

【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】 2020年8月7日

【四半期会計期間】 第84期第1四半期
(自 2020年4月1日 至 2020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83期 第1四半期 連結累計期間	第84期 第1四半期 連結累計期間	第83期
会計期間		自 2019年4月1日 至 2019年6月30日	自 2020年4月1日 至 2020年6月30日	自 2019年4月1日 至 2020年3月31日
営業収益	(百万円)	181,341	128,612	672,287
純営業収益	(百万円)	107,123	105,445	426,259
経常利益	(百万円)	17,922	21,370	70,283
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	16,066	17,552	60,346
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	3,367	20,632	20,969
純資産額	(百万円)	1,245,624	1,264,195	1,257,766
総資産額	(百万円)	22,896,425	25,657,575	23,822,099
1株当たり四半期(当期)純利益	(円)	10.26	11.55	39.11
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	10.21	11.50	38.92
自己資本比率	(%)	5.4	4.7	5.1

(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83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1兆8,354億円(7.7%)増加の25兆6,575億円となりました。内訳は流動資産が同1兆8,612億円(8.1%)増加の24兆7,078億円であり、このうち現金・預金が同813億円(2.1%)増加の4兆458億円、トレーディング商品が同1兆639億円(13.3%)増加の9兆912億円、営業貸付金が同2,034億円(11.5%)増加の1兆9,718億円、有価証券担保貸付金が同409億円(0.6%)増加の6兆7,266億円となっております。固定資産は同257億円(2.6%)減少の9,496億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1兆8,290億円(8.1%)増加の24兆3,933億円となりました。内訳は流動負債が同1兆7,604億円(8.8%)増加の21兆6,791億円であり、このうち有価証券担保借入金と同2兆4,674億円(34.3%)増加の9兆6,662億円、銀行業における預金が同597億円(1.5%)減少の3兆9,774億円となっております。固定負債は同685億円(2.6%)増加の2兆7,102億円であり、このうち社債が同536億円(3.9%)増加の1兆4,328億円、長期借入金が同151億円(1.3%)増加の1兆1,984億円となっております。

純資産合計は同64億円(0.5%)増加の1兆2,641億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,782億円となりました。利益剰余金は親会社株主に帰属する四半期純利益を175億円計上したほか、配当金136億円の支払いを行ったこと等により、同36億円(0.4%)増加の8,381億円となっております。自己株式の控除額は同8億円(0.7%)減少の1,095億円、その他有価証券評価差額金は同26億円(9.9%)増加の295億円、為替換算調整勘定は同21億円減少の76億円、非支配株主持分は同6億円(1.8%)減少の381億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29.1%減の1,286億円、純営業収益は同1.6%減の1,054億円となりました。

受入手数料は577億円と、同11.1%の減収となりました。委託手数料は、株式取引が増加したことにより、同37.9%増の171億円となりました。引受業務では、新型コロナウイルス感染症の影響で複数のエクイティ引受案件等が延期となったことから、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36.1%減の44億円となりました。

トレーディング損益は、相場環境を見据えたポジション構築が奏功したことなどから、同14.5%増の320億円となりました。

販売費・一般管理費は同6.2%減の888億円となりました。取引関係費は販売促進に関連する費用が減少し同25.4%減の132億円、人件費は主に国内における賞与が減少したことから同4.2%減の449億円となっております。

以上より、経常利益は同19.2%増の213億円となりました。

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9.2%増の175億円となりました。

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()			
	2019年 6月期	2020年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率	2019年 6月期	2020年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率
リテール部門	43,095	35,148	18.4%	33.3%	2,680	893	-	-
ホールセール部門	39,420	51,509	30.7%	48.8%	5,572	18,476	231.6%	70.6%
グローバル・ マーケット	27,310	45,271	65.8%	42.9%	4,541	20,574	353.0%	78.6%
グローバル・イン ベストメント・ バンキング	12,109	6,238	48.5%	5.9%	924	2,060	-	-
アセット・マネジ メント部門	11,352	12,784	12.6%	12.1%	6,209	7,571	21.9%	28.9%
投資部門	1,683	1,028	38.9%	1.0%	924	117	87.3%	0.4%
その他・調整等	11,571	4,974	-	4.7%	2,535	3,901	-	-
連結計	107,123	105,445	1.6%	100.0%	17,922	21,370	19.2%	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、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う緊急事態宣言の発令の影響等から、商品販売が減少しましたが、緊急事態宣言が解除された後は回復傾向にあります。エクイティ収益はエクイティ募集手数料収入の減少により減収となり、債券収益についても個人向け国債及び外債の販売額減少等により減収となりました。また、株式投資信託も4月の販売額が低迷したことから販売手数料収入は減少しました。なお、ラップ口座サービスの契約口座数が減少したものの、市場環境の回復により契約資産残高は増加しました。

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18.4%減の351億円、経常損失は8億円（前年同期は26億円の経常利益）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のグループ全体に占める割合は33.3%でした。

[ホールセール部門]

ホールセール部門は、機関投資家等を対象に有価証券のセールス及びトレーディングを行うグローバル・マーケットと、事業法人、金融法人等が発行する有価証券の引受け、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、地政学リスクや国際的な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・マーケットは増収増益となりました。エクイティ収益は株価の上昇を背景に投資家のアクティビティが回復し、増収となりました。フィクスト・インカム収益は、相場環境を見据えたポジション運営が好調であったことに加えて、前年度から引き続き米州における顧客フローが堅調であったことから増収となりました。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65.8%増の452億円、経常利益は同353.0%増の205億円となりました。

グローバル・インベストメント・バンキングは減収減益となりました。引受け・売出し手数料は、新型コロナウイルス感染症の影響で業績見通しが不透明となったこと等により、複数のエクイティ引受け案件が延期となったことから、減収となりました。また、M&Aビジネスにおいても、国内外で案件の延期等があったことから、減収となりました。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48.5%減の62億円、経常損失は20億円となりました。

その結果、当第1四半期連結累計期間のホールセール部門における純営業収益は前年同期比30.7%増の515億円、

経常利益は同231.6%増の184億円となりました。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に占める割合は、それぞれ48.8%及び70.6%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アセットマネジメント（旧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・マネジメント及びサムティ・レジデンシャル投資法人の不動産運用収益によって構成されます。また、当社持分法適用関連会社である三井住友DSアセットマネジメント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、サムティ・レジデンシャル投資法人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、大和アセットマネジメントでは、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を提供しており、特にETFを中心に運用資産残高を拡大させた結果、公募投資信託の運用資産残高は前連結会計年度末比14.2%増の17.0兆円となりました。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・マネジメント及びサムティ・レジデンシャル投資法人の2社を合わせた運用資産残高は前連結会計年度末比6.0%増の1兆1,332億円となりました。

その結果、当第1四半期連結累計期間のアセット・マネジメント部門における純営業収益は前年同期比12.6%増の127億円、経常利益は同21.9%増の75億円となりました。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に占める割合は、それぞれ12.1%及び28.9%でした。なお、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、新型コロナウイルスの感染拡大による業績への影響は限定的です。

[投資部門]

投資部門は主に、連結子会社である大和企業投資、大和PI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、大和企業投資では、引き続き国内外の成長企業への投資を行ったほか、大和PI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、脱炭素エネルギーファンドやスペインの通信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。しかしながら、前年同期に貢献した太陽光発電事業による収益が減少したこと等から、減収減益となりました。

その結果、当第1四半期連結累計期間の投資部門における純営業収益は前年同期比38.9%減の10億円、経常利益は同87.3%減の1億円となりました。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に占める割合は、それぞれ1.0%及び0.4%でした。なお、新型コロナウイルス感染症を起因とする投資先の株価下落や業績悪化等で、当第1四半期連結累計期間の投資部門の業績に大きな影響を与えたものはありません。

[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、連結会計上の調整などが含まれます。

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ました。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1.6%減の3兆9,945億円、銀行口座数は同0.4%増の141万口座となりました。

当第1四半期連結累計期間において、その他セグメントに属する一部のグループ会社の収益が、前年同期比で減少したため、その他・調整等に係る純営業収益は49億円（前年同期115億円）、経常損失は39億円（前年同期は25億円の経常利益）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のグループ全体に占める割合は4.7%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83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 >

2019年の世界経済は、米中貿易摩擦などから減速感が強まりつつも緩やかな拡大が続いていました。しかし、2020年に入って、新型コロナウイルスの感染が拡大したことにより、世界経済は急激に悪化することになりました。IMF（国際通貨基金）が2020年6月に公表した世界経済見通しによれば、2020年は新型コロナウイルス感染症の影響により先進国、新興国ともにマイナス成長に転じ、世界経済成長率は4.9%とリーマン・ショック時を上回る大幅なマイナスが見込まれています。

米国経済は、新型コロナウイルスの感染者数の急増を受けて、急速に悪化しました。3月半ばにトランプ大統領が緊急事態を宣言し、小売店や飲食店、娯楽施設などの営業規制や外出制限を実施したことによって、外食や娯楽関連など不要不急のサービスを中心に個人消費が急減し、2020年1 - 3月期の実質GDP成長率は前期比年率5.0%と6年ぶりのマイナス成長となりました。また、営業規制の影響を受けたサービス業などでは、大量の失業者が発生し、4月の失業率は14.7%と戦後最高水準を記録しました。急激な景気悪化を受けて、トランプ政権および連邦議会は、矢継ぎ早に対策を打ち出しました。なかでも3月27日に成立した経済対策は総額2兆ドル超と過去最大規模となり、4月以降、家計への現金給付や失業給付の拡充、企業への融資などが実施されました。こうした政府の経済対策による下支えに加えて、営業規制・外出制限が段階的に解除され、経済活動が再開されたことで、米国経済は5月頃から持ち直しつつあります。ただし、経済活動の再開はあくまで段階的なものであり、新型コロナウイルスの感染拡大前に比べると、経済活動の水準は非常に低い状況が続いています。このため4 - 6月期の実質GDP成長率は前期比年率32.9%と2四半期連続のマイナスとなり、マイナス幅は1 - 3月期から大きく拡大しました。

金融面では、FRB（連邦準備制度理事会）が景気悪化に対応して、積極的な金融緩和を行いました。新型コロナウイルスの感染が拡大する以前においても、景気減速懸念が高まる中、FRBは2019年7月、9月および10月のFOMC（連邦公開市場委員会）において、3度にわたる利下げを実施しました。しかし、こうした金融緩和にもかかわらず、新型コロナウイルス感染症の影響によって経済が急激に悪化したことを受け、FRBは2020年3月に2度の緊急利下げを実施し、2015年12月以来となる実質的なゼロ金利政策を復活させました。さらに、無制限の量的緩和の拡大も決定し、FRBのバランスシートは大幅に拡大しています。

欧州経済（ユーロ圏経済）も、2019年までの緩やかな成長から一転して、2020年に入って急激に悪化しています。2020年1 - 3月期の実質GDP成長率は前期比年率13.6%と、1995年の統計開始以降で最大の落ち込みとなりました。国別の動向を見ると、フランス、スペイン、イタリアなど、特に新型コロナウイルスの感染拡大が深刻だった国の落ち込みが大きく、欧州全体の実質GDP成長率の悪化の大きな要因となりました。また、多くの国では3月半ばからロックダウン（都市封鎖）に踏み切ったことから、4月には、個人消費や生産など、幅広い分野でユーロ圏経済は一層大きく落ち込むことになりました。一方、5月に入るとロックダウンが徐々に緩和されたことで、経済の悪化に歯止めが掛かりつつあります。ただし、引き続き新型コロナウイルスの感染リスクが高い中、経済活動の再開は段階的なものとなっており、景気の回復ペースは非常に緩やかなものとなっています。

金融面では、ECB（欧州中央銀行）は、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金融緩和を支持する傾向を強めました。ECBは2019年9月に3年半ぶりとなる利下げを実施し、量的緩和政策の再開を決定しましたが、新型コロナウイルスの感染拡大による急激な景気悪化を受けて、2020年3月に量的緩和策の拡大を決定しました。さらに、2020年6月には資産の買い取り枠を拡大し、量的緩和を強化しました。

新興市場国・発展途上国経済は、2019年の実質GDP成長率が3.7%と、2年連続で成長率が鈍化し、2009年以来の低成長となりました。また、IMFによれば、2020年の実質GDP成長率は新型コロナウイルス感染症の影響によって、3.0%とマイナス成長に落ち込むことが見込まれています。

新興国のうち、世界第2位の経済規模を持つ中国は、新型コロナウイルス感染症による影響が顕在化する以前

から、米国との貿易摩擦を主因に成長率が減速傾向にありました。2020年1 - 3月期に入ると新型コロナウイルス感染症により、中国の一部でロックダウンが実施され、経済活動の停止を余儀なくされたため、実質GDP成長率は前年同期比 6.8%と、1992年に四半期ベースの統計が開始されて以降、初めてのマイナス成長となりました。しかし、中国での新型コロナウイルスの感染は、他国に先んじて収束へ向かいつつあり、経済は4 - 6月期には持ち直しつつあります。4 - 6月期の実質GDP成長率は前年同期比 +3.2%と、新型コロナウイルスの感染拡大以前に比べると成長率は小幅ながら、プラス成長へと転じました。

中国以外の新興国については、総じて厳しい状況に置かれています。新興国でも新型コロナウイルス感染拡大を防止するために経済活動を制限せざるを得ない状況になったことに加えて、世界的な景気悪化を受けた資金流出や、資源価格の急激な低下も、新興国経済を下押しする要因となっています。多くの新興国では、財政による景気の下支えが困難であり、経済活動を停止することへの耐久力が低いことから、4 - 6月期には経済活動の再開を進めました。しかし、この結果として、多くの新興国では新型コロナウイルス感染者数の増加が続いており、非常にリスクの高い状況が続いています。

<日本の状況>

日本経済は、2019年10月に実施された消費増税に伴う反動減によって、2019年10 - 12月期の実質GDP成長率が前期比年率 7.2%と大幅に落ち込んでいましたが、2020年に入ってから新型コロナウイルスによる影響が、日本経済の悪化に拍車をかけることになりました。2020年1 - 3月期の実質GDPは前期比年率 2.2%と、個人消費の減少を主因に2四半期連続のマイナス成長となり、さらに4月7日に緊急事態宣言が発出され、自粛の動きが強まったことで、4 - 6月期の日本経済は一層落ち込みました。

需要項目ごとに見ると、個人消費は減少基調が続いています。2019年10 - 12月期には、消費増税に伴う駆け込み需要からの反動減によって、耐久財を中心に個人消費が大幅に減少しました。2020年1 - 3月期には、反動減からの持ち直しが期待されていたものの、新型コロナウイルスの感染拡大による自粛の動きによって、外出などをはじめとする不要不急のサービス消費が減少し、個人消費は2四半期連続で減少することとなりました。こうした個人消費を手控える動きは4月7日の緊急事態宣言によって加速し、4 - 6月期の個人消費はさらに大きく落ち込みました。住宅投資についても同様に、消費増税に伴う反動減があった2019年10-12月期以降減少が続いています。2020年1 - 3月期以降は、自粛に伴う販売の低迷や建設の遅れに加えて、雇用・所得環境の悪化が下押し要因となりました。

企業の設備投資は、高水準の企業収益や低金利、労働需給の逼迫などを背景として、2020年1 - 3月期まで底堅い推移が続きました。しかし、4 - 6月期に入って企業活動が急速に低迷する中、設備投資を手控える動きが広がっています。日銀短観（2020年6月調査）によれば、2020年度の設備投資計画（含む土地投資額）では、中小企業を中心に設備投資の減少が見込まれています。

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、日本銀行は、新型コロナウイルス感染拡大による急激な景気の悪化を受けて、2020年4月に、国債の購入額の上限を撤廃したほか、社債などの買入れ枠を拡大するなど、量的緩和を強化しました。

金利については、日本銀行による追加緩和策を受けて、日本の10年国債利回りが4月に一時 0.04%台まで低下しました。しかし、世界的に経済活動再開の動きが広まる中で、5月末以降はプラス圏で推移しました。FRBが実質的なゼロ金利政策を当面続けることを表明したことで、米国の長期金利が歴史的な低水準圏で安定的に推移したこともあり、日本の長期金利も総じて0%近傍で安定的に推移しました。

為替市場をみると、新型コロナウイルスによって世界的に経済が急速に悪化する中、リスク回避の動きが強まった4月から5月前半にかけては、安全資産とされる円への需要が高まり、対ドルでは一時106円台前半まで円高が進みました。その後、経済活動再開への期待が高まる中、6月前半には109円台まで円安が進みましたが、6月後半になると、欧米などで新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念が高まったことで、再度円高傾向に転じました。日米ともに金利が安定的に推移したため、ドル円相場は総じて振れが小さな展開となりました。対ユーロについても、対ドルと総じて同様の推移となり、4月から5月前半まで円高傾向となったのち、5月後半から6月前半にかけては円安が進みましたが、6月後半には再度円高方向で推移しました。

株式市場は、2020年度に入って以降、総じて上昇基調で推移しました。新型コロナウイルスの感染拡大によって、経済や企業業績は急激に悪化したものの、世界的に金融緩和が強化されたことによる低金利や、量的緩和拡大による需給の改善が株価を押し上げる要因となりました。2020年3月に16,000円台まで下落した日経平均は、6月には一時23,000円台を回復しました。

2020年6月末の日経平均株価は22,288円14銭（同年3月末比3,371円13銭高）、10年国債利回りは0.042%（同0.011ポイントの上昇）、為替は1ドル107円73銭（同69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る有価証券関連業務や、投融資業務を行っており、これらの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181.0%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、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 2020年4月 至 2020年6月)
適格流動資産	(A)	25,383
資金流出額	(B)	32,634
資金流入額	(C)	18,615
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)	25,383
純資金流出額	(E)	14,019
連結流動性カバレッジ比率	(D)/(E)	181.0%

<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、当社グループ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し、ハイブリッド型総合証券グループとしての新たな価値の提供に資する投融資を行うためには、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44億円増加し、1兆2,067億円となりました。また、資本金及び資本剰余金の合計は4,782億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175億円を計上したほか、配当金136億円の支払いを行った結果、前連結会計年度末比36億円増加の8,381億円となりました。自己株式の控除額は同8億円減少し、1,095億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) (2020年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (2020年8月7日)	上場金融商品取引所名 又は登録認可金融商品 取引業協会名	内容
普通株式	1,699,378,772	1,699,378,772	東京証券取引所市場第一部 名古屋証券取引所市場第一部	単元株式数は100株で あります。
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)
2020年4月1日～ 2020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（2020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】

2020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 179,906,400		
	(相互保有株式) 普通株式 652,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,518,199,200	15,181,992	
単元未満株式	普通株式 621,172		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		15,181,992	

- (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70株が含まれております。

【自己株式等】

2020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	179,906,400		179,906,400	10.58
計		179,906,400		179,906,400	10.58

- (注) 1 当社は、単元未満自己株式70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652,000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。

なお、当第1四半期連結会計期間(2020年4月1日から2020年6月30日まで)及び当第1四半期連結累計期間(2020年4月1日から2020年6月30日まで)は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」(令和2年3月6日内閣府令第9号)附則第7条第1項ただし書きにより、改正後の四半期連結財務諸表規則に基づい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(2020年4月1日から2020年6月30日まで)及び第1四半期連結累計期間(2020年4月1日から2020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 (2020年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2020年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,964,512	4,045,861
預託金	415,953	348,097
受取手形及び売掛金	18,427	16,262
有価証券	873,064	920,130
トレーディング商品	8,027,289	9,091,277
商品有価証券等	4,300,600	5,690,643
デリバティブ取引	3,726,689	3,400,633
約定見返勘定	-	503,970
営業投資有価証券	202,557	215,047
投資損失引当金	1,160	1,198
営業貸付金	1,768,471	1,971,894
仕掛品	609	864
信用取引資産	114,384	167,562
信用取引貸付金	105,203	116,183
信用取引借証券担保金	9,180	51,379
有価証券担保貸付金	6,685,756	6,726,660
借入有価証券担保金	4,813,361	4,550,214
現先取引貸付金	1,872,394	2,176,445
立替金	25,682	14,777
短期貸付金	3,087	1,325
未収収益	36,483	28,640
その他の流動資産	711,935	657,221
貸倒引当金	415	495
流動資産計	22,846,637	24,707,899
固定資産		
有形固定資産	309,166	309,562
無形固定資産	124,115	122,312
のれん	13,629	13,309
その他	110,486	109,003
投資その他の資産	542,179	517,801
投資有価証券	491,660	472,650
長期貸付金	5,915	6,186
長期差入保証金	17,877	18,024
繰延税金資産	17,125	12,366
その他	1 10,042	1 9,128
貸倒引当金	1 440	1 554
固定資産計	975,462	949,676
資産合計	23,822,099	25,657,575

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2020年6月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	8,938	4,750
トレーディング商品	5,362,261	5,363,518
商品有価証券等	1,805,910	2,131,735
デリバティブ取引	3,556,351	3,231,783
約定見返勘定	544,689	-
信用取引負債	59,256	75,413
信用取引借入金	3,994	2,766
信用取引貸証券受入金	55,261	72,647
有価証券担保借入金	7,198,730	9,666,225
有価証券貸借取引受入金	4,839,095	5,482,891
現先取引借入金	2,359,635	4,183,333
銀行業における預金	4,037,201	3,977,428
預り金	353,943	356,032
受入保証金	414,641	411,503
短期借入金	1,276,948	1,317,892
コマーシャル・ペーパー	178,000	120,300
1年内償還予定の社債	277,852	253,842
未払法人税等	7,403	4,068
賞与引当金	26,747	10,550
その他の流動負債	172,101	117,673
流動負債計	19,918,716	21,679,199
固定負債		
社債	1,379,226	1,432,835
長期借入金	1,183,272	1,198,441
繰延税金負債	4,369	5,150
退職給付に係る負債	44,359	44,418
訴訟損失引当金	1,570	1,586
その他の固定負債	28,900	27,829
固定負債計	2,641,697	2,710,262
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,918	3,918
特別法上の準備金計	3,918	3,918
負債合計	22,564,333	24,393,380

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2020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	230,808	230,808
利益剰余金	834,442	838,123
自己株式	110,351	109,541
自己株式申込証拠金	13	7
株主資本合計	1,202,310	1,206,794
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	26,853	29,524
繰延ヘッジ損益	13,592	11,434
為替換算調整勘定	5,556	7,659
その他の包括利益累計額合計	7,703	10,430
新株予約権	8,901	8,812
非支配株主持分	38,849	38,157
純資産合計	1,257,766	1,264,195
負債・純資産合計	23,822,099	25,657,575

(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2019年4月1日 至2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2020年4月1日 至2020年6月30日)
営業収益		
受入手数料	64,962	57,749
委託手数料	12,416	17,124
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	6,932	4,430
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	6,352	4,068
その他の受入手数料	39,261	32,126
トレーディング損益	1 27,992	1 32,056
営業投資有価証券関連損益	944	641
金融収益	72,893	26,516
その他の営業収益	14,548	11,648
営業収益計	181,341	128,612
金融費用	65,774	15,582
その他の営業費用	8,443	7,583
純営業収益	107,123	105,445
販売費・一般管理費		
取引関係費	17,806	13,289
人件費	2 46,935	2 44,979
不動産関係費	9,108	9,409
事務費	6,431	6,144
減価償却費	7,748	8,404
租税公課	2,560	2,762
貸倒引当金繰入れ	48	136
その他	4,069	3,706
販売費・一般管理費計	94,708	88,833
営業利益	12,414	16,612
営業外収益		
受取配当金	1,248	626
持分法による投資利益	2,933	2,291
投資事業組合運用益	-	956
その他	1,564	1,290
営業外収益計	5,746	5,165
営業外費用		
支払利息	6	125
為替差損	72	43
社債発行費	60	86
その他	99	151
営業外費用計	237	407
経常利益	17,922	21,370

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2020年4月1日 至2020年6月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	-	2,995
持分変動利益	11,413	-
特別利益計	11,413	2,995
特別損失		
固定資産除売却損	24	19
減損損失	624	-
投資有価証券評価損	875	97
持分変動損失	-	68
構造改革関連費用	3 7,969	-
特別損失計	9,494	185
税金等調整前四半期純利益	19,841	24,181
法人税、住民税及び事業税	2,370	2,482
法人税等調整額	1,372	3,795
法人税等合計	3,742	6,277
四半期純利益	16,098	17,903
非支配株主に帰属する四半期純利益	32	351
親会社株主に帰属する四半期純利益	16,066	17,552

【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2019年4月1日 至2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2020年4月1日 至2020年6月30日)
四半期純利益	16,098	17,903
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	1,342	3,061
繰延ヘッジ損益	1,400	2,027
為替換算調整勘定	10,063	1,831
持分法適用会社に対する持分相当額	75	529
その他の包括利益合計	12,731	2,728
四半期包括利益	3,367	20,632
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	3,359	20,279
非支配株主に係る四半期包括利益	7	353

【注記事項】

(会計方針の変更等)

当第1四半期連結累計期間
(自 2020年4月1日
至 2020年6月30日)

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当第1四半期連結会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる四半期連結財務諸表に与える影響はありません。

(追加情報)

当第1四半期連結累計期間
(自 2020年4月1日
至 2020年6月30日)

(1) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社及び一部の国内連結子会社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(2) 新型コロナウイルス感染症の影響に関する会計上の見積りの仮定について

当第1四半期連結累計期間において、新型コロナウイルス感染症の影響に関する会計上の見積りの仮定について、第83期有価証券報告書の追加情報に記載した当該仮定から重要な変更及び新たに生じた事項はありません。

(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 (2020年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2020年6月30日)
投資その他の資産・その他	6,147百万円	6,081百万円

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 (2020年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2020年6月30日)
従業員(借入金)	29百万円	25百万円
グッドタイムリビング株式会社 (入居一時金等返還債務)	12,115	11,797
その他(債務)	15	7
計	12,160	11,830

(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 2019年4月1日 至 2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年6月30日)
株券等トレーディング損益	11,791百万円	11,126百万円
債券・為替等トレーディング損益	16,201	20,930
計	27,992	32,056

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 2019年4月1日 至 2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年6月30日)
	9,776百万円	8,057百万円

3 前第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 2019年4月1日 至 2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年6月30日)
減価償却費	8,807百万円	10,104百万円
のれんの償却額	431	293

(株主資本等関係)

前第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。

当第1四半期連結累計期間(自 2020年4月1日 至 2020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
2020年5月8日 取締役会	普通株式	利益剰余金	13,675	9	2020年3月31日	2020年6月1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 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主な内容(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。

当第1四半期連結累計期間(自 2020年4月1日 至 2020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	30,663	51,140	16,040	1,589	99,434	1,961	101,396
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	4,484	369	3,256	561	1,036	4,579	5,616
計	35,148	51,509	12,784	1,028	100,471	6,541	107,012
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())	893	18,476	7,571	117	25,272	4,282	20,989

(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	金額
報告セグメント計	25,272
「その他」の区分の損失()	4,282
未実現損益の調整額	148
その他の調整額	231
四半期連結損益計算書の経常利益	21,370

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(2020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	141,696	142,552	855
その他			
計	141,696	142,552	855

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	95,718	112,714	16,996
債券	570,165	584,748	14,583
国債・地方債等	207,079	208,001	921
社債	85,050	86,986	1,935
その他	278,034	289,760	11,726
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	39,848	39,848	
その他	166,213	173,084	6,871
計	871,944	910,396	38,451

- (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7,119百万円(うち、株券6,725百万円、その他394百万円)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(2020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	145,987	146,747	759
その他			
計	145,987	146,747	759

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	91,642	113,740	22,098
債券	599,990	613,048	13,058
国債・地方債等	207,016	205,360	1,655
社債	96,988	98,866	1,877
その他	295,985	308,821	12,836
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	35,902	35,902	
その他	205,797	213,224	7,426
計	933,333	975,916	42,583

- (注) 1 市場価格のない株式等(非上場株式等)並びに組合出資金のうち組合財産が非上場株式等及び不動産等の固定資産で構成されているものについては、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、市場価格のあるその他有価証券について97百万円(うち、株券97百万円)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(2020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	2,426,911	294,208	3,016,320	310,523
為替予約取引	2,831,402	74,755	2,646,799	75,533
先物・先渡取引	6,100,189	79,876	10,666,946	112,289
スワップ取引	109,919,232	3,246,134	111,377,587	3,022,725
その他	1,503,354	34,669	1,378,106	35,279
リスクリザーブ		2,954		

当第1四半期連結会計期間末(2020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	2,436,836	286,331	2,997,198	306,273
為替予約取引	1,404,324	22,669	1,410,647	29,079
先物・先渡取引	4,749,186	35,598	9,529,274	40,773
スワップ取引	109,533,061	3,038,168	111,717,565	2,831,416
その他	1,200,192	20,488	1,323,159	24,240
リスクリザーブ		2,623		

(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 2019年4月1日 至 2019年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益	10.26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(百万円)	16,066	17,552
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)	16,066	17,552
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,566,433	1,519,983
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	10.21円	11.50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)	7,700	6,424
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)

該当事項はありません。

2 【その他】

(剰余金の配当)

2020年5月8日開催の取締役会において、2020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	13,675百万円
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	2020年6月1日

(注) 2020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

2020年 8月 7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

東京事務所

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

監査人の結論

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2020年4月1日から2021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（2020年4月1日から2020年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020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全ての重要な点において認められなかった。

監査人の結論の根拠

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。四半期レビューの基準における当監査法人の責任は、「四半期連結財務諸表の四半期レビューにおける監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社及び連結子会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

四半期連結財務諸表に対する経営者及び監査委員会の責任

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。

四半期連結財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき四半期連結財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における執行役及び取締役の職務の執行を監視することにある。

四半期連結財務諸表の四半期レビューにおける監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した四半期レビューに基づいて、四半期レビュー報告書にお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。

監査人は、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従って、四半期レビューの過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・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する質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続を実施する。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。
- ・継続企業の前提に関する事項について、重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められると判断した場合には、入手した証拠に基づき、四半期連結財務諸表において、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、適正に表示されていないと信じさせる事項が認められないかどうか結論付ける。また、継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、四半期レビュー報告書において四半期連結財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する四半期連結財務諸表の注記事項が適切でない場合は、四半期連結財務諸表に対して限定付結論又は否定的結論を表明することが求められている。監査人の結論は、四半期レビュー報告書日までに入手した証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・四半期連結財務諸表の表示及び注記事項が、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いないと信じさせる事項が認められないかどうかとともに、関連する注記事項を含めた四半期連結財務諸表の表示、構成及び内容、並びに四半期連結財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示していないと信じさせる事項が認められないかどうかを評価する。
- ・四半期連結財務諸表に対する結論を表明するために、会社及び連結子会社の財務情報に関する証拠を入手する。監査人は、四半期連結財務諸表の四半期レビューに関する指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で監査人の結論に対して責任を負う。

監査人は、監査委員会に対して、計画した四半期レビューの範囲とその実施時期、四半期レビュー上の重要な発見事項について報告を行う。

監査人は、監査委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社及び連結子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。