

【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】 2021年8月11日

【四半期会計期間】 第85期第1四半期
(自 2021年4月1日 至 2021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84期 第1四半期 連結累計期間	第85期 第1四半期 連結累計期間	第84期
会計期間		自 2020年4月1日 至 2020年6月30日	自 2021年4月1日 至 2021年6月30日	自 2020年4月1日 至 2021年3月31日
営業収益	(百万円)	128,612	149,836	576,172
純営業収益	(百万円)	105,445	126,721	466,660
経常利益	(百万円)	21,370	34,922	115,175
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	17,552	23,560	108,396
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	20,632	28,504	153,471
純資産額	(百万円)	1,264,195	1,581,457	1,591,841
総資産額	(百万円)	25,657,575	25,586,624	26,099,330
1株当たり四半期(当期)純利益	(円)	11.55	15.45	71.20
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	11.50	15.38	70.90
自己資本比率	(%)	4.7	5.2	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 「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)等を当第1四半期連結会計期間の期首から適用しており、当第1四半期連結累計期間に係る主要な経営指標等については、当該会計基準等を適用した後の指標等となっております。
- 3 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。

なお、株式会社大和総研ホールディングス、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションの3社は、2021年4月1日付で、株式会社大和総研ホールディングスを吸収合併存続会社、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションを吸収合併消滅会社とする吸収合併を行い、商号を株式会社大和総研といたしました。

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84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5,127億円(2.0%)減少の25兆5,866億円となりました。内訳は流動資産が同5,145億円(2.1%)減少の24兆1,318億円であり、このうち現金・預金が同7,924億円(16.6%)減少の3兆9,707億円、トレーディング商品が同6,300億円(8.0%)増加の8兆4,641億円、営業貸付金が同748億円(3.7%)減少の1兆9,212億円、有価証券担保貸付金が同3,952億円(5.3%)減少の7兆530億円となっております。固定資産は同18億円(0.1%)増加の1兆4,548億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5,023億円(2.0%)減少の24兆51億円となりました。内訳は流動負債が同3,116億円(1.5%)減少の20兆9,077億円であり、このうち約定見返勘定が同4,748億円(36.0%)減少の8,454億円、有価証券担保借入金が同7,462億円(9.1%)増加の8兆9,223億円、銀行業における預金が同1,293億円(2.9%)減少の4兆2,867億円、また短期借入金が同5,363億円(38.1%)減少の8,718億円となっております。固定負債は同1,906億円(5.8%)減少の3兆937億円であり、このうち社債が同357億円(2.3%)減少の1兆5,215億円、長期借入金が同1,531億円(9.7%)減少の1兆4,337億円となっております。

純資産合計は同103億円(0.7%)減少の1兆5,814億円となりました。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235億円計上したほか、配当金380億円の支払いを行ったこと等により、同146億円(1.6%)減少の8,971億円となっております。自己株式の控除額は同7億円(0.7%)減少の1,068億円、その他有価証券評価差額金は同8億円(2.1%)増加の424億円、為替換算調整勘定は同34億円増加の163億円、非支配株主持分は同13億円(0.6%)増加の2,505億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16.5%増の1,498億円、純営業収益は同20.2%増の1,267億円となりました。

受入手数料は773億円と、同33.9%の増収となりました。委託手数料は、株式取引が増加したことにより、同8.6%増の186億円となりました。引受業務では、エクイティや債券引受案件等が増加し、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139.1%増の105億円となりました。

トレーディング損益は、米州における債券収益が減少したこと等により、同18.0%減の262億円となりました。

販売費・一般管理費は同6.8%増の948億円となりました。取引関係費は販売促進に関連する費用が増加し同14.6%増の152億円、人件費は主に国内外における賞与が増加したことから同9.4%増の492億円となっております。

以上より、経常利益は同63.4%増の349億円となりました。

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34.2%増の235億円となりました。

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()			
	2020年 6月期	2021年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率	2020年 6月期	2021年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率
リテール部門	35,148	47,356	34.7%	37.4%	893	10,037	-	28.7%
ホールセール部門	51,509	46,751	9.2%	36.9%	18,476	11,328	38.7%	32.4%
グローバル・マー ケッツ	45,271	31,682	30.0%	25.0%	20,574	7,795	62.1%	22.3%
グローバル・イン ベストメント・バン キング	6,238	15,068	141.6%	11.9%	2,060	3,144	-	9.0%
アセット・マネジ メント部門	12,784	17,352	35.7%	13.7%	7,571	10,000	32.1%	28.6%
証券アセット・マ ネジメント	9,129	11,096	21.5%	8.8%	3,188	5,184	62.6%	14.8%
不動産アセット・ マネジメント	3,655	6,255	71.1%	4.9%	4,383	4,816	9.9%	13.8%
投資部門	1,028	2,757	168.1%	2.2%	117	1,824	15.6倍	5.2%
その他・調整等	4,974	12,502	-	9.9%	3,901	1,730	-	5.0%
連結計	105,445	126,721	20.2%	100.0%	21,370	34,922	63.4%	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、大型のエクイティ引受案件があったことや、新型コロナウイルスの感染拡大に起因する前年同期のマーケット下落時に比べてお客様のアクティビティが拡大したことにより、エクイティ収益が増加しました。債券収益は、大型の債券引受案件があったことにより増加しました。投資信託は、投信フレックスプランの効果も寄与し、販売額が拡大した結果、募集手数料、代理事務手数料ともに増加しました。また、契約額の増加により、ラップ口座サービスの契約資産残高は過去最高となりました。

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34.7%増の473億円、経常利益は100億円(前年同期は8億円の経常損失)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37.4%及び28.7%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あり、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・マーケットは減収減益となりました。エクイティ収益は、ほぼ横ばいとなりました。フィクストインカム収益は、ボラティリティの低下により国内外での収益機会が減少したため、債券市場が活況を呈した前年同期比では減収となりました。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30.0%減の316億円、経常利益は同62.1%減の77億円となりました。

グローバル・インベストメント・バンキングの主な収益源は、引受業務やM&Aアドバイザー業務によって得る引受け・売出し手数料とM&A手数料であり、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・インベストメント・バンキングは増収増益となりました。引受け・売出し手数料は、エクイティ大型公募売出し案件でグローバル・コーディネーターを務めたことや、多数の債券主幹事案件を積上げたことな

どから増収となりました。またM&Aビジネスでは、国内外多数の案件を遂行したことにより、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141.6%増の150億円、経常利益は31億円（前年同期は20億円の経常損失）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9.2%減の467億円、経常利益は同38.7%減の113億円となりました。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36.9%及び32.4%でした。

なお、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、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。

[アセット・マネジメント部門]

アセット・マネジメント部門は、証券アセット・マネジメントと不動産アセット・マネジメントで構成されません。

証券アセット・マネジメントの主な収益源は、当社連結子会社の大和アセットマネジメントにおける投資信託の組成と運用に関する報酬です。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は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には、マーケット環境によって変動するお客様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、お客様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。

証券アセット・マネジメントは増収増益となりました。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、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2.0%増の21.4兆円となりました。その結果、当第1四半期累計期間の純営業収益は前年同期比21.5%増の110億円、経常利益は同62.6%増の51億円となりました。

不動産アセット・マネジメントの主な収益源は、当社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、大和証券オフィス投資法人及びサムティ・レジデンシャル投資法人の不動産運用収益です。また、当社持分法適用関連会社であるサムティ株式会社及び大和証券リビング投資法人の不動産運用収益からの利益は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には、国内の不動産市場・オフィス需要の動向が挙げられます。

不動産アセット・マネジメントは増収増益となりました。大和証券オフィス投資法人の連結子会社化に伴い、当第1四半期累計期間より同社の利益の100%を経常利益へ取り込んでいます。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0.4%増の1兆2,174億円となりました。その結果、当第1四半期累計期間の純営業収益は前年同期比71.1%増の62億円、経常利益は同9.9%増の48億円となりました。

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35.7%増の173億円、経常利益は同32.1%増の100億円となりました。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13.7%及び28.6%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、大和企業投資では、国内外の成長企業への投資や上場支援に貢献しながら、投資先の売却益により収益を確保しました。また、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、大和エナジー・インフラでは、蓄電池分野や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ながら、インカムゲイン及びキャピタルゲインを計上しました。

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168.1%増の27億円、経常利益は同15.6倍の18億円となりました。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2.2%及び5.2%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遂行したほか、高付加価値のソリューション提案により、お客様との関係を強化したこと、また、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3.0%減の4兆2,933億円、銀行口座数は同0.9%増の152万口座となり、金融収支が改善した結果、当第1四半期連結累計期間の業績は増収増益となりました。

その結果、その他・調整等に係る純営業収益は125億円（前年同期49億円）、経常利益は17億円（前年同期は39億円の経常損失）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9.9%及び5.0%でした。

なお、当第1四半期連結累計期間のその他・調整等における、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。

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84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 >

新型コロナウイルスの感染拡大により2020年初からに急激に悪化した世界経済は、2020年後半以降、持ち直しへと向かっています。IMF（国際通貨基金）が2021年7月に公表した世界経済見通しによれば、2020年は先進国、新興国ともにマイナス成長に転じ、世界経済成長率は3.2%とリーマン・ショック時を上回る大幅なマイナス成長となりました。一方、2021年は、世界的に新型コロナウイルスワクチンの普及が見込まれることに加えて、前年の落ち込みからの反動もあり+6.0%と高い成長が見込まれています。もっとも、世界経済は最悪期を脱しつつも、引き続き新型コロナウイルスの感染状況に左右される不安定な状況が続いています。

米国経済は、2020年後半以降、順調な回復が続いています。新型コロナウイルスの感染拡大以降、政府が実行してきた累次の経済対策が下支えとなったことに加えて、2021年に入って新型コロナウイルスワクチンの接種が順調に進む中、政府による行動規制が緩和されたことで、2021年1-3月期の実質GDP成長率は前期比年率+6.3%となりました。4-6月期に入ると経済再開の動きが一層進展したことに加えて、2021年1月に発足したバイデン政権が3月に成立させた追加経済対策による家計所得の増加が個人消費を後押しし、4-6月期の実質GDP成長率は前期比年率+6.5%と成長ペースが加速しました。

金融面では、FRB（連邦準備制度理事会）がコロナ禍への対応として復活させたゼロ金利政策が続き、緩和的な環境が継続しています。2021年6月のFOMCでは、少なくとも2022年末まで政策金利がゼロで据え置かれる見通しが示されました。また、2020年12月のFOMCでは、経済が十分に回復するまでバランスシートの拡大を続けることを約束しており、量的緩和策も継続されています。

欧州経済（ユーロ圏経済）は、新型コロナウイルス感染症の影響が長引く中、厳しい状況が続いています。2020年前半に新型コロナウイルスの感染拡大によって急激に落ち込んだユーロ圏経済は、2020年7-9月期には一旦はプラス成長に転じましたが、2020年後半から感染者数が再び増加に転じたことを受け、ドイツ、フランスなど、多くの国で再びロックダウンを余儀なくされました。この結果、2020年10-12月期の実質GDP成長率は前期比年率2.5%とマイナス成長に転じ、続く2021年1-3月期も同1.3%と2四半期連続のマイナス成長となりました。しかし、4-6月期に入ると新型コロナワクチンの接種が進展したこともあり、経済は再び持ち直しへと向かっています。4-6月期の実質GDP成長率は前期比年率+8.3%と3四半期ぶりのプラス成長となりました。

金融面では、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和が続いています。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、ECBは2020年3月の緊急会合で、新型コロナウイルス感染症対応のための新規の資産買い取りプログラムを設定し、量的緩和策の拡大を決定しました。当初は2020年末までとされていた買い入れ期間は「少なくとも2022年3月まで」延長されており、ECBは緩和的な金融政策を当面続けることを約束しています。

新興市場国・発展途上国経済は、先進国と同様に2020年前半に急激に悪化した後、2020年後半以降持ち直しの動きが続いています。IMFによれば、新興国の実質GDP成長率は2020年に2.1%とマイナス成長に陥った後、2021年は+6.3%と高い成長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では、世界に先んじて新型コロナウイルスの感染が収束へ向かったこともあり、2020年4-6月期以降、経済の持ち直しが続いています。政策による下支えを背景とした投資の増加が経済の持ち直しに大きく寄与したことに加えて、コロナ禍に伴う医療用品やIT製品などの特需による輸出の増加が成長に寄与しました。さらに2021年に入ると、米国の成長加速を主因に輸出の伸びが加速したことに加え、出遅れていた個人消費の回復が進み、2021年1-3月期の実質GDP成長率は、前年の落ち込みからの反動もあり前年比+18.3%と四半期統計の公表を開始した1992年以来、最も高い成長となりました。続く4-6月期は、前年からの反動の影響が一巡したことで成長率が低下しつつも、同+7.9%と底堅い成長が続きました。

中国以外の新興国についても、2020年後半以降持ち直しの動きが続いています。米国や中国を中心とした海外経済の回復や、それに伴う資源価格の上昇、世界的な金融緩和を背景とした資金流入が新興国経済を下支えしています。ただし、新興国ではワクチン接種の実施が遅れている国が多く、感染再拡大による経済の下振れリスクが高い状況が続いています。

<日本の状況>

日本経済は、2020年初めから新型コロナウイルス感染症の影響によって大幅に悪化した後、2020年後半に一時持ち直しに転じたものの、感染再拡大によって2021年に入り再び回復が足踏みしています。新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて2021年1月8日に2回目の緊急事態宣言が発出され、2021年1 - 3月期の実質GDP成長率は、前期比年率 3.9%と3四半期ぶりのマイナス成長に転じました。2度目の緊急事態宣言は3月21日に全面解除されましたが、4月25日には3回目の緊急事態宣言が発出されたことで、人々の外出は抑制され、4 - 6月期も国内需要を中心に日本経済は厳しい状況が続いています。

需要項目ごとに見ると、個人消費は低い水準での推移が続いています。2020年後半には持ち直しの動きが見られていましたが、2回目の緊急事態宣言が発出されたことで、外食や娯楽サービスなどを中心としたサービス消費の減少を主因に、2021年1 - 3月期の個人消費は前期比年率 5.8%と3四半期ぶりに減少しました。また、4月に3回目となる緊急事態宣言が発出されたことで、対象地域ではサービス消費が抑制された状況が続いています。さらに、こうしたサービス業の低迷は雇用・所得環境の回復の遅れにも繋がり、個人消費は4 - 6月期に入っても、新型コロナウイルス感染拡大前よりも低い水準での推移が続いています。住宅投資についても同様に、コロナ禍によって大きく落ちこんだ後、持ち直しの動きがみられつつも、雇用環境の先行きに対する不透明感が続く中で低い水準で推移しています。

企業部門の需要である設備投資は、2020年後半に一時持ち直した後、緊急事態宣言の再発出によって2021年1 - 3月期には再び減少に転じました。しかし、4 - 6月期に入ると米中を中心とした海外経済の回復を背景に輸出が増加する中、設備投資についても再び増加傾向に転じつつあります。日銀短観（2021年6月調査）によれば、2021年度の設備投資計画（含む土地投資額）は、2020年度からの反動もあり、前年比+7.1%と高めの伸び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の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、社債などの買い入れ枠を拡大するなど量的緩和を強化しました。こうした中、日本の10年国債利回りは0%近傍での推移が続いています。2021年に入って米国での景気過熱や財政悪化への懸念から米国の長期金利が上昇したのに伴い、日本の長期金利も小幅ながら上昇し、2月末には一時、2018年10月以来初めて0.15%を上回りました。しかし、3月以降、米国の長期金利が低下したことを受けて日本の長期金利も低下傾向に転じています。

為替市場をみると、2021年前半は対ドルでは総じて円安傾向で推移しました。米国での長期金利の大幅な上昇を受けて日米金利差が拡大したことで、2021年1 - 3月期は速いペースで円安が続き、年初時点で102円台だった対ドルレートは3月末には110円台となりました。4 - 6月期に入って米国金利の上昇が収まったことで4月には一時的に円高が進む局面もありましたが、感染拡大による緊急事態宣言の再発出によって日本経済の回復が足踏みとなる中、米国経済の回復期待から4月末以降は再びドル高・円安傾向となりました。対ユーロについても、2021年に入って以降、総じて円安傾向が続いています。欧州では日本に比べて早くワクチンの接種が進み、行動制限の緩和による欧州経済の回復期待がユーロ高・円安の要因となりました。

株式市場では、2021年2月に日経平均株価が一時1990年8月以来となる30,000円台まで上昇しました。しかし、2021年度に入るとそれまで上昇基調に歯止めが掛かり、概ね横ばい圏で推移しています。世界的に緩和的な金融環境が続く中、経済の回復が進む米国で株価の上昇傾向が続いたことは日本の株式市場にとっても好材料となりました。一方、日本ではワクチンの接種が相対的に遅れ、緊急事態宣言が繰り返し発出されたことが、株価を押し下げる要因となり、日々の感染状況に左右される形で日本の株価も上昇・下落を繰り返しました。2021年6月末の日経平均株価は28,791円53銭（同年3月末比387円27銭安）、10年国債利回りは0.07%（同0.034ポイントの低下）、為替は1ドル110円55銭（同19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、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152.8%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、それらをかば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 2021年4月 至 2021年6月)
適格流動資産	(A)	26,736
資金流出額	(B)	34,946
資金流入額	(C)	17,453
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)	26,736
純資金流出額	(E)	17,493
連結流動性カバレッジ比率	(D)/(E)	152.8%

<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138億円減少し、1兆2,682億円となりました。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235億円を計上したほか、配当金380億円の支払いを行った結果、前連結会計年度末比146億円減少の8,971億円となりました。自己株式の控除額は同7億円減少し、1,068億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) (2021年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (2021年8月11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)
2021年4月1日～ 2021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(2021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】

2021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 175,501,700	-	-
	(相互保有株式) 普通株式 316,600	-	-
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,522,965,200	15,229,652	-
単元未満株式	普通株式 595,272	-	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	-	15,229,652	-

(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35株が含まれております。

【自己株式等】

2021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	175,501,700	-	175,501,700	10.32
計	-	175,501,700	-	175,501,700	10.32

(注)1 当社は、単元未満自己株式35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316,600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（2021年4月1日から2021年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（2021年4月1日から2021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 (2021年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2021年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,763,197	3,970,756
預託金	485,876	520,245
受取手形及び売掛金	21,488	-
受取手形、売掛金及び契約資産	-	22,048
有価証券	996,683	1,100,734
トレーディング商品	7,834,093	8,464,158
商品有価証券等	5,374,191	6,115,772
デリバティブ取引	2,459,901	2,348,386
営業投資有価証券	97,092	97,124
投資損失引当金	588	663
営業貸付金	1,996,121	1,921,295
仕掛品	603	816
信用取引資産	162,078	181,557
信用取引貸付金	152,077	176,303
信用取引借証券担保金	10,001	5,253
有価証券担保貸付金	7,448,321	7,053,099
借入有価証券担保金	5,054,451	4,248,248
現先取引貸付金	2,393,870	2,804,850
立替金	20,131	30,152
短期貸付金	595	368
未収収益	36,229	36,098
その他の流動資産	788,790	738,423
貸倒引当金	4,401	4,412
流動資産計	24,646,314	24,131,803
固定資産		
有形固定資産	880,477	883,318
無形固定資産	128,786	124,479
のれん	21,229	20,357
その他	107,557	104,122
投資その他の資産	443,751	447,023
投資有価証券	402,590	409,325
長期貸付金	6,313	7,300
長期差入保証金	17,692	17,260
繰延税金資産	11,397	6,491
その他	1 10,415	1 11,305
貸倒引当金	1 1,037	1 1,038
投資損失引当金	3,620	3,620
固定資産計	1,453,016	1,454,821
資産合計	26,099,330	25,586,624

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2021年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2021年6月30日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	5,382	4,437
トレーディング商品	4,367,822	4,372,958
商品有価証券等	2,032,969	2,153,565
デリバティブ取引	2,334,853	2,219,393
約定見返勘定	1,320,279	845,460
信用取引負債	64,022	62,750
信用取引借入金	4,139	1,576
信用取引貸証券受入金	59,882	61,174
有価証券担保借入金	8,176,094	8,922,306
有価証券貸借取引受入金	4,699,647	4,527,766
現先取引借入金	3,476,447	4,394,540
銀行業における預金	4,416,097	4,286,793
預り金	419,994	529,562
受入保証金	366,351	350,110
短期借入金	1,408,288	871,894
コマーシャル・ペーパー	265,000	225,000
1年内償還予定の社債	203,774	293,932
未払法人税等	17,962	13,336
賞与引当金	36,316	15,341
その他の流動負債	151,966	113,842
流動負債計	21,219,352	20,907,727
固定負債		
社債	1,557,333	1,521,571
長期借入金	1,586,913	1,433,768
繰延税金負債	43,176	42,730
退職給付に係る負債	44,773	44,509
訴訟損失引当金	1,809	203
その他の固定負債	50,430	50,954
固定負債計	3,284,436	3,093,738
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,699	3,700
特別法上の準備金計	3,699	3,700
負債合計	24,507,489	24,005,167

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2021年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2021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	230,651	230,651
利益剰余金	911,742	897,112
自己株式	107,646	106,875
自己株式申込証拠金	9	2
株主資本合計	1,282,154	1,268,287
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	41,587	42,460
繰延ヘッジ損益	3,058	5,239
為替換算調整勘定	12,886	16,374
その他の包括利益累計額合計	51,415	53,595
新株予約権	9,125	9,028
非支配株主持分	249,145	250,545
純資産合計	1,591,841	1,581,457
負債・純資産合計	26,099,330	25,586,624

(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 2020年4月1日 至 2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年6月30日)
営業収益		
受入手数料	57,749	77,309
委託手数料	17,124	18,600
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	4,430	10,595
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	4,068	6,295
その他の受入手数料	32,126	41,817
トレーディング損益	1 32,056	1 26,293
営業投資有価証券関連損益	641	1,681
金融収益	26,516	21,295
その他の営業収益	11,648	23,257
営業収益計	128,612	149,836
金融費用	15,582	10,421
その他の営業費用	7,583	12,692
純営業収益	105,445	126,721
販売費・一般管理費		
取引関係費	13,289	15,230
人件費	2 44,979	2 49,200
不動産関係費	9,409	9,137
事務費	6,144	5,657
減価償却費	8,404	8,771
租税公課	2,762	2,858
貸倒引当金繰入れ	136	0
その他	3,706	4,017
販売費・一般管理費計	88,833	94,873
営業利益	16,612	31,848
営業外収益		
受取配当金	626	1,532
持分法による投資利益	2,291	493
投資事業組合運用益	956	679
その他	1,290	1,036
営業外収益計	5,165	3,742
営業外費用		
支払利息	125	458
為替差損	43	0
社債発行費	86	18
その他	151	190
営業外費用計	407	668
経常利益	21,370	34,922

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年6月30日)
特別利益		
固定資産受贈益	-	318
投資有価証券売却益	2,995	236
訴訟損失引当金戻入額	-	686
特別利益計	2,995	1,241
特別損失		
固定資産除売却損	19	66
減損損失	-	495
投資有価証券評価損	97	380
持分変動損失	68	-
構造改革関連費用	-	344
特別損失計	185	987
税金等調整前四半期純利益	24,181	35,176
法人税、住民税及び事業税	2,482	4,561
法人税等調整額	3,795	4,743
法人税等合計	6,277	9,304
四半期純利益	17,903	25,871
非支配株主に帰属する四半期純利益	351	2,310
親会社株主に帰属する四半期純利益	17,552	23,560

【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 2020年4月1日 至 2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年6月30日)
四半期純利益	17,903	25,871
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	3,061	696
繰延ヘッジ損益	2,027	2,198
為替換算調整勘定	1,831	1,410
持分法適用会社に対する持分相当額	529	2,723
その他の包括利益合計	2,728	2,632
四半期包括利益	20,632	28,504
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	20,279	25,741
非支配株主に係る四半期包括利益	353	2,762

【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 2021年4月1日
至 2021年6月30日)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」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、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当第1四半期連結会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当第1四半期連結会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。ただし、収益認識会計基準第86項に定める方法を適用し、当第1四半期連結会計期間の期首より前までに従前の取扱いに従ってほとんどすべての収益の額を認識した契約に、新たな会計方針を遡及適用しておりません。また、収益認識会計基準第86項また書き(1)に定める方法を適用し、当第1四半期連結会計期間の期首より前までに行われた契約変更について、すべての契約変更を反映した後の契約条件に基づき、会計処理を行い、その累積的影響額を当第1四半期連結会計期間の期首の利益剰余金に加減しております。

収益認識会計基準等を適用したため、前連結会計年度の連結貸借対照表において、「流動資産」に表示していた「受取手形及び売掛金」は、当第1四半期連結会計期間より、「受取手形、売掛金及び契約資産」に含めて表示することといたしました。なお、収益認識会計基準第89-2項に定める経過的な取扱いに従って、前連結会計年度について新たな表示方法により組替えを行っておりません。さらに、「四半期財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第12号 2020年3月31日)第28-15項に定める経過的な取扱いに従って、前第1四半期連結累計期間に係る顧客との契約から生じる収益を分解した情報を記載しておりません。

なお、当第1四半期連結累計期間に与える影響は軽微です。

(追加情報)

当第1四半期連結累計期間
(自 2021年4月1日
至 2021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84期有価証券報告書の連結財務諸表注記「重要な会計上の見積り」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 (2021年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2021年6月30日)
投資その他の資産・その他	9,253百万円	9,243百万円

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 (2021年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2021年6月30日)
従業員(借入金)	18百万円	16百万円
グッドタイムリビング株式会社 (入居一時金等返還債務)	11,929	11,558
計	11,948	11,574

(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2020年4月1日 至2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2021年4月1日 至2021年6月30日)
株券等トレーディング損益	11,126百万円	18,023百万円
債券・為替等トレーディング損益	20,930	8,269
計	32,056	26,293

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2020年4月1日 至2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自2021年4月1日 至2021年6月30日)
	8,057百万円	12,609百万円

3 当第1四半期連結累計期間(自2021年4月1日至2021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、既存ビジネスにおける保有資産の見直しを進めております。これらに伴い、事業所の返却に係る費用44百万円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 2020年4月1日 至 2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年6月30日)
減価償却費	10,104百万円	11,252百万円
のれんの償却額	293	383

(株主資本等関係)

前第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。

当第1四半期連結累計期間(自 2021年4月1日 至 2021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
2021年4月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	38,096	25	2021年3月31日	2021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 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。

当第1四半期連結累計期間（自 2021年4月1日 至 2021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並びに収益の分解情報

（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		
顧客との契約から生じる収益	30,030	27,184	28,457	2,411	88,085	12,342	100,428
受入手数料	30,030	27,184	19,528	407	77,151	158	77,309
その他の営業収益（外部顧客）	-	-	8,929	2,004	10,933	12,184	23,118
トレーディング等の金融商品収益	12,096	19,199	-	2,010	33,306	31	33,274
資金その他（注）2	23	3	7,401	1,085	8,513	3,432	11,945
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	42,104	46,380	21,055	3,337	112,878	8,879	121,757
セグメント間の内部純営業収益 又は振替高	5,252	370	3,703	579	1,340	2,544	3,884
計	47,356	46,751	17,352	2,757	114,218	11,423	125,642
セグメント利益（経常利益）	10,037	11,328	10,000	1,824	33,191	1,748	34,940

（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 アセット・マネジメント部門、投資部門、その他の「資金その他」には、純営業収益を構成する支払手数料等が含まれております。

3 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	33,191
「その他」の区分の利益	1,748
セグメント間の取引消去	5
未実現損益の調整額	391
その他の調整額	414
四半期連結損益計算書の経常利益	34,922

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

海外のホールセール部門において、のれんの減損損失495百万円を計上しております。

(金融商品関係)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

当第1四半期連結会計期間末におけるトレーディング商品のレベル別の時価については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した投資信託については、表には含めておりません(1に記載のとおりであります)。

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で連結貸借対照表に計上している金融商品
前連結会計年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
資産				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	97,711	761	84	98,557
国債・地方債等	1,535,114	261,692	-	1,796,807
一般事業債	5,978	320,058	1,305	327,343
外国債券	1,027,327	308,726	6,151	1,342,205
その他	-	1,592,556	1,261	1,593,817
デリバティブ取引				
エクイティ	21,850	157,971	28,822	208,643
金利	948	1,712,457	9,229	1,722,634
通貨	2	503,484	4,119	507,606
クレジット・その他	-	16,187	4,829	21,017
資産計	2,688,933	4,873,897	55,802	7,618,633
負債				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	204,605	2,075	-	206,681
国債・地方債等	971,348	-	-	971,348
外国債券	769,608	23,483	-	793,092
その他	-	61,835	-	61,835
デリバティブ取引				
エクイティ	57,998	153,190	8,807	219,996
金利	117	1,637,156	6,032	1,643,306
通貨	17	440,052	249	440,319
クレジット・その他	-	26,436	4,793	31,229
負債計	2,003,697	2,344,230	19,883	4,367,811

- 「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5条第6項の経過措置を適用した投資信託については、上記表には含めておりません。連結貸借対照表における当該投資信託の金額は、商品有価証券等において資産215,460百万円、負債10百万円であります。
- 当社および一部の連結子会社は、一部の有価証券、借入金及び発行社債等にかかる金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するために、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っており、主に、繰延ヘッジを適用しております。なお、これらのヘッジ関係に、「LIBORを参照する金融商品に関するヘッジ会計の取扱い」（実務対応報告第40号 2020年9月29日）を適用しております。

当第1四半期連結会計期間末(2021年6月30日)

(単位:百万円)

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
資産				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	207,494	294	89	207,879
国債・地方債等	2,375,162	215,873	7,399	2,598,435
一般事業債	8,041	398,184	280	406,505
外国債券	1,407,656	398,196	6,880	1,812,733
その他	-	1,034,823	1,190	1,036,014
デリバティブ取引				
エクイティ	30,178	164,760	21,371	216,310
金利	149	1,727,748	10,463	1,738,362
通貨	4	373,434	4,158	377,597
クレジット・その他	-	10,911	5,203	16,115
資産計	4,028,688	4,324,228	57,037	8,409,954
負債				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	204,141	70	-	204,211
国債・地方債等	928,993	-	-	928,993
外国債券	933,043	20,395	-	953,439
その他	-	66,276	-	66,276
デリバティブ取引				
エクイティ	46,822	170,157	8,234	225,215
金利	383	1,665,799	6,843	1,673,025
通貨	2	293,869	395	294,267
クレジット・その他	-	21,784	5,100	26,885
負債計	2,113,387	2,238,352	20,574	4,372,314

- 「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6項の経過措置を適用した投資信託については、上記表には含めておりません。四半期連結貸借対照表における当該投資信託の金額は、商品有価証券等において資産54,204百万円、負債643百万円であります。
- 当社および一部の連結子会社は、一部の有価証券、借入金及び発行社債等にかかる金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するために、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っており、主に、繰延ヘッジを適用しております。なお、これらのヘッジ関係に、「LIBORを参照する金融商品に関するヘッジ会計の取扱い」(実務対応報告第40号 2020年9月29日)を適用しております。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(2021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	155,384	155,717	333
その他	-	-	-
計	155,384	155,717	333

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	93,024	137,600	44,575
債券	731,034	733,499	2,465
国債・地方債等	219,255	216,201	3,054
社債	204,267	206,115	1,847
その他	307,510	311,183	3,672
その他	144,030	150,723	6,692
計	968,090	1,021,823	53,733

(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 当連結会計年度において、市場価格のあるその他有価証券について減損処理は行っておりません。

当第1四半期連結会計期間末(2021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	159,287	160,109	821
その他	-	-	-
計	159,287	160,109	821

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	92,413	134,336	41,922
債券	791,036	796,656	5,620
国債・地方債等	221,389	220,168	1,221
社債	260,535	262,481	1,946
その他	309,111	314,006	4,894
その他	181,340	189,402	8,062
計	1,064,790	1,120,395	55,604

(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377百万円(うち、株券377百万円)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(2021年3月31日)
トレーディングに係るもの
(1) エクイティ関連取引

(単位: 百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
先物・先渡取引	335,977	12,088	651,982	18,252
スワップ取引	463,945	29,587	92,461	9,979
オプション取引	1,474,958	166,968	1,969,716	191,764
合計	2,274,881	208,643	2,714,160	219,996

(2) 金利関連取引

(単位: 百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
先物・先渡取引	12,048,369	50,932	5,263,754	35,432
スワップ取引	61,803,143	1,671,691	63,864,597	1,608,549
オプション取引	99,941	7,639	75,483	6,952
合計	73,951,455	1,730,263	69,203,835	1,650,935

(3) 通貨関連取引

(単位: 百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
先物・先渡取引	122,057	8,539	16,545	813
為替予約取引	1,557,843	44,086	1,792,068	58,763
スワップ取引	5,071,877	369,498	4,995,217	274,693
オプション取引	606,145	77,900	1,012,784	98,467
合計	7,357,924	500,025	7,816,616	432,738

(4) クレジット・その他

(単位: 百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
クレジット・その他	1,399,093	20,969	1,720,590	31,181
合計	1,399,093	20,969	1,720,590	31,181

当第1四半期連結会計期間末(2021年6月30日)

トレーディングに係るもの

(1) エクイティ関連取引

(単位:百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
先物・先渡取引	406,649	11,251	558,990	15,455
スワップ取引	441,848	23,218	243,572	10,173
オプション取引	1,896,137	181,840	2,395,937	199,586
合計	2,744,635	216,310	3,198,500	225,215

(2) 金利関連取引

(単位:百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
先物・先渡取引	5,911,112	6,286	5,920,071	7,399
スワップ取引	62,668,229	1,731,959	65,011,817	1,665,580
オプション取引	55,786	115	35,759	45
合計	68,635,128	1,738,362	70,967,649	1,673,025

(3) 通貨関連取引

(単位:百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
先物・先渡取引	117,756	8,275	14,154	750
為替予約取引	1,561,488	25,852	1,838,466	31,437
スワップ取引	4,705,517	264,125	4,862,932	165,476
オプション取引	667,356	79,343	1,011,136	96,601
合計	7,052,118	377,597	7,726,689	294,267

(4) クレジット・その他

(単位:百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
クレジット・その他	1,030,648	16,115	1,449,376	26,885
合計	1,030,648	16,115	1,449,376	26,885

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「注記事項(セグメント情報等)」に記載のとおりであります。

(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 2020年4月1日 至 2020年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益	11.55円	15.45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)	17,552	23,560
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)	17,552	23,560
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,519,983	1,524,567
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	11.50円	15.38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)	6,424	7,136
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)

2021年4月28日開催の取締役会において、2021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	38,096百万円
1株当たりの金額	25円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	2021年6月1日

(注) 2021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

2021年8月11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2021年4月1日から2022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（2021年4月1日から2021年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（2021年4月1日から2021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2021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。