

【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】 2023年2月10日

【四半期会計期間】 第86期第3四半期
(自 2022年10月1日 至 2022年12月31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3四半期 連結累計期間	第86期 第3四半期 連結累計期間	第85期
会計期間		自 2021年4月1日 至 2021年12月31日	自 2022年4月1日 至 2022年12月31日	自 2021年4月1日 至 2022年3月31日
営業収益	(百万円)	471,138	572,229	619,471
純営業収益	(百万円)	390,317	338,488	502,093
経常利益	(百万円)	112,481	56,112	135,821
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	76,902	46,750	94,891
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	96,321	81,518	140,781
純資産額	(百万円)	1,600,496	1,657,832	1,639,888
総資産額	(百万円)	26,415,274	28,115,421	27,531,089
1株当たり四半期(当期)純利益	(円)	50.86	31.75	63.06
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益	(円)	50.60	31.60	62.72
自己資本比率	(%)	5.0	4.9	5.0

回次		第85期 第3四半期 連結会計期間	第86期 第3四半期 連結会計期間
会計期間		自 2021年10月1日 至 2021年12月31日	自 2022年10月1日 至 2022年12月31日
1株当たり四半期純利益	(円)	17.90	10.52

(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3四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3四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3四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3四半期連結会計期間末の総資産は前連結会計年度末比5,843億円(2.1%)増加の28兆1,154億円となりました。内訳は流動資産が同5,695億円(2.2%)増加の26兆5,791億円であり、このうち現金・預金が同1,266億円(2.8%)減少の4兆4,657億円、有価証券が同1,404億円(11.9%)減少の1兆374億円、トレーディング商品が同3,202億円(4.0%)増加の8兆3,251億円、有価証券担保貸付金が同4,918億円(5.9%)増加の8兆8,861億円、その他の流動資産が同837億円(8.7%)増加の1兆507億円となっております。固定資産は同147億円(1.0%)増加の1兆5,362億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5,663億円(2.2%)増加の26兆4,575億円となりました。内訳は流動負債が同4,153億円(1.8%)増加の23兆3,606億円であり、このうちトレーディング商品が同6,601億円(13.3%)増加の5兆6,060億円、約定見返勘定が同1,700億円(31.0%)増加の7,184億円、有価証券担保借入金が同2,219億円(2.3%)増加の9兆6,856億円、預り金が同823億円(18.0%)増加の5,387億円、受入保証金が同2,226億円(64.1%)増加の5,700億円、短期借入金が同1兆569億円(49.0%)減少の1兆987億円、コマーシャル・ペーパーが同1,823億円(157.2%)増加の2,983億円、1年内償還予定の社債が同626億円(14.0%)増加の5,094億円となっております。固定負債は同1,510億円(5.1%)増加の3兆932億円であり、このうち社債が同2,381億円(15.2%)減少の1兆3,254億円、長期借入金が同3,896億円(31.5%)増加の1兆6,266億円となっております。

純資産合計は同179億円(1.1%)増加の1兆6,578億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,777億円となりました。利益剰余金は親会社株主に帰属する四半期純利益を467億円計上したほか、自己株式の消却を807億円、配当金399億円の支払いを行ったこと等により、同737億円(7.8%)減少の8,690億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625億円(46.6%)減少の716億円、その他有価証券評価差額金は同127億円(42.9%)減少の168億円、為替換算調整勘定は同255億円(54.1%)増加の728億円、非支配株主持分は同32億円(1.3%)増加の2,607億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3四半期連結累計期間の営業収益は前年同期比21.5%増の5,722億円、純営業収益は同13.3%減の3,384億円となりました。

受入手数料は2,071億円と、同15.4%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17.7%減の479億円となりました。引受業務では、エクイティや債券の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は、同43.4%減の193億円となりました。

トレーディング損益は、エクイティのデリバティブ運営で苦戦したことから、同30.1%減の563億円となりました。

販売費・一般管理費は前年同期比1.5%増の2,961億円となりました。取引関係費は支払手数料が増加し同14.5%増の535億円、人件費は賞与が減少したことにより同2.0%減の1,480億円となっております。

以上より、経常利益は同50.1%減の561億円となりました。

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39.2%減の467億円となりました。

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 12月期	2022年 12月期	対前年同期 増減率	構成比率	2021年 12月期	2022年 12月期	対前年同期 増減率	構成比率 (注)
リテール部門	146,794	123,785	15.7%	36.6%	35,104	19,614	44.1%	33.4%
ホールセール部門	150,864	117,547	22.1%	34.7%	40,539	786	-	-
グローバル・ マーケット	100,142	77,695	22.4%	22.9%	27,925	3,327	-	-
グローバル・イ ンベストメント ・バンキング	50,721	39,852	21.4%	11.8%	11,429	1,502	86.9%	-
アセット・マネジ メント部門	53,291	52,825	0.9%	15.6%	34,052	32,528	4.5%	55.5%
証券アセット・マ ネジメント	34,117	32,536	4.6%	9.6%	16,677	14,098	15.5%	24.0%
不動産アセット・ マネジメント	19,174	20,289	5.8%	6.0%	17,374	18,430	6.1%	31.5%
投資部門	6,940	9,399	35.4%	2.8%	3,089	6,505	110.6%	11.1%
その他・調整等	32,426	34,931	-	10.3%	304	1,748	-	-
連結計	390,317	338,488	13.3%	100.0%	112,481	56,112	50.1%	100.0%

(注) 経常利益又は経常損失()の構成比率は、当第3四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3四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3四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15.7%減の1,237億円、経常利益は同44.1%減の196億円となりました。リテール部門の当第3四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36.6%及び33.4%でした。

なお、当第3四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ことから、増収となりました。その結果、当第3四半期連結累計期間の純営業収益は776億円(前年同期1,001億円)、経常損失は33億円(前年同期は279億円の経常利益)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・債券の双方で主幹事案件を多数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、国内外で多数の案件を遂行しました。これらの結果、当第3四半期連結累計期間の純営業収益は398億円（前年同期507億円）、経常利益は15億円（前年同期114億円）となりました。

その結果、当第3四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1,175億円（前年同期1,508億円）、経常損失は7億円（前年同期は405億円の経常利益）となりました。ホールセール部門の当第3四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34.7%でした。

なお、当第3四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、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・マネジメントは減収減益となりました。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5.6%減の20兆4,857億円となりました。その結果、当第3四半期連結累計期間の純営業収益は前年同期比4.6%減の325億円、経常利益は同15.5%減の140億円となりました。

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5.8%増の1兆3,532億円となりました。その結果、当第3四半期連結累計期間の純営業収益は前年同期比5.8%増の202億円、経常利益は同6.1%増の184億円となりました。

当第3四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0.9%減の528億円、経常利益は同4.5%減の325億円となりました。アセット・マネジメント部門の当第3四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15.6%及び55.5%でした。

なお、当第3四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3四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3四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35.4%増の93億円、経常利益は同110.6%増の65億円となりました。投資部門の当第3四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2.8%及び11.1%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3四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3四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1.2%減の4兆1,489億円、銀行口座数は同4.5%増の164万口座となり、金融収支が改善した結果、当第3四半期連結累計期間の業績は増収増益となりました。

一方で、その他セグメントに属する一部のグループ会社が前年同期比で減益となったため、その他・調整等に係る純営業収益は349億円（前年同期324億円）、経常損失は17億円（前年同期は3億円の経常損失）となりました。その他・調整等の当第3四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10.3%でした。

なお、当第3四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3四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3四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、総じて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拡大基調が続いていますが、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2023年1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+6.2%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+3.4%へと低下したと見込まれています。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要因となっています。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や、それに伴うエネルギー不足への懸念などが、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、緩やかな回復傾向が続いています。2022年4 - 6月期の実質GDP成長率は、前期比年率 0.6%と2四半期連続のマイナス成長となりました。中国・上海市でのロックダウンなどを背景とした供給制約によって生産が停滞し、在庫投資が大幅に減少したことに加え、金利上昇を背景に住宅投資が減少したことでGDPが押し下げられました。他方、労働市場が改善基調を維持する中、経済正常化によるサービス消費の回復もあり、個人消費は減速しつつも増加が続きました。7 - 9月期に入ってから労働市場の改善は続いており、個人消費の増加を主因に7 - 9月期の実質GDP成長率は前期比年率+3.2%と3四半期ぶりの上昇に転じました。しかし、10 - 12月期にはFRB（連邦準備制度理事会）による利上げの影響によって、住宅投資が減少したほか、設備投資の増加ペースが鈍化したことにより、実質GDP成長率は前期比年率+2.9%と、前四半期から減速しました。高いインフレ率が引き続き家計の重荷になっていることに加え、利上げを受けた労働市場の回復ペースの鈍化などにより、米国経済の先行きの不透明感は増えています。

金融面では、FRBは歴史的な高インフレを鎮静化するため、金融引き締めを強化しています。インフレ率がFRBの目標である2%を大幅に上回っていることを背景に、2022年3月のFOMC（連邦公開市場委員会）では政策金利が0.25%pt引き上げられ、2020年3月以来続いてい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、6月からFRBのバランスシートの縮小を開始することが決定されました。6月のFOMCでは利上げ幅がさらに拡大され、0.75%ptの利上げが行われました。その後、7月、9月、11月のFOMCでもそれぞれ0.75%ptの利上げが実施されましたが、12月のFOMCでは利上げ幅が0.50%ptへと縮小されました。利上げペースの鈍化が明確になったこともあり、9月末には一時2010年以来となる4%超まで上昇していた米国の10年債利回りは、12月末には3%台後半へと低下しました。

欧州経済（ユーロ圏経済）は、緩やかな回復基調が続いたものの、2022年後半以降は停滞感が強まっています。2022年4 - 6月期の実質GDP成長率は、行動制限の緩和などによる個人消費の持ち直しなどから、前期比年率+3.4%と堅調な結果となりました。しかし、2月下旬に開始したロシアによるウクライナ侵攻の長期化やインフレ率の高進などから、個人や企業の景況感は大幅な悪化が続いています。また、インフレ率の高進を背景に、ECB（欧州中央銀行）が金融引き締めへ転じたことによる借り入れコストの上昇も、投資や消費を下押しする要因となり、7 - 9月期の実質GDP成長率は前期比年率+1.2%と減速しました。さらに、10 - 12月期には実質GDP成長率は前期比年率+0.5%となり、一段と伸び率が低下しました。

金融面では、ECBはコロナ禍以降の金融緩和を終了し、引き締めへと転じています。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買入プログラムの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日付で同プログラムを終了することが決定されました。続く7月の理事会では、0.50%ptの利上げに踏み切り、2014年に導入されたマイナス金利が8年ぶりに解除されました。さらに、9月と10月の理事会では0.75%ptと過去最大の利上げ幅での利上げを実施しましたが、12月の理事会では利上げ幅を0.50%ptに縮小しました。

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+6.7%と高い成長となりました。また、2022年は+3.9%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、政府が掲げていたゼロコロナ政策の下、上海市などの多くの都市でロックダウンが実施されたため、4 - 6月期の実質GDP成長率は前年比+0.4%の低成長にとどまりました。しかし、ロックダウンが順次解除されたことに加え、財政・金融政策による下支えもあり、7 - 9月期の中国の実質GDP成長率は前年比+3.9%となり、前期から伸びが加速しました。10 - 12月期には、感染者数が急増した結果、経済活動が停滞した影響で実質GDP成長率は前年比+2.9%にとどまりました。

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したことに加え、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、欧米での金融引き締め・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、新興国でも景気の減速感は強まりつつあります。

<日本の状況>

日本経済は、2022年度に入り緩やかな回復が続いています。2022年1 - 3月期は、新型コロナウイルスの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 1.8%のマイナス成長となりましたが、その後、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月期の実質GDP成長率は前期比年率 + 4.5%と成長ペースが大きく加速しました。7 - 9月期には輸入の急増を主因に実質GDP成長率は前期比年率 0.8%となったものの、10月以降、経済は再び持ち直しへ向かいました。

需要項目ごとに見ると、個人消費は持ち直しの動きが続いています。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、サービス消費を中心に個人消費は減少しました。しかし、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月期は、サービス消費を中心に個人消費は持ち直しました。7 - 9月期には、再び新型コロナウイルスの感染が拡大しましたが、行動制限が導入されなかったため、緩やかに個人消費の増加基調が続いています。一方、家計による需要のうち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、減少傾向にあります。

企業部門の需要である設備投資は増加基調にあります。2022年1 - 3月期の設備投資は、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ました。また、7 - 9月期以降は、それまで設備投資を抑制する要因となっていた、中国でのロックダウンなどによるサプライチェーンの混乱が解消に向かったこともあり、設備投資の回復傾向が続いています。新型コロナウイルス感染症拡大の影響などから2021年度に見送られた設備投資の一部は2022年度に先送りされているとみられ、日銀短観（2022年12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 + 15.1%と非常に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続いています。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月の金融政策決定会合で、コロナ禍への対応として導入された社債などの買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年度に入ってから、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した。こうした状況の中、12月の金融政策決定会合において、日本銀行は10年債利回りの変動幅を±0.5%へと拡大することを決定し、これを受けて、10年債利回りは12月末時点で0.454%へと上昇しました。

為替市場をみると、2022年度に入り円安が急速に進みましたが、11月以降は円高への揺り戻しがみられました。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、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、10月には一時150円台とおよそ32年ぶりの円安水準となりました。しかし、その後、FRBによる利上げのペースが鈍化する公算が高まるなか、日本銀行による10年債利回りの変動幅拡大もあり、12月には一時131円台まで急速に円高が進みました。

株式市場では、海外市場の動向に大きく左右される形で、株価が一進一退の推移を続けています。4 - 6月期は、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、日経平均株価も上昇・下落を繰り返す不安定な相場展開となりました。7 - 9月期に入ると、米国での景気減速懸念が強まったことに加えてインフレ率に鈍化の兆候が見られたことで、米国長期金利の低下が進み、8月中旬まで米国株価は上昇しました。日経平均株価もそうした米国株価の動きに追随して上昇し、8月半ばには一時29,000円台を回復しました。しかし、8月後半に入ると米国のインフレ懸念が再び高まり、これに対してFRBがタカ派的な姿勢を強めたため、9月末にかけて日米ともに株価は下落基調となりました。10月以降には、FRBによる利上げペースが鈍化するとの見方が広まったことなどもあり株価は上昇したものの、12月に入ると日本銀行による10年債利回りの変動幅拡大を受けて再度下落に転じました。

2022年12月末の日経平均株価は26,094円50銭（同年9月末比157円29銭高）、10年国債利回りは0.454%（同0.177%ptの上昇）、為替は1ドル132円14銭（同12円18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3四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うえ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3四半期日次平均のLCRは139.6%です。当第3四半期末の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3四半期日次平均のLCRの状況は次のとおりです。

（単位：億円）

		日次平均 (自 2022年10月 至 2022年12月)
適格流動資産	(A)	27,575
資金流出額	(B)	39,764
資金流入額	(C)	20,015
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)	27,575
純資金流出額	(E)	19,748
連結流動性カバレッジ比率	(D)/(E)	139.6%

<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3四半期連結会計期間末の株主資本は、前連結会計年度末比113億円減少し、1兆2,751億円となりました。また、資本金及び資本剰余金の合計は4,777億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467億円を計上したほか、自己株式の消却を807億円、配当金399億円の支払いを行ったこと等により、前連結会計年度末比737億円減少の8,690億円となりました。自己株式の控除額は同625億円減少し、716億円となっております。

3【経営上の重要な契約等】

当第3四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3四半期会計期間末 現在発行数(株) (2022年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (2023年2月10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株であります。
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10月1日～ 2022年12月31日	-	1,569,378	-	247,397	-	226,751

(5)【大株主の状況】

当四半期会計期間は第3四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3四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9月30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9月30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 99,180,100	-	-
	(相互保有株式) 普通株式 745,600	-	-
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,468,869,400	14,688,694	-
単元未満株式	普通株式 583,672	-	一単元(100株)未満の株式
発行済株式総数	1,569,378,772	-	-
総株主の議決権	-	14,688,694	-

(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16株が含まれております。

【自己株式等】

2022年9月30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	99,180,100	-	99,180,100	6.31
計	-	99,180,100	-	99,180,100	6.31

(注)1 当社は、単元未満自己株式16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745,600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3四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3四半期連結会計期間（2022年10月1日から2022年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（2022年4月1日から2022年12月31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3四半期連結会計期間 (2022年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,592,384	4,465,713
預託金	559,729	504,143
受取手形、売掛金及び契約資産	22,420	19,580
有価証券	1,177,898	1,037,450
トレーディング商品	8,004,920	8,325,191
商品有価証券等	5,919,617	5,540,590
デリバティブ取引	2,085,303	2,784,600
営業投資有価証券	123,839	142,363
投資損失引当金	151	52
営業貸付金	1,933,758	1,908,865
仕掛品	768	1,325
信用取引資産	177,401	170,077
信用取引貸付金	170,555	163,435
信用取引借証券担保金	6,845	6,642
有価証券担保貸付金	8,394,277	8,886,131
借入有価証券担保金	5,283,874	6,539,929
現先取引貸付金	3,110,403	2,346,202
立替金	22,454	15,334
短期貸付金	439	712
未収収益	40,062	59,812
その他の流動資産	967,025	1,050,791
貸倒引当金	7,589	8,253
流動資産計	26,009,638	26,579,187
固定資産		
有形固定資産	913,879	925,859
無形固定資産	121,482	123,047
のれん	19,657	18,997
その他	101,825	104,049
投資その他の資産	486,088	487,327
投資有価証券	443,446	449,382
長期貸付金	6,451	6,395
長期差入保証金	16,748	15,492
繰延税金資産	11,992	6,352
その他	1,124,911	1,150,131
貸倒引当金	1,142	1,689
投資損失引当金	3,620	3,620
固定資産計	1,521,450	1,536,234
資産合計	27,531,089	28,115,421

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2022年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (2022年12月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	6,361	7,438
トレーディング商品	4,945,900	5,606,060
商品有価証券等	2,948,427	3,101,907
デリバティブ取引	1,997,473	2,504,152
約定見返勘定	548,406	718,499
信用取引負債	70,318	50,092
信用取引借入金	5,327	3,630
信用取引貸証券受入金	64,991	46,461
有価証券担保借入金	9,463,697	9,685,635
有価証券貸借取引受入金	4,761,437	6,653,371
現先取引借入金	4,702,259	3,032,264
銀行業における預金	4,189,105	4,135,808
預り金	456,384	538,759
受入保証金	347,468	570,068
短期借入金	2,155,782	1,098,789
コマーシャル・ペーパー	116,000	298,300
1年内償還予定の社債	446,760	509,407
未払法人税等	8,649	4,483
賞与引当金	37,586	20,622
その他の流動負債	152,851	116,680
流動負債計	22,945,274	23,360,646
固定負債		
社債	1,563,631	1,325,448
長期借入金	1,237,048	1,626,693
繰延税金負債	42,241	42,287
退職給付に係る負債	44,236	44,458
訴訟損失引当金	115	59
その他の固定負債	54,934	54,271
固定負債計	2,942,208	3,093,218
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	3,717	3,724
特別法上の準備金計	3,717	3,724
負債合計	25,891,200	26,457,589

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2022年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (2022年12月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,451	230,358
利益剰余金	942,793	869,035
自己株式	134,201	71,631
自己株式申込証拠金	26	1
株主資本合計	1,286,467	1,275,162
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	16,884
繰延ヘッジ損益	9,940	23,483
為替換算調整勘定	47,288	72,850
その他の包括利益累計額合計	86,815	113,218
新株予約権	9,109	8,727
非支配株主持分	257,497	260,724
純資産合計	1,639,888	1,657,832
負債・純資産合計	27,531,089	28,115,421

(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3四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31日)
営業収益		
受入手数料	244,783	207,100
委託手数料	58,227	47,904
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	34,137	19,307
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	18,036	9,244
その他の受入手数料	134,380	130,644
トレーディング損益	1 80,684	1 56,361
営業投資有価証券関連損益	3,644	2,755
金融収益	57,570	212,329
その他の営業収益	84,454	93,681
営業収益計	471,138	572,229
金融費用	33,151	167,071
その他の営業費用	47,668	66,669
純営業収益	390,317	338,488
販売費・一般管理費		
取引関係費	46,772	53,563
人件費	2 151,063	2 148,084
不動産関係費	27,999	29,216
事務費	18,340	18,917
減価償却費	26,298	25,979
租税公課	8,386	7,479
貸倒引当金繰入れ	22	52
その他	12,858	12,836
販売費・一般管理費計	291,741	296,130
営業利益	98,575	42,358
営業外収益		
受取配当金	2,977	2,650
持分法による投資利益	5,124	4,797
為替差益	170	911
投資事業組合運用益	5,070	5,777
その他	2,689	2,632
営業外収益計	16,032	16,769
営業外費用		
支払利息	1,375	1,429
社債発行費	30	106
その他	721	1,479
営業外費用計	2,127	3,015
経常利益	112,481	56,112

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31日)
特別利益		
固定資産売却益	45	11,714
固定資産受贈益	318	-
投資有価証券売却益	742	5,154
関係会社株式売却益	2,926	-
償却債権取立益	302	-
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	5,021	17,536
特別損失		
固定資産除売却損	147	1,732
減損損失	486	-
投資有価証券評価損	586	2,195
持分変動損失	-	42
金融商品取引責任準備金繰入れ	-	7
構造改革関連費用	344	-
事業再編等関連費用	-	4,857
120周年記念事業関連費用	-	412
その他	147	-
特別損失計	1,412	5,248
税金等調整前四半期純利益	116,091	68,400
法人税、住民税及び事業税	27,317	10,043
法人税等調整額	4,861	4,421
法人税等合計	32,178	14,464
四半期純利益	83,912	53,935
非支配株主に帰属する四半期純利益	7,010	7,185
親会社株主に帰属する四半期純利益	76,902	46,750

【四半期連結包括利益計算書】

【第3四半期連結累計期間】

(単位:百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31日)
四半期純利益	83,912	53,935
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	3,752	12,851
繰延ヘッジ損益	1,322	13,707
為替換算調整勘定	11,861	21,880
持分法適用会社に対する持分相当額	2,976	4,846
その他の包括利益合計	12,408	27,582
四半期包括利益	96,321	81,518
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	88,546	73,153
非支配株主に係る四半期包括利益	7,774	8,364

【注記事項】

(会計方針の変更等)

当第3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31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3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31日)
(1) 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の適用 当社及び一部の国内連結子会社は、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3四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3四半期連結会計期間 (2022年12月31日)
投資その他の資産・その他	9,231百万円	9,255百万円

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3四半期連結会計期間 (2022年12月31日)
従業員(借入金)	6百万円	3百万円
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	10,687
その他(スタンドバイ信用状)	2,302	2,382
計	13,305	13,073

(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3四半期連結累計期間 (自2021年4月1日 至2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自2022年4月1日 至2022年12月31日)
株券等トレーディング損益	57,574百万円	15,016百万円
債券・為替等トレーディング損益	23,110	41,344
計	80,684	56,361

2 人件費に含まれている賞与引当金繰入額

	前第3四半期連結累計期間 (自2021年4月1日 至2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自2022年4月1日 至2022年12月31日)
	25,671百万円	20,164百万円

3 前第3四半期連結累計期間(自2021年4月1日至2021年12月31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3四半期連結累計期間(自2022年4月1日至2022年12月31日)

事業再編等関連費用には、国内及び海外子会社の事業再編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3四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3四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3四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31日)
減価償却費	33,853百万円	33,131百万円
のれんの償却額	1,155	1,392

(株主資本等関係)

前第3四半期連結累計期間(自 2021年4月1日 至 2021年12月31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
2021年10月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	25,693	17	2021年9月30日	2021年12月1日

2 基準日が当第3四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3四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3四半期連結累計期間(自 2022年4月1日 至 2022年12月31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
2022年10月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	16,172	11	2022年9月30日	2022年12月1日

2 基準日が当第3四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3四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3四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3四半期連結会計期間末において利益剰余金が869,035百万円、自己株式が71,631百万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3四半期連結累計期間(自 2021年4月1日 至 2021年12月31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	94,628	88,200	87,600	15,595	286,024	42,240	328,265
受入手数料	94,628	88,200	60,400	1,010	244,239	543	244,783
その他の営業収益(外部顧客)	-	-	27,200	14,584	41,784	41,697	83,482
トレーディング等の金融商品収益	36,268	62,553	-	3,500	102,322	88	102,234
資金その他 (注)3	69	7	23,146	10,265	33,489	21,903	55,392
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	130,828	150,746	64,453	8,829	354,857	20,249	375,107
セグメント間の内部純営業収益 又は振替高	15,966	117	11,161	1,889	3,032	8,972	12,005
計	146,794	150,864	53,291	6,940	357,890	29,221	387,112
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 ())	35,104	40,539	34,052	3,089	112,786	1,830	110,955

(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)

利益又は損失()	金額
報告セグメント計	112,786
「その他」の区分の損失()	1,830
未実現損益の調整額	1,218
その他の調整額	307
四半期連結損益計算書の経常利益	112,481

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486百万円を計上しております。

当第3四半期連結累計期間（自 2022年4月1日 至 2022年12月31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	79,502	68,088	86,282	17,192	251,066	45,323	296,390
受入手数料	79,502	68,088	57,771	1,103	206,466	633	207,100
その他の営業収益(外部顧客)	-	-	28,511	16,088	44,599	44,689	89,289
トレーディング等の金融商品収益	26,411	49,376	-	3,399	79,187	243	79,431
資金その他 (注)3	80	44	24,139	9,063	33,327	21,207	54,535
純営業収益							
外部顧客への純営業収益	105,834	117,421	62,143	11,527	296,926	24,359	321,286
セグメント間の内部純営業収益 又は振替高	17,950	126	9,317	2,128	6,631	6,770	13,402
計	123,785	117,547	52,825	9,399	303,557	31,130	334,688
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 ())	19,614	786	32,528	6,505	57,860	1,514	56,346

(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)

利益又は損失()	金額
報告セグメント計	57,860
「その他」の区分の損失()	1,514
セグメント間の取引消去	13
未実現損益の調整額	281
その他の調整額	502
四半期連結損益計算書の経常利益	56,112

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3四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
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	115,391	140	73	115,605
国債・地方債等	2,265,332	189,523	-	2,454,856
社債	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
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	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3四半期連結会計期間末(2022年12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	98,608	83	140	98,832
国債・地方債等	1,431,115	143,149	-	1,574,265
社債	546	190,949	5,889	197,384
外国債券	2,565,247	367,232	5,601	2,938,080
受益証券	29,965	18,108	-	48,073
その他	10,424	672,157	1,371	683,953
デリバティブ取引				
エクイティ	64,769	112,014	157,067	333,851
金利	628	1,790,275	7,776	1,798,681
通貨	0	605,019	8,295	613,315
クレジット・その他	11	28,509	10,231	38,752
資産計	4,201,318	3,927,498	196,374	8,325,191
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	105,391	5,052	-	110,443
国債・地方債等	1,210,389	2,230	-	1,212,619
外国債券	1,611,472	120,027	-	1,731,500
受益証券	4,580	-	-	4,580
その他	-	42,763	-	42,763
デリバティブ取引				
エクイティ	94,729	143,367	3,059	241,156
金利	410	1,792,179	3,801	1,796,391
通貨	-	428,187	611	428,798
クレジット・その他	-	31,649	6,155	37,805
負債計	3,026,972	2,565,458	13,628	5,606,060

- 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 前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3四半期連結会計期間末(2022年12月31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	169,338	162,282	7,056
その他	-	-	-
計	169,338	162,282	7,056

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	102,646	141,961	39,315
債券	746,195	708,788	37,406
国債・地方債等	138,153	120,875	17,277
社債	176,162	176,104	57
その他	431,879	411,808	20,070
その他	201,983	209,015	7,031
計	1,050,825	1,059,765	8,940

(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3四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1,757百万円(うち、株券1,426百万円、その他331百万円)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3四半期連結会計期間末(2022年12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	238,459	4,188	516,827	14,894
スワップ取引	611,011	141,299	193,561	6,150
オプション取引	3,365,031	188,363	3,864,438	220,112
合計	4,214,502	333,851	4,574,828	241,156

(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	3,084,807	8,164	1,055,270	2,524
スワップ取引	47,618,552	1,790,378	46,833,278	1,793,752
オプション取引	118,534	138	104,273	114
合計	50,821,894	1,798,681	47,992,822	1,796,391

(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	125,723	22,235	28,700	3,634
為替予約取引	2,651,489	98,421	2,124,410	63,891
スワップ取引	4,840,682	427,144	4,178,443	239,710
オプション取引	541,730	65,513	998,696	121,562
合計	8,159,625	613,315	7,330,251	428,798

(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	131	11	-	-
その他	2,097,633	38,740	2,056,940	37,805
合計	2,097,764	38,752	2,056,940	37,805

(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3四半期連結累計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年12月31日)
(1) 1株当たり四半期純利益	50.86円	31.75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)	76,902	46,750
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)	76,902	46,750
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,511,963	1,472,252
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益	50.60円	31.60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)	7,801	7,259
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10月31日開催の取締役会において、2022年9月30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	16,172百万円
1株当たりの金額	11円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	2022年12月1日

(注) 2022年9月30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

2023年2月10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3四半期連結会計期間（2022年10月1日から2022年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（2022年4月1日から2022年12月31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12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する第3四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。