

【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21年2月12日
【四半期会計期間】	第72期第3四半期 (自平成20年10月1日至平成20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 鈴木 茂 晴
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内1丁目9番1号
【電話番号】	03(5555)1111
【事務連絡者氏名】	財務部長 阪 上 光
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区丸の内1丁目9番1号
【電話番号】	03(5555)1111
【事務連絡者氏名】	財務部長 阪 上 光
【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) 株式会社大阪証券取引所 (大阪府中央区北浜1丁目8番16号) 株式会社名古屋証券取引所 (名古屋市中区栄3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】

連結経営指標等

回次	第72期 当第3四半期 連結累計期間	第72期 当第3四半期 連結会計期間	第71期
会計期間	自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日	自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日	自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日
営業収益 (百万円)	335,500	38,564	825,422
純営業収益 (百万円)	145,540	5,582	447,491
経常利益又は 経常損失() (百万円)	113,226	90,022	90,143
当期純利益又は 四半期純損失() (百万円)	67,676	53,039	46,411
純資産額 (百万円)		996,110	1,082,923
総資産額 (百万円)		15,113,175	17,307,119
1株当たり純資産額 (円)		554.82	607.64
1株当たり当期純利益金額 又は四半期純損失金額() (円)	50.27	39.40	33.69
潜在株式調整後 1株当たり四半期 (当期)純利益金額 (円)			33.63
自己資本比率 (%)		4.9	4.7
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	552,219		782,533
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	26,771		189,042
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	475,733		991,086
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高 (百万円)		443,539	359,851
従業員数 (人)		15,419	14,456

(注) 1 従業員数は、就業人員数を表示しております。

2 営業収益等については、消費税等を含んでおりません。

3 第72期第3四半期連結累計期間及び第72期第3四半期連結会計期間の潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については、潜在株式は存在するものの、1株当たり四半期純損失であるため記載しておりません。

2 【事業の内容】

当第3四半期連結会計期間において、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、主要な関係会社の異動は、「3 関係会社の状況」に記載のとおりです。

3 【関係会社の状況】

当第3四半期連結会計期間において、当社の連結子会社である株式会社大和総研は、平成20年10月1日付でリサーチ・コンサルティング及びグループ向けシステム事業を行う株式会社大和総研とグループ外のお客様向けシステム事業を行う株式会社大和総研ビジネス・イノベーションに会社分割した上で中間持株会社となり、株式会社大和総研ホールディングスに商号変更しております。また、同じく当社の連結子会社であるエヌ・アイ・エフSMB Cベンチャーズ株式会社は、平成20年10月1日付で大和SMB Cキャピタル株式会社に商号変更しております。

名称	住所	資本金 (千円)	主要な事業 の内容	議決権の 所有割合 (%)	関係内容
(連結子会社)					
株式会社大和総研ホールディングス	東京都江東区	3,898,000	子会社の統合・管理	100.0	役員の兼任等... 3 転籍... 4
株式会社大和総研	東京都江東区	1,000,000	情報サービス業	100.0 (100.0)	情報提供 業務委託 金銭の貸借 役員の兼任等... 3 転籍... 6
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	東京都中央区	3,000,000	情報サービス業	100.0 (100.0)	金銭の貸借 役員の兼任等... 2 転籍... 4

(注) 議決権のうち間接保有の割合は、()に内書きしております。

4 【従業員の状況】

(1) 連結会社の状況

平成20年12月31日現在

従業員数(人)	15,419 [1,557]
---------	----------------

(注) 1 従業員数には、FA（ファイナンシャルアドバイザー）社員の雇用人員600人を含めております。

2 従業員数は就業人員数であり、臨時従業員数は[]内に当第3四半期連結会計期間の平均人員を外数で記載しております。

(2) 提出会社の状況

平成20年12月31日現在

従業員数(人)	301
---------	-----

(注) 従業員数は、就業人員数を表示しております。

第2 【事業の状況】

1 【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、経営上の重要な契約等は締結されておりません。

2 【財政状態及び経営成績の分析】

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、四半期報告書提出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

経営成績の分析

当第3四半期連結会計期間におけるわが国の景気は、米国発の金融不安が更に高まりをみせたことから海外金融市場において信用収縮が強まり、また、急激な円高の進行などを受けて急速に減速しました。このような収益環境のもと、当第3四半期連結会計期間の営業収益は385億円となりました。

(百万円)

	当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)
受入手数料	49,383
トレーディング損益	22,849
営業投資有価証券関連損益	37,478
金融収益	37,525
その他の売上高	11,983
営業収益	38,564
金融費用	34,774
売上原価	9,372
純営業収益	5,582

急速なマーケット環境の悪化により実体経済は悪化の一途を辿ったことから、投資家心理は急激に悪化し、また、世界的な信用収縮の中で企業の直接金融による資金調達も低調となったことなどから受入手数料は493億円になりました。トレーディング損益は株式相場の急落や急激な円高の進行に伴い228億円の損失となりました。また、営業投資有価証券関連損益は不動産市況及び株式市況の低迷に伴い評価損及び投資損失引当金を計上したことで374億円の損失となりました。金融収支は27億円、純営業収益は55億円の損失となっております。

事業別の受入手数料の内訳は次のとおりです。

(百万円)

	当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)					
	エクイティ (株式関連)	フィックス ト・インカム (債券)	アセット・ マネジメント (資産運用)	インベスト メント・ バンキング (投資銀行)	その他	合計
委託手数料	14,022	84	213			14,320
引受け・売出し・特定 投資家向け売付け勧誘 等の手数料				7,636		7,636
(株券等)	()	()	()	(5,648)	()	(5,648)
(債券等)	()	()	()	(1,865)	()	(1,865)
募集・売出し・特定投 資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料			2,189	80		2,269
その他の受入手数料	486	63	16,965	3,037	4,605	25,157
合計	14,508	148	19,367	10,753	4,605	49,383

[エクイティ（株式関連）]

当第3四半期連結会計期間の東京証券取引所における株式の一日平均売買代金が1兆9,102億円となったことなどから、委託手数料は140億円となりました。受入手数料合計は145億円となっております。

[フィックス・インカム（債券）]

受入手数料は、委託手数料のほか、利金・償還金等の支払事務代行にかかる代理事務手数料等で構成されています。受入手数料合計は1億円となりました。

[アセット・マネジメント（資産運用）]

投資信託の事務代行手数料や信託報酬からなるその他の受入手数料は169億円となりました。受入手数料合計は193億円となっております。

[インベストメント・バンキング（投資銀行）]

受入手数料は、主に公募・売出しに係る手数料のほか、M&A業務の手数料などで構成されています。受入手数料合計は107億円となりました。

[その他]

主なものは、カストディ・フィー（保管手数料）、投資事業組合等運営報酬、個人年金保険の販売手数料であります。その他の受入手数料合計は46億円となりました。

(百万円)

	当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)
純営業収益	5,582
販売費・一般管理費	83,606
経常損失()	90,022
四半期純損失()	53,039

販売費・一般管理費は、取引関係費153億円、人件費353億円、不動産関係費105億円などにより、合計で836億円となりました。

この結果、900億円の経常損失となりました。

主に投資有価証券評価損95億円を特別損失に計上したことなどから、特別損益は純額で88億円の損失となりました。法人税等及び少数株主損失を加味した結果、当第3四半期連結会計期間は530億円の四半期純損失となりました。

所在地別セグメントの業績は以下のとおりとなっております。

(百万円)

	当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)						
	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	連結
純営業収益	18,035	7,538	3,735	2,397	4,364	(1,217)	5,582
営業利益 又は営業損失()	90,172	3,785	2,010	790	89,188	(0)	89,189

< 国内 >

国内主要グループ会社の動向は次のとおりです。

(百万円)

	当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)		
	大和証券	大和証券エスエム ビーシー(連結)	大和証券投資信託委託
営業収益	33,763	34,916	14,913
経常利益又は経常損失()	1,307	89,546	1,831
四半期純利益又は四半期純損失()	964	78,933	888

リテール証券業務を営む大和証券は337億円の営業収益、13億円の経常損失となりました。世界的な市況の低迷を受け、エクイティを中心とする委託手数料は88億円、募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は50億円となりました。その他受入手数は投資信託の代理事務手数料を中心に123億円となりました。また、トレーディング損益は62億円の黒字となりました。当第3四半期連結会計期間末の大和証券顧客資産は、株式市況の悪化によるエクイティ資産の減少を中心に24.4兆円となっています。

ホールセール証券業務を営む大和証券エスエムビーシー（連結）の営業収益は349億円の損失となりました。エクイティ・ファイナンス市場の停滞などに伴う投資銀行業務の低迷や、株式・為替市場の急激な変動によるトレーディング損益の悪化、大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメントが手がける投資業務における営業投資有価証券関連損益が損失となったことなどにより、895億円の経常損失となりました。

アセット・マネジメント業務を営む大和証券投資信託委託では、株式市況の悪化に伴い株式投資信託の運用資産残高が減少し、営業収益は149億円、経常利益は18億円となりました。

また、その他の国内主要グループ会社の経常利益又は経常損失は以下のとおりです。

(百万円)

	当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)		
	大和総研3社(注)	大和住銀投信投資顧問	大和S M B C キャピタル
経常利益又は経常損失()	1,648	645	3,304

(注) 大和総研ホールディングス、大和総研、大和総研ビジネス・イノベーションの合計。

< 海外 >

米州は、大和セキュリティーズアメリカがプライマリー・ディーラーとしての入札関連業務が好調であったこと及び金利低下局面においてレポ業務が堅調に推移したことから、37億円の営業利益となっております。

欧州は、債券関連業務は好調だったものの、日本株関連業務が引き続き低迷したほか、新規に立ち上げたデリバティブ関連業務の先行コスト増もあり、20億円の営業損失となりました。

アジア・オセアニアは、アジア株式市場の低迷に加え、アジア事業基盤を強化するための人員増強などで経費が増加したため、7億円の営業損失となりました。

その結果、海外合計では9億円の営業利益となっております。

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資産合計は15兆1,131億円となりました。内訳は流動資産が14兆5,907億円であり、このうちトレーディング商品が6兆9,713億円、有価証券担保貸付金が5兆4,611億円となっております。固定資産は5,224億円となっております。

< 負債の部・純資産の部 >

負債合計は14兆1,170億円となりました。内訳は流動負債が12兆6,051億円であり、このうちトレーディング商品が4兆5,348億円、有価証券担保借入金が4兆9,477億円となっております。固定負債は1兆5,042億円であり、このうち社債が1兆2,719億円となっております。

純資産合計は9,961億円となりました。利益剰余金は、四半期純損失による676億円の減少や配当金支払いによる201億円の減少などの結果、4,392億円となりました。また、その他有価証券評価差額金は、三洋電機株式会社第1回A種優先株式及び第1回B種優先株式に係る608億円などを計上した結果、670億円となりました。

(2) キャッシュ・フローの状況

当第3四半期連結会計期間において、営業活動によるキャッシュ・フローは、トレーディング商品の増加などにより4,992億円の減少となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、定期預金の増加や無形固定資産の取得などにより143億円の減少となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金の増加などにより5,733億円の増加となりました。これらに為替変動の影響等を加えた結果、当第3四半期連結会計期間末の現金及び現金同等物の残高は4,435億円となりました。

(3) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第3四半期連結会計期間において、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) 重要な会計方針及び見積もり

当社の四半期連結財務諸表は、わが国において一般に公正妥当と認められた会計基準に基づき作成されております。また、当社は、四半期連結財務諸表を作成するにあたり、会計方針に基づいていくつかの重要な見積もりを行っており、これらの見積もりは一定の条件や仮定を前提としております。そのため、条件や仮定が変化した場合には、実際の結果が見積もりと異なることがあり、結果として四半期連結財務諸表に重要な影響を与える場合があります。重要な会計方針のうち、特に重要と考える項目は、次の4項目です。

金融商品の評価

当社グループでは、トレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引は、時価をもって貸借対照表価額とし、評価差額はトレーディング損益として損益計算書に計上しております。評価に用いる時価は、市場で取引が行われている有価証券やデリバティブ取引については当第3四半期連結会計期間末時点の市場価格を、市場価格のない有価証券やデリバティブ取引については理論価格を、それぞれ使用しております。理論価格を算出する際には、対象となる商品や取引について最も適切と考えられるモデルを採用しております。

有価証券の減損

当社グループでは、投資有価証券等のトレーディング商品に属さない有価証券を保有しております。このうち時価のある有価証券については、時価が著しく下落したときは、回復する見込みがあると認められる場合を除き、減損処理を行っております。具体的には、当第3四半期連結会計期間末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は、著しい下落かつ回復する見込みがないと判断して、減損処理を行っております。時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、過去6ヶ月間の株価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復する見込みを検討し、回復する見込みがないと判断したものについては、減損処理を行っております。また、時価のない有価証券については、実質価額が著しく低下した場合に、減損処理を行っております。

固定資産の減損

当社グループでは、各資産グループにおいて、収益性が著しく低下した資産については、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失としております。なお、資産のグルーピングは、継続使用資産のうち、証券店舗など個別性の強い資産については個別物件単位で、その他の事業用資産については管理会計上の区分に従っております。

繰延税金資産の回収可能性

当社グループでは、税務上の繰越欠損金や企業会計上の資産・負債と税務上の資産・負債との差額である一時差異について税効果会計を適用し、繰延税金資産及び繰延税金負債を計上しております。繰延税金資産の回収可能性については、将来の合理的な見積もり可能期間内の課税所得の見積もり額を限度として、当該期間内の一時差異等のスケジュールリングの結果に基づき判断しております。

(6) 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3四半期連結会計期間のマクロ経済環境 >

海外の経済環境

当第3四半期連結会計期間は、米国・欧州における金融不安が更に高まりました。昨年9月の米大手投資銀行リーマン・ブラザーズの破綻以降、米国や欧州では金融機関の相互不信が日増しに深まり、欧州インターバンク市場でLIBORが急騰するなど信用不安が顕在化しました。また、住宅・不動産価格の下落は続き、不良資産の増加による自己資本の毀損を懸念した米国や欧州の金融機関は、個人や企業に対する融資態度を一層引き締めました。こうした信用収縮の強まりで、実体経済が更に悪化し金融不安が増幅するという負のスパイラルが深刻化しました。

また、世界経済が同時不況の色合いを強める中、原油や穀物などの商品市況は急速に下落し、世界的に原材料高を反映したインフレから一転し、デフレが懸念される状況となりました。そのため各国の金融政策の軸足は、インフレ抑制から景気の下支えを狙う緩和姿勢に移行しました。

世界的な金融危機拡大を阻止する取り組みとして、昨年10月にはG7、同11月には新興国を含む主要20カ国の金融サミットが開催され、協調的な政策対応が協議されました。ここでは各国が一層の金融緩和に加え、財政出動による大型の景気対策を表明するなど、危機克服へ向けた行動計画が確認されました。その後、各国の金融緩和が相次ぎ、昨年12月には米国の連邦準備制度理事会(FRB)が、政策金利を0～0.25%を目標圏とする事実上のゼロ金利政策に転じ、さらに、量的緩和に踏み込む姿勢を示しました。一方財政政策の面では、昨年11月に中国がGDP比で約16%に上る大型景気対策を打ち出し、続く12月には米国で財政出動が表明されるなど、世界各国が危機打開に向けて動き出しました。

日本の経済環境

世界経済の連鎖的な悪化により、輸出依存度の高い日本経済を取り巻く環境は、昨年10月以降、急速に厳しさを増しました。昨年9月までの日本経済は在庫・雇用・設備などストック面の過剰感が低かったため、海外経済と比べて健全とみられていましたが、想定以上に輸出が悪化し、在庫が大幅に積み上がる事態となりました。主に自動車や電機を中心とした輸出関連業種は、減産を余儀なくされるとともに、急激な円高を受けて大幅な減益となる公算が高まりました。さらに、雇用人員における余剰感が高まり、派遣社員を中心に人員削減の動きが広まるなど、雇用不安も急速に高まりました。

昨年12月調査の日銀短観は、ストック面においても国内経済の健全性が損なわれ始めたことを反映し、企業の景況感は第一次オイルショック時に匹敵する大幅な悪化を示しました。

また、世界的な信用収縮の中で直接金融による資金調達が困難となると同時に、銀行が企業に対する融資態度を厳格化したことにより資金繰りが悪化し、倒産が増加するなど、企業を取り巻く環境は一段と厳しさを増しました。

(7) 資本の財源及び資金の流動性に係る情報

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て有価証券関連業務を中心としたビジネス活動を行っております。

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、現先取引、レポ取引等の方法があり、これらの方法を適切に組み合わせることにより、効率的な資金調達の実現を図っています。

一方で、財務の安定性の確保も重視しています。当社グループでは、環境が大きく変動した場合においても、事業の継続に支障を来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います。特に、当第3四半期連結会計期間においては、金融市場の混乱による不測の事態に備え、流動性の積み増しを実行しています。グループ全体で、現金・預金、国債等の極めて換金性の高い有価証券等により構成される合計1兆1,426億円（当第3四半期連結会計期間末）のポートフォリオを保有しています。

< グループ全体の資金管理 >

グループ全体の流動性は、当社が一元的に管理・モニタリングしています。国内外の証券子会社（大和証券、大和証券エスエムビーシー、大和証券S M B Cヨーロッパ等）及び上場している子会社（大和S M B Cキャピタル）については各社が独自に資金調達と流動性の管理を行っておりますが、当社は、その状況を常にモニタリングしています。その他の子会社については、当社が一元的に資金調達し、効率的に配分するなど、一体化した資金管理をしております。

特に、当第3四半期連結会計期間は、海外拠点を含む証券子会社各社において、市場調達、金融機関借入等により、手元流動性を厚めに確保しております。

当第3四半期連結会計期間末における当社グループの無担保資金調達の状況は次のとおりです。

当第3四半期連結会計期間末の当社グループの無担保資金調達の状況

(億円)

	銀行等からの短期借入	2,827
	その他の短期借入	6,725
	コマーシャル・ペーパー	2,923
	1年以内償還予定の社債	109
(短期)無担保資金調達		12,584
	銀行等からの長期借入	2,020
	社債	12,719
(長期)無担保資金調達		14,740
株主資本合計		7,136
合計		34,461

(注)上記のほか、日本銀行の共通担保オペを利用した資金調達があります。

<コンティンジェンシー・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・プランを策定しております。これによって、市場環境の激変や想定外のクレジット・クランチ等が発生し、短期の無担保資金調達が困難になった場合にも、十分な流動性を確保できるものと考えております。

大和証券エスエムピーシーは、トレーディング・ポジションを中心とする流動資産の保有に伴う資金調達額が大きいため、同社のコンティンジェンシー・プランは、当社グループにとって最も重要です。同社では、短期の無担保資金調達が困難となった場合、自己資本、長期の無担保資金調達可能額及びその時点で可能な短期の無担保資金調達額の合計金額の範囲内まで、トレーディング・ポジションの圧縮を図ることとしております。

当社は、子会社のコンティンジェンシー・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資金調達プランやコンティンジェンシー・プランそのものの見直しを行い、さら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。

また、当社グループは、緊急時の資金調達手段の確保のため、複数の金融機関とコミットメント・ライン契約を結んでおります。

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務等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当社グループの株主資本は7,136億円となっております。資本金及び資本剰余金の合計は3,360億円、利益剰余金は四半期純損失の計上や配当金支払いによる減少などの結果、4,392億円となりました。自己株式の控除額は615億円となっております。

格付会社による信用格付

当社、大和証券及び大和証券エスエムビーシーには、国内外の大手格付会社により長期及び短期の信用格付が付与されております。

当社グループの信用格付に影響を及ぼす要因としては、マクロ経済環境及び主たる事業領域である証券市場などの事業環境、経営戦略、営業基盤、当社グループのマーケットにおける地位、収益性及び収益のボラティリティ、経費構造及び経費の柔軟性、リスク管理体制、流動性の状況、資本政策及び資本の十分性、コーポレート・ガバナンスの状況等が考えられます。

なお、格付が付与された有価証券を発行して資金調達を行うのは、当社グループにおいては当社、大和証券及び大和証券エスエムビーシーであります。

平成21年1月30日現在における当社、大和証券及び大和証券エスエムビーシーの格付は次のとおりであります。

当社

格付会社	長期格付	短期格付
Moody's Investors Service	Baa1	
Standard & Poor's	BBB+	A-2
格付投資情報センター	A	a-1
日本格付研究所	A+	

大和証券

格付会社	長期格付	短期格付
Moody's Investors Service	Baa1	P-2
Standard & Poor's	BBB+	A-2
格付投資情報センター	A	a-1
日本格付研究所	A+	

大和証券エスエムビーシー

格付会社	長期格付	短期格付
Moody's Investors Service	A1	P-1
Standard & Poor's	A	A-1
格付投資情報センター	A+	a-1

第3 【設備の状況】

(1) 主要な設備の状況

当第3四半期連結会計期間において、主要な設備に重要な異動はありません。

(2) 設備の新設、除却等の計画

第2四半期連結会計期間末において、重要な設備の新設、除却等の計画はありませんでした。

また、当第3四半期連結会計期間において、新たに確定した重要な設備の新設、除却等の計画はありません。

第 4 【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
計	4,000,000,000

【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20年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成21年2月12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	1,404,664,772	1,404,664,772	東京証券取引所 大阪証券取引所 名古屋証券取引所 各市場第一部	単元株式数は1,000株であります。
計	1,404,664,772	1,404,664,772		

(注) 「提出日現在発行数」欄には、平成21年2月1日からこの四半期報告書提出日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれておりません。

(2) 【新株予約権等の状況】

新株予約権の状況は以下のとおりであります。

平成16年定時株主総会の決議によるもの

当社は、ストック・オプションの目的で「商法等の一部を改正する法律」(平成13年法律第128号)(以下、「平成13年改正旧商法」といいます)第280条ノ20及び第280条ノ21の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成16年6月23日開催の株主総会及び平成16年8月24日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	1,644
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	1,644,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 756
新株予約権の行使期間	平成18年7月1日から平成23年8月31日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 756 資本組入額 378
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権付与契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

平成17年定時株主総会の決議によるもの

() 当社は、ストック・オプションの目的で平成13年改正旧商法第280条ノ20及び第280条ノ21の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成17年6月24日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	513
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	513,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 1
新株予約権の行使期間	平成17年7月1日から平成37年6月30日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成37年6月1日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権付与契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

() 当社は、ストック・オプションの目的で平成13年改正旧商法第280条ノ20及び第280条ノ21の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成17年6月24日開催の株主総会及び平成17年8月25日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	1,970
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	1,970,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 781
新株予約権の行使期間	平成19年7月1日から平成24年8月31日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 781 資本組入額 391
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権付与契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みにに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

平成18年定時株主総会の決議によるもの

() 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき
新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成18年6月24日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	293
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	293,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 1
新株予約権の行使期間	平成18年7月1日から平成38年6月30日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会 社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成38年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

(注) 上記の「資本組入額」欄には、株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。
株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額1,363円を加算した資本組入額は682円となります。

() 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成18年6月24日開催の株主総会及び平成18年8月24日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	2,593
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	68
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,593,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 1,515
新株予約権の行使期間	平成23年7月1日から平成28年6月23日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1,515 資本組入額 758
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みにに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

(注) 上記の「資本組入額」欄には、株式の発行価格1,515円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額499.8円を加算した資本組入額は1,008円となります。

平成19年定時株主総会の決議によるもの

- () 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成19年6月23日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	306
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	306,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 1
新株予約権の行使期間	平成19年7月1日から平成39年6月30日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成39年5月31日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

(注) 上記の「資本組入額」欄には、株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。
株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額1,312円を加算した資本組入額は657円となります。

() 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成19年6月23日開催の株主総会及び平成19年8月23日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	2,570
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	39
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	2,570,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 1,224
新株予約権の行使期間	平成24年7月1日から平成29年6月22日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1,224 資本組入額 612
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みにに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

(注) 上記の「資本組入額」欄には、株式の発行価格1,224円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額349円を加算した資本組入額は787円となります。

平成20年定時株主総会の決議によるもの

() 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成20年6月21日開催の株主総会及び同日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	350
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	350,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 1
新株予約権の行使期間	平成20年7月1日から平成40年6月30日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 1 資本組入額 1
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 当社及び当社子会社のうち当社取締役会または取締役会の決議による委任を受けた執行役が決定する会 社の取締役、執行役、執行役員のいずれの地位も喪 失した日の翌日から行使できるものとします。 3 上記2にかかわらず、平成40年5月31日より、他の 権利行使の条件に従い行使できるものとします。 4 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者と の間で締結する新株予約権割当契約に定めるところ によるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

(注) 上記の「資本組入額」欄には、株式の発行価格1円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。
株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額972円を加算した資本組入額は487円となります。

() 当社は、ストック・オプションの目的で会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づき新株予約権を無償発行しております。この発行は、平成20年6月21日開催の株主総会及び平成20年8月28日開催の執行役会において決議されたものであります。

	第3四半期会計期間末現在 (平成20年12月31日)
新株予約権の数(個)	3,099
新株予約権のうち自己新株予約権の数(個)	7
新株予約権の目的となる株式の種類	普通株式 単元株式数は1,000株であります。
新株予約権の目的となる株式の数(株)	3,099,000
新株予約権の行使時の払込金額(円)	1株当たり 917
新株予約権の行使期間	平成25年7月1日から平成30年6月20日
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額(円)	発行価格 917 資本組入額 459
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の条件は当社と新株予約権の割当の対象者との間で締結する新株予約権割当契約に定めるところによるものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みにに関する事項	
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	

(注) 上記の「資本組入額」欄には、株式の発行価格917円に0.5を乗じた額(円未満切上げ)を記載しております。株式の発行価格に新株予約権の帳簿価額243.7円を加算した資本組入額は581円となります。

(3) 【ライツプランの内容】

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)
自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日		1,404,664		178,324		157,678

(5) 【大株主の状況】

当第3四半期会計期間において、大株主の異動は把握しておりません。

(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、実質株主が把握できず、記載することができませんので、直前の基準日である平成20年9月30日の株主名簿により記載しております。

【発行済株式】

平成20年12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 58,471,000		
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,342,363,000	1,340,840	
単元未満株式	普通株式 3,830,772		
発行済株式総数	1,404,664,772		
総株主の議決権		1,340,840	

(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47,000株(議決権47個)が含まれております。

なお、当該株式は議決権の数から除いております。

2 「完全議決権株式(その他)」欄の株式数には、当社の証券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1,476,000株(議決権1,476個)が含まれております。

なお、当該株式は議決権の数から除いております。

3 「単元未満株式」欄の株式数には、当社所有の自己株式635株が含まれております。

【自己株式等】

平成20年12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 1丁目9番1号	58,471,000		58,471,000	4.16
計		58,471,000		58,471,000	4.16

(注) 上記のほか、当社の証券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1,476,000株(議決権1,476個)あります。なお、当該株式数は上記「発行済株式」の「完全議決権株式(その他)」欄の株式数に含めております。

2 【株価の推移】

【当該四半期累計期間における月別最高・最低株価】

月別	平成20年 4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
最高(円)	1,055	1,112	1,187	1,021	953	867	776	651	540
最低(円)	827	967	966	869	811	671	444	368	426

(注) 株価は東京証券取引所市場第一部におけるものです。

3 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当四半期報告書提出日までの役員の異動は、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

役職の異動

新役名及び職名		旧役名及び職名		氏名	異動年月日
専務執行役	企画・人事担当 兼 ホールセール部門副担当	専務執行役	企画・人事担当	日比野 隆司	平成20年 7 月 1 日

第5 【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」（平成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、当第3四半期連結会計期間(平成20年10月1日から平成20年12月31日まで)及び当第3四半期連結累計期間(平成20年4月1日から平成20年12月31日まで)に係る四半期連結財務諸表について、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)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成20年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	441,638	429,976
預託金	244,295	233,544
受取手形及び売掛金	11,119	13,580
有価証券	41,934	54,105
トレーディング商品	² 6,971,359	² 7,857,122
商品有価証券等	4,283,080	6,271,253
デリバティブ取引	2,688,279	1,585,868
約定見返勘定	-	219,314
営業投資有価証券	² 614,053	² 483,268
投資損失引当金	33,012	11,536
営業貸付金	70,034	75,421
商品	2	0
仕掛品	1,969	1,601
信用取引資産	213,007	369,312
信用取引貸付金	88,686	192,000
信用取引借証券担保金	124,321	177,311
有価証券担保貸付金	5,461,101	6,206,327
借入有価証券担保金	5,461,101	6,206,125
現先取引貸付金	-	202
立替金	7,439	12,511
短期貸付金	92,617	² 148,991
未収収益	29,502	36,597
繰延税金資産	1,623	15,913
その他の流動資産	422,261	² 608,629
貸倒引当金	206	1,384
流動資産計	14,590,744	16,753,297
固定資産		
有形固定資産	¹ 149,401	¹ 153,392
無形固定資産	108,805	101,879
その他	108,805	101,879
投資その他の資産	264,224	298,549
投資有価証券	² 183,649	² 215,611
長期貸付金	18,874	15,061
長期差入保証金	26,111	30,130
繰延税金資産	18,007	15,434
その他	⁵ 24,345	⁵ 24,579
貸倒引当金	⁵ 6,763	⁵ 2,267
固定資産計	522,431	553,821
資産合計	15,113,175	17,307,119

(単位: 百万円)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成20年3月31日)
負債の部		
流動負債		
支払手形及び買掛金	4,172	4,941
トレーディング商品	4,534,877	4,643,643
商品有価証券等	2,269,072	3,443,374
デリバティブ取引	2,265,805	1,200,269
約定見返勘定	140,501	-
信用取引負債	149,813	202,010
信用取引借入金	5,334	8,617
信用取引貸証券受入金	144,478	193,392
有価証券担保借入金	4,947,747	6,238,684
有価証券貸借取引受入金	4,516,231	5,535,106
現先取引借入金	431,516	703,577
預り金	143,007	134,361
受入保証金	288,625	101,149
短期借入金	1,966,594	2,362,803
コマーシャル・ペーパー	292,300	488,300
1年内償還予定の社債	10,904	130,613
未払法人税等	1,023	21,537
繰延税金負債	37,596	13
賞与引当金	9,175	17,325
本社移転関連費用引当金	610	4,129
その他の流動負債	78,224	571,406
流動負債計	12,605,173	14,920,920
固定負債		
社債	1,271,919	1,063,741
長期借入金	202,099	199,070
繰延税金負債	1,477	4,541
退職給付引当金	24,961	23,576
訴訟損失引当金	752	779
その他の固定負債	3,066	3,548
固定負債計	1,504,277	1,295,257
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	7,614	-
証券取引責任準備金	-	8,017
特別法上の準備金計	7,614	8,017
負債合計	14,117,065	16,224,195

	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成20年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	178,324	178,324
資本剰余金	157,678	157,678
利益剰余金	439,226	527,579
自己株式	61,579	61,701
株主資本合計	713,650	801,880
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7 67,026	24,470
繰延ヘッジ損益	694	800
為替換算調整勘定	34,417	9,061
評価・換算差額等合計	33,303	16,208
新株予約権	2,210	1,429
少数株主持分	246,946	263,404
純資産合計	996,110	1,082,923
負債・純資産合計	15,113,175	17,307,119

(2) 【 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)

	当第 3 四半期連結累計期間 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成20年12月31日)
営業収益	
受入手数料	165,221
トレーディング損益	9,315
株券等トレーディング損益	35,632
債券・為替等トレーディング損益	44,947
営業投資有価証券関連損益	53,692
金融収益	176,404
その他の売上高	38,251
営業収益計	335,500
金融費用	161,279
売上原価	28,679
純営業収益	145,540
販売費・一般管理費	
取引関係費	51,236
人件費	108,057
不動産関係費	33,154
事務費	22,983
減価償却費	25,404
租税公課	4,978
貸倒引当金繰入れ	5,174
その他	10,358
販売費・一般管理費計	261,346
営業損失 ()	115,805
営業外収益	
受取利息	236
受取配当金	3,685
持分法による投資利益	516
その他	1,868
営業外収益計	6,306
営業外費用	
支払利息	331
為替差損	1,313
その他	2,082
営業外費用計	3,728
経常損失 ()	113,226

(単位：百万円)

当第3四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年12月31日)	
特別利益	
投資有価証券売却益	2,327
金融商品取引責任準備金戻入	402
その他	205
特別利益計	2,935
特別損失	
固定資産除売却損	1,014
貸付債権処分損	1,967
関係会社株式評価損	262
投資有価証券評価損	14,513
その他	392
特別損失計	18,150
税金等調整前四半期純損失()	128,441
法人税、住民税及び事業税	7,321
法人税等調整額	17,300
法人税等合計	9,978
少数株主損失()	50,786
四半期純損失()	67,676

【第3四半期連結会計期間】

(単位：百万円)

当第3四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)	
営業収益	
受入手数料	49,383
トレーディング損益	22,849
株券等トレーディング損益	48,076
債券・為替等トレーディング損益	25,226
営業投資有価証券関連損益	37,478
金融収益	37,525
その他の売上高	11,983
営業収益計	38,564
金融費用	34,774
売上原価	9,372
純営業収益	5,582
販売費・一般管理費	
取引関係費	15,380
人件費	35,331
不動産関係費	10,566
事務費	7,460
減価償却費	8,767
租税公課	1,657
貸倒引当金繰入れ	702
その他	3,741
販売費・一般管理費計	83,606
営業損失()	89,189
営業外収益	
受取利息	115
受取配当金	994
持分法による投資利益	265
その他	118
営業外収益計	1,256
営業外費用	
支払利息	64
有価証券運用損	480
為替差損	971
その他	573
営業外費用計	2,089
経常損失()	90,022

(単位:百万円)

当第3四半期連結会計期間 (自平成20年10月1日 至平成20年12月31日)	
特別利益	
投資有価証券売却益	646
その他	2
特別利益計	644
特別損失	
固定資産除売却損	216
貸付債権処分損	208
関係会社株式評価損	46
投資有価証券評価損	9,521
その他	40
特別損失計	9,535
税金等調整前四半期純損失()	98,913
法人税、住民税及び事業税	3,133
法人税等調整額	9,877
法人税等合計	13,010
少数株主損失()	32,863
四半期純損失()	53,039

(3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

当第3四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日)	
営業活動によるキャッシュ・フロー	
税金等調整前四半期純損失 ()	128,441
減価償却費	28,257
貸倒引当金の増減額 (は減少)	5,179
受取利息及び受取配当金	3,921
支払利息	331
持分法による投資損益 (は益)	516
固定資産除売却損益 (は益)	1,014
投資有価証券売却損益 (は益)	2,309
関係会社株式評価損	262
投資有価証券評価損益 (は益)	14,513
金融商品取引責任準備金の増減額 (は減少)	402
顧客分別金信託の増減額 (は増加)	7,319
トレーディング商品の増減額	1,113,257
営業投資有価証券の増減額 (は増加)	37,754
営業貸付金の増減額 (は増加)	645
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	104,107
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	539,010
短期貸付金の増減額 (は増加)	21,357
預り金の増減額 (は減少)	8,634
その他	71,558
小計	580,543
利息及び配当金の受取額	3,999
利息の支払額	352
法人税等の支払額	31,972
営業活動によるキャッシュ・フロー	552,219
投資活動によるキャッシュ・フロー	
定期預金の預入による支出	41,358
定期預金の払戻による収入	116,125
有価証券の取得による支出	12,656
有価証券の売却及び償還による収入	4,996
有形固定資産の取得による支出	10,072
無形固定資産の取得による支出	25,649
投資有価証券の取得による支出	12,811
投資有価証券の売却及び償還による収入	7,648
貸付けによる支出	7,329
貸付金の回収による収入	3,581
その他	4,299
投資活動によるキャッシュ・フロー	26,771

(単位：百万円)

当第3四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日)	
財務活動によるキャッシュ・フロー	
短期借入金の純増減額（は減少）	550,867
長期借入れによる収入	22,600
長期借入金の返済による支出	16,775
社債の発行による収入	287,075
社債の償還による支出	197,603
配当金の支払額	20,194
その他	31
財務活動によるキャッシュ・フロー	475,733
現金及び現金同等物に係る換算差額	19,779
現金及び現金同等物の増減額（は減少）	83,478
現金及び現金同等物の期首残高	359,851
新規連結に伴う現金及び現金同等物の増加額	209
現金及び現金同等物の四半期末残高	1 443,539

【四半期連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項等の変更】

<p>当第3四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日)</p>
<p>1 連結の範囲に関する事項の変更</p> <p>(1) 連結の範囲の変更</p> <p>第1四半期連結会計期間より、重要性が増したため1社を連結の範囲に含めております。また、清算等に伴い3社を連結の範囲から除外しております。</p> <p>当第3四半期連結会計期間において、国内連結子会社が会社分割したことに伴い、連結子会社が2社増加しております。</p> <p>(2) 変更後の連結子会社の数 46社</p> <p>2 会計処理基準に関する事項の変更</p> <p>(1) たな卸資産の評価に関する会計基準の適用</p> <p>第1四半期連結会計期間より、「棚卸資産の評価に関する会計基準」(企業会計基準第9号 平成18年7月5日)を適用しております。</p> <p>なお、この変更による損益に与える影響はありません。</p> <p>(2) 「連結財務諸表作成における在外子会社の会計処理に関する当面の取扱い」の適用</p> <p>第1四半期連結会計期間より、「連結財務諸表作成における在外子会社の会計処理に関する当面の取扱い」(実務対応報告第18号 平成18年5月17日)を適用しております。</p> <p>なお、この変更による損益に与える影響はありません。</p> <p>(3) リース取引に関する会計基準等の適用</p> <p>「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号 平成5年6月17日、平成19年3月30日改正)及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号 平成6年1月18日、平成19年3月30日改正)を第1四半期連結会計期間から早期に適用し、所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理から通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理に変更し、リース資産として計上しております。</p> <p>また、リース資産の減価償却の方法は、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>ただし、リース取引開始日が適用初年度前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を引き続き採用しております。</p> <p>なお、この変更による損益に与える影響は軽微であります。</p>

【追加情報】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日)
従来、特別法上の準備金として、旧証券取引法第51条の規定により計上しておりました「証券取引責任準備金」は、第1四半期連結会計期間より金融商品取引法第46条の5の規定に基づく方法により「金融商品取引責任準備金」として計上しております。 なお、この変更による損益に与える影響は軽微であります。

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)	前連結会計年度末 (平成20年3月31日)																																																																								
<p>1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は105,561百万円であります。</p> <p>2 担保に供されている資産</p> <table><tr><td>トレーディング商品</td><td>1,397,350百万円</td></tr><tr><td>営業投資有価証券</td><td>14</td></tr><tr><td>投資有価証券</td><td>51,200</td></tr><tr><td>計</td><td>1,448,564</td></tr></table> <p>(注) 上記の金額は四半期連結貸借対照表計上額によっております。なお上記担保資産の他に、借り入れた有価証券等205,969百万円を担保として差し入れております。</p> <p>3 差し入れた有価証券等の時価</p> <table><tr><td>消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td><td>5,052,142百万円</td></tr><tr><td>現先取引で売却した有価証券</td><td>437,499</td></tr><tr><td>その他</td><td>534,096</td></tr><tr><td>計</td><td>6,023,738</td></tr></table> <p>(注) 2 担保に供されている資産に属するものは除いております。</p> <p>4 差し入れを受けた有価証券等の時価</p> <table><tr><td>消費貸借契約により借り入れた有価証券</td><td>6,316,489百万円</td></tr><tr><td>その他</td><td>370,304</td></tr><tr><td>計</td><td>6,686,793</td></tr></table> <p>5 貸倒引当金10,036百万円は、債権額と相殺して表示しております。</p> <p>6 保証債務</p> <table><tr><th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr><tr><td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,993</td></tr><tr><td>その他 (2社)</td><td>債務</td><td>922</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>2,915</td></tr></table> <p>7 その他有価証券評価差額金には、「種類株式の貸借対照表価額に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第10号)に基づく種類株式に係る58,913百万円が含まれております。</p>	トレーディング商品	1,397,350百万円	営業投資有価証券	14	投資有価証券	51,200	計	1,448,564	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	5,052,142百万円	現先取引で売却した有価証券	437,499	その他	534,096	計	6,023,738	消費貸借契約により借り入れた有価証券	6,316,489百万円	その他	370,304	計	6,686,793	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	1,993	その他 (2社)	債務	922	合計		2,915	<p>1 有形固定資産から控除した減価償却累計額は106,710百万円であります。</p> <p>2 担保に供されている資産</p> <table><tr><td>トレーディング商品</td><td>1,165,096百万円</td></tr><tr><td>営業投資有価証券</td><td>314</td></tr><tr><td>短期貸付金</td><td>34,720</td></tr><tr><td>その他の流動資産</td><td>10,522</td></tr><tr><td>投資有価証券</td><td>62,247</td></tr><tr><td>計</td><td>1,272,901</td></tr></table> <p>(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。なお上記担保資産の他に、借り入れた有価証券等609,272百万円を担保として差し入れております。</p> <p>3 差し入れた有価証券等の時価</p> <table><tr><td>消費貸借契約により貸し付けた有価証券</td><td>6,782,108百万円</td></tr><tr><td>現先取引で売却した有価証券</td><td>710,431</td></tr><tr><td>その他</td><td>577,499</td></tr><tr><td>計</td><td>8,070,038</td></tr></table> <p>(注) 2 担保に供されている資産に属するものは除いております。</p> <p>4 差し入れを受けた有価証券等の時価</p> <table><tr><td>消費貸借契約により借り入れた有価証券</td><td>7,542,741百万円</td></tr><tr><td>その他</td><td>466,116</td></tr><tr><td>計</td><td>8,008,857</td></tr></table> <p>5 貸倒引当金8,325百万円は、債権額と相殺して表示しております。</p> <p>6 保証債務</p> <table><tr><th>被保証者</th><th>被保証債務の内容</th><th>金額 (百万円)</th></tr><tr><td>従業員</td><td>借入金</td><td>1,400</td></tr><tr><td>その他 (2社)</td><td>債務</td><td>290</td></tr><tr><td>合計</td><td></td><td>1,690</td></tr></table>	トレーディング商品	1,165,096百万円	営業投資有価証券	314	短期貸付金	34,720	その他の流動資産	10,522	投資有価証券	62,247	計	1,272,901	消費貸借契約により貸し付けた有価証券	6,782,108百万円	現先取引で売却した有価証券	710,431	その他	577,499	計	8,070,038	消費貸借契約により借り入れた有価証券	7,542,741百万円	その他	466,116	計	8,008,857	被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)	従業員	借入金	1,400	その他 (2社)	債務	290	合計		1,690
トレーディング商品	1,397,350百万円																																																																								
営業投資有価証券	14																																																																								
投資有価証券	51,200																																																																								
計	1,448,564																																																																								
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	5,052,142百万円																																																																								
現先取引で売却した有価証券	437,499																																																																								
その他	534,096																																																																								
計	6,023,738																																																																								
消費貸借契約により借り入れた有価証券	6,316,489百万円																																																																								
その他	370,304																																																																								
計	6,686,793																																																																								
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																																							
従業員	借入金	1,993																																																																							
その他 (2社)	債務	922																																																																							
合計		2,915																																																																							
トレーディング商品	1,165,096百万円																																																																								
営業投資有価証券	314																																																																								
短期貸付金	34,720																																																																								
その他の流動資産	10,522																																																																								
投資有価証券	62,247																																																																								
計	1,272,901																																																																								
消費貸借契約により貸し付けた有価証券	6,782,108百万円																																																																								
現先取引で売却した有価証券	710,431																																																																								
その他	577,499																																																																								
計	8,070,038																																																																								
消費貸借契約により借り入れた有価証券	7,542,741百万円																																																																								
その他	466,116																																																																								
計	8,008,857																																																																								
被保証者	被保証債務の内容	金額 (百万円)																																																																							
従業員	借入金	1,400																																																																							
その他 (2社)	債務	290																																																																							
合計		1,690																																																																							

(四半期連結損益計算書関係)

第3 四半期連結累計期間

当第3 四半期連結累計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日)
1 人件費には、賞与引当金繰入額10,577百万円が含まれております。

第3 四半期連結会計期間

当第3 四半期連結会計期間 (自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日)
1 人件費には、賞与引当金繰入額 106百万円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 (自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日)	
1	現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結 貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係
	現金・預金勘定 441,638百万円
	預入期間が3ヶ月を 超える定期預金 8,099
	預入期間が3ヵ月以内の 譲渡性預金 10,000
	現金及び現金同等物 443,539

(株主資本等関係)

当第3四半期連結会計期間末(平成20年12月31日)及び当第3四半期連結累計期間(自平成20年4月1日至平成20年12月31日)

1 発行済株式の種類及び総数

普通株式 1,404,664千株

2 自己株式の種類及び株式数

普通株式 58,361千株

3 新株予約権の四半期連結会計期間末残高

会社名	内訳	当第3四半期 連結会計期間末残高 (百万円)
当社	ストック・オプションとしての 新株予約権	2,068
連結子会社	ストック・オプションとしての 新株予約権	141
合計		2,210

(注)上記の連結子会社は、大和SMB Cキャピタル株式会社であります。

4 配当に関する事項

(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20年5月19日 取締役会	普通株式	利益剰余金	13,463	10	平成20年3月31日	平成20年6月2日
平成20年10月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	6,730	5	平成20年9月30日	平成20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末後となるもの

該当事項はありません。

(セグメント情報)

【事業の種類別セグメント情報】

当第3四半期連結会計期間(自平成20年10月1日至平成20年12月31日)及び当第3四半期連結累計期間(自平成20年4月1日至平成20年12月31日)

当企業集団は、有価証券及びデリバティブ商品の売買等、有価証券及びデリバティブ商品の売買等の委託の媒介、有価証券の引受け及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱いなどの有価証券関連業を中心とする営業活動をグローバルに展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。従って、当企業集団の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しております。

【所在地別セグメント情報】

当第3四半期連結会計期間(自平成20年10月1日至平成20年12月31日)

	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	(百万円) 連結
純営業収益							
(1) 外部顧客からの 純営業収益	18,424	7,676	3,096	2,068	5,582		5,582
(2) セグメント間の 内部純営業収益	389	138	638	328	1,217	(1,217)	
計	18,035	7,538	3,735	2,397	4,364	(1,217)	5,582
営業利益又は営業損失()	90,172	3,785	2,010	790	89,188	(0)	89,189

当第3四半期連結累計期間(自平成20年4月1日至平成20年12月31日)

	日本	米州	欧州	アジア・ オセアニア	計	消去又は 全社	(百万円) 連結
純営業収益							
(1) 外部顧客からの 純営業収益	111,986	15,421	10,134	7,998	145,540		145,540
(2) セグメント間の 内部純営業収益	352	1,084	5,569	1,775	8,782	(8,782)	
計	112,339	16,506	15,703	9,774	154,323	(8,782)	145,540
営業利益又は営業損失()	117,283	6,022	3,663	885	115,810	4	115,805

- (注) 1 国または地域の区分の方法は、地理的近接度によっております。
2 各区分に属する主な国または地域
米州・・・・・・アメリカ
欧州・・・・・・イギリス、ドイツ、スイス、フランス
アジア・オセアニア・・・香港、シンガポール

【海外売上高】

当第3四半期連結会計期間（自 平成20年10月1日 至 平成20年12月31日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	(百万円) 計
海外売上高 (純営業収益)	8,546	1,603	2,359	12,509
連結純営業収益				5,582
連結純営業収益に 占める海外売上高の割合(%)	-	-	-	-

当第3四半期連結累計期間（自 平成20年4月1日 至 平成20年12月31日）

	米州	欧州	アジア・ オセアニア	(百万円) 計
海外売上高 (純営業収益)	20,476	10,498	8,516	39,491
連結純営業収益				145,540
連結純営業収益に 占める海外売上高の割合(%)	14.1	7.2	5.9	27.1

- (注) 1 国または地域の区分の方法は、地理的近接度によっております。
2 各区分に属する主な国または地域
米州・・・・・・アメリカ
欧州・・・・・・イギリス、ドイツ、スイス、フランス
アジア・オセアニア・・・香港、シンガポール

(有価証券及びデリバティブ取引関係)

1 トレーディングに係るもの

デリバティブ取引

(百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)			
	資産		負債	
	契約額等	時価	契約額等	時価
オプション取引	2,823,030	228,902	3,206,499	238,651
為替予約取引	569,383	19,610	1,442,192	51,824
先物・先渡取引	528,476	72,810	2,707,137	225,483
スワップ取引	45,786,120	2,324,816	41,730,663	1,705,433
その他	671,191	46,960	675,495	44,411
リスクリザーブ		4,820		

2 トレーディングに係るもの以外

(1) 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

(2) その他有価証券で時価のあるもの

(百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)		
	取得原価	四半期連結貸借 対照表計上額	差額
株券	236,775	421,758	184,982
債券			
その他	14,419	11,568	2,851
計	251,195	433,326	182,130

(注) その他有価証券で時価のあるものにつき、当第3四半期連結累計期間において26,587百万円の減損処理を行っております。

(3) デリバティブ取引

(百万円)

種類	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)		
	契約額等	時価	評価損益
金利スワップ取引	20,000	51	51
通貨スワップ取引	11,503	28	28
為替予約取引	130	9	9

(注) ヘッジ会計を適用しているものは除いております。

(1 株当たり情報)

1 1 株当たり純資産額

当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)	前連結会計年度末 (平成20年3月31日)
1 株当たり純資産額 554.82円	1 株当たり純資産額 607.64円

(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	当第3四半期連結会計期間末 (平成20年12月31日)	前連結会計年度末 (平成20年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	996,110	1,082,923
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	249,156	264,833
(うち新株予約権)	(2,210)	(1,429)
(うち少数株主持分)	(246,946)	(263,404)
普通株式に係る四半期連結会計期間末 (連結会計年度末)の純資産額 (百万円)	746,953	818,089
1 株当たり純資産額の算定に用いられた 四半期連結会計期間末(連結会計年 度末)の普通株式の数(千株)	1,346,303	1,346,335

2 1 株当たり四半期純損失金額

当第3四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年12月31日)	当第3四半期連結会計期間 (自平成20年10月1日 至平成20年12月31日)
1 株当たり四半期純損失金額 50.27円	1 株当たり四半期純損失金額 39.40円

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については、潜在株式は存在するものの、1株当たり四半期純損失であるため記載しておりません。

2 1 株当たり四半期純損失金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当第3四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年12月31日)	当第3四半期連結会計期間 (自平成20年10月1日 至平成20年12月31日)
四半期純損失金額(百万円)	67,676	53,039
普通株主に帰属しない金額(百万円)		
普通株式に係る四半期純損失金額(百万円)	67,676	53,039
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,346,321	1,346,257
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	平成20年定時株主総会の決議によるもの()及び()の新株予約権 この概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況(2) 新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。	平成20年定時株主総会の決議によるもの()及び()の新株予約権 この概要は「第4 提出会社の状況 1 株式等の状況(2) 新株予約権等の状況」に記載のとおりであります。

(重要な後発事象)

当第3四半期連結会計期間(自平成20年10月1日至平成20年12月31日)

該当事項はありません。

2【その他】

(剰余金の配当)

平成20年10月31日開催の取締役会において、平成20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 6,730百万円

1株当たりの金額 5円00銭

支払請求権の効力発生日及び支払開始日 平成20年12月1日

(注) 平成20年9月30日現在の株主名簿または実質株主名簿に記載または記録された株主または登録質権者に対し支払いを行います。

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21年 2 月12日

株式会社大和証券グループ本社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社 員 公 認 会 計 士 堀 内 巧 印
業 務 執 行 社 員

指 定 社 員 公 認 会 計 士 小 澤 陽 一 印
業 務 執 行 社 員

指 定 社 員 公 認 会 計 士 福 井 淳 印
業 務 執 行 社 員

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20年4月1日から平成21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20年10月1日から平成20年12月31日まで)及び第3四半期連結累計期間(平成20年4月1日から平成20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及び四半期連結キャッシュ・フロー計算書について四半期レビューを行った。この四半期連結財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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により行われており、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限定された手続により行われた。

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平成20年12月31日現在の財政状態、同日をもって終了する第3四半期連結会計期間及び第3四半期連結累計期間の経営成績並びに第3四半期連結累計期間のキャッシュ・フローの状況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。

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 四半期連結財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。