708	14,294
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	32,907	32,907	
その他	45,037	44,125	912
計	1,787,798	1,869,676	81,877

- (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6百万円(うち、株券6百万円)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29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	78,710	78,618	91
その他			
計	78,719	78,628	91

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	80,980	155,217	74,237
債券	1,449,866	1,458,497	8,631
国債・地方債等	528,099	542,320	14,220
社債	152,854	155,546	2,691
その他	768,911	760,630	8,281
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	31,524	31,524	
その他	123,084	125,333	2,248
計	1,685,455	1,770,571	85,116

- (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29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	3,198,443	455,875	3,376,422	370,000
為替予約取引	1,896,320	56,372	1,675,688	52,311
先物・先渡取引	3,794,512	26,624	2,911,364	18,735
スワップ取引	82,096,964	2,131,829	82,158,316	1,925,183
その他	2,028,618	27,982	2,163,102	30,643
リスクリザーブ		5,717		

当第1四半期連結会計期間末(平成29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	3,290,349	463,614	3,289,062	390,542
為替予約取引	2,001,207	55,282	1,898,978	56,134
先物・先渡取引	4,303,551	24,841	2,383,885	15,716
スワップ取引	85,348,287	2,147,148	87,132,975	1,908,160
その他	1,621,812	24,244	1,692,719	26,899
リスクリザーブ		5,341		

(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28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第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) 1株当たり四半期純利益金額	14.52円	11.63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)	24,571	19,395
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)	24,571	19,395
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,692,253	1,668,395
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	14.43円	11.55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)	10,404	10,546
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		

(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29年5月16日開催の取締役会において、平成29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 21,804百万円  
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29年6月5日

(注) 平成29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29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 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29年4月1日から平成30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29年4月1日から平成29年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成29年4月1日から平成29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29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。