

【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】 2019年8月6日

【四半期会計期間】 第83期第1四半期
(自 2019年4月1日 至 2019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82期 第1四半期 連結累計期間	第83期 第1四半期 連結累計期間	第82期
会計期間		自 2018年4月1日 至 2018年6月30日	自 2019年4月1日 至 2019年6月30日	自 2018年4月1日 至 2019年3月31日
営業収益	(百万円)	175,175	181,341	720,586
純営業収益	(百万円)	115,606	107,123	441,240
経常利益	(百万円)	25,860	17,922	83,159
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	18,534	16,066	63,813
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	25,434	3,367	48,194
純資産額	(百万円)	1,371,244	1,245,624	1,256,430
総資産額	(百万円)	20,853,852	22,896,425	21,126,706
1株当たり四半期(当期)純利益	(円)	11.45	10.26	39.95
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	11.38	10.21	39.72
自己資本比率	(%)	6.1	5.4	5.9

(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82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連結会計年度末比1兆7,697億円(8.4%)増加の22兆8,964億円となりました。内訳は流動資産が同1兆7,065億円(8.4%)増加の22兆1,121億円であり、このうち現金・預金が同1,557億円(3.8%)増加の4兆3,090億円、トレーディング商品が同1兆2,544億円(18.7%)増加の7兆9,704億円、営業貸付金が同786億円(5.0%)増加の1兆6,434億円、有価証券担保貸付金が同2,048億円(3.4%)増加の6兆1,786億円となっております。固定資産は同631億円(8.8%)増加の7,843億円となっております。

<負債の部・純資産の部>

負債合計は前連結会計年度末比1兆7,805億円(9.0%)増加の21兆6,508億円となりました。内訳は流動負債が同1兆8,471億円(10.8%)増加の18兆9,291億円であり、このうち約定見返動定が同7,333億円(286.7%)増加の9,891億円、有価証券担保借入金が同7,990億円(13.4%)増加の6兆7,469億円、銀行業における預金が同2,159億円(5.9%)増加の3兆8,484億円となっております。固定負債は同666億円(2.4%)減少の2兆7,177億円であり、このうち社債が同533億円(3.9%)減少の1兆3,085億円、長期借入金が同322億円(2.4%)減少の1兆3,045億円となっております。

純資産合計は同108億円(0.9%)減少の1兆2,456億円となりました。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160億円計上したほか、配当金140億円の支払いを行ったこと等により、同19億円(0.2%)増加の8,077億円となっております。自己株式の控除額は同1億円(0.1%)減少の872億円、その他有価証券評価差額金は同12億円(2.7%)減少の463億円、為替換算調整勘定は同100億円減少の40億円、非支配株主持分は同9百万円(0.3%)減少の32億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3.5%増の1,813億円、純営業収益は同7.3%減の1,071億円となりました。

受入手数料は649億円と、同12%の減収となりました。委託手数料は、株式取引が減少したことにより、同25.1%減の124億円となりました。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た前年同期と比べ、引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料が、同39.5%減の69億円となりました。

トレーディング損益は、金利動向を捉えたことで債券収益が増加し、同5.2%増の279億円となりました。

販売費・一般管理費は同1.3%増の947億円となりました。取引関係費は同0.9%減の178億円、人件費は国内における賞与や退職給付費用が減少した一方で、海外子会社で業績に連動する賞与が増加したことから同0.1%増の469億円、減価償却費はシステムの更改や、海外子会社における新リース基準の適用により同23.2%増の77億円となっております。

以上より、経常利益は同30.7%減の179億円となりました。

これに特別損益を加え、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13.3%減の160億円となりました。

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()			
	2018年 6月期	2019年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率	2018年 6月期	2019年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率
リテール部門	50,609	43,095	14.8%	40.2%	9,894	2,680	72.9%	15.0%
ホールセール部門	39,798	39,420	0.9%	36.8%	6,996	5,572	20.4%	31.1%
グローバル・ マーケット	28,078	27,310	2.7%	25.5%	5,849	4,541	22.4%	25.3%
グローバル・イン ベストメント・ バンキング	11,719	12,109	3.3%	11.3%	823	924	12.2%	5.2%
アセット・マネジ メント部門	12,268	11,352	7.5%	10.6%	7,488	6,209	17.1%	34.6%
投資部門	2,435	1,683	30.9%	1.6%	1,760	924	47.5%	5.2%
その他・調整等	10,494	11,571	-	10.8%	278	2,535	-	14.1%
連結計	115,606	107,123	7.3%	100.0%	25,860	17,922	30.7%	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お客様の資産管理・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、お客様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、お客様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、ラップ口座サービスの契約資産残高が過去最高水準の2兆円突破後も堅調に推移したものの、低調な顧客アクティビティから日本株収益が減少しました。また、外債の販売額減少等により、債券収益も減少しました。

その結果、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14.8%減の430億円、経常利益は同72.9%減の26億円となりました。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40.2%及び15.0%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アドバイザリ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アドバイザリ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・マーケットは減収減益となりました。フィクスト・インカム収益は、金利低下とイールドカーブのフラットニングのトレンドを捉えたこと等から増収となりましたが、エクイティ収益は、昨年度からの米中貿易摩擦懸念等による不透明な市場環境が継続したことにより、日本株における顧客のアクティビティが低調に推移し、減収となりました。その結果、当第1四半期連結累計期間の純営業収益は前年同期比2.7%減の273億円、経常利益は同22.4%減の45億円となりました。

グローバル・インベストメント・バンキングは増収増益となりました。エクイティの引受け・売出し手数料は、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前年同期と比べ、減収となりました。その一方で、M&Aビジネスにおいては、DC Advisoryが関与する海外・クロスボーダー案件や、国内案件が収益に貢献し、増収となりました。これらの結果、グローバル・インベストメント・バンキングの純営業収益は前年同期比3.3%増の121億円、経常利益は同12.2%増の9億円となりました。

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0.9%減の394億円、経常利益は同20.4%減の55億円となりました。ホールセール部門の当第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36.8%及び31.1%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大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、連結子会社の大和リアル・エステート・アセット・マネジメントの不動産等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三井住友D Sアセットマネジメント（注）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、同じく持分法適用関連会社である大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。大和リアル・エステート・アセット・マネジメント及び大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の影響を受けます。

当第1四半期連結累計期間において、大和証券投資信託委託では、R&Iファンド大賞において表彰された複数のファンド、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資金流入は継続したものの、市場環境悪化の影響を受け、公募投資信託の運用資産残高は前連結会計年度末比0.3%減の15.9兆円となりました。不動産アセット・マネジメントでは、大和リアル・エステート・アセット・マネジメントが運用する2019年6月末時点の運用資産残高が0.9兆円となっています。

その結果、当第1四半期連結累計期間のアセット・マネジメント部門における純営業収益は前年同期比7.5%減の113億円、経常利益は同17.1%減の62億円となりました。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34.6%でした。

（注）当社の持分法適用関連会社であった大和住銀投信投資顧問株式会社は、三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、2019年4月1日に三井住友D Sアセットマネジメント株式会社となりました。

[投資部門]

投資部門は主に、連結子会社である大和企业投資、大和P Iパートナーズ及び大和エナジー・インフラで構成されます。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、大和企业投資では、引き続き国内外の成長企業への投資を行ったほか、大和P Iパートナーズでは、ローン、不良債権、不動産、国内外のPE投資を着実に実行しました。また、大和エナジー・インフラでは、洋上太陽光発電事業への出資を行うなど、持続可能な開発目標（SDGs）に資するエネルギー・インフラ関連投資を拡大しました。

当第1四半期連結累計期間は、前年同期にあった大型のエクイティ投資先の売却益がなかったことなどから、投資部門の純営業収益は前年同期比30.9%減の16億円、経常利益は同47.5%減の9億円となりました。投資部門の当第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1.6%及び5.2%でした。

[その他]

その他の事業には、主に大和総研と大和総研ビジネス・イノベーションからなる大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、大和ネクスト銀行による銀行業務などが含まれます。

大和総研は、当社グループのシステム開発を着実に実行したほか、社内外の連携強化による、付加価値の高い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。

大和総研ビジネス・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。

大和ネクスト銀行では、引き続き、銀行代理業者である大和証券と連携して各種キャンペーンを実施し、当第1四半期連結会計期間末の預金残高（譲渡性預金含む）は前連結会計年度末比5.5%増の3兆8,814億円、銀行口座数は同0.6%増の137万口座となりました。

その結果、その他・調整等に係る純営業収益は115億円（前年同期104億円）、経常利益は25億円（前年同期は2億円の経常損失）となりました。その他・調整等の当第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10.8%及び14.1%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

当第1四半期連結累計期間において、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について、第82期有価証券報告書の「目標とする経営指標の達成状況等」に記載した経営指標から重要な変更及び新たに生じた事項はありません。

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、IMF（国際通貨基金）などの国際機関は、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たことで米中間の貿易摩擦が激化し、世界経済の先行きに対する下振れリスクが一段と高まっているとみています。IMFによると、2018年の世界経済成長率は3.6%と前年を下回る伸びにとどまり、2019年は3.2%とさらに鈍化すると見込まれています。地域別にみると、先進国では米国やユーロ圏、イギリスの減速を主因に、2018年の2.2%の成長から、2019年は1.9%まで成長率が低下すると予想されています。新興国についても、2019年は下記のように幅広い地域で減速する見通しです。

米国経済では、2019年1 - 3月期の実質GDP成長率が前期比年率3.1%増と堅調な伸びとなりました。政府閉鎖や悪天候などの一時的な要因が下押し要因となり、個人消費や設備投資といった民間需要が減速する一方で、輸入の減少に伴う外需の寄与や在庫の増加、政府支出が押し上げに寄与しました。4 - 6月期になると、一時的な要因による下押しがなくなったことに加えて、雇用・所得環境の改善を背景に、個人消費に持ち直しの動きが見られました。しかし、輸出の減少や在庫の減少、設備投資の停滞が足を引っ張り、4 - 6月期の実質GDP成長率は前期比年率2.1%増と伸び率が縮小しました。トランプ大統領の政権運営は米国内外の混乱を招いており、先行きに対する懸念が高まっています。米国内では、政府機関の一部閉鎖が起こったように、野党である民主党とトランプ大統領の対立は激しさを増しています。対外的には、トランプ大統領の強硬姿勢は、中国にとどまらず、EU（欧州連合）やメキシコ、カナダ、日本などに対しても広がっています。メキシコ、カナダと新たな貿易協定の合意が成立するなど、一定の成果を挙げているものの、中国との間では互いに追加関税を掛け合う状態が続いており、対立解消に向けた糸口が見えない状況にあります。米中対立をはじめとする通商政策をめぐる不透明感、すでに企業景況感を悪化させる要因になっており、中国からの輸入品に対する追加関税の対象が更に拡大すれば、輸入コストの増加による家計や企業の負担が増加し、米国経済への悪影響が一層拡大する恐れがあります。

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）が2018年まで利上げを続けてきました。しかし、米国経済、世界経済の減速懸念が強まったことを受けて、2019年に入ると、景気に配慮した「ハト派」の姿勢にシフトしました。3月のFOMC（連邦公開市場委員会）では、2019年中の利上げを見送る見通しを示すと同時に、バランスシート縮小を9月末で停止することが決定されました。また6月には、FOMC参加者のおよそ半数が2019年内に利下げを実施すべきであると考えていることが明らかとなり、「ハト派」姿勢がより鮮明となりました。

欧州経済（ユーロ圏経済）では、緩やかな成長が続いているものの、成長ベースが減速傾向にあります。2018年の後半にかけては、米中の貿易摩擦の激化に加え、ユーロ圏と関係が深いトルコなどの新興国の景気減速によって外需が落ち込み、イタリアやドイツを中心に減速がみられました。2019年1 - 3月期には、イギリスのEU離脱に備えた買いだめなどもあり、ドイツやスペイン、フランス等の主要国において個人消費を中心に内需が持ち直し、ユーロ圏の実質GDP成長率は前期比年率1.8%増へと加速しました。しかし、米中貿易摩擦やイギリスのEU離脱問題の混迷に加えて、EUと米国の通商交渉も控える中、外需の先行きが不透明な状況が続いています。また、1 - 3月期に持ち直しが見られた内需も再び減速感が強まっており、4 - 6月期の実質GDP成長率は前期比年率0.8%増と伸び率が縮小しました。

金融面では、ECB（欧州中央銀行）は、2018年末まで非伝統的な金融緩和政策の軌道修正を進めてきました。しかしながら、世界経済の不透明さが増し、ユーロ圏の景気減速が鮮明になる中で、2019年3月、ECBは次の利上げの可能性を2019年秋から2020年以降に先送りしました。さらに6月にはこれを2020年後半まで先送りすることを決定し、ECBによる非伝統的な金融緩和終了に向けた議論は後退し、当面、金融緩和が継続されることが見込まれます。

新興市場国・発展途上国経済は、2018年の実質GDP成長率が4.5%と、3年ぶりに成長が鈍化しました。その大きな要因となったのは、世界第2位の経済規模を持つ中国で、2018年1 - 3月期の6.8%をピークに成長率の低下傾向が続いてきていることです。2019年に入ると、中国の1 - 3月期の実質GDP成長率は6.4%と、2018年10 - 12月期から横ばいとなり、成長率の低下に一旦歯止めがかかったように見えました。ただし、これは個人消費や総資本形成などの内需の鈍化により輸出以上に輸入が落ち込んだことが外需の寄与を拡大させたためであり、米国

との貿易摩擦の激化が中国経済に打撃を及ぼしていることが確認される内容でした。4 - 6期の実質GDP成長率は6.2%と、内需の減速によってさらに伸びが低下する結果となり、中国経済の減速傾向に歯止めはかかっていません。このため、中国政府は、貿易摩擦をきっかけとした景気失速を回避すべく財政・金融の両面から大規模な経済対策を打ち出しており、内需を下支えする効果が期待されます。米中を中心とした貿易摩擦の激化の影響は世界全体に及んでおり、中国以外の新興国経済にも大きな打撃を与えています。新興国全体では、上記のような中国の成長率の鈍化に加えて、ASEANやロシアなどの減速により、2019年の成長率は4.1%と、2018年の4.5%から成長率が低下する見通しです。

他方、世界経済の減速を受けて、FRBをはじめとする各国中央銀行による金融緩和への期待が高まり、世界的に金利が低下したことは、新興国への資金流入を促し、新興国経済を下支えする要因になると期待されています。また、経済対策によって中国経済の減速に歯止めがかかれば、その効果は他の新興国へも波及するとみられることから、中国の経済対策への期待感が高まっています。

<日本の状況>

日本経済は、緩やかな回復基調が続いていますが、2019年に入って足踏みが見られています。2019年1 - 3月期の実質GDP成長率は前期比年率2.2%増と底堅い伸びとなりましたが、その内容をみると、輸入の減少に伴う外需の寄与が成長率を大きく押し上げており、在庫要因を除くと内需はほぼゼロ成長にとどまりました。

GDPに占めるウエイトが大きい個人消費は、前期に好調だった自動車販売の反動減が響き、2019年1 - 3月期は2四半期ぶりのマイナス成長となりました。しかし、個人消費の裏付けとなる雇用・所得環境の着実な改善が続いているため、4 - 6月期には持ち直しの動きが見られています。消費者マインドについては、米中貿易摩擦に対する懸念などから弱含みが続いているようですが、企業による高水準の採用意欲を背景とした雇用・所得環境の改善が持続し、個人消費を下支えすることが期待されます。

住宅投資は、低金利の継続や雇用・所得環境の改善を受けて、2018年7 - 9月期以降、3四半期連続で増加が続いています。2019年4 - 6月期に入って、住宅着工は弱含んでいます。これは相続税対策を見込んだ貸家需要の減少基調が影響したと考えられます。10月の消費増税に向けて、住宅投資では増税前の駆け込み需要が見込まれます。ただし、住宅購入支援策により、駆け込み需要は過去の消費増税時に比べると抑制される見込みです。

企業の設備投資は、2019年1 - 3月期は2四半期連続の増加となりました。堅調な企業収益や低金利、労働需給の逼迫など企業を取り巻く環境に変化はなく、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機械・設備の更新、研究開発投資などが増加しました。また、日銀短観（6月調査）の2019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堅調な伸びが示されています。

もっとも、米中の通商交渉やイギリスのEU離脱の行方など先行きの不透明感が高まったために、企業の景況感が高水準ながらも悪化傾向にあり、設備投資に対する態度にも慎重さが見られるようになりました。引き続き、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。

金融面では、日本銀行による短期金利に加えて長期金利も操作対象とする金融緩和措置が継続しています。また、世界経済の減速懸念が強まる中、日本銀行は4月の金融政策決定会合において、少なくとも2020年春頃まで金融緩和措置を続けることを表明しました。2019年に入って以降は、FRBによる利下げ期待によって世界的に金利が低下する中、日本の長期金利も低下基調を強め、2019年6月末の10年国債利回りは0.15%前後と、2016年7月以来の低水準になりました。

為替市場をみると、対ドルでは、2018年末にかけての世界経済に対する過度に悲観的な見方が後退したことから、2019年年初からは円安・ドル高傾向で推移し、4月には一時112円台まで円安が進みました。しかし、5月に入ると米国による対中関税率の追加引き上げをきっかけに米中貿易摩擦激化への警戒感が高まり、再びリスク回避の動きが強まりました。また、世界経済の減速感が強まる中、FRBによる追加緩和期待によって日米金利差が縮小したことも円高・ドル安要因となり、6月には一時106円台まで円高が進みました。対ユーロでも対ドルと同様に、2019年年初から4月にかけて円安傾向で推移した後、4月半ば以降は、リスク回避の動きが強まったことで円高方向へとトレンドが転換しました。

株式市場においては、引き続き海外経済・市場の動向に左右される展開となりました。2019年に入ると、FRBがそれまでの引き締め路線から、緩和的な政策スタンスへと転じたことにより、2018年末の過度な景気悪化懸念が後退し、世界的に株価は上昇基調となりました。日経平均も2019年年初から上昇基調が続き、4月の半ばには2018年12月以来およそ4ヵ月ぶりに22,000円台を回復しました。5月に入ると米中貿易摩擦激化に対する懸念が再燃したことで、株価は下落に転じました。しかし、6月以降はFRBによる利下げ期待の高まりによる金利低下、

米国株高を受けて、日経平均も再び上昇基調へと転じました。

2019年6月末の日経平均株価は21,275円92銭（同年3月末比70円11銭安）、10年国債利回りは0.165%（同0.070ポイントの低下）、為替は1ドル107円64銭（同3円11銭の円高）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、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ると同時に、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」という。）の最低基準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145.7%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 2019年4月 至 2019年6月)
適格流動資産	(A)	26,742
資金流出額	(B)	35,524
資金流入額	(C)	17,170
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)	26,742
純資金流出額	(B) - (C)	18,354
連結流動性カバレッジ比率	(D) / ((B) - (C))	145.7%

<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20億円増加し、1兆1,985億円となりました。また、資本金及び資本剰余金の合計は4,780億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160億円を計上したほか、配当金140億円の支払いを行った結果、前連結会計年度末比19億円増加の8,077億円となりました。自己株式の控除額は同1億円減少し、872億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) (2019年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (2019年8月6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 あります。
計	1,699,378,772	1,699,378,772		

(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)
2019年4月1日～ 2019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（2019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】

2019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 133,081,400		
	(相互保有株式) 普通株式 1,054,800		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,564,574,600	15,645,746	
単元未満株式	普通株式 667,972		一単元(100株)未満の株式
発行済株式総数	1,699,378,772		
総株主の議決権		15,645,746	

- (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30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41株が含まれております。

【自己株式等】

2019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	133,081,400		133,081,400	7.83
計		133,081,400		133,081,400	7.83

- (注) 1 当社は、単元未満自己株式41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1,054,800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(2019年4月1日から2019年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(2019年4月1日から2019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 (2019年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2019年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,153,271	4,309,028
預託金	324,559	324,181
受取手形及び売掛金	18,741	17,627
有価証券	812,341	816,346
トレーディング商品	6,716,066	7,970,473
商品有価証券等	3,785,250	4,713,137
デリバティブ取引	2,930,815	3,257,335
営業投資有価証券	110,034	128,407
投資損失引当金	155	187
営業貸付金	1,564,856	1,643,497
仕掛品	901	1,350
信用取引資産	175,034	168,095
信用取引貸付金	157,309	147,752
信用取引借証券担保金	17,724	20,342
有価証券担保貸付金	5,973,771	6,178,622
借入有価証券担保金	5,119,636	5,423,629
現先取引貸付金	854,135	754,993
立替金	28,503	19,742
短期貸付金	350	809
未収収益	39,229	37,797
その他の流動資産	488,391	496,671
貸倒引当金	317	358
流動資産計	20,405,580	22,112,106
固定資産		
有形固定資産	168,089	187,025
無形固定資産	115,937	116,375
のれん	10,605	9,829
その他	105,331	106,546
投資その他の資産	437,100	480,917
投資有価証券	374,484	420,958
長期貸付金	5,505	5,497
長期差入保証金	17,448	17,333
繰延税金資産	6,915	6,285
その他	1 33,408	1 31,502
貸倒引当金	1 662	1 660
固定資産計	721,126	784,318
資産合計	21,126,706	22,896,425

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2019年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2019年6月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	7,116	6,532
トレーディング商品	4,747,777	4,789,092
商品有価証券等	2,040,196	1,738,556
デリバティブ取引	2,707,580	3,050,535
約定見返勘定	255,804	989,197
信用取引負債	69,981	71,987
信用取引借入金	3,675	2,890
信用取引貸証券受入金	66,306	69,096
有価証券担保借入金	5,947,969	6,746,970
有価証券貸借取引受入金	4,934,115	5,153,306
現先取引借入金	1,013,853	1,593,664
銀行業における預金	3,632,575	3,848,498
預り金	276,700	318,800
受入保証金	372,591	422,588
短期借入金	1,341,415	1,324,302
コマーシャル・ペーパー	100,000	50,000
1年内償還予定の社債	190,772	239,783
未払法人税等	5,978	2,687
賞与引当金	28,436	11,416
その他の流動負債	104,852	107,248
流動負債計	17,081,971	18,929,107
固定負債		
社債	1,361,918	1,308,561
長期借入金	1,336,787	1,304,500
繰延税金負債	6,071	6,277
退職給付に係る負債	43,441	43,615
訴訟損失引当金	25,573	24,632
その他の固定負債	10,572	30,166
固定負債計	2,784,365	2,717,755
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,938	3,938
特別法上の準備金計	3,938	3,938
負債合計	19,870,276	21,650,801

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2019年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2019年6月30日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,633	230,633
利益剰余金	805,761	807,709
自己株式	87,320	87,201
自己株式申込証拠金	5	3
株主資本合計	1,196,476	1,198,541
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	47,668	46,375
繰延ヘッジ損益	5,611	6,993
為替換算調整勘定	5,942	4,088
その他の包括利益累計額合計	48,000	35,293
新株予約権	8,741	8,587
非支配株主持分	3,211	3,201
純資産合計	1,256,430	1,245,624
負債・純資産合計	21,126,706	22,896,425

(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2018年4月1日 至2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年6月30日)
営業収益		
受入手数料	73,813	64,962
委託手数料	16,566	12,416
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	11,466	6,932
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	7,669	6,352
その他の受入手数料	38,111	39,261
トレーディング損益	1 26,610	1 27,992
営業投資有価証券関連損益	2,045	944
金融収益	62,070	72,893
その他の営業収益	10,635	14,548
営業収益計	175,175	181,341
金融費用	50,559	65,774
その他の営業費用	9,009	8,443
純営業収益	115,606	107,123
販売費・一般管理費		
取引関係費	17,961	17,806
人件費	2 46,903	2 46,935
不動産関係費	9,260	9,108
事務費	6,519	6,431
減価償却費	6,290	7,748
租税公課	2,637	2,560
貸倒引当金繰入れ	10	48
その他	3,871	4,069
販売費・一般管理費計	93,454	94,708
営業利益	22,151	12,414
営業外収益		
受取配当金	1,115	1,248
持分法による投資利益	2,473	2,933
為替差益	70	-
その他	676	1,564
営業外収益計	4,335	5,746
営業外費用		
支払利息	6	6
為替差損	-	72
投資事業組合運用損	330	-
社債発行費	-	60
その他	288	99
営業外費用計	626	237
経常利益	25,860	17,922

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自2018年4月1日 至2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年6月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	221	-
持分変動利益	-	11,413
新株予約権戻入益	688	-
移転補償金	347	-
特別利益計	1,256	11,413
特別損失		
固定資産除売却損	-	24
減損損失	-	624
投資有価証券評価損	-	875
移転関連費用	115	-
構造改革関連費用	-	3 7,969
特別損失計	115	9,494
税金等調整前四半期純利益	27,002	19,841
法人税、住民税及び事業税	3,220	2,370
法人税等調整額	5,249	1,372
法人税等合計	8,470	3,742
四半期純利益	18,531	16,098
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()	2	32
親会社株主に帰属する四半期純利益	18,534	16,066

【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2018年4月1日 至2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年6月30日)
四半期純利益	18,531	16,098
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	3,848	1,342
繰延ヘッジ損益	657	1,400
為替換算調整勘定	2,999	10,063
持分法適用会社に対する持分相当額	602	75
その他の包括利益合計	6,903	12,731
四半期包括利益	25,434	3,367
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	25,494	3,359
非支配株主に係る四半期包括利益	60	7

【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 (2019年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2019年6月30日)
投資その他の資産・その他	6,015百万円	6,012百万円

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 (2019年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2019年6月30日)
従業員(借入金)	57百万円	48百万円

(四半期連結損益計算書関係)

1 トレーディング損益の内訳

	前第1四半期連結累計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
株券等トレーディング損益	11,732百万円	11,791百万円
債券・為替等トレーディング損益	14,878	16,201
計	26,610	27,992

2 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 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
	10,497百万円	9,776百万円

3 当第1四半期連結累計期間(自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)

当社グループは収支構造の改善に取り組んでおり、その一環として近接する本支店の統合や店舗機能の効率化による不動産費用の削減を進めております。これらに伴うフロア返却および支店の移転等にかかる費用を構造改革関連費用に計上しております。

(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 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
減価償却費	7,310百万円	8,807百万円
のれんの償却額	414	431

(株主資本等関係)

前第1四半期連結累計期間(自 2018年4月1日 至 2018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
2018年5月17日 取締役会	普通株式	利益剰余金	24,279	15	2018年3月31日	2018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
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 2019年4月1日 至 2019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
2019年5月16日 取締役会	普通株式	利益剰余金	14,096	9	2019年3月31日	2019年6月3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 2018年4月1日 至 2018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	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。

当第1四半期連結累計期間(自 2019年4月1日 至 2019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	37,302	40,334	15,707	1,901	95,245	6,773	102,018
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	5,793	913	4,354	218	306	4,924	5,230
計	43,095	39,420	11,352	1,683	95,551	11,697	107,249
セグメント利益(経常利益)	2,680	5,572	6,209	924	15,387	1,807	17,195

(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	15,387
「その他」の区分の利益	1,807
のれんの償却額	77
未実現損益の調整額	77
その他の調整額	882
四半期連結損益計算書の経常利益	17,922

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

(固定資産に係る重要な減損損失)

海外のホールセール部門において、のれんの減損損失168百万円、その他において、固定資産に係る減損損失456百万円を計上しております。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(2019年3月31日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等			
社債	132,124	133,964	1,840
その他			
計	132,124	133,964	1,840

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	82,770	132,653	49,882
債券	456,763	467,615	10,851
国債・地方債等	92,388	95,974	3,585
社債	60,462	62,983	2,520
その他	303,912	308,658	4,745
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	28,599	28,599	
その他	219,911	225,616	5,704
計	788,045	854,484	66,438

- (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528百万円(うち、株券528百万円)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(2019年6月30日)

1 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	四半期連結貸借 対照表計上額	時価	差額
国債・地方債等			
社債	137,501	139,946	2,444
その他			
計	137,501	139,946	2,444

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	79,710	126,142	46,431
債券	433,954	447,710	13,756
国債・地方債等	92,354	97,624	5,269
社債	84,053	86,690	2,636
その他	257,546	263,396	5,850
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	27,683	27,683	
その他	238,398	244,056	5,658
計	779,746	845,593	65,846

- (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841百万円(うち、株券841百万円)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(2019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	2,845,396	376,665	2,964,718	352,230
為替予約取引	1,615,542	22,845	1,790,726	32,707
先物・先渡取引	5,171,249	24,644	6,503,982	16,493
スワップ取引	104,080,856	2,491,173	102,231,626	2,283,698
その他	1,136,501	19,357	1,289,523	22,449
リスクリザーブ		3,870		

当第1四半期連結会計期間末(2019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	2,965,087	354,471	3,093,552	336,000
為替予約取引	1,784,134	24,697	1,737,062	32,592
先物・先渡取引	5,488,755	27,076	7,519,782	21,535
スワップ取引	105,597,686	2,837,588	103,101,122	2,636,893
その他	1,092,514	17,418	1,346,030	23,513
リスクリザーブ		3,916		

(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 2018年4月1日 至 2018年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益	11.45円	10.26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)	18,534	16,066
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)	18,534	16,066
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,618,691	1,566,433
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	11.38円	10.21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)	10,036	7,700
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、2019年7月31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	5,000万株(上限) (発行済株式総数(自己株式を除く)に対する割合3.19%)
株式の取得価額の総額	300億円(上限)
期間	2019年8月22日から2020年3月24日まで (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)

2019年5月16日開催の取締役会において、2019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	14,096百万円
1株当たりの金額	9円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	2019年6月3日

(注) 2019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

2019年 8月 6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2019年4月1日から2020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（2019年4月1日から2019年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（2019年4月1日から2019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2019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。