

【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】 平成30年2月7日

【四半期会計期間】 第81期第3四半期  
(自 平成29年10月1日 至 平成29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80期 第3四半期 連結累計期間	第81期 第3四半期 連結累計期間	第80期
会計期間		自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日	自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日	自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日
営業収益	(百万円)	450,175	527,140	616,497
純営業収益	(百万円)	351,131	374,464	472,750
経常利益	(百万円)	101,229	112,199	135,623
親会社株主に帰属する 四半期(当期)純利益	(百万円)	81,708	73,998	104,067
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	76,025	102,936	84,835
純資産額	(百万円)	1,347,052	1,375,632	1,343,433
総資産額	(百万円)	20,523,661	21,925,865	19,827,296
1株当たり四半期(当期)純利益金額	(円)	48.26	44.49	61.53
潜在株式調整後1株当たり 四半期(当期)純利益金額	(円)	47.97	44.21	61.14
自己資本比率	(%)	6.1	5.8	6.3

回次		第80期 第3四半期 連結会計期間	第81期 第3四半期 連結会計期間
会計期間		自 平成28年10月1日 至 平成28年12月31日	自 平成29年10月1日 至 平成29年12月31日
1株当たり四半期純利益金額	(円)	15.76	13.73

- (注) 1 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。  
2 営業収益等には、消費税等は含まれておりません。

#### 2 【事業の内容】

当第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。

また、主要な関係会社についても異動はありません。

## 第2 【事業の状況】

### 1 【事業等のリスク】

当第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80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。

### 3 【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) 業績の状況

当第3四半期連結累計期間の当社グループの営業収益は5,271億円（前年同期比17.1%増）となりました。受入手数料は2,340億円（同18.9%増）、トレーディング損益は775億円（同22.2%減）となりました。金融収支は353億円（同0.5%減）、純営業収益は3,744億円（同6.6%増）となっております。

販売費・一般管理費は、取引関係費537億円（同5.7%増）、人件費1,362億円（同3.7%増）などにより、合計で2,727億円（同4.0%増）となりました。

この結果、経常利益は1,121億円（同10.8%増）となりました。

これに特別利益51億円、訴訟損失引当金繰入額等の計上による特別損失98億円、法人税等及び非支配株主に帰属する四半期純利益を計上した結果、親会社株主に帰属する四半期純利益は739億円（同9.4%減）となりました。

セグメントの業績は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

	純営業収益			経常利益		
	平成28年 12月期	平成29年 12月期	対前年同期 増減率	平成28年 12月期	平成29年 12月期	対前年同期 増減率
リテール部門	138,397	159,673	15.4%	20,675	39,019	88.7%
ホールセール部門	135,761	124,057	8.6%	49,008	32,120	34.5%
アセット・マネジメント部門	34,639	36,802	6.2%	19,944	21,827	9.4%
投資部門	13,252	22,042	66.3%	11,488	20,121	75.1%
その他・調整等	29,080	31,887		112	890	
連結計	351,131	374,464	6.6%	101,229	112,199	10.8%

[リテール部門]

好調な市場環境による国内外の株式取引の増加や、株式投資信託の販売額が高水準で推移したことなどにより、純営業収益は1,596億円（前年同期比15.4%増）、経常利益は390億円（同88.7%増）となりました。

[ホールセール部門]

投資銀行部門において株式引受けの大型案件や国内外のM&A案件を積み上げたものの、金融市場における低ボラティリティが継続し顧客フローが減少したことなどにより、純営業収益は1,240億円（同8.6%減）、経常利益は321億円（同34.5%減）となりました。

[アセット・マネジメント部門]

マーケットが堅調に推移したことに加え、資金フローにおいても純増を確保したことから運用資産残高が拡大し、純営業収益は368億円（同6.2%増）、経常利益は218億円（同9.4%増）となりました。

[投資部門]

投資案件の回収により、純営業収益は220億円（同66.3%増）、経常利益は201億円（同75.1%増）となりました。

(2) 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21兆9,258億円（前連結会計年度末比2兆985億円増）となりました。内訳は流動資産が21兆2,831億円（同2兆242億円増）であり、このうち現金・預金が4兆6,693億円（同8,407億円増）、有価証券が1兆300億円（同7,121億円減）、トレーディング商品が7兆346億円（同4,884億円増）、有価証券担保貸付金が6兆5,784億円（同1兆2,729億円増）となっております。固定資産は6,427億円（同743億円増）となっております。

< 負債の部・純資産の部 >

負債合計は20兆5,502億円（同2兆663億円増）となりました。内訳は流動負債が17兆8,473億円（同1兆8,394億円増）であり、このうちトレーディング商品が4兆9,350億円（同2,765億円増）、有価証券担保借入金が6兆3,763億円（同3,575億円増）、銀行業における預金が3兆5,550億円（同5,693億円増）となっております。固定負債は2兆6,989億円（同2,269億円増）であり、このうち社債が1兆2,676億円（同482億円増）、長期借入金が1兆3,356億円（同1,564億円増）となっております。

純資産合計は1兆3,756億円（同321億円増）となりました。株主資本については、「(6)資本の財源及び流動性に係る情報 株主資本」に記載のとおりであります。その他有価証券評価差額金は827億円（同228億円増）、非支配株主持分は886億円（同48億円増）となっております。また、繰延ヘッジ損益は 65億円（同69億円減）、為替換算調整勘定は152億円（同83億円増）となっております。

(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) 経営成績に重要な影響を与える要因についての分析

当第3四半期連結累計期間のマクロ経済環境

&lt;海外の状況&gt;

世界経済は緩やかに拡大しており、IMF（国際通貨基金）などの国際機関の推計によれば、平成29年の世界経済成長率は前年を上回る伸びとなったとみられます。米国経済は、引き続き政治的な混乱に対する懸念を払拭できないものの、政策に依存せずとも堅調に推移しています。また、ユーロ圏の景気は加速しており、デフレ懸念が後退しました。ユーロ圏は、他の地域に比べて景気循環面での成熟化が進んでいない分、今後の成長の伸びしろがあると期待されています。さらに、先進国だけでなく、新興国経済も回復基調にあり、中国が底堅く推移している他、ブラジルやロシアはプラス成長に転じるとみられます。

米国経済は、平成29年1 - 3月期こそ個人消費の伸びが抑制され、実質GDP成長率は低成長に留まりましたが、平成29年4 - 6月期以降は前期比年率3%前後の高成長となっています。雇用・所得環境が安定しているなかで、個人消費が回復していることや、好調な企業業績や企業マインドの改善を背景に、設備投資が活発であることなどが要因として挙げられます。さらに、12月には、トランプ大統領が公約に掲げてきた、約30年ぶりとなる税制の抜本改革が実現することになり、今後の景気浮揚効果が期待されています。金融面では、底堅い景気拡大を受けて、FRB（連邦準備制度理事会）は平成29年一年間に3月、6月及び12月の3回にわたり政策金利を引き上げました。また、10月からは、FRBが保有する資産の規模の縮小を開始しています。一方、米国株式市場では、一時、税制改革への不透明感から上値の重い展開が見られたものの、底堅い米国経済や税制改革進展への期待から騰勢に転じ、NYダウ平均株価は過去最高値を更新しました。

欧州経済は、緩やかながら安定した成長が続いており、平成29年のユーロ圏の実質GDP成長率は2.5%と10年ぶりの高成長になりました。平成29年10 - 12月期は前期比0.6%増、前年比では2.7%増となり、平成28年10 - 12月期以降高成長が続いています。堅調な個人消費に加え、足下では輸出や投資も活発になり、内需を中心に、よりバランスの取れた形で成長しています。一方、イギリスの離脱に関するEU（欧州連合）との交渉の行方は依然として不透明さが残り、イギリス経済の重しになっています。また、金融面では、デフレ懸念の後退を受けて、ECB（欧州中央銀行）は、非伝統的な金融緩和の軌道修正を進めています。平成29年4月から量的緩和の規模を縮小させたのに続いて、平成29年10月には、平成30年1月以降、資産買取額を毎月300億ユーロに半減させつつ、少なくとも同年9月末までは買取を継続する方針を決定しました。もっとも、デフレ懸念が後退したとはいえ、ユーロ圏のインフレ率は、ECBが目指すインフレ目標に届いていないことから、ECBは慎重に金融緩和策の修正を進めていくとみられます。

新興国経済は、平成28年をボトムにして経済成長率が加速しています。中国経済は、実質GDP成長率が平成29年1 - 3月期、4 - 6月期の前年比6.9%増から、7 - 9月期、10 - 12月期は6.8%増と僅かに減速したものの、安定成長を続けています。平成22年の10.6%をピークに6年連続で経済成長率は鈍化してきましたが、平成29年は6.9%と7年ぶりに前年から加速し、中国政府の成長率目標である6.5%前後を上回りました。また、デフレ脱却によって平成29年の名目GDP成長率は急回復しており、企業業績の改善は雇用者報酬の増加を通じて、堅調な消費を下支えしました。このように、個人消費が景気を牽引する一方、固定資産投資の伸びは減速しています。不動産開発投資では住宅販売の不振、製造業投資に関しては、過剰生産能力削減を目的とした新規投資の抑制などが要因として挙げられます。特に、住宅販売は平成29年秋以降大きく鈍化しており、耐久財など関連消費への影響が懸念されます。

## &lt;日本の状況&gt;

日本経済は「踊り場」局面から脱し、平成28年半ば以降、緩やかな回復を続けています。平成24年11月を谷とする今回の景気拡大は5年を超えて、事実上、戦後2番目の長さになっています。平成29年7 - 9月期の実質GDP成長率は前期比年率2.5%増となり、4 - 6月期の同2.9%増からは減速したものの、高い成長を維持しているといえます。設備投資が堅調に拡大する一方、個人消費や住宅投資がマイナスに転じたことから、内需の寄与度は前期から縮小しましたが、4 - 6月期に一旦落ち込んだ輸出が再び景気の牽引役となっています。

GDPに占めるウエイトの大きい個人消費は、平成29年7 - 9月期に5四半期ぶりに減少しましたが、これは天候不順が重なったためで、一時的な調整とみられます。雇用・所得環境の改善を背景に、消費者マインドは高い水準にあり、消費の基調は堅調に拡大しています。失業率が2%台後半まで低下する一方、有効求人倍率は高度経済成長期以来の高水準が続いています。賃金の伸び悩みが大きな課題でしたが、足下では非正規比率の上昇は頭打ちとなっており、正規雇用も増加し始めています。さらに、非製造業や中小企業を中心に人手不足感は依然として強く、人手確保のために、今後もマクロ経済全体で見た賃金は緩やかに増加していくとみられます。一方で、生鮮食品の高騰だけでなく、原油価格が平成29年6月を底に上昇に転じ、年末までに約3割上昇しています。企業活動だけでなく、消費者の生活にも影響を及ぼしていくとみられます。

一方、住宅投資については、低い住宅ローン金利という支援材料のほか、相続税対策などの特殊要因が押し上げてきましたが、貸家の着工に頭打ち感が見られるなど、概ね横ばいで推移しています。

企業の設備投資は、平成29年7 - 9月期に前期比+1.1%と4四半期連続で増加しており、好調な輸出や人手不足の深刻化に対応するための効率化・省力化投資の増加が背景にあるとみられます。日銀短観(12月調査)によると、平成29年度の設備投資計画は大企業を中心に増加が見込まれ、研究開発投資も底堅く、設備投資に広がりが見られます。日本企業の収益が過去最高水準にあることも寄与していると考えられますが、利益の伸びに比べると、設備投資の伸び率は低いまです。設備投資の水準は依然としてキャッシュ・フローを大きく下回っており、企業の投資態度は慎重さを崩していません。

外需に関しては、海外経済が底堅く拡大していることを背景に、輸出は増加基調にあります。地域別に輸出の動向を見ると、米国向けやアジア向けが堅調に伸びている一方、EU向けは平成29年春以降減少が目立ちます。自動車や半導体等製造装置の輸出が好調ですが、引き続き、海外経済の動向には留意が必要です。一方、平成29年7 - 9月期の輸入は国内需要の減少に伴って5四半期ぶりに減少に転じました。10月以降は、円安や原油高が前年比で輸入価格を押し上げており、直近の輸入数量が5ヶ月ぶりに増加するなど、輸入金額は持ち直しの動きが見られます。

金融面では、日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の下で、強力な金融緩和が続いています。その一環としてイールドカーブ・コントロールを導入し、短期金利と長期金利の両方を事実上管理するという、より直接的な政策を実行しています。その結果、長期金利(10年国債利回り)は、平成29年に入ってから概ね0.0%~0.1%という狭いレンジで推移しており、平成29年10 - 12月期の平均値は0.05%となりました。また、為替レートは平成29年に入ると、米国の新政権に対する不透明感などが意識されるに伴い、4月半ばにかけて円高が進行しました。その後、円は狭いレンジのなかでアップダウンを繰り返した後、地政学的リスクの高まりを受けてリスク回避の動きが強まり、7月から9月上旬にかけては円高が進み、平成29年で最も高値を付けました。10 - 12月期に限ると、円は対ドルでは、米国の長期金利の動向に左右される展開が続くなか、トランプ大統領の政策運営に対する不安感が高まると、円高・ドル安に振れる場面が見られました。ただ、総じて111円~114円という狭いレンジ内の変動にとどまりました。また、対ユーロでも概ね横ばいで推移しましたが、年末にかけては、欧州債金利の上昇を受けて、円安・ユーロ高が進みました。

平成29年12月末の日経平均株価は22,764円94銭(同年9月末比2,408円66銭高)、10年国債利回りは0.047%(同0.015ポイントの低下)、為替は1ドル112円65銭(同19銭の円安)となりました。

## (6) 資本の財源及び流動性に係る情報

## 流動性の管理

## &lt;財務の効率性と安定性の両立&gt;

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、ミディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めております。特に近年においては、世界的金融危機及び信用危機による不測の事態に備え、市場からの資金調達、金融機関からの借入等により、手元流動性の更なる積み増しを行っております。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」）の最低基準（平成27年3月末から段階的に導入）の遵守が求められております。当社の当第3四半期日次平均のLCRは148.9%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、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理体制を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当第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 (自平成29年10月 至平成29年12月)
適格流動資産	(A)	25,328
資金流出額	(B)	35,527
資金流入額	(C)	18,526
連結流動性カバレッジ比率 (LCR)		
算入可能適格流動資産の合計額	(D)	25,328
純資金流出額	(B)-(C)	17,000
連結流動性カバレッジ比率	(D)/((B)-(C))	148.9%

#### <グループ全体の資金管理>

当社グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、当社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。当社は、当社固有のストレス又は市場全体のストレスの発生により新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、短期の無担保調達資金について、当社グループの流動性ポートフォリオが十分に確保されているかをモニタリングしております。また、当社は、必要に応じて当社からグループ各社に対し、機動的な資金の配分・供給を行うと共に、グループ内で資金融通を可能とする体制を整えることで、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体制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・ファイナンス、M&A、プリンシパル・インベストメント、証券担保ローン等の有価証券関連業を中心とした幅広い金融サービスを展開するためには、十分な資本を確保する必要があります。また、当社グループは、日本のみならず、海外においても有価証券関連業務を行っており、それぞれの地域において法規制上必要な資本を維持しなければなりません。

当第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35億円増加し、1兆1,871億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,781億円となりました。利益剰余金は、配当金支払いにより434億円減少したほか、親会社株主に帰属する四半期純利益を739億円計上した結果、前連結会計年度末比310億円増の7,492億円となりました。自己株式の控除額は、前連結会計年度末に比べ274億円増加し、402億円となっております。

### 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) (平成29年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成30年2月7日)	上場金融商品取引所名 又は登録認可金融商品 取引業協会名	内容
普通株式	1,699,378,772	1,699,378,772	東京証券取引所市場第一部 名古屋証券取引所市場第一部	単元株式数は1,000株 あります。
計	1,699,378,772	1,699,378,772		

##### (2) 【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) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

##### (5) 【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)
平成29年10月1日～ 平成29年12月31日		1,699,378		247,397		226,751

##### (6) 【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。

## (7) 【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（平成29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】

平成29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 30,484,000		
	(相互保有株式) 普通株式 2,102,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,664,242,000	1,664,242	
単元未満株式	普通株式 2,550,772		
発行済株式総数	1,699,378,772		
総株主の議決権		1,664,242	

(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3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84株が含まれております。

## 【自己株式等】

平成29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	30,484,000		30,484,000	1.79
計		30,484,000		30,484,000	1.79

(注) 1 当社は、単元未満自己株式84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2,102,000株あります。

## 2 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当第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(平成29年10月1日から平成29年12月31日まで)及び第3四半期連結累計期間(平成29年4月1日から平成29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 (平成29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	3,828,674	4,669,397
預託金	336,338	392,294
受取手形及び売掛金	16,649	18,178
有価証券	1,742,127	1,030,007
トレーディング商品	6,546,229	7,034,664
商品有価証券等	3,853,260	4,425,737
デリバティブ取引	2,692,968	2,608,927
営業投資有価証券	125,040	156,543
投資損失引当金	11,052	4,369
営業貸付金	655,709	717,111
仕掛品	1,285	1,395
信用取引資産	202,530	220,341
信用取引貸付金	174,524	189,205
信用取引借証券担保金	28,006	31,135
有価証券担保貸付金	5,305,518	6,578,491
借入有価証券担保金	5,005,170	6,535,828
現先取引貸付金	300,347	42,663
立替金	26,345	26,391
短期貸付金	606	1,278
未収収益	35,380	36,564
繰延税金資産	8,023	5,011
その他の流動資産	440,034	400,475
貸倒引当金	502	620
流動資産計	19,258,940	21,283,158
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	124,980	123,699
無形固定資産	90,596	103,681
のれん	6,103	13,428
その他	84,493	90,253
投資その他の資産	352,779	415,325
投資有価証券	318,751	355,993
長期貸付金	4,939	4,934
長期差入保証金	17,298	17,642
繰延税金資産	4,796	4,536
その他	1 7,655	1 32,891
貸倒引当金	1 661	1 671
固定資産計	568,356	642,706
資産合計	19,827,296	21,925,865

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
支払手形及び買掛金	8,166	5,135
トレーディング商品	4,658,595	4,935,096
商品有価証券等	2,261,720	2,657,909
デリバティブ取引	2,396,874	2,277,186
約定見返勘定	216,836	175,369
信用取引負債	62,377	86,740
信用取引借入金	3,086	2,998
信用取引貸証券受入金	59,290	83,742
有価証券担保借入金	6,018,813	6,376,375
有価証券貸借取引受入金	5,909,682	6,152,761
現先取引借入金	109,130	223,614
銀行業における預金	2,985,733	3,555,097
預り金	256,873	396,201
受入保証金	418,039	418,324
短期借入金	918,954	1,343,005
コマーシャル・ペーパー	-	115,500
1年内償還予定の社債	278,237	290,505
未払法人税等	15,084	3,530
繰延税金負債	1,790	1,860
賞与引当金	30,872	21,103
その他の流動負債	137,494	123,462
流動負債計	16,007,868	17,847,306
<b>固定負債</b>		
社債	1,219,344	1,267,634
長期借入金	1,179,264	1,335,688
繰延税金負債	10,234	20,611
退職給付に係る負債	39,791	41,495
訴訟損失引当金	15,903	26,035
その他の固定負債	7,527	7,531
固定負債計	2,472,065	2,698,995
<b>特別法上の準備金</b>		
金融商品取引責任準備金	3,929	3,930
特別法上の準備金計	3,929	3,930
負債合計	18,483,863	20,550,232

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
<b>純資産の部</b>		
株主資本		
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,712	230,713
利益剰余金	718,238	749,256
自己株式	12,719	40,205
自己株式申込証拠金	7	6
株主資本合計	1,183,636	1,187,168
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	59,922	82,759
繰延ヘッジ損益	435	6,551
為替換算調整勘定	6,896	15,266
その他の包括利益累計額合計	67,254	91,474
新株予約権	8,729	8,335
非支配株主持分	83,813	88,653
純資産合計	1,343,433	1,375,632
負債・純資産合計	19,827,296	21,925,865

(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 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)
営業収益		
受入手数料	196,819	234,008
委託手数料	44,275	54,655
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	21,802	28,642
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	23,378	35,194
その他の受入手数料	107,362	115,517
トレーディング損益	99,790	77,594
株券等トレーディング損益	15,051	25,216
債券・為替等トレーディング損益	84,738	52,377
営業投資有価証券関連損益	12,839	21,826
金融収益	103,623	139,831
その他の営業収益	37,102	53,879
営業収益計	450,175	527,140
金融費用	68,112	104,488
その他の営業費用	30,931	48,187
純営業収益	351,131	374,464
販売費・一般管理費		
取引関係費	50,870	53,785
人件費	131,434	136,249
不動産関係費	26,116	26,746
事務費	20,083	19,673
減価償却費	17,450	18,246
租税公課	7,582	8,125
貸倒引当金繰入れ	-	104
その他	8,641	9,841
販売費・一般管理費計	262,179	272,771
営業利益	88,952	101,692
営業外収益		
受取配当金	2,923	3,031
持分法による投資利益	6,820	5,752
為替差益	129	-
その他	3,006	2,573
営業外収益計	12,879	11,358
営業外費用		
支払利息	21	24
為替差損	-	1
社債発行費	263	664
その他	318	160
営業外費用計	602	851
経常利益	101,229	112,199

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)
<b>特別利益</b>		
固定資産売却益	-	814
投資有価証券売却益	2,515	814
段階取得に係る差益	-	1,498
持分変動利益	768	-
償却債権取立益	-	481
新株予約権戻入益	1,228	894
事業再編関連費用戻入益	689	-
その他	158	688
特別利益計	5,361	5,191
<b>特別損失</b>		
固定資産除売却損	-	200
投資有価証券評価損	90	-
子会社清算損	769	-
金融商品取引責任準備金繰入れ	-	0
事業再編関連費用	76	100
MMF等償還関連費用	305	-
訴訟損失引当金繰入額	-	<sup>2</sup> 9,598
特別損失計	1,242	9,899
税金等調整前四半期純利益	105,347	107,491
法人税、住民税及び事業税	22,723	20,441
法人税等調整額	846	8,335
法人税等合計	23,569	28,776
四半期純利益	81,777	78,714
非支配株主に帰属する四半期純利益	69	4,715
親会社株主に帰属する四半期純利益	81,708	73,998

## 【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 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)
四半期純利益	81,777	78,714
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	26,957	22,010
繰延ヘッジ損益	29,021	7,015
為替換算調整勘定	6,941	8,641
持分法適用会社に対する持分相当額	874	585
その他の包括利益合計	5,752	24,222
四半期包括利益	76,025	102,936
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	76,025	98,219
非支配株主に係る四半期包括利益	0	4,716

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

1 資産の金額から直接控除している貸倒引当金の額

	前連結会計年度 (平成29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
投資その他の資産・その他	6,313百万円	6,301百万円

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 (平成29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
従業員(借入金)	135百万円	95百万円

(四半期連結損益計算書関係)

1 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 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)
	20,771百万円	21,642百万円

2 当第3四半期連結累計期間(自平成29年4月1日至平成29年12月31日)

当社の英国現地法人である大和証券キャピタル・マーケッツヨーロッパリミテッド（以下、「DCME」）が、Singularis Holdings Limitedから提起された訴訟について、英国控訴院に控訴しておりましたが、平成30年2月1日に判決が言い渡され、DCMEの控訴が退けられました。これを踏まえ、判決の内容を精査の上、本訴訟に関する費用等の見直しを行い、訴訟損失引当金繰入額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 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)
減価償却費	20,575百万円	21,201百万円
のれんの償却額	832	930

(株主資本等関係)

前第3四半期連結累計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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
平成28年5月18日 取締役会	普通株式	利益剰余金	20,308	12	平成28年3月31日	平成28年6月6日
平成28年10月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	22,018	13	平成28年9月30日	平成28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。

当第3四半期連結累計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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
平成29年5月16日 取締役会	普通株式	利益剰余金	21,804	13	平成29年3月31日	平成29年6月5日
平成29年10月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	21,695	13	平成29年9月30日	平成29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。

(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(自平成28年4月1日至平成28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

(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	119,028	135,147	52,195	13,747	320,119	14,522	334,641
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	19,368	614	17,556	494	1,931	12,616	14,547
計	138,397	135,761	34,639	13,252	322,050	27,138	349,189
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( ))	20,675	49,008	19,944	11,488	101,116	880	100,236

(注) 1 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントであり、子会社の統合・管理、銀行、情報サービス、事務代行及び不動産賃貸等の事業が含まれております。

- 2 上記の純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 報告セグメントの利益又は損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額及び当該差額の内容(差異調整に関する事項)

(単位:百万円)

利益又は損失( )	金額
報告セグメント計	101,116
「その他」の区分の損失( )	880
セグメント間取引消去	0
のれんの償却額	231
未実現損益の調整額	482
その他の調整額	1,707
四半期連結損益計算書の経常利益	101,229

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3四半期連結累計期間(自平成29年4月1日至平成29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

(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	139,856	123,780	54,236	22,488	340,362	18,385	358,748
セグメント間の内部純営業収益又は振替高	19,817	276	17,433	446	2,214	11,417	13,631
計	159,673	124,057	36,802	22,042	342,576	29,803	372,380
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( ))	39,019	32,120	21,827	20,121	113,089	861	112,228

(注) 1 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントであり、子会社の統合・管理、銀行、情報サービス、事務代行及び不動産賃貸等の事業が含まれております。

2 上記の純営業収益は主に、営業収益、金融費用、その他の営業費用及び支払手数料(販売費・一般管理費)より構成されております。

2 報告セグメントの利益又は損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額及び当該差額の内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益又は損失( )	金額
報告セグメント計	113,089
「その他」の区分の損失( )	861
セグメント間取引消去	4
のれんの償却額	231
未実現損益の調整額	209
その他の調整額	415
四半期連結損益計算書の経常利益	112,199

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失又はのれん等に関する情報

該当事項はありません。

(有価証券関係)

前連結会計年度末(平成29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	9	10	0
社債	56,220	56,183	37
その他			
計	56,230	56,193	36

## 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	79,046	148,398	69,351
債券	1,630,806	1,644,245	13,438
国債・地方債等	640,094	664,765	24,670
社債	141,708	144,771	3,062
その他	849,003	834,708	14,294
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	32,907	32,907	
その他	45,037	44,125	912
計	1,787,798	1,869,676	81,877

- (注) 1 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。  
2 当連結会計年度において、時価のあるその他有価証券について6百万円(うち、株券6百万円)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(平成29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	9	10	0
社債	105,791	106,002	211
その他			
計	105,800	106,012	212

## 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	102,894	194,355	91,461
債券	679,652	689,892	10,240
国債・地方債等	178,963	185,240	6,277
社債	134,587	137,247	2,660
その他	366,102	367,404	1,302
投資事業有限責任組合及び それに類する組合等への出資	26,238	26,238	
その他	229,190	239,503	10,313
計	1,037,975	1,149,989	112,014

- (注) 1 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。  
2 当第3四半期連結累計期間において、時価のあるその他有価証券について減損処理は行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

前連結会計年度末(平成29年3月31日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,198,443	455,875	3,376,422	370,000
為替予約取引	1,896,320	56,372	1,675,688	52,311
先物・先渡取引	3,794,512	26,624	2,911,364	18,735
スワップ取引	82,096,964	2,131,829	82,158,316	1,925,183
その他	2,028,618	27,982	2,163,102	30,643
リスクリザーブ		5,717		

当第3四半期連結会計期間末(平成29年12月31日)

トレーディングに係るもの

(単位：百万円)

種類	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	3,016,614	481,681	3,174,069	422,032
為替予約取引	1,603,940	37,823	1,606,535	40,151
先物・先渡取引	3,265,905	32,184	2,472,666	15,019
スワップ取引	96,710,667	2,040,926	95,941,095	1,776,299
その他	1,469,572	21,342	1,609,764	23,683
リスクリザーブ		5,031		

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純利益金額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金額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 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)
(1) 1株当たり四半期純利益金額	48.26円	44.49円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益金額(百万円)	81,708	73,998
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 四半期純利益金額(百万円)	81,708	73,998
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,693,094	1,663,373
(2) 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額	47.97円	44.21円
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益調整額(百万円)		
普通株式増加数(千株)	10,139	10,325
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり 四半期純利益金額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)

平成29年10月25日開催の取締役会において、平成29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	21,695百万円
1株当たりの金額	13円00銭
支払請求権の効力発生日及び支払開始日	平成29年12月1日

(注) 平成29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

平成30年2月7日

株式会社大和証券グループ本社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 高波博之 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 貞廣篤典 印

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

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平成29年4月1日から平成30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（平成29年10月1日から平成29年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成29年4月1日から平成29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。

### 四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して四半期連結財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない四半期連結財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した四半期レビューに基づいて、独立の立場から四半期連結財務諸表に対する結論を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に準拠して四半期レビューを行った。

四半期レビューにおいては、主として経営者、財務及び会計に関する事項に責任を有する者等に対して実施される質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続が実施される。四半期レビュー手続は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して実施される年度の財務諸表の監査に比べて限定された手続である。

当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

### 監査人の結論

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社の平成29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すべての重要な点において認められなかった。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は四半期レビュー報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（四半期報告書提出会社）が別途保管しております。

2. XBRLデータは四半期レビューの対象には含まれていません。