

【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】 2022年8月9日

【四半期会計期間】 第86期第1四半期  
(自 2022年4月1日 至 2022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85期 第1四半期 連結累計期間	第86期 第1四半期 連結累計期間	第85期
会計期間		自 2021年4月1日 至 2021年6月30日	自 2022年4月1日 至 2022年6月30日	自 2021年4月1日 至 2022年3月31日
営業収益	(百万円)	149,836	146,640	619,471
純営業収益	(百万円)	126,721	106,122	502,093
経常利益	(百万円)	34,922	18,085	135,821
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	23,560	11,878	94,891
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	28,504	53,840	140,781
純資産額	(百万円)	1,581,457	1,668,661	1,639,888
総資産額	(百万円)	25,586,624	28,747,174	27,531,089
1株当たり四半期(当期)純利益	(円)	15.45	8.01	63.06
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	15.38	7.96	62.72
自己資本比率	(%)	5.2	4.9	5.0

(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【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。

## 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85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1兆2,160億円(4.4%)増加の28兆7,471億円となりました。内訳は流動資産が同1兆1,985億円(4.6%)増加の27兆2,081億円であり、このうち現金・預金が同6,354億円(13.8%)減少の3兆9,569億円、トレーディング商品が同6,259億円(7.8%)増加の8兆6,308億円、営業貸付金が同2,215億円(11.5%)増加の2兆1,553億円、有価証券担保貸付金が同8,719億円(10.4%)増加の9兆2,662億円となっております。固定資産は同175億円(1.2%)増加の1兆5,389億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1兆1,873億円(4.6%)増加の27兆785億円となりました。内訳は流動負債が同1兆1,045億円(4.8%)増加の24兆497億円であり、このうちトレーディング商品が同9,877億円(20.0%)増加の5兆9,336億円、約定見返勘定が同4,642億円(84.6%)減少の842億円、有価証券担保借入金が同9,435億円(10.0%)増加の10兆4,072億円、また短期借入金が同4,757億円(22.1%)減少の1兆6,800億円となっております。固定負債は同828億円(2.8%)増加の3兆250億円であり、このうち社債が同1,046億円(6.7%)減少の1兆4,589億円、長期借入金が同1,827億円(14.8%)増加の1兆4,197億円となっております。

純資産合計は同287億円(1.8%)増加の1兆6,686億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,778億円となりました。利益剰余金は、親会社株主に帰属する四半期純利益を118億円計上したほか、自己株式の消却を807億円、配当金の支払いを237億円行ったこと等により、同924億円(9.8%)減少の8,503億円となっております。自己株式の控除額は、自己株式の消却等を行った結果、同812億円(60.5%)減少の529億円、その他有価証券評価差額は同51億円(17.4%)減少の244億円、為替換算調整勘定は同351億円(74.4%)増加の824億円、非支配株主持分は同21億円(0.8%)増加の2,596億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2.1%減の1,466億円、純営業収益は同16.3%減の1,061億円となりました。

受入手数料は670億円と、同13.3%の減収となりました。委託手数料は、マーケット環境の悪化により顧客フローが減少し、同18.6%減の151億円となりました。引受業務では、エクイティや債券引受案件等が減少し、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49.4%減の53億円となりました。

トレーディング損益は、株券・債券ともにポジション運営で苦戦し収益が減少したことから、同40.7%減の155億円となりました。

販売費・一般管理費は同2.5%増の972億円となりました。取引関係費は支払手数料が増加したことから同14.3%増の174億円、人件費は、円安影響もあり海外の人件費が増加した一方で、国内の賞与が減少したことから同0.2%減の491億円となっております。

以上より、経常利益は同48.2%減の180億円となりました。

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49.6%減の118億円となりました。

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( )			
	2021年 6月期	2022年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率	2021年 6月期	2022年 6月期	対前年同期 増減率	構成比率
リテール部門	47,356	40,393	14.7%	38.1%	10,037	6,298	37.2%	28.7%
ホールセール部門	46,751	35,965	23.1%	33.9%	11,328	2,672	-	-
グローバル・マ ケッツ	31,682	24,491	22.7%	23.1%	7,795	2,073	-	-
グローバル・イン ベストメント・バン キング	15,068	11,474	23.9%	10.8%	3,144	1,155	-	-
アセット・マネジ メント部門	17,352	18,605	7.2%	17.5%	10,000	11,173	11.7%	50.9%
証券アセット・マ ネジメント	11,096	11,306	1.9%	10.6%	5,184	5,309	2.4%	24.2%
不動産アセット・ マネジメント	6,255	7,299	16.7%	6.9%	4,816	5,863	21.7%	26.7%
投資部門	2,757	3,689	33.8%	3.5%	1,824	4,483	145.7%	20.4%
その他・調整等	12,502	7,466	-	7.0%	1,730	1,196	-	-
連結計	126,721	106,122	16.3%	100.0%	34,922	18,085	48.2%	100.0%

(注) 経常利益又は経常損失( )の構成比率は、当第1四半期連結累計期間において経常利益であったセグメントの経常利益合計に占める、各セグメントの経常利益の割合としております。

[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、エクイティ収益は委託手数料が減少したほか、募集・売出し案件が前年同期に比べて少なかったことに起因する募集手数料収入の減少等により減収となりました。債券収益は募集・売出し案件の減少等により減収となりました。株式投資信託についても、販売額が減少したことから販売手数料収入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リテール部門における純営業収益は前年同期比14.7%減の403億円、経常利益は同37.2%減の62億円となりました。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38.1%及び28.7%でした。

なお、当第1四半期連結累計期間のリテール部門における、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。

[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やM&Aアドバイザリー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顧客フロー収益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、市場の不透明感を背景とした顧客フローの減少に加え、ポジション運営も苦戦したことから、減収となりました。フィクストインカム収益は、海外において、金利のボラティリティ上昇を背景に収益機会が増加した一方、国内において、クレジットスプレッドのワイドニングによりクレジット収益が低迷し、また、デリバティブのポジション運営で苦戦したことから、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244億円(前年同期316億円)、経常損失は20億円(前年同期は77億円の経常利益)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を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・バンキングは減収減益となりました。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、かつ、多数の債券主幹事案件を積上げた前年同期との比較では、減収となりました。また、M&Aビジネスでは、海外で多数の案件を遂行しました。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114億円（前年同期150億円）、経常損失は11億円（前年同期は31億円の経常利益）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359億円（前年同期467億円）、経常損失は26億円（前年同期は113億円の経常利益）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のグループ全体に占める割合は33.9%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す。

証券アセット・マネジメントの主な収益源は、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、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、時価の下落により、公募投資信託の運用資産残高は前連結会計年度末比4.5%減の20.7兆円となりましたが、期中平均残高は前年同期を上回り、当第1四半期累計期間の純営業収益は前年同期比1.9%増の113億円、経常利益は同2.4%増の53億円となりました。

不動産アセット・マネジメントの主な収益源は、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、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2.0%増の1兆3,049億円となりました。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16.7%増の72億円、経常利益は同21.7%増の58億円となりました。

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7.2%増の186億円、経常利益は同11.7%増の111億円となりました。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17.5%及び50.9%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、大和企業投資、大和P I パートナーズ及び大和エネルギー・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、株式への配当、売電収入などのインカムゲインです。

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、大和エネルギー・インフラでは、太陽光発電所の取得など、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33.8%増の36億円、経常利益は同145.7%増の44億円となりました。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3.5%及び20.4%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による、当第1四半期連結累計期間の投資部門における業績への影響は限定的です。

[ 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1.1%減の4兆1,515億円、銀行口座数は同1.3%増の158万口座となりました。

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74億円（前年同期125億円）、経常損失は11億円（前年同期は17億円の経常利益）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の連結純営業収益に占める割合は7.0%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85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、2020年前半の新型コロナウイルスの感染拡大による落ち込みからの回復局面が依然として続いています。経済の正常化が進むにしたがってその改善ペースは鈍化しつつあります。IMF（国際通貨基金）が2022年7月に公表した世界経済見通しによれば、2020年の大幅な落ち込みからの反動もあり、2021年の世界経済成長率は+6.1%と、IMFが成長率を公表する1980年以降で最も高い成長となりました。一方、2022年の世界経済成長率は+3.2%へと低下することが見込まれています。世界的にコロナ禍で落ち込んだサービス活動の回復が継続すると見込まれる一方、歴史的に高いインフレ率や、それに対応するための当局による金融引き締めが、景気拡大ペースを抑制すると予想されています。また、2022年初に始まったロシアによるウクライナへの侵攻を契機とした地政学的リスクの高まりは、世界経済における新たなリスクとなっています。

米国経済は、回復傾向が続いているものの、そのペースが鈍化しつつあります。2022年1 - 3月期の実質GDP成長率は、前期比年率 1.6%と2020年4 - 6月期以来のマイナス成長となりました。国内最終需要については前期から伸びが加速する一方、世界的な半導体不足などの供給制約を背景とした輸出の伸び悩みや、輸入の増加及び在庫調整が、GDPを押し下げました。また、好調だった国内最終需要のなかでも、個人消費及び住宅投資については前期から伸びが鈍化しました。これは、記録的なペースでの物価上昇が続く中、消費者マインドの悪化が個人消費の抑制につながっていることに加えて、金利の上昇が住宅投資を抑制したものです。4 - 6月期に入ってもインフレ率は非常に高い状態が続いていることに加えて、株価の下落基調が続いていることもあり、個人消費を中心とした内需の減速傾向が継続し、4 - 6月期の実質GDP成長率は、前期比年率 0.9%と2四半期連続で低下しました。

金融面では、FRB（連邦準備制度理事会）は、コロナ禍以降続けてきた緩和的な金融政策を終了し、金融緩和の縮小、金融引き締めへと姿勢を転換しています。FRBは、米国経済がコロナ禍による落ち込みから回復してきていることを受けて、2021年11月のFOMC（連邦公開市場委員会）で量的緩和の縮小開始を決定し、コロナ禍以降続けてきたFRBによるバランスシートの拡大は、2022年2月に停止されました。また、米国のインフレ率が目標である2%を大幅に上回っていることを背景に、2022年3月のFOMCでは政策金利が0.25%pt引き上げられ、2020年3月以降続けてきた実質的なゼロ金利政策が終了しました。続く5月のFOMCでは、0.50%ptの利上げに加えて、バランスシートの縮小の開始が決定されました。6月のFOMCでは、3会合連続での利上げが決定され、利上げ幅も0.75%ptへとさらに拡大しました。

欧州経済（ユーロ圏経済）は、緩やかな回復基調が続いています。2021年末にかけて、欧州では新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限が経済の下押し要因となっていました。2022年に入ると行動制限が緩和され、経済への下押し圧力は弱まりました。一方で、2月下旬に開始したロシアによるウクライナ侵攻に伴うマインドの悪化やエネルギー価格の高騰が、個人消費や企業活動を鈍らせる要因となりました。2022年1 - 3月期の実質GDP成長率は、輸入の減少を主因に前期比年率+2.0%と伸びが加速しましたが、国内需要については前期から伸びが鈍化し、小幅な増加にとどまりました。ウクライナを巡る問題は4 - 6月期に入っても解決せず、とりわけロシアからの禁輸措置によるエネルギーの供給不安が、企業活動を鈍らせる要因になっています。4 - 6月期の実質GDP成長率は前期比年率+2.8%とプラス成長が続いたものの、エネルギー価格の高騰を主因とした高インフレは企業や家計への打撃となっており、先行きに対する不透明感が増えています。

金融面では、ECB（欧州中央銀行）はコロナ禍以降の金融緩和から正常化へと舵を切りつつあります。2021年12月のECB理事会では、コロナ禍で新設されたパンデミック緊急購入プログラムによる資産の買い入れを2022年3月に終了することが決定されました。また、インフレが加速する中、2022年3月のECB理事会では、コロナ禍以前から実施されてきた資産購入プログラムについても終了を前倒しする方針が示され、6月の理事会では、7月1日で同プログラムを終了することが決定されました。さらに、同じく6月の理事会では、次回の7月の理事会で政策金利の0.25%ptの利上げを実施する方針が示され、その後もさらに利上げを続けていく姿勢が示されました。

新興国経済は、2020年後半以降、総じて持ち直しの動きが続いています。IMFによれば、2021年の新興国の実質GDP成長率は、前年の落ち込みの反動から+6.8%と高い成長となりました。また、2022年は+3.6%の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、2022年1 - 3月期の実質GDP成長率は前年比+4.8%となり、前期から伸びが加速しました。しかし、新型コロナウイルスの感染者数が急増し、ゼロコロナ政策の下、上海などの多くの都市でロックダウンが実施されたことを主因に、4 - 6月期前半の中国経済は急減速し、4 - 6月期の実質GDP成長率は前年比+0.4%の低成長となりました。しかし、感染者数の減少を受けてロックダウンが順次解除されたことに加えて、財政・金融政策による下支えもあり、4 - 6月期後半から、中国経済は再び持ち直しに向かっています。

中国以外の新興国は、総じて見れば持ち直しの動きが続きました。欧米を中心とした主要国経済の回復による外需の拡大が新興国経済を下支えたことに加え、一部の資源国では、資源価格の上昇が経済を押し上げる要因となりました。一方、高インフレや、米国での金融緩和縮小、金利上昇に伴う資金流出抑制のため、多くの国が利上げを余儀なくされており、新興国でも景気減速のリスクは高まりつつあります。

#### <日本の状況>

日本経済は、新型コロナウイルスの感染動向に大きく左右されつつ、2022年度は回復基調にあります。2022年1 - 3月期は、感染者数の増加を受けて多くの地域でまん延防止等重点措置が適用されたことに加え、半導体不足による供給制約なども影響し、実質GDP成長率は前期比年率 0.5%と、小幅ながら2四半期ぶりのマイナス成長となりました。しかし、まん延防止等重点措置が解除され、経済活動の正常化が進んだことで、4 - 6月期には再び経済は回復へと向かいました。ただし、中国の上海でのロックダウンに伴うサプライチェーンの混乱や需要の減少などが足を引っ張り、経済の回復ペースは緩やかなものとなっています。

需要項目ごとに見ると、個人消費は、2022年度に入って持ち直しに向かっています。2022年1 - 3月期は、感染再拡大に伴い多くの地域でまん延防止等重点措置が適用されたことで、サービス消費の回復に足踏みがみられました。巣ごもり消費の増加は個人消費を下支えしましたが、半導体不足による自動車の供給不足などの影響で耐久財の消費が減少したこともあり、個人消費全体では前期からほぼ横ばいとなりました。その後、まん延防止等重点措置が3月21日を期限に全面解除されたことで、4 - 6月期に入ってサービス消費を中心に個人消費は持ち直しに向かっています。住宅投資については、資材価格上昇を背景とした価格上昇などにより、2021年後半以降は緩やかに減少傾向が続いています。

企業部門の需要である設備投資は、横ばい圏で推移しています。2022年1 - 3月期の設備投資は、まん延防止等重点措置に伴う個人消費の減少や、供給制約による生産活動の停滞、さらにはロシアのウクライナ侵攻による先行きの不透明感などが影響し、前期から減少しました。しかし、4 - 6月期に入って新型コロナウイルスの感染者数が減少し、国内の経済活動が再開される中、設備投資にも再び増加の兆しが見られています。ただし、中国のロックダウンによるサプライチェーン混乱の影響などもあり、4 - 6月期の設備投資の持ち直しは非常に緩やかなものとなっています。なお、新型コロナウイルス感染症拡大の影響などから2021年に見送られた設備投資の一部は2022年に先送りされているとみられ、日銀短観（2022年6月調査）によれば、2022年度の設備投資計画（含む土地投資額）は、前年比+14.1%と高い伸びが見込まれています。

金融面では、短期金利に加えて長期金利も操作対象とする日本銀行の金融緩和措置が継続しています。ただし、日本経済がコロナ禍による落ち込みから持ち直す中、日本銀行は、2021年12月の政策決定会で、コロナ禍への対応として導入された社債などの買い入れ増額の一部について2022年3月で終了することを決定しました。日本銀行による緩和的な金融政策が続くものの、2022年に入って米国長期金利が上昇する中、日本の10年国債利回りでも上昇圧力が強まっており、2022年3月頃からは、日本銀行が政策目標とする範囲の上限である0.25%近傍で推移しています。

為替市場をみると、2022年以降、総じて円安傾向で推移しました。米国では高インフレを抑制するためにFRBが利上げを続ける姿勢を示し、長期金利の上昇が続いた一方、日本では日本銀行による低金利政策が維持されたことで、日米金利差が拡大し、対ドルレートは非常に速いペースで円安が進みました。年初時点で115円台だった対ドルレートは、6月には一時137円台とおよそ24年ぶりの円安水準となりました。対ユーロでも同様に、ユーロ圏との金利差拡大を背景に円安が進み、年初時点の130円台から6月には一時144円台まで円安が進みました。

株式市場では、2022年に入って株価は一進一退での推移が続いています。FRBによる利上げ観測が急速に高まったことに加え、ロシアによるウクライナ侵攻による市場センチメントの悪化もあって、日本株式は年初をピークに下落し、年初に29,300円台だった日経平均株価は3月半ばには25,000円を割り込みました。しかし3月後半に入ると、米国株式が一時的に持ち直したことに加えて、円安が急速に進んだことを背景に、日経平均株価も持ち直しました。その後、4 - 6月期に入ると、米国での金融引き締めや、景気減速懸念によって米国の株価が一進一退となる中、日経平均も上昇・下落を繰り返す不安定な相場展開となりました。

2022年6月末の日経平均株価は26,393円4銭（同年3月末比1,428円39銭安）、10年国債利回りは0.242%（同0.024%ptの上昇）、為替は1ドル136円20銭（同14円56銭の円安）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、「金融商品取引法第五十七条の十七第一項の規定に基づき、最終指定親会社が当該最終指定親会社及びその子法人等の経営の健全性を判断するための基準として定める最終指定親会社及びその子法人等の経営の健全性のうち流動性に係る健全性の状況を表示する基準」（平成26年金融庁告示第61号）により連結流動性カバレッジ比率（以下、「LCR」という。）及び連結安定調達比率（以下、「NSFR」という。）を所定の比率（それぞれ100%）以上に維持することが求められており、当第1四半期日次平均のLCRは141.1%です。当第1四半期末のNSFRは所定の比率を上回る見込みとなっております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCR及びNSFR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 2022年 4月 至 2022年 6月)
適格流動資産	(A)	24,470
資金流出額	(B)	36,422
資金流入額	(C)	19,083
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)	24,470
純資金流出額	(E)	17,338
連結流動性カバレッジ比率	(D)/(E)	141.1%

<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一部の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112億円減少し、1兆2,752億円となりました。また、資本金及び資本剰余金の合計は4,778億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118億円を計上したほか、自己株式の消却を807億円、配当金の支払いを237億円行った結果、前連結会計年度末比924億円減少の8,503億円となりました。自己株式の控除額は、自己株式の消却等を行った結果、同812億円減少し、529億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) (2022年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (2022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	1,569,378,772	1,569,378,772	東京証券取引所プライム市場 名古屋証券取引所プレミアム市場	単元株式数は100株 あります。
計	1,569,378,772	1,569,378,772	-	-

##### (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)
2022年5月10日 (注)	130,000	1,569,378	-	247,397	-	226,751

(注) 自己株式の消却による減少であります。

##### (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(2022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】

2022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 216,066,400	-	-
	(相互保有株式) 普通株式 286,200	-	-
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,482,452,800	14,824,528	-
単元未満株式	普通株式 573,372	-	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	-	14,824,528	-

- (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85株が含まれております。
- 3 2022年4月27日開催の執行役員会における決議に基づき、2022年5月10日付で自己株式を消却したことにより、発行済株式総数が130,000,000株減少しております。

【自己株式等】

2022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	216,066,400	-	216,066,400	12.71
計	-	216,066,400	-	216,066,400	12.71

- (注) 1 当社は、単元未満自己株式85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286,200株あります。
- 3 2022年4月27日開催の執行役員会における決議に基づき、2022年5月10日付で自己株式を消却したことにより、発行済株式総数が130,000,000株減少しております。

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（2022年4月1日から2022年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（2022年4月1日から2022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 (2022年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2022年6月30日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	4,592,384	3,956,935
預託金	559,729	552,760
受取手形、売掛金及び契約資産	22,420	20,689
有価証券	1,177,898	1,155,314
トレーディング商品	8,004,920	8,630,884
商品有価証券等	5,919,617	6,263,426
デリバティブ取引	2,085,303	2,367,457
営業投資有価証券	123,839	134,997
投資損失引当金	151	187
営業貸付金	1,933,758	2,155,308
仕掛品	768	999
信用取引資産	177,401	175,506
信用取引貸付金	170,555	168,831
信用取引借証券担保金	6,845	6,675
有価証券担保貸付金	8,394,277	9,266,201
借入有価証券担保金	5,283,874	6,366,511
現先取引貸付金	3,110,403	2,899,690
立替金	22,454	21,531
短期貸付金	439	653
未収収益	40,062	42,506
その他の流動資産	967,025	1,102,207
貸倒引当金	7,589	8,116
<b>流動資産計</b>	<b>26,009,638</b>	<b>27,208,192</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	913,879	915,681
無形固定資産	121,482	121,816
のれん	19,657	19,699
その他	101,825	102,117
投資その他の資産	486,088	501,484
投資有価証券	443,446	460,654
長期貸付金	6,451	6,468
長期差入保証金	16,748	16,825
繰延税金資産	11,992	8,374
その他	1 12,491	1 14,204
貸倒引当金	1 1,422	1 1,421
投資損失引当金	3,620	3,620
<b>固定資産計</b>	<b>1,521,450</b>	<b>1,538,981</b>
<b>資産合計</b>	<b>27,531,089</b>	<b>28,747,174</b>

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2022年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2022年6月30日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
支払手形及び買掛金	6,361	5,540
トレーディング商品	4,945,900	5,933,696
商品有価証券等	2,948,427	3,689,599
デリバティブ取引	1,997,473	2,244,097
約定見返勘定	548,406	84,204
信用取引負債	70,318	62,949
信用取引借入金	5,327	1,631
信用取引貸証券受入金	64,991	61,318
有価証券担保借入金	9,463,697	10,407,202
有価証券貸借取引受入金	4,761,437	5,899,241
現先取引借入金	4,702,259	4,507,960
銀行業における預金	4,189,105	4,142,009
預り金	456,384	551,140
受入保証金	347,468	408,653
短期借入金	2,155,782	1,680,005
コマーシャル・ペーパー	116,000	145,000
1年内償還予定の社債	446,760	465,035
未払法人税等	8,649	4,361
賞与引当金	37,586	13,899
その他の流動負債	152,851	146,079
流動負債計	22,945,274	24,049,778
<b>固定負債</b>		
社債	1,563,631	1,458,959
長期借入金	1,237,048	1,419,797
繰延税金負債	42,241	44,467
退職給付に係る負債	44,236	44,336
訴訟損失引当金	115	122
その他の固定負債	54,934	57,332
固定負債計	2,942,208	3,025,015
<b>特別法上の準備金</b>		
金融商品取引責任準備金	3,717	3,718
特別法上の準備金計	3,717	3,718
負債合計	25,891,200	27,078,513

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2022年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2022年6月30日)
<b>純資産の部</b>		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,451	230,451
利益剰余金	942,793	850,340
自己株式	134,201	52,944
自己株式申込証拠金	26	7
株主資本合計	1,286,467	1,275,251
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	29,587	24,452
繰延ヘッジ損益	9,940	18,419
為替換算調整勘定	47,288	82,467
その他の包括利益累計額合計	86,815	125,339
新株予約権	9,109	8,433
非支配株主持分	257,497	259,637
純資産合計	1,639,888	1,668,661
負債・純資産合計	27,531,089	28,747,174



## ( 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 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
<b>営業収益</b>		
受入手数料	77,309	67,004
委託手数料	18,600	15,137
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	10,595	5,357
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	6,295	3,620
その他の受入手数料	41,817	42,889
トレーディング損益	<sup>1</sup> 26,293	<sup>1</sup> 15,594
営業投資有価証券関連損益	1,681	2,544
金融収益	21,295	34,836
その他の営業収益	23,257	26,659
<b>営業収益計</b>	<b>149,836</b>	<b>146,640</b>
金融費用	10,421	23,556
その他の営業費用	12,692	16,961
純営業収益	126,721	106,122
<b>販売費・一般管理費</b>		
取引関係費	15,230	17,409
人件費	<sup>2</sup> 49,200	<sup>2</sup> 49,116
不動産関係費	9,137	9,704
事務費	5,657	6,178
減価償却費	8,771	8,623
租税公課	2,858	2,283
貸倒引当金繰入れ	0	36
その他	4,017	3,921
<b>販売費・一般管理費計</b>	<b>94,873</b>	<b>97,274</b>
<b>営業利益</b>	<b>31,848</b>	<b>8,847</b>
<b>営業外収益</b>		
受取配当金	1,532	1,492
持分法による投資利益	493	1,639
為替差益	-	780
投資事業組合運用益	679	5,004
その他	1,036	1,208
<b>営業外収益計</b>	<b>3,742</b>	<b>10,127</b>
<b>営業外費用</b>		
支払利息	458	476
社債発行費	18	-
その他	191	412
<b>営業外費用計</b>	<b>668</b>	<b>889</b>
<b>経常利益</b>	<b>34,922</b>	<b>18,085</b>

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
<b>特別利益</b>		
固定資産受贈益	318	-
投資有価証券売却益	236	2,179
訴訟損失引当金戻入額	686	-
新株予約権戻入益	-	667
特別利益計	1,241	2,846
<b>特別損失</b>		
固定資産除売却損	66	30
減損損失	495	-
投資有価証券評価損	380	308
持分変動損失	-	42
金融商品取引責任準備金繰入れ	-	1
構造改革関連費用	344	-
事業再編等関連費用	-	491
120周年記念事業関連費用	-	276
特別損失計	987	751
税金等調整前四半期純利益	35,176	20,180
法人税、住民税及び事業税	4,561	1,214
法人税等調整額	4,743	4,309
法人税等合計	9,304	5,524
四半期純利益	25,871	14,656
非支配株主に帰属する四半期純利益	2,310	2,778
親会社株主に帰属する四半期純利益	23,560	11,878

## 【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 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
四半期純利益	25,871	14,656
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	696	5,071
繰延ヘッジ損益	2,198	8,528
為替換算調整勘定	1,410	33,075
持分法適用会社に対する持分相当額	2,723	2,651
その他の包括利益合計	2,632	39,183
四半期包括利益	28,504	53,840
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	25,741	50,401
非支配株主に係る四半期包括利益	2,762	3,438

## 【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 2022年4月1日  
至 2022年6月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。)を当第1四半期連結会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。

なお、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 2022年4月1日  
至 2022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、当第1四半期連結会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。)に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## (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85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 (2022年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2022年6月30日)
投資その他の資産・その他	9,231百万円	9,262百万円

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 (2022年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (2022年6月30日)
従業員(借入金)	6百万円	4百万円
グッドタイムリビング株式会社 (入居一時金等返還債務)	10,996	10,874
その他(スタンバイ信用状)	2,302	2,402
計	13,305	13,281

(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 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
株券等トレーディング損益	18,023百万円	9,987百万円
債券・為替等トレーディング損益	8,269	5,607
計	26,293	15,594

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 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
	12,609百万円	9,896百万円

3 前第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。

4 当第1四半期連結累計期間(自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)

事業再編等関連費用には、海外子会社の事業再編等に伴う費用が含まれております。

(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 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
減価償却費	11,252百万円	11,001百万円
のれんの償却額	383	411

(株主資本等関係)

前第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。

3 株主資本の金額が前連結会計年度末に比べて著しい変動がある場合  
該当事項はありません。

当第1四半期連結累計期間(自 2022年4月1日 至 2022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
2022年4月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	23,732	16	2022年3月31日	2022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。

3 株主資本の金額が前連結会計年度末に比べて著しい変動がある場合  
当社は、2022年4月27日開催の執行役員会決議に基づき、2022年5月10日付で、自己株式13,000万株の消却を実施いたしました。当該消却により、当第1四半期連結累計期間において利益剰余金及び自己株式がそれぞれ80,744百万円減少しております。この結果等により、当第1四半期連結会計期間末において利益剰余金が850,340百万円、自己株式が52,944百万円となっております。

(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 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 (注) 2	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) 3	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 顧客との契約から生じる収益には、賃貸借契約に基づくリース収益を含めております。

3 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。

4 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。

当第1四半期連結累計期間（自 2022年4月1日 至 2022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 (注)2	25,484	21,196	29,244	2,929	78,855	13,891	92,746
受入手数料	25,484	21,196	19,764	347	66,793	211	67,004
その他の営業収益（外部顧客）	-	-	9,480	2,581	12,061	13,679	25,741
トレーディング等の金融商品収益	9,377	14,828	-	2,771	26,977	46	27,024
資金その他（注）3	24	55	7,545	1,366	8,991	10,074	19,065
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	34,838	35,969	21,699	4,335	96,841	3,863	100,705
セグメント間の内部純営業収益 又は振替高	5,555	3	3,093	645	1,813	1,804	3,618
計	40,393	35,965	18,605	3,689	98,655	5,668	104,324
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 （ ））	6,298	2,672	11,173	4,483	19,282	913	18,369

(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 顧客との契約から生じる収益には、賃貸借契約に基づくリース収益を含めております。

3 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。

4 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	19,282
「その他」の区分の損失（ ）	913
セグメント間の取引消去	-
未実現損益の調整額	204
その他の調整額	488
四半期連結損益計算書の経常利益	18,085

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。



(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。

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（2022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
<b>資産</b>				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	115,391	140	73	115,605
国債・地方債等	2,265,332	189,523	-	2,454,856
一般事業債	7,319	445,249	20	452,589
外国債券	1,823,468	298,980	51,977	2,174,426
その他	10,854	595,072	995	606,922
デリバティブ取引				
エクイティ	64,191	168,739	82,179	315,110
金利	1,636	1,176,144	5,008	1,182,790
通貨	2	542,976	3,568	546,547
クレジット・その他	12	32,663	8,179	40,855
資産計	4,288,209	3,449,491	152,001	7,889,703
<b>負債</b>				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	178,321	-	-	178,321
国債・地方債等	1,221,603	158	-	1,221,762
外国債券	1,367,511	25,988	-	1,393,499
その他	-	147,628	-	147,628
デリバティブ取引				
エクイティ	139,035	184,876	5,842	329,755
金利	440	1,134,415	4,677	1,139,533
通貨	8	481,936	444	482,389
クレジット・その他	-	39,735	6,060	45,795
負債計	2,906,921	2,014,740	17,024	4,938,686

- 「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115,217百万円、負債7,214百万円であります。
- 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 2022年3月17日）を適用しております。

当第1四半期連結会計期間末(2022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
<b>資産</b>				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	76,090	11,082	153	87,326
国債・地方債等	2,437,940	125,337	-	2,563,278
一般事業債	1,900	310,860	41	312,802
外国債券	2,093,514	525,106	33,403	2,652,023
受益証券	98,728	18,392	-	117,121
その他	16,219	513,178	1,475	530,873
デリバティブ取引				
エクイティ	55,080	182,540	162,257	399,878
金利	1,795	1,278,096	5,125	1,285,017
通貨	8	647,465	4,169	651,643
クレジット・その他	-	20,585	10,332	30,917
資産計	4,781,279	3,632,646	216,958	8,630,884
<b>負債</b>				
(1) トレーディング商品				
商品有価証券等				
株券・ワラント	195,952	563	-	196,515
国債・地方債等	1,575,190	136	-	1,575,326
外国債券	1,685,878	50,816	-	1,736,694
受益証券	22,092	-	-	22,092
その他	-	158,970	-	158,970
デリバティブ取引				
エクイティ	130,409	252,596	3,161	386,167
金利	186	1,266,436	3,433	1,270,057
通貨	4	554,454	759	555,218
クレジット・その他	-	24,923	7,730	32,653
負債計	3,609,714	2,308,898	15,083	5,933,696

- 1 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 2022年3月17日)を適用しております。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(2022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	171,576	170,315	1,260
その他	-	-	-
計	171,576	170,315	1,260

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	101,599	142,547	40,947
債券	836,538	817,698	18,840
国債・地方債等	227,842	220,349	7,493
社債	229,352	230,692	1,340
その他	379,343	366,656	12,687
その他	229,458	237,260	7,802
計	1,167,596	1,197,505	29,909

(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730百万円(うち、株券399百万円、その他331百万円)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(2022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	173,603	171,212	2,390
その他	-	-	-
計	173,603	171,212	2,390

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	104,357	146,035	41,678
債券	825,979	792,592	33,387
国債・地方債等	150,151	139,334	10,816
社債	186,003	187,292	1,289
その他	489,824	465,964	23,860
その他	227,756	236,966	9,209
計	1,158,094	1,175,594	17,500

(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281百万円(うち、その他281百万円)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(2022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	413,666	6,209	678,365	34,699
スワップ取引	708,969	74,373	169,301	7,815
オプション取引	3,676,055	234,527	4,172,984	287,239
合計	4,798,690	315,110	5,020,650	329,755

(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	3,172,953	34,850	1,808,451	23,160
スワップ取引	48,524,615	1,147,489	46,459,352	1,116,309
オプション取引	51,499	450	33,764	64
合計	51,749,068	1,182,790	48,301,569	1,139,533

(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	121,734	15,419	26,081	2,517
為替予約取引	2,417,129	91,177	2,820,279	117,374
スワップ取引	4,793,550	364,922	4,409,058	245,488
オプション取引	560,103	75,026	920,934	117,007
合計	7,892,516	546,547	8,176,353	482,389

(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
先物・先渡取引	94	12	-	-
その他	2,133,890	40,843	2,180,990	45,795
合計	2,133,985	40,855	2,180,990	45,795

当第1四半期連結会計期間末(2022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	194,782	4,717	1,573,226	23,506
スワップ取引	720,066	143,818	163,868	4,341
オプション取引	3,867,324	251,342	4,496,476	358,319
合計	4,782,174	399,878	6,233,572	386,167

(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	3,613,594	11,477	1,665,899	7,674
スワップ取引	45,474,668	1,273,514	44,397,483	1,262,199
オプション取引	91,025	25	91,025	183
合計	49,179,287	1,285,017	46,154,407	1,270,057

(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	126,974	25,441	38,086	5,005
為替予約取引	3,401,746	95,214	4,045,223	127,757
スワップ取引	4,824,979	449,374	4,455,910	273,188
オプション取引	537,494	81,614	967,849	149,266
合計	8,891,194	651,643	9,507,069	555,218

(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	1,596,339	30,917	1,554,305	32,653
合計	1,596,339	30,917	1,554,305	32,653

(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 2021年4月1日 至 2021年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年6月30日)
(1) 1株当たり四半期純利益	15.45円	8.01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)	23,560	11,878
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)	23,560	11,878
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,524,567	1,483,794
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	15.38円	7.96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)	7,136	7,658
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 )

2022年4月27日開催の取締役会において、2022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	23,732百万円
1株当たりの金額	16円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	2022年6月6日

(注) 2022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

2022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

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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 間 瀬 友 未

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深 井 康 治

### 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2022年4月1日から2023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（2022年4月1日から2022年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（2022年4月1日から2022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2022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. 上記の四半期レビュー報告書の原本は当社(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。