# 第83回

# 定時株主総会 招集ご通知

日時	2020年6月25日 (木曜日)
	午前10時〔午前9時開場〕

場所	東京都港区芝公園	園四丁目8番1号	
	ザ・プリンス	パークタワー東	疗
	地下の陸 コ	ンベンションホー	П

目次	第83回定時株主総会招集ご通知	3
	株主総会参考書類	7
	議案 取締役13名選任の件	7
	【第83回定時株主総会招集ご通知添付書類】	
	事業報告	22
連結計算書類		
	計算書類	47
	監査報告	48



本招集通知は、パソコン・スマートフォンでも主要な コンテンツをご覧いただけます。

https://p.sokai.jp/8601/



株主総会にご出席の株主の皆様への お土産のご用意はございません。

## 大和証券グループ本社

Daiwa Securities Group Inc.

証券コード:8601

## 株主の皆様へ

平素は格別のご高配を賜り厚く御礼申し上げます。

はじめに、新型コロナウイルス感染症により影響を受けられ た皆様には、心よりお見舞い申し上げます。

大和証券グループでは、2018年4月より3ヵ年の中期経営計画"Passion for the Best" 2020をスタートさせ、「クオリティNo.1のコンサルティング力による付加価値の高いソリューションの提供」と、「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」を基本方針に掲げています。2020年度も引き続き、「お客様第一の業務運営」のクオリティを追求するとともに、新規ビジネス領域と伝統的な証券業との融合による「新たな価値」を創出することにより、持続的な企業価値向上を目指してまいります。

また、中期経営計画では、戦略の根幹に2015年に国連にて採択されたSDGs(注)を据えております。当社グループとしましては、ビジネスを通じ、企業の経済的価値の追求と社会課題の解決を両立することで、サステナブルで豊かな社会・国民生活の実現に貢献してまいります。

新型コロナウイルスによる今回の危機対応を契機として、世界的にも働き方改革やデジタル化の進展が加速しており、産業構造のみならず、社会全体が変貌を遂げようとしています。歴史的転換点に立つ今こそ、新たな時代の「未来を創る、金融・資本市場のパイオニア」を目指し、グループを挙げて取り組んでまいります。

株主の皆様におかれましては、なお一層のご支援を賜ります よう、お願い申し上げます。

株式会社大和証券グループ本社 執行役社長(CEO)

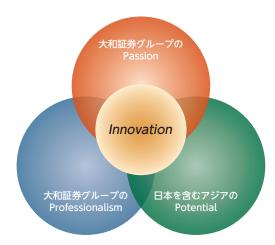
## 中田誠司

(注) SDGs: Sustainable Development Goals (持続可能な開発目標)の略。 当社グループのSDGsへの取り組みは43ページをご覧ください。



#### ■中期経営計画 "Passion for the Best" 2020概要

#### ■ 大和証券グループの目指す姿



#### Passion

- ■「金融・資本市場を通じて社会および経済の発展に貢献」するという高い志と使命感
- 企業理念「信頼の構築」・「人材の重視」・「社会への貢献」・「健全な利益の確保」の実現への情熱

#### Professionalism

- クオリティNo.1の誠実さと高い専門能力
- ハイブリッド型総合証券グループへ向けた多様な事業ポートフォリオ

#### Potential

- 人生100年時代の幕開け:運用ニーズ・資産承継ニーズの拡大
- デジタル化の進展による資産形成世代の運用ニーズの拡大と多様化
- アジアにおける産業化の進展と経済の急成長



#### Innovation

#### 未来を創る、金融・資本市場のパイオニア "Passion for the Best" 2017 2018年度 2019年度 2020年度 資産規模・企業価値 基本方針 進捗のイメージ 営業体制、プロダクト・サービスの整備 クオリティNo.1の コンサルティング力による 「お客様第一の業務運営」の実現と進化 日本経済を牽引する 「付加価値」の高い 客様資産の お客様満足度の飛躍的向上 ソリューションの提供 デジタル・トランスフォーメーション 2 ハイブリッド型 伝統的ビジネス強化、グループ内リソースのフル活用 拡大 総合証券グループとして 外部ネットワーク、周辺ビジネスの拡大・強化 「新たな価値」の提供 プロダクト・サービスの高度化

間部

(証券コード:8601) 2020年5月29日

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

#### 株式会社大和証券グループ本社

執行役社長 中田 誠司

## 第83回定時株主総会招集ご通知

拝啓 平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、当社第83回定時株主総会を下記のとおり開催いたしますので、ご通知申し上げます。

近時、新型コロナウイルス感染拡大防止のため政府や都道府県知事から外出自粛が要請される事態に至っております。この事態を受け、慎重に検討いたしました結果、本総会につきましては、適切な感染拡大防止策を実施させていただいた上で、開催させていただくことといたしました。

株主の皆様におかれましては、感染拡大防止の観点から、本総会につきましては、極力、ご来場をお控えいただき、書面又はインターネット等による事前の議決権行使をお願い申し上げます。

お手数ながら後記の株主総会参考書類をご検討いただき、5ページの「議決権行使のご案内」に従って、2020年6月24日(水曜日)17時(午後5時)までに議決権を行使してくださいますようお願い申し上げます。

敬具

記

1.	B	時	<b>2020年6月25日 (木曜日) 午前10時</b> 〔午前9時開場〕
2.	場	所	東京都港区芝公園四丁目8番1号 ザ・プリンス パークタワー東京 地下2階 コンベンションホール (末尾の「株主総会会場ご案内図」をご参照ください。)
3.	目的	事項	
	報告	事項	1. 第83期(2019年4月1日から2020年3月31日まで)事業報告の内容、連結計算 書類の内容並びに会計監査人及び監査委員会の連結計算書類監査結果報告の件
			2. 第83期(2019年4月1日から2020年3月31日まで)計算書類の内容報告の件
	決請	事項	議案 取締役13名選任の件

#### 4. 招集にあたっての決定事項

- (1) 書面又は電磁的方法(インターネット等)により、議決権を行使することができます。具体的な手続等について、5ページの「議決権行使のご案内」をご高覧の上、それに従って、議決権をご行使ください。
- (2) 書面による議決権行使において、議案についての賛否を記載する欄に記載がない議決権行使書用紙が提出された場合においては、賛成の意思表示があったものとして取扱わせていただきます。
- (3) 代理人により議決権を行使される場合は、議決権を有する株主の方に委任する場合に限られます。また、その際には代理権を証明する委任状に加え、代理人ご本人の議決権行使書用紙が必要となります。なお、代理人は1名とさせていただきます。
- (4) 議決権の不統一行使をされる場合には、株主総会の3日前までに議決権の不統一行使を行う旨とその理由を書面により当社にご通知ください。

#### 5. インターネットによる開示

- (1) 本招集ご通知に添付すべき書類のうち、「新株予約権等の状況」、「業務の適正を確保するための体制及び当該体制の運用状況」、「連結株主資本等変動計算書」、「連結計算書類の注記」、「株主資本等変動計算書」及び「計算書類の注記」は、法令及び当社定款第23条の定めにより、インターネット上の当社ウェブサイト(https://www.daiwa-grp.jp/ir/shareholders/meeting/)に掲載しておりますので、本招集ご通知には添付しておりません。したがいまして、本招集ご通知の添付書類は、監査委員会又は会計監査人が監査報告又は会計監査報告を作成するに際して監査した事業報告、連結計算書類及び計算書類の一部であります。
- (2) 株主総会参考書類、事業報告、連結計算書類及び計算書類の内容について、株主総会の前日までに修正すべき事情が生じた場合は、上記の当社ウェブサイトに掲載いたします。
- (3) 新型コロナウイルス感染拡大の状況次第では、やむなく会場や開始時刻が変更となる場合があります。その場合は、上記の当社ウェブサイトに掲載いたします。
- (4) 本招集ご通知の内容については、早期に情報を提供する観点から、本招集ご通知発送前に当社ウェブサイトに開示いたしました。

以上

- 株主ではない代理人及び同伴の方など、**株主以外の方は本総会にご出席いただけません**ので、ご注意願います。
- 当日ご出席の際は、お手数ながら同封の<mark>議決権行使書用紙を会場受付にご提出ください</mark>ますようお願い申し上げます。
- 管理信託銀行等の名義株主様(常任代理人様を含みます。)につきましては、株式会社ICJが運営する機関投資家向け議決権電子行使プラットフォームの利用を事前に申し込まれた場合には、当社株主総会における電磁的方法による議決権行使の方法として、インターネットによる議決権行使以外に、当該プラットフォームをご利用いただくことができます。

### 議決権行使のご案内

今回の定時株主総会で付議されております議案につきまして、以下のいずれかの方法で議決権の行使を 賜りますようお願い申し上げます。

# による場合

**インターネット等** スマートフォン等により議決権行使書用紙のQRコードを読み取るか、当社の指定する 議決権行使ウェブサイト(https://www.web54.net/)にアクセスし、画面の案内に従 って議決権をご行使ください。



行 使 期 限 | **2020年6月24日 (水曜日) 17時 (午後5時)** 

詳細は次頁をご覧ください

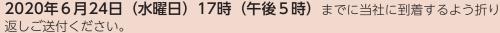
#### ■重複行使のお取扱いについて

書面と電磁的方法(インターネット等)によって、二重に議決権を行使された場合は、電磁的方法によるも のを議決権行使として取扱わせていただきます。

また、電磁的方法によって、複数回数又はパソコンや携帯電話、スマートフォンで重複して議決権を行使さ れた場合は、最後に行われたものを有効な議決権行使として取扱わせていただきます。

#### 書面による場合

書面による議決権行使は、同封の議決権行使書用紙に替否をご表示いただき、



※ご送付いただきます議決権行使書用紙は、通常の郵便物に比べ郵便局での処理に時間を要しますので、早めにご投 函くださいますようお願い申し上げます。

#### ■議決権行使書用紙のご記入方法のご案内



#### →こちらに、議案の賛否をご記入ください。

#### 議案

▶全員替成の場合:「替」の欄に○印

▶全員反対の場合:「否」の欄に○印

▶一部の候補者を

反対される場合:「賛」の欄に○印の上、反対される

候補者の番号をご記入ください。

#### 株主総会にご出席 いただく場合

議決権行使書用紙を会場受付にご提出ください。

2020年6月25日(木曜日)午前10時(午前9時開場)  $\Box$ 



所 東京都港区芝公園四丁目8番1号 ザ・プリンス パークタワー東京 地下2階 コンベンションホール

(末尾の「株主総会会場ご案内図」をご参照ください。)

### インターネット等による議決権行使のご案内

### QRコードを読み取る方法 「スマート行使」

議決権行使コード及びパスワードを入力することなく議決権行使ウェブサイトにログインすることができます。

 議決権行使書用紙 右下に記載のQR コードを読取って ください。

> ※「QRコード」は株式会 社デンソーウェーブの 登録商標です。



2 以降は画面の案内に従って賛否をご入力ください。

### 「スマート行使」での議 決権行使は 1 回に限り 可能です。

議決権行使後に行使内容を変更する場合は、お手数ですが議決権行使ウェブサイトへアクセスし、議決権行使書用紙に記載の「議決権行使コード」・「パスワード」を入力してログイン、再度議決権行使をお願いいたします。



\*\*QRコードを再度読取っていただくと、議決権行使ウェブサイトへアクセス出来ます。

### 議決権行使コード・パスワードを 入力する方法

議決権行使ウェブサイト https://www.web54.net/

1 議決権行使ウェブサイトにアクセスしてください。 「次へすすむ」をクリック

2 議決権行使書用紙に 記載された「議決権 行使コード」をご入 力ください。 「議決権行使コード」を入力

3 議決権行使書用紙に 記載された「パスワード」をご入力ください。 「初期パスワード」を入力 実際にご使用になる新し いパスワードを登録して ください (登録) をクリック

4 以降は画面の案内に従って賛否をご入力ください。

インターネットによる議決権行使でパソコンや 携帯電話、スマートフォンの操作方法などがご 不明な場合は、右記にお問い合わせください。 三井住友信託銀行 証券代行ウェブサポート 専用ダイヤル 電話番号: **0120-652-031** (フリーダイヤル)

(受付時間 午前9時~午後9時)

機関投資家の皆様は、株式会社ICJの運営する機関投資家向け議決権電子行使プラットフォームをご利用いただくことが可能です。

## 株主総会参考書類

#### 議案及び参考事項

### 職案 取締役13名選任の件

本総会終結の時をもって、取締役全員(14名)が任期満了となりますので、指名委員会の決定に基づき取締役13名の選任をお願いいたしたいと存じます。

取締役の候補者は次のとおりであり、このうち、小笠原 倫明 氏、竹内 弘高 氏、西川 郁生 氏、河合 江理子 氏、西川 克行 氏及び岩本 敏男 氏の6名は、会社法施行規則第2条第3項第7号に定める社 外取締役候補者であります。

候補者 番号		氏	名		現在の当	社における地位、担当		取締役在任年数 (本総会終結時)	取締役会への 出席状況
1	日比野	8 隆司	再任		取締役会長 兼 執行 取締役会議長	登 指名 委員	報酬 委員	16年	10/10回 (100%)
2	中田	誠司	再任		取締役 兼 代表執行 最高経営責任者(CEC		報酬 委員	5年	10/10回 (100%)
3	松井	敏浩	再任		取締役 兼 代表執行 最高執行責任者(COC			4年	10/10回 (100%)
4	田代	桂子	再任	女性	取締役 兼 執行役副 海外担当 兼 SDGs持			6年	10/10回 (100%)
5	荻 野	明彦	新任		専務執行役 企画担当 兼 法務担	当 兼 人事管掌		_	_
6	花岡	幸子	再任	女性 非執行	取締役	監査 委員		1年	8/8回 (100%)
7	川島	博政	新任	非執行	執行役員			_	_
8	小笠原	( 倫明	再任	社外独立	社外取締役	指名 監査 委員 委員		5年	10/10回 (100%)
9	竹内	弘高	再任	社外独立	社外取締役	指名 委員	報酬 委員	4年	10/10回 (100%)
10	西川	郁生	再任	社外独立	社外取締役	監査 委員	報酬 委員	4年	10/10回 (100%)
11	河合	江理子	再任	女性 社外 独立	社外取締役	指名 監査 委員 委員		2年	10/10回 (100%)
12	西川	克行	再任	社外独立	社外取締役	指名 監査 委員 委員		1年	8/8回 (100%)
13	岩本	敏男	新任	社外独立				_	_
再任	<b>月任取締役候補</b>	者新任新	f任取締役候	補者 非執行	非業務執行取締役候補者	<b>社外</b> 社外取締役候補者	独立	証券取引所の定めに基	<b>基づく独立役員</b>



# ででののたかし日比野隆司

4400



105540 00704

報酬委員会 4/4回(100%)

<del>生牛</del> 月日	1900年9月27日主
現在の当社における地位、担当	取締役会長 兼 執行役 取締役会議長
所有する当社の株式の数	普通株式 258,090株
取締役在任年数(本総会終結時)	16年
取締役会等への出席状況	取締役会 10/10回(100%) 指名委員会 3/3回(100%)

#### ┃取締役候補者とした理由

1979年に当社に入社し、これまで商品部門や海外部門、企画・人事部門の担当を歴任し、当社グループ全体の業務に関わる豊富な経験を有しております。また、2011年から2017年まで当社代表執行役社長 最高経営責任者 (CEO) を務め、経営者としての豊かな経験と見識を有していることから、取締役として適任であると考えております。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1979年 4月 当社入社
2002年 4月 当社経営企画部長
2002年 6月 大和証券エスエムビーシー(㈱執行役員 エクイティ担当
2004年 5月 当社常務執行役員 経営企画・人事・法務・秘書担当 兼 人事部長
2004年 6月 当社取締役兼常務執行役 企画・人事・法務担当 兼 人事部長
2004年 7月 当社企画・人事・法務担当
2007年 4月 当社企画・人事担当
2007年 4月 当社企画・人事担当
第 ホールセール部門副担当
大和証券エスエムビーシー(㈱専務執行役)

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱取締役会長 ㈱帝国ホテル社外取締役 2009年 4月 当社取締役兼執行役副社長 ホールセール部門副担当大和証券エスエムビーシー㈱代表取締役副社長
2011年 4月 当社取締役兼代表執行役社長 最高経営責任者 (CEO) 兼 リテール部門担当兼 ホールセール部門担当大和証券㈱代表取締役社長大和証券キャピタル・マーケッツ㈱代表取締役社長2013年 4月 当社最高経営責任者 (CEO)
2017年 4月 当社取締役会長兼執行役(現任)

大和証券㈱代表取締役会長 2020年 4月 大和証券㈱取締役会長(現任)



# せいじ 中田 誠司

再任

生年月日	1960年7月16日生
現在の当社における地位、担当	取締役 兼 代表執行役社長 最高経営責任者(CEO)
所有する当社の株式の数	普通株式 193,930株
取締役在任年数(本総会終結時)	<b>5年</b> <sup>(注)</sup>
取締役会等への出席状況	取締役会 10/10回(100%) 指名委員会 3/3回(100%) 報酬委員会 4/4回(100%)
(注) 取締役左任年粉の今卦を記載しております	

(注)取締役仕仕年数の台計を記載しております。

#### ▮取締役候補者とした理由

1983年に当社に入社し、これまで当社の企画副担当及び人事副担当、大和証券㈱の法人本部長、営業本部長、当社 の最高執行責任者(COO)及びリテール部門担当などを歴任し、2017年より当社代表執行役社長 最高経営責任者 (CEO) を務めております。幅広い視野に基づいた経営戦略を示すとともに、当社グループの経営管理を適切に実行 する知識・経験を有していることから、取締役として適任であると考えております。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1983年 4月 当社入社

1999年 4月 大和証券エスビーキャピタル・マーケッ ツ(株)へ転籍

2005年 4月 大和証券エスエムビーシー(株) 商品戦略部長

2006年 4月 同社執行役員 企画担当

2007年 4月 当社執行役 企画副担当 兼 人事副担 当 兼 経営企画部長

2008年10月 当社企画副担当 兼 人事副担当

2009年 4月 当社常務執行役

2009年 6月 当社取締役 兼 常務執行役

2010年 4月 当社取締役

大和証券キャピタル・マーケッツ㈱常務

取締役

2010年 6月 大和証券キャピタル・マーケッツ㈱法人 営業上席担当 兼 事業法人上席担当

兼 法人統括担当

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱代表取締役社長 2011年 4月 同社事業法人上席担当 兼 法人営業担 当 兼 法人統括担当

2012年 4月 大和証券㈱専務取締役 法人本部長

2015年 4月 当社専務執行役 リテール部門副担当

2016年 4月 当社代表執行役副社長

最高執行責任者 (COO) 兼 リテール部 門担当

大和証券㈱代表取締役副社長

2016年 6月 当社取締役兼代表執行役副社長

2017年 4月 当社取締役兼代表執行役社長 (現任)

最高経営責任者(CEO)兼 リテール部 門担当

大和証券㈱代表取締役社長 (現任)

2020年 4月 当社最高経営責任者(CEO)(現任)



# 3 松井 敏浩



生年月日	1962年4月27日生
現在の当社における地位、担当	取締役 兼 代表執行役副社長 最高執行責任者(COO)
所有する当社の株式の数	普通株式 170,100株
取締役在任年数(本総会終結時)	4年
取締役会等への出席状況	取締役会 10/10回(100%)

#### ┃取締役候補者とした理由

1985年に当社に入社し、大和証券エスエムビーシー㈱の事業法人部長、コーポレート・ファイナンス部長、当社の経営企画部長を務め、2009年に当社の執行役に就任して以降は、法務担当及び企画副担当、企画担当、人事担当、ホールセール部門担当等を歴任し、現在は当社の代表執行役副社長 最高執行責任者(COO)を務めております。リテール部門、法人部門、投資銀行部門、企画・人事部門など幅広い分野における豊富な経験・知識を有しており、取締役として適任であると考えております。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1985年 4月 当社入社
1999年 4月 共和証券エスビーキャピタル・マーケッツ(株)へ転籍
2007年 9月 当社へ転籍
2008年10月 当社経営企画部長
2009年 4月 当社執行役 法務担当 兼 企画副担当 兼 経営企画部長
2010年 4月 当社企画副担当 兼 人事副担当
2011年 4月 当社常務執行役 法務担当 兼 企画副担当 兼 人事副担当 大和証券(株)執行役員
大和証券(株)執行役員
大和証券(株)執行役員
大和証券(本)、マーケッツ(株)執行

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱代表取締役副社長

役員

2012年 4月 当社企画担当 兼 法務担当 兼 人事 副担当 大和証券㈱常務執行役員 2014年 4月 当計事務執行役 企画担当 兼 人事担 쏰 大和証券㈱専務取締役 2016年 4月 当社企画担当 兼 ホールセール部門副 担当 2016年 6月 当社取締役兼専務執行役 2018年 4月 当社取締役兼代表執行役副社長 (現任) 最高執行責任者(COO)兼企画担当 兼 ホールセール部門担当 大和証券㈱代表取締役副社長 (現任) 2019年 4月 当社最高執行責任者 (COO) 兼 ホール セール部門担当 2020年 4月 当社最高執行責任者(COO)(現任)



# 候補者番号

## た しろ けい こ 田代 桂子



女性

生年月日	1963年8月5日生
現在の当社における地位、担当	取締役 兼 執行役副社長 海外担当 兼 SDGs担当
所有する当社の株式の数	普通株式 77,900株
取締役在任年数(本総会終結時)	6年
取締役会等への出席状況	取締役会 10/10回(100%)

#### ■取締役候補者とした理由

1986年に当社に入社し、当社IR室長及び大和証券㈱のダイレクト企画部長を歴任し、2009年に大和証券㈱の執行 役員に就任して以降は、ダイレクト担当、金融市場担当、当社の米州担当、海外副担当(米州担当)及び大和証券も ャピタル・マーケッツアメリカホールディングスInc.の会長を歴任し、現在は当社の執行役副社長として海外担当及び SDGs担当を務めております。海外部門及び企画部門における豊富な知識・経験を有しており、取締役として適任であ ると考えております。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1986年 4月 当社入社

1999年 4月 大和証券エスビーキャピタル・マーケッ ツ(株)へ転籍

1999年 7月 当社へ転籍

2005年 9月 大和証券㈱ダイレクト企画部長

2009年 4月 同社執行役員 PTS担当 兼 ダイレク 卜担当

2009年 6月 同社オンライン商品担当 兼 ダイレク 卜担当

2011年 4月 大和証券キャピタル・マーケッツ㈱執行 役員 金融市場担当

2012年 4月 大和証券㈱執行役員 金融市場担当

2013年 4月 当社常務執行役員 米州担当 大和証券キャピタル・マーケッツ アメリカホールディングスInc. 会長 2013年 7月 大和証券キャピタル・マーケッツ アメリカInc. 会長 2014年 4月 当社常務執行役 海外副担当 (米州担 当) 2014年 6月 当社取締役兼常務執行役 2016年 4月 当社取締役兼専務執行役 海外担当 大和証券㈱専務取締役 2019年 4月 当社取締役兼執行役副社長 (現任) 大和証券㈱代表取締役副社長 (現任)

2020年 4月 当社海外担当 兼 SDGs担当 (現任)

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱代表取締役副社長



### 



牛年月日

1966年1月28日生

現在の当社における地位、担当

専務執行役 法務担当 兼 人事管掌

所有する当社の株式の数

普通株式 97,100株

取締役在任年数(本総会終結時)

取締役会等への出席状況

#### ┃取締役候補者とした理由

1989年に当社に入社し、当社秘書室長、経営企画部長、法務部長を務め、2014年に当社の執行役員に就任して以降は、法務担当、企画副担当、海外副担当を歴任し、現在は当社の企画担当、法務担当及び人事管掌を務めております。企画・人事部門の豊富な経験・実績に加えて、投資銀行部門における経験も有しており、取締役として適任であると考えております。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1989年 4月 当社入社

2008年10月 当社秘書室長

2014年 4月 当社執行役員 法務担当 兼 企画副担

大和証券(株)執行役員

2015年 4月 当社法務担当 兼 企画副担当 兼 海 外副担当

2017年 4月 当社常務執行役 法務担当 兼 企画副 担当

----大和証券㈱常務執行役員

企画担当

2019年 4月 当社専務執行役 企画担当 兼 法務担 当 兼 人事管掌 (現任)

大和証券㈱専務取締役(現任)

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱専務取締役 大和アセットマネジメント㈱取締役 ㈱大和ネクスト銀行取締役 ㈱DG Daiwa Ventures代表取締役



候補者番号

花岡幸子

非執行

再任

女性

生年月日 **1967年5月28日生** 

現在の当社における地位、担当

取締役

所有する当社の株式の数

普通株式 31.800株

取締役在任年数(本総会終結時)

1年

取締役会等への出席状況(注)

取締役会 8/8回(100%) 監査委員会 15/15回(100%)

(注)2019年6月の当社取締役就任以降に開催された取締役会等への出席状況を記載しております。

#### ┃取締役候補者とした理由

1990年に当社に入社し、リサーチ部門、プロダクト部門の業務に携わった後、大和証券㈱の商品企画部長、教育研修部長、投資情報部長を歴任しております。リサーチ部門における豊富な経験を通じて、高い分析力や企業会計に関する知識を備えていることに加え、豊富なマネジメント経験を有しており、取締役として適任であると考えております。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1990年 4月 当社入社

1995年 3月 ㈱大和総研へ転籍

1999年10月 大和証券㈱へ転籍

2012年 4月 同社投資情報部長

2019年 4月 当社執行役員

大和証券(株)監査役(現任)

大和証券投資信託委託㈱(現 大和アセットマネジメント㈱)監査役(現任)

㈱大和総研ビジネス・イノベーション監

查役 (現任)

大和リアル・エステート・アセット・マ

ネジメント㈱監査役

2019年 6月 当社取締役 (現任)

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱監査役 大和アセットマネジメント㈱監査役 ㈱大和総研ビジネス・イノベーション監査役



# 7 川島 博政

非執行



生年月日	1968年7月18日生
現在の当社における地位、担当	執行役員
所有する当社の株式の数	普通株式 26,000株
取締役在任年数(本総会終結時)	-
取締役会等への出席状況	

#### ┃取締役候補者とした理由

1992年に当社に入社し、人事部門、投資銀行部門の業務に携わった後、当社の秘書室長、内部監査部長を歴任しております。人事部門、内部監査部門における豊富な経験・知識を有しており、取締役として適任であると考えております。

#### ■略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1992年 4月 当社入社

2006年 4月 大和証券エスエムビーシー(株)へ転籍

2011年 4月 当社へ転籍

2016年 4月 当社内部監査部長

大和証券㈱内部監査部長

2020年 4月 当社執行役員 (現任)

大和証券(株)監査役 (現任)

大和リアル・エステート・アセット・マ ネジメント㈱監査役(現任)

(重要な兼職の状況) 大和証券㈱監査役

大和リアル・エステート・アセット・マネジメント㈱監査役



## 候補者番号 **8**

# 小笠原 倫明



社外 独立

生年月日	1954年1月29日生

現在の当社における地位、担当

社外取締役

所有する当社の株式の数

普通株式 13,300株

取締役在任年数(本総会終結時)

5年 10/10回(100%)

取締役会等への出席状況

取締役会 10/10回(100%) 指名委員会 3/3回(100%) 監査委員会 17/17回(100%)

#### ┃社外取締役候補者とした理由

総務省情報通信国際戦略局長、総務事務次官等を歴任し、その経歴を通じて培われた専門的な知識・経験を当社の経営に活かしていただきたいため、社外取締役として選任をお願いするものであります。同氏は、これまで直接会社経営に関与した経験は有しておりませんが、上記の理由により、社外取締役としての職務を適切に遂行できると判断いたしました。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1976年 4月 郵政省入省

2003年 1月 総務省東北総合通信局長

2004年 1月 総務省関東総合通信局長

2005年 2月 総務省大臣官房審議官

2005年 8月 総務省自治行政局公務員部長

2006年 7月 総務省消防庁国民保護・防災部長

2007年 7月 総務省情報通信政策局長

(重要な兼職の状況)

住友商事㈱顧問

東急不動産ホールディングス㈱社外取締役

2008年 7月 総務省情報通信国際戦略局長

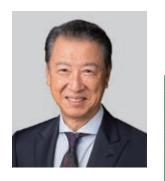
2010年 1月 総務審議官

2012年 9月 総務事務次官

2013年10月 ㈱大和総研顧問

2015年 6月 同社顧問退任

2015年 6月 当社取締役 (現任)



# 竹内 弘高



生年月日	1946年10月16日生
現在の当社における地位、担当	社外取締役
所有する当社の株式の数	普通株式 20,400株
取締役在任年数(本総会終結時)	4年
取締役会等への出席状況	取締役会 10/10回(100%) 指名委員会 3/3回(100%) 報酬委員会 4/4回(100%)

#### ■社外取締役候補者とした理由

一橋大学商学部教授、ハーバード大学経営大学院教授等を歴任し、その経歴を通じて培われた専門的な知識・経験 を当社の経営に活かしていただきたいため、社外取締役として選任をお願いするものであります。同氏は、これまで 直接会社経営に関与した経験は有しておりませんが、上記の理由により、社外取締役としての職務を適切に遂行でき ると判断いたしました。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1976年 9月 ハーバード大学経営大学院講師 1977年12月 ハーバード大学経営大学院助教授

1983年 4月 一橋大学商学部助教授

1987年 4月 一橋大学商学部教授

1998年 4月 一橋大学大学院国際企業戦略研究科 究科長

2010年 4月 一橋大学名誉教授

2010年 7月 ハーバード大学経営大学院教授(現任)

2016年 6月 当社取締役 (現任)

#### (重要な兼職の状況)

ハーバード大学経営大学院教授 インテグラル㈱汁外取締役 ブライトパス・バイオ(株)社外取締役 (株)t-lab取締役

Global Academy(株)会長

GlobalTreehouse㈱共同創業者、取締役会特別顧問

国際基督教大学理事長



# 10 西川 郁生



社外 独立

生年月日	1951年7月1日生
現在の当社における地位、担当	社外取締役
所有する当社の株式の数	普通株式 7,200株
取締役在任年数(本総会終結時)	4年
取締役会等への出席状況	取締役会 10/10回(100%) 監査委員会 17/17回(100%) 報酬委員会 4/4回(100%)

#### ▮社外取締役候補者とした理由

センチュリー監査法人代表社員、企業会計基準委員会委員長等を歴任し、その経歴を通じて培われた専門的な知識・経験を当社の経営に活かしていただきたいため、社外取締役として選任をお願いするものであります。同氏は、これまで直接会社経営に関与した経験は有しておりませんが、上記の理由により、社外取締役としての職務を適切に遂行できると判断いたしました。

#### ■略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1990年 9月 センチュリー監査法人(現 EY新日本有限責任監査法人)代表社員

1993年 1月 国際会計基準委員会JICPA代表 1995年 7月 日本公認会計士協会常務理事

2001年 8月 企業会計基準委員会副委員長

#### (重要な兼職の状況)

雪印メグミルク㈱社外取締役 慶應義塾大学大学院商学研究科客員教授 東京海 F日動火災保険㈱社外監査役 2007年 4月 企業会計基準委員会委員長

2012年 4月 慶應義塾大学商学部教授

2016年 6月 当社取締役 (現任)

2017年 4月 慶應義塾大学大学院商学研究科 客員教授 (現任)



# 11 河合 江理子



女性

社外 独立

生年月日1958年4月28日生現在の当社における地位、担当社外取締役所有する当社の株式の数普通株式 3,100株

取締役在任年数(本総会終結時)

2年 10/10回(100%)

取締役会等への出席状況

取締役会 10/10回(100%) 指名委員会 3/3回(100%) 監査委員会 17/17回(100%)

#### ▮社外取締役候補者とした理由

BIS (国際決済銀行) とOECD (経済協力開発機構) で年金基金運用統括官等を歴任し、国際的な企業や国際機関における豊富な経験に加え、経営者としての経験と実績を有しており、その経歴を通じて培われた経営に関する豊かな知識・見識を当社の経営に活かしていただきたいため、社外取締役として選任をお願いするものであります。

#### ■略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1981年10月 ㈱野村総合研究所入社

1985年 9月 McKinsey & Company経営コンサルタ ント

1986年10月 Mercury Asset Management,

SG Warburgファンドマネージャー

1995年11月 Yamaichi Regent ABC Polska 投資担当取締役執行役員 (CIO)

1998年 7月 BIS (国際決済銀行) 年金基金運用統括官

2004年10月 OECD (経済協力開発機構)

年金基金運用統括官

2008年 3月 Kawai Global Intelligence代表

2012年 4月 京都大学高等教育研究開発推進機構教授

2013年 4月 京都大学国際高等教育院教授

2014年 4月 京都大学大学院総合生存学館教授(現任)

2018年 6月 当社取締役 (現任)

#### (重要な兼職の状況)

京都大学大学院総合生存学館教授 一般財団法人未来を創る財団理事 公益財団法人グルー・バンクロフト基金理事 シミックホールディングス(株社外取締役



# 12 西川 克行



社外 独立

生年月日	1954年2月20日生
現在の当社における地位、担当	社外取締役
所有する当社の株式の数 取締役在任年数(本総会終結時)	普通株式 0株 1年
取締役会等への出席状況 <sup>(注)</sup>	取締役会 8/8回(100%) 指名委員会 3/3回(100%) 監査委員会 15/15回(100%)
(注)2019年6月の当社取締役就任以降に開催された取締役	・ 安会等への出席状況を記載しております。

#### ▮社外取締役候補者とした理由

法務事務次官、東京高等検察庁検事長、検事総長等を歴任し、現在は弁護士でありますが、その経歴を通じて培われた法律やコンプライアンスに関する豊かな経験・専門的な知識を当社の経営に活かしていただきたいため、社外取締役として選任をお願いするものであります。同氏は、これまで直接会社経営に関与した経験は有しておりませんが、上記の理由により、社外取締役としての職務を適切に遂行できると判断いたしました。

#### ▮略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1979年 4月 大阪地方検察庁検事任官

2008年 1月 法務省保護局長

2008年 7月 法務省入国管理局長

2009年 7月 法務省刑事局長

2011年 8月 法務事務次官

2014年 1月 札幌高等検察庁検事長

2015年12月 東京高等検察庁検事長

2016年 9月 検事総長

2018年 7月 検事総長退官

2018年 9月 弁護士 (現任)

2019年 6月 当社取締役 (現任)

(重要な兼職の状況)

西川克行法律事務所弁護士イオン北海道㈱社外監査役



# 13 岩本 敏男



社外 独立

生年月日	1953年1月5	日生
現在の当社における地位、担当		-
所有する当社の株式の数	普通株式	0株

取締役在任年数(本総会終結時)

取締役会等への出席状況

#### ▮社外取締役候補者とした理由

㈱エヌ・ティ・ティ・データ社長等を歴任し、現在は㈱エヌ・ティ・ティ・データ相談役でありますが、その経歴を通じて培われたグローバル企業の経営に関する豊かな経験及びITに関する豊富な知見を当社の経営に活かしていただきたいため、社外取締役として選任をお願いするものであります。

#### ■略歴、地位、担当及び重要な兼職の状況

1976年 4月 日本電信電話公社入社 2004年 6月 ㈱エヌ・ティ・ディタ取締役

2005年 6月 同社執行役員

(重要な兼職の状況) ㈱エヌ・ティ・ティ・データ相談役 日本精工㈱社外取締役 ㈱川社外監査役 2007年 6月 同社取締役常務執行役員

2009年 6月 同社代表取締役副社長執行役員

2012年 6月 同社代表取締役社長 2018年 6月 同社相談役 (現任)

- (注) 1. 社外取締役候補者の独立性については、次のとおりであります。
  - ・社外取締役候補者は、過去に当社の社外取締役となる以外の方法で当社又は当社の子会社の業務執行者又は役員であったことはありません。
  - ・社外取締役候補者は、当社の特定関係事業者の業務執行者又は役員ではなく、また、過去5年間に当社の特定関係事業者の業務執行者又は役員であったことはありません。
  - ・社外取締役候補者は、いずれも過去に当社又は当社の特定関係事業者から多額の金銭その他の財産を受けたことはなく、 今後も受ける予定はありません。
  - ・社外取締役候補者は、いずれも当社又は当社の特定関係事業者の業務執行者又は役員の配偶者・三親等以内の親族その他これに準ずる者ではありません。
  - ・社外取締役候補者は、いずれも東京証券取引所及び名古屋証券取引所が定める独立役員の要件を満たしており、当社は、 社外取締役候補者全員を独立役員として指定し届け出る予定であります。
  - 2. 現任の社外取締役である小笠原 倫明氏、竹内 弘高氏、西川 郁生氏、河合 江理子氏及び西川 克行氏の5名は、金1,000 万円と会社法第425条第1項で定める最低責任限度額とのいずれか高い額を限度とする責任限定契約を締結しており、各 氏の再任が承認された場合は、各氏との間で当該契約を継続する予定であります。また、岩本 敏男氏の選任が承認された場合は、同氏との間でも同様の責任限定契約を締結する予定であります。

#### (ご参考)

本総会終了後の取締役会及び各委員会における決議を経て、指名委員会、監査委員会及び報酬委員会の各委員及び委員長を以下のとおり選定する予定であります。各委員会は以下のとおりいずれも社外取締役が過半数を占める構成とする予定であります。

氏名	地位及び役位	指名委員会	監査委員会	報酬委員会
日比野 隆 司	取締役会長 兼 執行役	0		0
中田誠司	取締役 兼 代表執行役社長	0		0
花 岡 幸 子	取締役		0	
川島博政	取締役		0	
小笠原 倫 明	取締役(社外)・独立役員	0	0	
竹 内 弘 高	取締役(社外)・独立役員	0		0
西川郁生	取締役(社外)・独立役員		0	0
河 合 江理子	取締役(社外)・独立役員	0	0	
西 川 克 行	取締役(社外)・独立役員	0	0	
岩本敏男	取締役(社外)・独立役員	0		0

(注) ◎は委員長、○は委員を示しています。

以上

#### 【第83回定時株主総会招集ご通知添付書類】

## 事業報告 (2019年4月1日から2020年3月31日まで)

#### I. 当社グループの事業活動の状況

当社グループ(注)は、グループの企業価値の向上を目指し、証券業を中核とした事業活動を行っております。当社グループの当期(2019年度)の事業の概況は以下のとおりであります。

(注) 本事業報告において、「当社グループ」とは、当社及びその関係会社から成る企業集団を指します。

#### 1. 経済・市場環境

当期のわが国の経済は、2019年5月の貿易などを巡る米中協議の決裂、それを受けた両国による追加関 税の再度の引き上げによって世界貿易の停滞色が強まるなど外部環境が悪化する中、輸出の減少、能力増 強を目的とした設備投資の先送りなどの動きがみられました。一方、高水準の企業収益や超低金利、労働 需給の逼迫などを背景に、合理化・省人化投資や研究開発投資などの増勢は維持されました。2019年10 月には消費税率が10%に引き上げられました。住宅や耐久財などにおいては政府の需要平準化策が一定 の効果を発揮したものの、駆け込み需要の反動に大型台風による甚大な被害、さらに暖冬の影響などが重 なり、2019年10-12月期の実質GDP成長率は前期比年率換算△7.1%と大幅なマイナスを記録しました。 また当期のわが国経済の一つの特徴は、米中貿易摩擦などの影響を受けやすい製造業の収益環境が悪化す る一方で、非製造業の業況は高水準が維持されたことです。その結果、10-12月期の大幅マイナス成長な どを経験しながらも雇用・所得環境は緩やかな改善を続けました。2020年1月には米中両国政府が貿易交 渉で「第一段階の合意」に署名したことを受け、製造業を含めた世界経済が回復に転じ、その恩恵を日本 も受けるという期待が高まる局面もありました。しかしながら、新型コロナウイルスの発生と感染拡大に よって状況は一変しました。新型コロナウイルスの感染は欧米諸国をはじめとして世界各国に広く拡大し、 3月にはWHO(世界保健機関)が世界的な大流行を意味する「パンデミック」を表明しました。日米欧な どでは強力な財政・金融政策が実施され、企業の資金繰りや雇用の維持を支援しているものの、不要不急 の外出や飲食店等の営業の自粛・制限などの感染拡大抑止策の経済への悪影響は極めて大きく、日本及び 世界経済の大幅な落ち込みは不可避の情勢となっています。

株式市場においては、貿易をはじめとした米中間の対立、新型コロナウイルスの感染拡大などの外部環境に左右される展開となりました。日経平均株価は2019年4月から8月にかけて21,000円前後で推移しましたが、その後は米中両国政府が再交渉を開始したことや米国の金融緩和を受けて上昇基調が強まり、12月には約1年2カ月ぶりに24,000円台を一時回復しました。しかし、新型コロナウイルスによる日本及び世界経済の悪化懸念が強まった2020年2月末以降は記録的な下落となり、3月半ばには一時、2016年以来の16,000円台まで急落しました。その後は追加の金融緩和や大型経済対策への期待から株価がやや持ち直した結果、当期末の日経平均株価は18,917円01銭となりました。前期末比では△10.8%の大幅下落となりました。

債券市場においては、極めて緩和的な金融環境や世界経済の減速懸念を受けて、当期中の10年国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。当期末の10年国債利回りは0.005%となりました。

#### 2. 連結業績の概況

#### (1) 当社グループの損益の状況





	純営業収益			経常利益		
	前期(第82期)	当期 (第83期)	対前期増減率	前期(第82期)	当期(第83期)	対前期増減率
リテール部門	185,865	166,430	△10.5%	24,674	6,405	△74.0%
ホールセール部門	158,903	172,289	8.4%	25,400	38,034	49.7%
アセット・マネジメント部門	48,232	48,091	△0.3%	28,359	26,580	△6.3%
投資部門	1,766	2,502	41.7%	△1,093	△877	_
その他・調整等	46,473	36,943	_	5,817	140	_
連結 計	441,240	426,259	△3.4%	83,159	70,283	△15.5%
その他・調整等	46,473	36,943		5,817	140	_ _ _ △15.5%

#### (2) 当社グループの資産・負債・純資産の状況

総資産	23兆8,220億円 前期末比2兆6,953億円増	負債	22兆 5,643億円 前期末比2兆6,940億円増
純資産	1 兆 2,577 億円	1 株当たり	796 <sub>円</sub> 33銭
	前期末比13億円増	純資産	前期末比1円79銭増

#### 3. 当社グループの事業活動の成果(各セグメントの実績)

## リテール部門

【主な商品・サービス】

株式、債券、投資信託、ラップ口座サービス、保険、預金、ローン、 相続関連サービスなど

大和証券株式会社では、「クオリティNo.1」の実現に向け、「商品・サービスのクオリティ向上」、「お客様担当の最適化」、「お客様との接点拡大」に注力した営業推進体制改革により、お客様からの信頼の飛躍的向上を目指しています。

当期は、「お客様の最善の利益を追求」する企業文化の醸成と営業スタイルの確立を目指すため、大和版NPS®(注1)の行動指針を策定し、お客様満足度向上のため営業推進体制の刷新や評価制度の見直しなどに取り組みました。その結果、外部のNPS調査(注2)において、対面証券部門で第一位を獲得しました。

お客様のあらゆるニーズに応える魅力的な商品・サービスの提供に努めており、2019年11月には、最先端のシステム運用と24時間モニタリングにより、収益機会の追求とリスク管理を徹底する「マンAHLスマート・レバレッジ戦略ファンド」の取扱いを開始し、残高1,000億円を突破し順調に拡大しています。

また、あらゆる世代のお客様ごとにきめ細やかな対応ができるよう、相続関連業務を専門とし、お客様の個別のニーズに対応する「相続コンサルタント」及び主にシニア層のお客様を担当し、資産運用に留まらず幅広くシニアライフをサポートする「あんしんプランナー」を全店配置し、相続・贈与に関するコンサルティングを強化しています。「ダイワファンドラッププレミアム」の付帯サービスである「相続時受取人指定サービス」、「暦年贈与サービス」は、お客様の"資産をのこしたい"というニーズに訴求し、ラップ口座サービスの契約残高の拡大に寄与しています。

さらに、お客様との更なる接点拡充を目指し、低コスト・小規模な営業所を増やし、当期末に国内店舗の合計は54営業所を含め、168店舗となりました。



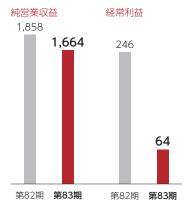
純営業収益構成比 **39.0**%



純営業 収益

1,664億円 前期比10.5%減

経常 利益 **64億円** 前期比74.0%減

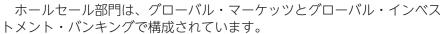


- (注1) NPS®: Net Promoter Scoreの略であり、お客様のロイヤルティを数値化する指標。なお、NPS®は、ベイン・アンド・カンパニー、フレッド・ライクヘルド、サトメトリックス・システムズの登録商標です。
- (注2) NTTコム オンライン・マーケティング・ソリューション株式会社が2019年10月に公表した利用者を対象に実施した業界別のNPSベンチマーク調査結果です。

### ホールセール部門

【主な商品・サービス】

**グローバル・マーケッツ**:株式、債券・為替、デリバティブ **グローバル・インベストメント・バンキング**:株式の引受け、 債券の引受け、M&Aアドバイザリー、上場コンサルティングなど



グローバル・マーケッツでは、主に機関投資家や事業法人を対象とした 株式、債券・為替及びそれらの金融派生商品のセールス及びトレーディン グ、並びにリテール部門への商品供給、販売サポートを行っています。

当期は、変動の激しい経済・市場環境の中、リテール部門とホールセール部門との連携によるタイムリーな商品提供や、市場環境の変化に対応した機動的なトレーディングが、収益に貢献しました。

グローバル・インベストメント・バンキングでは、有価証券の引受業務及びM&Aアドバイザリー業務などを行っています。

引受業務では、freee株式会社のグローバルIPO(注1)においてジョイント・グローバル・コーディネーターを務めたほか、上場市場変更に伴う株式の公募売出しの主幹事を複数務めました。また、債券においては事業会社による初めての個人向けサステナビリティボンド(注2)となった株式会社商船三井社債等のSDGs債(注3)を含む普通社債及び劣後債で主幹事を複数務めました。

M&Aアドバイザリー業務では、京セラ株式会社による米国上場子会社 AVX Corporationの完全子会社化など、当社グループ各社の連携により 多くのM&A案件に関与しました。

また、日本、アジア、欧州及び米州の各拠点の連携促進のため、2019年4月より、当社グループのM&Aアドバイザリー業務のブランド名を「DC Advisory」に統一しました。さらに、2019年9月に、イタリアのミラノ市に、欧州7拠点目となる、Daiwa Corporate Advisory S.r.lを設立し、同10月には、風力及び太陽光等の再生可能エネルギー分野に強みを持つ、オランダのフィナンシャル・アドバイザリー事業を行うGreen Giraffe Advisory B.V.へ50%出資するなど、グローバルで質の高いM&Aアドバイザリー業務を提供すべく体制強化を行いました。



純営業収益構成比 **40.4**%



純営業 収益

1,722億円 前期比8.4%増

経常 利益 380億円 前期比49.7%増

経常利益



1,722 380 1,589 254 254 第82期 第83期 第82期 第83期

- (注1) IPO (Initial Public Offering) :新規株式公開を実施するときに株式の公募・売出しを行うこと。
- (注2) サステナビリティボンド:企業や地方自治体等が、国内外のグリーンプロジェクト及びソーシャルプロジェクト双方に要する資金を調達するために発行する債券。
- (注3) SDGs債:日本証券業協会が提唱する、調達資金がSDGsに貢献する事業に充当されるソーシャルボンド、グリーンボンド、サステナビリティボンドなどを含む債券の総称。

## アセット・マネジメント部門

#### 【主な商品・サービス】

各種投資信託商品(組成・運用)、投資顧問、お客様・販売会社支援、 不動産投資信託(組成・運用)など

大和証券投資信託委託株式会社 (注1) は、幅広い販売チャネルを通じた商品の提供や運用力の強化により、運用資産額の拡大に取り組みました。

2019年11月に設定した「マンAHLスマート・レバレッジ・ファンド」の販売が好調で1,139億円の資金増加となりました。また、上場投資信託への資金流入を主因として、公募株式投資信託全体で当期の資金増加額は7,297億円、当期末の純資産残高は13兆4,783億円となりました。

当社と大和証券投資信託委託株式会社は、Global X Management Company Inc.とアセット・マネジメント分野において協業し、テーマ型・スマートベータ(注2)を中心とした先進的なETFの提供などを目的として、2019年9月に合弁会社Global X Japan 株式会社を設立しました。

不動産アセット・マネジメント分野では、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社において、物流施設特化型REITである大和証券ロジスティクス・プライベート投資法人の運用を開始しました。また、2019年9月に、住宅特化型上場REITであるサムティ・レジデンシャル投資法人の投資口を追加取得し、同投資法人を連結子会社としました。更に、新規物件の取得や資産の入替によるポートフォリオ利回りの向上、既存物件の価値向上に努め、当期末の運用資産規模は1兆693億円となりました。なお、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社運用の日本賃貸住宅投資法人及び日本ヘルスケア投資法人は、2020年4月1日付で合併し、大和証券リビング投資法人となりました。合併と同時に一部保有物件の売却、第三者割当増資及びそれに伴う物件取得を行い、資産の入替及び運用資産規模拡大を実現しました。



純営業収益構成比 11.3%



純営業 収益

480億円 前期比0.3%減

経常 利益 265億円 前期比6.3%減

純党業収益

経常利益



(注1) 大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日に大和アセットマネジメント株式会社に商号を変更いたしました。

(注2) 「デーマ型」の投資とは、特定の株価指標や、環境、企業責任など絞り込まれたデーマに沿って投資を行うことを指し、「スマートベータ」とは、財務指標や配当などの要素に着目して定量的に銘柄選定をすることで、市場全体や業種別の平均よりも高いリターンを目指す指数をいいます。

## 投資部門

#### 【主な商品・サービス】

ベンチャー投資、プライベート・エクイティ投資、 金銭債権投資、エネルギー・

インフラストラクチャー投資など



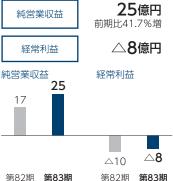
純営業収益構成比 **0.6**%

大和企業投資株式会社は、国内外の様々なステージのベンチャー企業への投資を実行するとともに、投資先の上場などを通じた既存投資案件の回収を進めました。

大和PIパートナーズ株式会社は、国内外で不動産ローンや企業向け投融 資を実行しました。また、不良債権投資や企業投資などの既存投資案件の 回収を進めました。

さらに、大和企業投資株式会社と大和PIパートナーズ株式会社は、2019年7月に、主としてミャンマーで事業を行う未上場企業に対して投資するファンドである「DAIWA Myanmar Growth Fund」を共同で組成しました。

大和エナジー・インフラ株式会社は、太陽光発電などの再生可能エネルギー事業や海外配電などのインフラ事業に対する投資を実行しました。また、2019年12月に、再生可能エネルギー事業を開発・運用するドイツのAquila Capital Holding GmbHと戦略的提携を行うことを決定しました。



## その他(注)

#### 【主な商品・サービス】

経済・社会に関する調査・研究、

コンサルティング、システムインテグレーションなど

(注) 連結会計上の調整等を含みます。

純営業収益構成比 **8.7**%

株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションは、 同志社大学や立教大学との産学連携による共同研究や、AIを活用したお客 様ごとの金融商品に対するニーズを予測するサービスの地域金融機関への 提供など、先端技術の調査・研究及び活用に積極的に取り組みました。

株式会社大和ネクスト銀行は、全国の大和証券株式会社の店舗網を通じて、魅力ある好金利の円預金や外貨預金、利便性の高いサービスを幅広いお客様に提供しています。2019年12月に外貨預金残高は5,000億円を突破し、2020年2月には応援定期預金の累計預入額は1,000億円を突破いたしました。

2019年8月に、高齢者向け施設・住宅の運営会社であるグッドタイムリビング株式会社を子会社化しました。同社は、大和証券株式会社のお客様やそのご家族に対して同社の施設・住宅を提供するなど、大和証券グループのシニア層向けサービスの拡充に貢献しています。



#### 4. 当社グループの設備投資の状況

当社グループでは、お客様本位の営業体制の構築やお客様ニーズを捉えた商品・サービスの提供、付加価値の高い業務に従事するための既存業務の効率化とビジネス革新・業務プロセス改革を目指すデジタル・トランスフォーメーション(注)の推進、事業継続に不可欠なインフラ基盤の整備や法制度への対応、リスク管理態勢の強化などを目的とする設備投資を行っております。

当期は、場所を問わず効率的な働き方を可能とするため、テレワークを前提とした業務端末やコミュニケーションツールの導入などを行い、お客様へのコンタクト頻度を高めるなど社員がお客様満足度の向上により一層取り組むことのできる環境を整備しました。また、口座開設をはじめとする各種事務手続きのペーパーレス化・自動化など業務プロセスの効率化、お客様が目的に応じ積立条件を設定・管理できる「つみたてサービス」の新設などお客様サービスの向上、サイバー攻撃やマネー・ローンダリングへの対策強化などのリスク管理高度化に取り組みました。これらの取り組みなどにより、総額約414億円のIT関連投資を行いました。

また、大和証券株式会社は、金沢文庫営業所、宝塚営業所、熊谷営業所、四日市営業所、大垣営業所、八千代緑が丘営業所、春日原営業所、福知山営業所、千里中央営業所、藤枝営業所、塚口営業所を新たに開設しました。

(注) デジタル・トランスフォーメーション:企業がビジネス環境の激しい変化に対応し、データとデジタル技術を活用して、顧客や社会のニーズを基に、製品やサービス、ビジネスモデルを変革するとともに、業務そのものや、組織、プロセス、企業文化・風土を変革し、競争上の優位性を確立すること。

#### 5. 当社グループの資金調達の状況

当社は、以下のとおり総額で1,500億円の社債を発行しました。当社として初めてとなる任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約付及び劣後特約付)による資金調達となります。

社債	金額	払込日
第1回任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約付及び劣後特約付)	1,250億円	2020年3月16日
第2回任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約付及び劣後特約付)	250億円	2020年3月16日

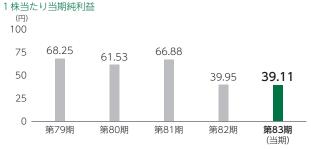
#### 6. 過去5年間の連結業績及び連結財産の状況の推移

期別	第79期	第80期	第81期	第82期	第83期(当期)
項目	(自 2015年4月 1 日 至 2016年3月31日)	(自 2016年4月 1 日 至 2017年3月31日)	(自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月 1 日 至 2019年3月31日)	(自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日)
営業収益	6,537億円	6,164億円	7,126億円	7,205億円	6,722億円
純営業収益	5,148億円	4,727億円	5,053億円	4,412億円	4,262億円
経常利益	1,651億円	1,356億円	1,556億円	831億円	702億円
親会社株主に帰属する当期純利益	1,168億円	1,040億円	1,105億円	638億円	603億円
純資産	1兆3,130億円	1兆3,434億円	1兆3,705億円	1兆2,564億円	1兆2,577億円
総資産	20兆4,208億円	19兆8,272億円	21兆1,350億円	21兆1,267億円	23兆8,220億円
1株当たり純資産額	720.86円	745.80円	786.56円	794.54円	796.33円
1株当たり当期純利益	68.25円	61.53円	66.88円	39.95円	39.11円
自己資本利益率(ROE)	9.5%	8.4%	8.8%	5.1%	4.9%
連結子会社数	50社	52社	59社	60社	66社
持分法適用関連会社数	10社	11社	10社	10社	15社

(注)「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を第82期の期首から適用しており、第81期に係る総資産については、当該会計基準を遡って適用した後の数値となっております。









#### 7. 当社グループの対処すべき課題

「令和」の新時代の幕開けとなった2019年度は、証券市場においては激動の1年となりました。米中貿易協議の第一段階合意やBrexitの不透明感が後退したこと等に伴い、株式市場も一時、バブル崩壊後の戻り高値に迫る回復を見せましたが、年明け以降は新型コロナウイルスの世界的な感染急拡大が、世界経済と国際金融市場を激しく揺さぶり、混乱の中で株式市場も大幅な調整を余儀なくされました。

世界がこれまで経験したことのないような危機に直面する中、多くのお客様は先行きへの不安を抱えています。この様な時こそ、117年もの長きに亘りマーケットと真摯に向き合ってきた当社グループが、これまで培ってきた経験とノウハウを最大限に活かす局面となっています。

資産運用や資金調達に係るお客様の不安に真正面から向き合い、まずはその対応に最善を尽くします。 その上で危機の先を見据え、お客様の中長期的なライフプランの設計、企業の持続的成長の実現に向けて、 徹底したコンサルティング提案に務めます。またハイブリッド戦略により、お客様に対して新たな価値を 提供することで、グループ収益の多様化と安定化を図り、持続的な成長を目指してまいります。

今般の危機対応を契機として、世界的に働き方改革やデジタル化の進展が加速しており、産業構造のみならず社会全体が変貌を遂げようとしています。歴史的転換点に立つ今こそ、大和証券グループは「未来を創る、金融・資本市場のパイオニア」として、新たな価値を提供すると共に、SDGs達成に向けた共通価値創造を通じ、サステナブルで豊かな社会の実現に貢献してまいります。

#### 各事業部門のアクションプラン

#### リテール部門

- 1 プリンシプルベースの営業体制の構築
- 2 お客様のあらゆるニーズに応える魅力的な商品・サービスの開発、ソリューション提案の高度化
- 3 外部チャネル・外部リソースを活用したビジネス展開
- 4 収益構造の転換、コスト構造の見直し

#### アセット・マネジメント部門

- 1 既存ファンドのプロモーション強化、新ファンドの戦略的投入によるヒット商品の育成
- 2 販売会社拡大等を通じた資金純増の実現
- 3 戦略別運用チーム体制への移行、運用解析チームの新設等による運用力の強化
- 4 不動産を中心としたオルタナティブ投資商品の拡大

#### その他 (大和総研グループ)

- 1 ハイブリッド型総合証券グループのシンクタンクとして、グループ連携によるビジネス強化へ貢献
- 2 デジタル化により加速する社会の変化に対応した経済・金融における先見性の高い情報発信
- 3 お客様ビジネスの競争力強化へ貢献するソリューションの提供
- 4 先端技術の活用による「新たな価値」の創出を通じた ビジネスの拡大

#### ホールセール部門

- 1 企業の高付加価値化を促進
- 2 お客様ニーズを捉えたプロダクト・サービスの提供
- 3 事業構造や日本の産業構造転換を支援
- **4** アジアのリージョナル・ブローカーとしての汎アジア ビジネスサポート

#### 投資部門

- 1 新規産業の発掘・育成によるファンド・エコシステム への貢献
- 2 アジアへの投資拡大
- 3 社会的意義のある投資対象の開拓
- 4 運用力の更なる進化による投資リターンの追求

### その他(大和ネクスト銀行)

- 1 証銀連携によるお客様本位の商品・サービス展開
- 2 グループ全体の将来的な収益基盤構築に向けた仕組み作り
- 3 市場環境の変化に即応可能なポートフォリオ運営
- 4 健全な利益の確保を通じた持続的成長

#### 8. 当社グループの状況

#### (1) 当社グループの主要な事業内容

当社グループの主たる事業は有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業であり、具体的な事業として有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び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その他の有価証券関連業並びに銀行業その他の金融業等を営んでおります。

#### (2) 重要な子会社及び関連会社の状況

会社名	所在地	資本金	議決権比率 (うち直接所有)	主要な事業内容
大和証券株式会社	東京都千代田区	100,000百万円	100.0% (100.0%)	有価証券関連業 投資助言・代理業
大和証券投資信託委託株式会社	東京都千代田区	15,174百万円	100.0% (100.0%)	投資運用業 投資助言・代理業
株式会社大和総研ホールディングス	東京都江東区	3,898百万円	100.0% (100.0%)	子会社の統合・管理
株式会社大和証券ビジネスセンター	東京都江東区	100百万円	100.0% (100.0%)	事務代行業
大和プロパティ株式会社	東京都中央区	100百万円	100.0% ( 100.0%)	不動産賃貸業
株式会社大和ネクスト銀行	東京都千代田区	50,000百万円	100.0% (100.0%)	銀行業
株式会社大和総研	東京都江東区	1,000百万円	100.0% (-)	情報サービス業
株式会社大和総研 ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000百万円	100.0% (-)	情報サービス業
大和企業投資株式会社	東京都千代田区	100百万円	100.0% (-)	投資業
大和PIパートナーズ株式会社	東京都千代田区	12,000百万円	100.0% (-)	投資業
大和エナジー・インフラ株式会社	東京都千代田区	500百万円	100.0% (-)	投資業
大和リアル・エステート・ アセット・マネジメント株式会社	東京都中央区	200百万円	100.0% (100.0%)	投資運用業 投資助言・代理業

会社名	所在地	資本金	議決権比率 (うち直接所有)	主要な事業内容
大和証券オフィス投資法人 (注)	東京都中央区	247,876百万円	38.9% ( 12.7%)	特定資産に対する投資運用
サムティ・レジデンシャル投資法人	東京都千代田区	54,250百万円	40.15% (38.3%)	特定資産に対する投資運用
大和証券キャピタル・マーケッツ	イギリス	732百万	100.0%	有価証券関連業
ヨーロッパリミテッド	ロンドン市	スターリングポンド	(-)	
大和証券キャピタル・マーケッツ	中国	100百万香港ドル	100.0%	有価証券関連業
香港リミテッド	香港特別行政区	及び276百万米ドル	(-)	
大和証券キャピタル・マーケッツ	シンガポール	140百万	100.0%	有価証券関連業
シンガポールリミテッド	シンガポール市	シンガポールドル	(-)	
大和証券キャピタル・マーケッツ	アメリカ	621百万	100.0%	子会社の統合・管理
アメリカホールディングスInc.	ニューヨーク市	米ドル	(-)	
大和証券キャピタル・マーケッツ	アメリカ	100百万	100.0%	有価証券関連業
アメリカInc.	ニューヨーク市	米ドル	(-)	

<sup>(</sup>注)大札証券オフィス投資法人は、関連会社であります。

#### (3) 当期末における特定完全子会社の状況

特定完全子会社の名称	特定完全子会社の住所	当期末における特定完全子会社の 株式の帳簿価額
大和証券株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	635,569百万円

<sup>(</sup>注) 当期末における当社の総資産額は、2,559,957百万円であります。

#### (4) 当社グループの企業結合等の状況

特にございません。

#### (5) 重要な業務提携の状況

特にございません。

#### (6) 当社グループの主要な拠点の状況

- ① 当社の本社 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
- ② 主要な子会社の営業拠点等の状況 大和証券株式会社

北海道・東北地区	札幌支店・仙台支店ほか8店
関東地区	横浜支店・横浜駅西口支店・
(東京除く)	千葉支店・大宮支店ほか37店
東京地区	本店・銀座支店・新宿支店・
果尔地区	渋谷支店・池袋支店ほか33店
中部・北陸地区	名古屋支店・静岡支店ほか25店
<b>近畿地区</b>	京都支店・大阪支店・梅田支店・
<u> </u>	難波支店・神戸支店ほか22店
中国・四国地区	広島支店ほか12店
九州・沖縄地区	福岡支店ほか11店

#### (7) 従業員の状況

① 当社グループの従業員の状況

従業員数	前期末比増減
15,320名	124名増

- (注1) 従業員数は就業人員数であります。
- (注2) 臨時従業員数(年間の平均人員)は635名です。
- ② 当社の従業員の状況

従業員数	平均年齢	平均勤続年数
5名〔596名〕	〔42.2歳〕	〔15.3年〕

- (注1) 従業員数は就業人員数であり、大和証券株式会社との兼 務者数は〔1) 内に外数で記載しております。
- (注2) 平均年齢、平均勤続年数は大和証券株式会社との兼務者 を含めた数値を記載しております。
- (注3) 平均勤続年数は当社グループでの勤続年数を通算して おります。

#### (8) 主要な借入先の状況

借入先	借入金の種類	借入金残高
株式会社三井住友銀行	短期借入金	121,766百万円
	長期借入金	150,000百万円
株式会社みずほ銀行	短期借入金	73,166百万円
	長期借入金	82,000百万円
株式会社三菱UFJ銀行	短期借入金	9,359百万円
	長期借入金	71,883百万円
株式会社りそな銀行	長期借入金	33,000百万円
株式会社山口銀行	長期借入金	21,928百万円

(注) 当社グループ外からの借入のうち、コールマネー等を除く主要なものを記載しております。

# (9) その他当社グループの現況に関する重要な事項特にございません。

(注)本事業報告は、「会社法」(平成17年法律第86号)、「会社法施行規則」(平成18年法務省令第12号)及び「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)の規定に基づき記載しております。なお、当社グループの状況に関する事項を記載することが可能な部分については、当社単独の状況の記載に代えて、当社グループの状況を記載しております。

### Ⅱ. 会社の概況(2020年3月31日現在)

#### 1. 株式の状況

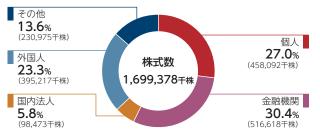
#### (1) 発行可能株式総数

4,000,000,000株

各種類の株式の発行可能種類株式総数は次のと おりです。

種類	発行可能種類株式総数
普通株式	4,000,000,000株
第1種優先株式	100,000,000株
第2種優先株式	100,000,000株
第3種優先株式	100,000,000株

**(2) 発行済株式の総数** 普通株式 1,699,378,772株 (自己株式を含む)



(注) 「その他」には、政府・地方公共団体、証券会社、自己名 義株式が含まれます。

#### (3) 株主数

151.537名

#### (4) 大株主 (上位10名)

株主名	持株数 (持株比率)
日本マスタートラスト信託銀行株式会社(信託口)	117,262千株 (7.71%)
日本トラスティ・サービス信託銀行株式 会社(信託口)	70,107千株 (4.61%)
太陽生命保険株式会社	37,980千株 (2.49%)
日本トラスティ・サービス信託銀行株式 会社(信託口5)	32,208千株 (2.11%)
日本生命保険相互会社	31,164千株 (2.05%)
日本郵政株式会社	30,000千株 (1.97%)
JP MORGAN CHASE BANK 385151	29,923千株 (1.96%)
日本トラスティ・サービス信託銀行株式 会社 (信託口9)	24,842千株 (1.63%)
日本トラスティ・サービス信託銀行株式 会社(信託口7)	24,347千株 (1.60%)
STATE STREET BANK WEST CLIENT – TREATY 505234	23,044千株 (1.51%)

- (注1) 当社は、2020年3月31日現在、自己株式179,906,470 株を保有しておりますが、上記大株主から除外しております。
- (注2) 持株比率は自己株式を控除して計算しております。

#### 2. 大和証券グループのコーポレート・ガバナンス

### 【コーポレート・ガバナンスに関する基本的な考え方

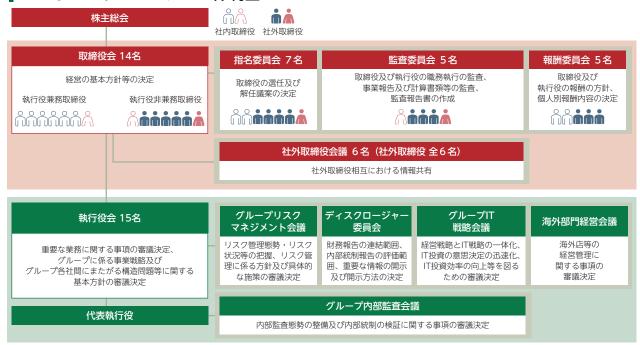
持株会社体制によるグループ経営を実践する当社グループは、国際的な水準に適う透明性・客観性の高いガバナンス態勢を目指しています。さらに、効率性・専門性の高いグループ会社監督機能を実現し、グループ各社間のシナジーを発揮する一体感のあるグループ経営体制を構築していきます。

当社は、下記3つの取り組みにより経営監視機能を発揮することを目的として、指名委員会等設置会社 形態を採用しています。

#### 【コーポレート・ガバナンスに対する3つの取り組み】

- A 取締役会から執行役への大幅な権限委譲及び執行役の業務分掌の明確化により意思決定の機動性を向上させること
- B 社外取締役が過半数を占め、かつ、委員長を務める指名委員会・監査委員会・報酬委員会の三委員会を設置することにより経営の透明性の向上を図るとともに、専門性の高い社外取締役を招聘することで取締役会の監督機能をより効果的なものとすること
- C 高い独立性と倫理観を備えた社外取締役が、各自の見識及び経験に基づき取締役会及び三委員会において第 三者の視点から助言等を行うこと

#### ┃コーポレート・ガバナンス体制図



(2020年3月31日現在)

### ■ 2019年度 三委員会の主な役割と活動状況

より透明性・客観性の高いガバナンス体制の構築を図るため、三委員会(指名委員会、監査委員会、報 酬委員会) の委員長に社外取締役を選任しております。

### 指名委員会

### 【主な役割】

株主総会に提出する取締役の選任・解任議案の内容決定等を 行う。

### 【当期の運営状況】

当期は3回開催し、コーポレート・ガバナンスに配慮した取 締役会の構成、取締役候補者の指名に関する基本的な考え 方、取締役候補者の選定などについて検討しました。

取締役候補者の選定については、指名委員会において取締役 選任基準に照らして審議・決定されますが、当基準には社外 取締役の独立性を担保するための基準も盛り込んでいます。



### 【委員会構成】

委員長 小野寺 正

日比野 降司

中田 誠司

小笠原 倫明 社外

社外

社外

社外

竹内 弘高

河合 汀理子 社外

社外 西川 克行

### 監査委員会

### 【主な役割】

取締役・執行役の職務執行について、適法性・妥当性の監査 を行う。

### 【当期の運営状況】

当期は17回開催し、取締役及び執行役の職務執行の監査、事 業報告及び計算書類等の監査、監査報告の作成などを行いま した。



### 【委員会構成】

委員長 西川 郁生 花岡 幸子

小笠原 倫明 社外

河合 江理子 社外

社外 西川克行

### 報酬委員会

### 【主な役割】

役員報酬の方針、取締役・執行役の個人別報酬の決定等を行 う。

### 【当期の運営状況】

当期は4回開催し、役員報酬に関する方針及び個別報酬内容の決 定に関する事項や、連結業績の向上に資するグループ全体のイン センティブ・プランなどについて検討しました。



### 【委員会構成】

委員長 竹内 弘高 日比野 隆司

中田 誠司

社外 小野寺 正

西川郁生

社外

### ■取締役会の実効性向上に向けた取り組み

当社は、取締役会の実効性向上に向けた課題を明らかにし、改善を図ることを目的に、2014年度より取締役会の実効性評価(取締役会評価)を実施しています。取締役会評価では、全取締役から、取締役会の役割・責務、構成、運営方法、議論の状況等についてアンケートによる回答を得たうえで、専門機関によるインタビューを実施し、その結果を分析・評価しています。評価結果については取締役会へ報告し、議論を行うことによりPDCAサイクルを回し、取締役会の実効性の維持・向上に努めています。

### ・過去の取締役会評価を踏まえた主な対応・

### 機関投資家等の要望共有

・取締役会において、投資家やアナリストからの 要望やディスカッションの状況を報告しまし た。

### 将来の潜在リスク等の議論

- ・役員研修において、外部講師を招き、Fintech に関する最近の動向などの研修を実施し、議論 しました。
- ・BCP(業務継続計画)をテーマに社外取締役 との意見交換を実施しました。

### 中期経営計画・年度計画の監督

・四半期ごとに中期経営計画で掲げるグループ 数値目標を、半期ごとにアクションプランの報 告にあわせ、部門別KPIの達成状況を報告しま した。

### 後継者計画の整理

・後継者候補育成に関する対応状況を取締役会で報告しました。

### 会議資料の論点明確化

・論点を明確化するため、資料枚数を削減しました。 た。

### 3. 役員の状況

### (1) 取締役の状況

地位	氏名	担当及び重要な兼職の状況
取締役会長	日比野 隆司	(2) 執行役の状況参照
取締役	中田 誠司	(2) 執行役の状況参照
取締役	松井 敏浩	(2) 執行役の状況参照
取締役	髙橋 一夫	(2) 執行役の状況参照
取締役	田代 桂子	(2) 執行役の状況参照
取締役	小松 幹太	(2) 執行役の状況参照
取締役	中川 雅久	(2) 執行役の状況参照
取締役	花岡 幸子	大和証券株式会社監査役 大和証券投資信託委託株式会社監査役 株式会社大和総研ビジネス・イノベーション監査役 大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社監査役
取締役	小野寺 正	(3) 社外役員に関する事項参照
取締役	小笠原 倫明	(3) 社外役員に関する事項参照
取締役	竹内 弘高	(3) 社外役員に関する事項参照
取締役	西川 郁生	(3) 社外役員に関する事項参照
取締役	河合 江理子	(3) 社外役員に関する事項参照
取締役	西川 克行	(3) 社外役員に関する事項参照

- (注1) 取締役のうち、小野寺 正氏、小笠原 倫明氏、竹内 弘高氏、西川 郁生氏、河合 江理子氏及び西川 克行氏の6名は会社法第 2条第15号に定める社外取締役であります。各氏につきましては、東京証券取引所及び名古屋証券取引所に対し、独立役員としてそれぞれ届け出ております。
- (注2) 西川 郁生氏は、公認会計士の資格を有しており、財務及び会計に関する相当程度の知見を有するものであります。
- (注3) 当社は指名委員会等設置会社として、取締役から構成される以下の三委員会を設置しております。

指名委員会:小野寺 正(委員長)、日比野 隆司、中田 誠司、小笠原 倫明、竹内 弘高、河合 江理子、西川 克行

監査委員会:西川 郁生(委員長)、花岡 幸子、小笠原 倫明、河合 江理子、西川 克行

報酬委員会:竹内 弘高(委員長)、日比野 隆司、中田 誠司、小野寺 正、西川 郁生

- (注4) 当社は、執行役等へのヒアリングや内部監査部門等からの報告受領、子会社の監査等による情報の把握及び各種会議への出席を継続的・実効的に行うため、常勤の監査委員として花岡 幸子を置いております。
- (注5) 取締役のうち、花岡 幸子は、2020年3月31日をもって、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社監査 役を退任いたしました。

### (2) 執行役の状況

地位	氏名	担当及び重要な兼職の状況
代表執行役社長	中田 誠司	最高経営責任者(CEO)兼 リテール部門担当 大和証券株式会社代表取締役社長
代表執行役副社長	松井 敏浩	最高執行責任者(COO)兼 ホールセール部門担当 大和証券株式会社代表取締役副社長
執行役副社長	髙橋 一夫	ホールセール部門副担当 大和証券株式会社代表取締役副社長
執行役副社長	田代 桂子	海外担当 大和証券株式会社代表取締役副社長
執行役副社長	松下 浩一	アセットマネジメント部門担当 大和証券投資信託委託株式会社代表取締役社長
執行役副社長	草木 頼幸	シンクタンク部門担当 株式会社大和総研ホールディングス代表取締役社長 株式会社大和総研代表取締役社長 株式会社大和総研ビジネス・イノベーション代表取締役社長
専務執行役	小松 幹太	ホールセール部門副担当 大和証券株式会社専務取締役
専務執行役	中川雅久	情報技術担当(CIO) 大和証券株式会社専務取締役
専務執行役	新妻 信介	リテール部門副担当 大和証券株式会社専務取締役
専務執行役	荻野 明彦	企画担当 兼 法務担当 兼 人事管掌 大和証券株式会社専務取締役
常務執行役	在原 淳一	最高リスク管理責任者(CRO)兼 データ管理担当(CDO) 大和証券株式会社常務取締役
常務執行役	大塚 祥史	内部監査担当 大和証券株式会社常務執行役員
常務執行役	白川 香名	人事担当 兼 最高健康責任者(CHO) 大和証券株式会社常務執行役員
執行役	佐藤 英二	最高財務責任者(CFO)兼企画副担当兼海外副担当大和証券株式会社執行役員
執行役	日比野 隆司	大和証券株式会社代表取締役会長 株式会社帝国ホテル社外取締役

- (注1) 執行役のうち、中田 誠司、松井 敏浩、髙橋 一夫、田代 桂子、小松 幹太、中川 雅久及び日比野 隆司の7名は取締役を兼務 しております。
- (注2) 切(元分のうち、草木 頼幸は2020年3月31日をもって退任いたしました。 なお、2020年4月1日付で草木 頼幸は株式会社大和総研ホールディングス代表取締役社長、株式会社大和総研代表取締役社 及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーション代表取締役社長を退任いたしました。 (注3) 2020年4月1日付で、望月 篤及び村瀬 智之は新たに執行役に就任し、同日付で執行役の担当を以下のとおり変更しておりま
- す。

最高経営責任者 (CEO) 誠司 敏浩 桂子 代表執行役社長 最高執行責任者(COO) 海外担当 兼 SDGs担当 代表執行役副社長 松莊 笛代 執行役副社長 ホールセール部門担当 執行役副社長執行役副社長執行役副社長 一夫幹太 髙橋 ホールセール部門副担当シンクタンク部門担当 小松 中川 雅久 リテール部門担当 専務執行役 新妻 望月 信介 コンプライアンス担当 情報技術担当 (CIO) 専務執行役 智之 常務執行役 村瀬

常務執行役 佐藤 英二 最高財務責任者 (CFO) 兼 企画副担当 兼 海外副担当 なお、2020年3月31日をもって、中川 雅久は大和証券株式会社専務取締役を退任いたしました。また、2020年4月1日付 で、日比野 隆司は大和証券株式会社取締役会長に、小松 幹太は大和証券株式会社代表取締役副社長に、望月 篤は大和証券 株式会社代表取締役専務取締役に、大塚 祥史、白川 香名及び村瀬 智之は大和証券株式会社常務取締役に、佐藤 英二は大和 証券株式会社常務執行役員に、中川 雅久は株式会社大和総研ホールディングス代表取締役社長、株式会社大和総研代表取締 役社長及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーション代表取締役社長に就任しております。

### (3) 社外役員に関する事項

① 重要な兼職先と当社との関係

氏名	重要な兼職の状況		
小野寺 正	KDDI株式会社相談役		
	損害保険ジャパン日本興亜株式会社顧問		
小笠原 倫明	住友商事株式会社顧問		
小立尽 冊明	東急不動産ホールディングス株式会社社外取締		
	役		
	ハーバード大学経営大学院教授		
	インテグラル株式会社社外取締役		
	ブライトパス・バイオ株式会社社外取締役		
*****	株式会社t-lab取締役		
竹内 弘高	Global Academy株式会社会長		
	GlobalTreehouse株式会社共同創業者、取締		
	役会特別顧問		
	国際基督教大学理事長		
	雪印メグミルク株式会社社外取締役		
	三菱商事株式会社社外監査役		
西川 郁生	慶應義塾大学大学院商学研究科客員教授		
	東京海上日動火災保険株式会社社外監査役		
	京都大学大学院総合生存学館教授		
河本 江畑マ	一般財団法人未来を創る財団理事		
河合 江理子	公益財団法人グルー・バンクロフト基金理事		
	シミックホールディングス株式会社社外取締役		
	西川克行法律事務所弁護士		
西川 克行	イオン北海道株式会社社外監査役		

(注) 当社と上記兼職先との間に特別な関係はありません。

### ② 当期における主な活動状況

氏名	主な活動状況(出席及び発言の状況)
小野寺 正	当期に開催の取締役会10回の全てに出席し、 主に経営者としての豊かな経験と見識から、議 案・審議等についての発言を行っております。
小笠原 倫明	当期に開催の取締役会10回及び監査委員会17回の全てに出席し、主に官公庁での経歴による知識・経験から、議案・審議等についての発言を行っております。

氏名	主な活動状況(出席及び発言の状況)
竹内 弘高	当期に開催の取締役会10回の全てに出席し、 主に経営戦略に関する知識と経験に基づき、議 案・審議等についての発言を行っております。
西川 郁生	当期に開催の取締役会10回及び監査委員会17回の全てに出席し、主に公認会計士としての専門的見地から、議案・審議等についての発言を行っております。
河合 江理子	当期に開催の取締役会10回及び監査委員会17回の全てに出席し、主に金融分野における経験と見識から、議案・審議等についての発言を行っております。
西川 克行	当期の就任後に開催の取締役会8回及び監査委員会15回の全てに出席し、主に法律家としての専門的見地から、議案・審議等についての発言を行っております。

(注) 小笠原 倫明氏、西川 郁生氏、河合 江理子氏及び西川 克行 氏の4名は、監査委員であります。

### ③ 責任限定契約の内容の概要

各社外取締役は、当社と会社法第423条第1項の責任を限定する契約を締結しており、当該契約に基づく賠償責任限度額は、金1,000万円又は会社法第425条第1項に定める最低責任限度額のいずれか高い額となります。

### (4) 取締役及び執行役の報酬等の額

区分	報酬委員会決議に基づく報酬等の額			
<b>运</b> 刀	支給人員 (名)	支給額(百万円)		
取締役	9	156		
執行役	15	1,023		
計	24	1,179		

- (注1)上記の支給額には、当期の業績連動型報酬として支給予 定の額を含んでおります。
- (注2) 上記の支給額には、取締役及び執行役に対して割り当て られた譲渡制限付株式の価額合計196百万円を含んで おります。
- (注3) 社外取締役7名に対する報酬等の総額は125百万円であります。
- (注4) 取締役と執行役の兼務者 (7名) の報酬は、執行役に対する報酬等の支給額の欄に総額を記載しております。

### (5) 報酬委員会の定める取締役及び執行役の報酬の内容の決定に関する方針

取締役及び執行役の報酬については、

- ・健全なビジネス展開を通じて株主価値の増大に寄与し、短期及び中長期の業績向上へ結びつくインセンティブが有効に機能すること
- ・グローバルに展開する証券グループとして、国内はもとより、国際的にも競争力のある水準であること
- ・指名委員会等設置会社として、執行と監督が有効に機能すること

を基本方針としています。

取締役及び執行役の報酬は、基本報酬、業績連動型報酬、株価連動型報酬で構成され、具体的には以下のとおりです。

基本報酬	・基本報酬は、役職、職責、役割に応じた固定報酬とする。
業績連動型 報酬	・業績連動型報酬は、中期経営計画において業績KPIとしている連結ROE、連結経常利益を基準に、中期経営計画における経営目標の達成状況等を総合的に加味した上で、個人の貢献度合に応じて決定する。 ・執行役を兼務しない取締役に対しては、業績連動型報酬を設定しない。
株価連動型 報酬	・株価連動型報酬として、株主価値との連動性を高めるために、基本報酬の一定割合に相 当する価値の譲渡制限付株式等を付与する。 ・社外取締役に対しては、株価連動型報酬を設定しない。

### 4. 会計監査人の状況

### (1) 名称 有限責任 あずさ監査法人

### (2) 報酬等の額

① 当社が会計監査人に支払うべき報酬等の額

84百万円

- ② 当社及び当社の子会社が会計監査人に支払うべき金銭その他の財産上の利益の合計額 501百万円
- (注1) 当社と会計監査人との間の監査契約において、会社法に基づく監査と金融商品取引法に基づく監査の監査報酬等の額を明確に区分しておらず、 実質的にも区分できないため、上記①の報酬等の額にはこれらの合計額を記載しております。
- (注2) 監査委員会は、会計監査人から説明を受けた監査計画の適切性を吟味するとともに、週年度の監査実績の分析・評価や他社比較などの手続を通じて監査時間数や報酬単価などの見積の算出根拠を確認し、当期の報酬額の妥当性を検討した結果、監査報酬等の額について同意を行っております。
- (注3) 当社及び当社の子会社は、会計監査人に対して公認会計士法第2条第1項の業務(監査証明業務)以外に、委託業務に係る統制リスクの評価及び顧客資産の分別管理の法令遵守に関する業務等についての対価を支払っております。

### (3) 会計監査人の解任又は不再任の決定の方針

① 法定事由による解任

監査委員会は、会社法第340条第1項各号のいずれかに該当する事由があった場合には、監査委員 全員の同意をもって、会計監査人を解任します。

② その他の事中による解仟又は不再仟

監査委員会は、会計監査人の総合的能力、独立性、品質管理体制等を、毎年、評価しております。 評価の結果、会計監査人の適格性に問題があると判断した場合や、監査の有効性等の観点から他の 会計監査人に変更することが合理的であると判断した場合には、株主総会に提出する会計監査人の 解任又は不再任に関する議案の内容を決定いたします。

### (4) その他

当社の重要な子会社のうち、大和証券キャピタル・マーケッツヨーロッパリミテッド及び大和証券キャピタル・マーケッツアメリカホールディングスInc.等の海外子会社は、当社の会計監査人以外の公認会計士又は監査法人(外国におけるこれらの資格に相当する資格を有する者を含む。)の監査(会社法又は金融商品取引法(これらの法律に相当する外国の法令を含む。)の規定によるものに限る。)を受けております。

(注) 当社は、会計監査人「有限責任 あずさ監査法人」との間で責任限定契約を締結しておりません。

### 5. 剰余金の配当等の決定に関する方針

当社は、利益配分を含む株主価値の持続的な向上を目指しております。

配当については、中間配当及び期末配当の年2回を基本とし、連結業績を反映して半期毎に配当性向50%以上の配当を行う方針です。但し、安定性にも配慮した上で、今後の事業展開に要する内部留保を十分確保できた場合には、自社株買入等も含めてより積極的に株主への利益還元を行う方針です。

上記の基本方針を踏まえ、当期に係る剰余金の配当は、中間配当として1株当たり11円(2019年10月30日開催取締役会決議)、期末配当として1株当たり9円とさせていただきます。従いまして、年間での配当金額は1株につき20円となります。

# (ご参考) 大和証券グループのSDGs

当社グループは、SDGsを、世界を牽引する重要な目標と捉え、当社グループビジネスを通じ、企業の 経済的価値の追求と社会課題の解決を両立することで、豊かな社会の実現に積極的に取り組んでいきます。



### SDGs (Sustainable Development Goals (持続可能な開発目標)) とは

2015年9月の国連サミットで採択された2030年までの国際目標。持続可能な世界を実現するために、17のゴール・169のターゲットを掲げています。開発途上国だけでなく、日本を含む先進国の在り方を問い、その取り組みの過程で"誰一人取り残さない(No one will be left behind)"ことを誓っていることが特徴です。

### ■ SDGs推進アクションプラン"Passion for SDGs"2019の策定

### 持続可能な資金循環を生む"大和版SDGsバリュー・チェーン"の構築

### 市場拡大に向けたSDGsマーケティングの推進

- SDGsの普及啓発に向けたプロモーションの強化
- SDGsを通じた投資教育による金融リテラシー向上
- 人や地球環境に配慮した店舗づくりとマーケティングツールの整備
- あらゆるお客様が利用しやすいサービスの追求

### 社会課題解決に資するSDGsファイナンス商品の拡充

- SDGs関連商品のラインナップ拡充 (SDGs関連ファンド、SDGs債等)
- 大和ネクスト銀行預金、クラウドファンディング等を通じたソーシャルファイナ ンス拡大
- SDGsマーケティングと連携した新たな金融商品の組成
- SDGs関連ビジネスに取組む未上場企業への投資機会の提供

### 大和版SDGsバリュー・チェーン

### 投資循環を促進するエンゲージメントの強化

- SDGsインパクト評価手法の検討
- 社内スクリーニング体制の整備
- 対話促進に資するSDGs/ESG情報の積極的な発信
- 非財務情報の開示拡充に向けたコンサルテーションの実施

### SDGsに資する産業基盤の育成・支援

- M&A・事業承継を通じた産業基盤の維持・継承サポート
- スタートアップ企業・ソーシャルイノベーターの育成・支援
- 地域経済の活性化支援/各国の経済発展支援
- 先端テクノロジーを活用した新たな価値の提供
- SDGs関連ビジネスへの投資■ NPO等との連携・支援

# 大和証券グループの「ジブンゴト化」計画 会社 社員 ● 環境配慮への取り組み ● 「誰一人取り残さない」職場づくり ● SDGs人材の育成 ● 働きがい改革の推進 ● 取組み事例の社内外への発信 ● 課題解決に向けたアクションの実施

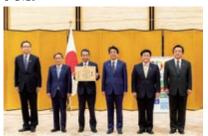
### 【2019年度の主な取り組み事例

### 1 100, 3 10000 4 10000 10 10000 14 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 1000 15 100

### 「第3回ジャパンSDGsアワード」(注)で特別賞を受賞

株式会社大和ネクスト銀行は、2019年12月に、特別賞「SDGsパートナーシップ賞」を受賞しました。

同行では、お客様の預入残高に一定割合を乗じた金額を、お客様が選ばれた団体・活動に同行が支援金として、寄付する「応援定期預金」をお取り扱いしており、同預金がSDGsに貢献するものとして、今回の受賞に至りました。



(左から3番目:大和ネクスト銀行 中村社長(当時))

(注)ジャパンSDGsアワード:内閣総理大臣を本部長とするSDGs推進本部が、SDGs達成に資する優れた取り組みを行っている企業・団体等を表彰するもの

### 

### SDGs債の推進

大和証券株式会社では、従来のグリーンボンドに加え、ソーシャルボンドやサステナビリティボンドなど様々な種類のSDGs債の引受・販売を積極的に行っています。

2020年3月末時点における個人向けSDGs債の国内市場での累積販売シェアは49%と、高水準を維持しています。

### 主なSDG s 債

- ●グリーンボンド…
- 環境問題の解決に資するグリーンプロジェクトに要する資金を調達
- ●ソーシャルボンド… 福祉や教育などの社会課題の解決に資するソーシャルプロジェクト に要する資金を調達
- ●サステナビリティボンド…

グリーン及びソーシャル双方のプロジェクトに要する資金を調達



(2020年3月末時点における個人向けSDG s 債の実績)

### 

### 再生可能エネルギーへの投資

大和エナジー・インフラ株式会社は、再生可能エネルギーへの投資 を通じて、新たなエネルギーシステムの構築等による社会課題の解決 を目指しています。

国内における太陽光発電所等への投資に加え、2019年6月にはモルディブで洋上太陽光発電事業を展開するSwimsol GmbHへの出資を行い、沿岸地域や島におけるクリーンな電源の提供に貢献しています。



(洋上太陽光発電システム)

### 

### トマト生産ビジネスへの参入

大和フード&アグリ株式会社は、大規模かつ効率化を追求した農業の産業化を推進していくことで、日本の農業・食料分野を取り巻く社会課題の解決に貢献していくことを目指しています。

山形県川西町に拠点を構える農地所有適格法人への資本参加を通じて経営に参画し、大規模栽培によるトマト生産ビジネスに新たに参入しました。



(トマト栽培の様子)

### 連結計算書類

# 連結貸借対照表

(単	V	Ħ,	n	円)	

資	産の部	
<u>^</u>	第83期	第82期(ご参考)
流動資産	(2020年3月31日現在)	(2019年3月31日現在) 20,405,580
現金・預金	3,964,512	4,153,271
預託金	415,953	324,559
受取手形及び売掛金	18,427	18,741
有 価 証 券	873,064	812,341
トレーディング商品	8,027,289	6,716,066
商品有価証券等	4,300,600	3,785,250
デリバティブ取引	3,726,689	2,930,815
営業投資有価証券	202,557	110,034
投資損失引当金	△1,160	△155
営 業 貸 付 金	1,768,471	1,564,856
仕 掛 品	609	901
信用取引資産	114,384	175,034
信用取引貸付金	105,203	157,309
信用取引借証券担保金	9,180	17,724
有価証券担保貸付金	6,685,756	5,973,771
借入有価証券担保金	4,813,361	5,119,636
現先取引貸付金	1,872,394	854,135
立替金	25,682	28,503 350
短 期 貸 付 金 未 収 収 益	3,087 36,483	39,229
その他の流動資産	711,935	488,391
貸 倒 引 当 金	△415	△317
固定資産	975,462	721,126
有形固定資産	309,166	168,089
建物	115,882	44,864
機械装置	8,004	_
器 具 備 品	19,153	19,666
土 地	127,751	69,521
建設仮勘定	38,375	34,037
無形固定資産	124,115	115,937
の れ ん	13,629	10,605
借 地 権	3,217	3,217
ソフトウェア	77,985	76,491
そ の 他	29,283	25,622
投資その他の資産	542,179	437,100
投資有価証券 長期貸付金	491,660	374,484
	5,915 17,877	5,505 17,448
長期差入保証金繰延税金資産	17,677	6,915
深 些 枕 並 貝 性 そ の 他	10,042	33,408
貸倒引当金	↑0,042 △440	△662
資産合計	23,822,099	21,126,706
	20,322,033	2.,.20,,00

負	債 の 部	
—————————————————————————————————————	第83期	第82期(ご参考)
· · · —	(2020年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
流動負價	19,918,716	17,081,971
支払手形及び買掛金	8,938	7,116
トレーディング商品	5,362,261	4,747,777
商品有価証券等デリバティブ取引	1,805,910	2,040,196
	3,556,351 544,689	2,707,580 255,804
利 定 見 返 勘 定 信 用 取 引 負 債	59,256	69,981
信用取引借入金	3,994	3,675
信用取引貸証券受入金	55,261	66,306
有価証券担保借入金	7,198,730	5,947,969
有価証券貸借取引受入金	4,839,095	4,934,115
現先取引借入金	2,359,635	1,013,853
銀行業における預金	4,037,201	3,632,575
預 り 金	353,943	276,700
受 入 保 証 金	414,641	372,591
短期借入金	1,276,948	1,341,415
コマーシャル・ペーパー	178,000	100,000
1年内償還予定の社債	277,852	190,772
未払法人税等	7,403	5,978
賞 与 引 当 金 その他の流動負債	26,747	28,436
	172,101 <b>2,641,697</b>	104,852 <b>2,784,365</b>
固定     負債       社     債	1,379,226	1,361,918
長期借入金	1,183,272	1,336,787
操延税金負債	4,369	6,071
退職給付に係る負債	44,359	43,441
訴訟損失引当金	1,570	25,573
その他の固定負債	28,900	10,572
特 別 法 上 の 準 備 金	3,918	3,938
金融商品取引責任準備金	3,918	3,938
<u>負債合計</u> 純	22,564,333	19,870,276
	資産の部	
株 主 資 本	1,202,310	1,196,476
資 本 金	247,397	247,397
資 本 剰 余 金	230,808	230,633
利 益 剰 余 金	834,442	805,761
自 己 株 式	△110,351	△87,320
自己株式申込証拠金	13	5
その他の包括利益累計額	7,703	48,000
その他有価証券評価差額金	26,853	47,668
繰延ヘッジ損益	△13,592	△5,611
為替換算調整勘定 新株 <b>予約</b> 権	△5,556 <b>8.901</b>	5,942 <b>8.741</b>
新 株 予 約 権 非 支 配 株 主 持 分	38,849	3,211
純 資 産 合 計	1,257,766	1,256,430
負債・純資産合計	23,822,099	21,126,706

# 連結損益計算書

科目	第83期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第82期 (ご参考) (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		
営     業     収       受     入     手     数     料       委     託     手     数     料	<b>672,287</b> 266,574 56,503	<b>720,586</b> 283,027 58,336		
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料 そのので、スーチン数とは トール・ディインングで損し、益	29,818 23,254 156,997	41,810 26,047 156,833		
字 美 投 貸 有 恤 証 券 関 埋 損 益 金 融 収 益	93,802 14 258,122	92,218 △232 291,005		
その他の営業収益費       金融     費用       その他の営業費用       種類     単数       類     型       販売費・一般管理費	53,772 <b>209,916</b> <b>36,110</b>	54,567 <b>242,468</b> <b>36,876</b>		
純     営     業     収     益       販売費・一般管理費	426,259 371,970	441,240 373,914		
<b>双 元 貞 ・ 一 版 官 珪 貞</b> 取 引 関 係 費	68,891	71,933		
人 件 閱 第	184,032	185,436		
不     動     産     関     係     費       事     務     費	36,647 25,969	37,394 26,518		
減 価 償 却 費	30,813	25,343		
租 税 公 課 貸 倒 引 当 金 繰 入 れ	10,529 170	10,740 84		
そ の 他	14,917	16,461		
営業     利益       営業     外収益	54,288 17.465	67,326 16,562		
受取配当金	5,062	4,844		
	8,586 —	8,397 172		
そ の 他	3,816	3,147		
営 業 外 費 用	1,470	<b>729</b>		
支     払     利       為     替     差	269 123	27 —		
投資事業組合運用損	207	_		
社 債 発 行 費 そ の 他	128 741	85 616		
経     常     利     益       特     別     利     益	70,283	83,159		
特         別         利         益           固         定         資         産         売         却         益	<b>37,476</b> 8,749	<b>14,320</b> 149		
投資有価証券売却益	12,442	13,128		
段階取得に係る差益 持分変動利益	4,642 11,413	_ _		
金融商品取引責任準備金戻入	19	6		
新 株 予 約 権 戻 <u> </u>		688 347		
そ の 他	208	_		
特     別     損     失       固     定     資     産     除     売     却     損	<b>22,930</b> 609	<b>2,396</b> 430		
固定     資産     除売     却損       減     損     失損       投資     有価証券評価負	1,283	430		
投資有 価 証 券 評 価 損	8,114	526 178		
持     分     変     動     損     失       移     転     関     連     費     用	_	178 592		
製品補償関連費用	12.500	631		
構造 改革 関連 費 用 そ の 他	12,500 422			
	84,828	95,083		
税     金     等     調     整     前     当     期     純     利     益       法     人     税     明     軽     額     整     額       当     期     純     利     益       非     支     配     株     主     に     帰     属     す     る     当     期     純     利	26,087 △2,524	27,664 3,587		
出     期     純     利       当     期     純	61,265	63,832		
非支配株主に帰属する当期純利益 親会社株主に帰属する当期純利益	918 60,346	<u>18</u> 63,813		
<u> </u>	00,340	03,013		

### 計算書類

# 貸借対照表

貝信刈照衣 <sup>(単位:百万円</sup>				
資産の部	ß	負債の部		
科目	第83期 (2020年3月31日熟定)	科目	第83期 (2020年3月31日駐	
流 動 資 産	374,709	流 動 負 債	390,938	
現金・預金	40,719	短期借入金	219,379	
15. Tr. 15. Tr.	40,713	1年内償還予定の社債	127,496	
短期貸付金	309,807	未 払 費 用	4,379	
未 収 入 金	17,952	有価証券担保借入金	34,366	
未収収益	3,999	未払法人税等	379	
		賞 与 引 当 金	656	
その他の流動資産	2,231	その他の流動負債	4,279	
固定資産	2,185,247	固定負債	1,275,877	
有形固定資産	81,366	社債	782,154	
		長期借入金	486,487	
建物	378	繰延税金負債	5,413	
器具備品	2,354	その他の固定負債	1,821	
土 地	6,895	負債合計 純資産の	1,666,815 <u>±</u> r	
<b>净 乳 仁 妝 宀</b>	71 720	株主資本	874,095	
建設仮勘定	71,738	資 本 金	247,397	
無形固定資産	9,078	資本剰余金	226,751	
ソフトウェア	6,793	資本準備金	226,751	
その他	2,284	利益剰余金	510,283	
		利益準備金	45,335	
投資その他の資産	2,094,802	その他利益剰余金	464,947	
投資有価証券	153,909	圧縮積立金	1,860	
関係会社株式	887,688	繰越利益剰余金	463,087	
その他の問係		自己株式	△110,351	
その他の関係 会社有価証券	161,602	自己株式申込証拠金	13	
長期貸付金	884,120	評価・換算差額等	10,144	
		そ の 他 有 価 証券評価差額金	10,068	
長期差入保証金	5,349	繰延ヘッジ損益	75	
そ の 他	2,363	新 株 予 約 権	8,901	
貸倒引当金	△231	純 資 産 合 計	893,141	
資 産 合 計	2,559,957	負債・純資産合計	2,559,957	

# 損益計算書

(単位:百万円)

科	· 目		<b>第83期</b> (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営 業	収	益	75,682
関係会	社 受 取 配 当	金	63,986
関係会	社 貸 付 金 利	息	11,619
そ	の	他	76
営 業	費	用	32,558
販 売 費	• 一般管理	費	19,984
取引	関 係	費	2,168
人	件	費	5,435
不動	産 関 係	費	1,840
事	務	費	3,893
減 価	償 却	費	2,594
租	税 公	課	1,969
そ	$\sigma$	他	2,081
金融	費	用	12,574
営 業	利	益	43,124
営 業	外 収	益	6,854
受 取	配当	金	4,561
受 取	補償	金	1,394
そ	の	他	899
営 業	外 費	用	1,258
社 債	発 行	費	1,090
そ	$\sigma$	他	168
経 常	利	益	48,720
特 別	利	益	12,417
投資有	西証券売却	益	12,417
特 別	損	失	7,805
投資有	西証券売却	損	17
投資有	西証券評価	損	7,752
そ	$\sigma$	他	36
税引前	当期純利	益	53,331
法人税、住	民税及び事業	税	744
法 人 税	等調整	額	454

### | 連結計算書類に係る会計監査人の会計監査報告

# 独立監査人の監査報告書

2020年5月12日

株式会社大和証券グループ本社 取締役会 御中

指定有限責任社員 公認会計士 小 倉 加奈子 🗐

指定有限責任社員 公認会計士 間 瀬 友 未 ⑬ 業 務 執 行 社 員

指定有限責任社員 公認会計士 深 井 康 治 ⑨ 業 務 執 行 社 員

### 監査意見

当監査法人は、会社法第444条第4項の規定に基づき、株式会社大和証券グループ本社の2019年4月1日から2020年3月31日までの連結会計年度の連結計算書類、すなわち、連結貸借対照表、連結損益計算書、連結株主資本等変動計算書、連結計算書類の作成のための基本となる重要な事項及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の連結計算書類が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、株式会社大和証券グループ本社及び連結子会社からなる企業集団の当該連結計算書類に係る期間の財産及び損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「連結計算書類の監査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、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 連結計算書類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企業会計の基準に準拠して連結計算書類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連結計算書類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。

連結計算書類を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき連結計算書類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企業会計の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。

### 連結計算書類の監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての連結計算書類に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から連結計算書類に対する意見を表明することにある。 虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、連結計算書類の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、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。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案 し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を 入手する。
- ・連結計算書類の監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として連結計算書類を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に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かどうか結論付ける。 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、監査報告書において連結計算書類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連結計算書類の注記事項が適切でない場合は、連結計算書類に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査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。
- ・連結計算書類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企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた連結計算書類の表示、構成及び内容、並びに連結計算書類が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- ・連結計算書類に対する意見を表明するために、会社及び連結子会社の財務情報に関する十分かつ適切な監査証拠を入手する。監査人は、連結計算書類の監査に関する指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で監査意見に対して 責任を負う。

監査人は、監査委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を 含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の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

### ■会計監査人の会計監査報告

# 独立監査人の監査報告書

2020年5月12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 公認会計士 小 倉 加奈子 ⑨ 業務 執 行 社 員 公認会計士 小 倉 加奈子 ⑩

指定有限責任社員業務執行社員

公認会計士 間瀬友 未印

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 深井 康治 ⑩

### 監査意見

当監査法人は、会社法第436条第2項第1号の規定に基づき、株式会社大和証券グループ本社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第83期事業年度の計算書類、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記並びにその附属明細書(以下「計算書類等」という。)について監査を行った。

当監査法人は、上記の計算書類等が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、当該計算書類等に係る期間の財産及び掲益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「計算書類等の監査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、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 計算書類等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企業会計の基準に準拠して計算書類等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計算書類等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。

計算書類等を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき計算書類等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企業会計の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。

### 計算書類等の監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての計算書類等に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から計算書類等に対する意見を表明することにある。 虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、計算書類等の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。 監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、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。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案 し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を 入手する。
- ・計算書類等の監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施 に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として計算書類等を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に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かどうか結論付ける。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、監査報告書において計算書類等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計算書類等の注記事項が適切でない場合は、計算書類等に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査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。
- ・計算書類等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企業会計の基準に準拠しているかどうかと ともに、関連する注記事項を含めた計算書類等の表示、構成及び内容、並びに計算書類等が基礎となる取引や会計事象を適 正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の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

### ■監査委員会の監査報告

### 監査報告

当監査委員会は、2019年4月1日から2020年3月31日までの第83期事業年度における取締役及び執行役の職務の執行について監査いたしました。その方法及び結果につき以下のとおり報告いたします。

### 1 監査の方法及びその内容

監査委員会は、会社法第416条第1項第1号ロ及びホに掲げる事項に関する取締役会決議の内容並びに当該決議に基づき整備されている体制(内部統制システム)について取締役及び執行役並びに使用人等からその構築及び運用の状況について定期的に報告を受け、必要に応じて説明を求め、意見を表明するとともに、下記の方法で監査を実施しました。

- ①監査委員会が定めた監査委員会監査基準に準拠し、監査の方針、職務の分担等に従い、内部統制部門と連携の上、重要な会議に出席し、取締役及び執行役等からその職務の執行に関する事項の報告を受け、必要に応じて説明を求め、重要な決裁書類等を閲覧し、業務及び財産の状況を調査しました。また、子会社については、子会社の取締役及び監査役等と意思疎通及び情報の交換を図り、必要に応じて子会社から事業の報告を受けました。
- ②会計監査人が独立の立場を保持し、かつ、適正な監査を実施しているかを監視及び検証するとともに、会計監査人からその職務の執行状況について報告を受け、必要に応じて説明を求めました。また、会計監査人から「職務の遂行が適正に行われることを確保するための体制」(会社計算規則第131条各号に掲げる事項)を「監査に関する品質管理基準」(平成17年(2005年)10月28日企業会計審議会)等に従って整備している旨の通知を受け、必要に応じて説明を求めました。

以上の方法に基づき、当該事業年度に係る事業報告及びその附属明細書、連結計算書類(連結貸借対照表、連結損益計算書、連結株主資本等変動計算書、連結計算書類の作成のための基本となる重要な事項及びその他の注記)並びに計算書類(貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記)及びその附属明細書について検討いたしました。

### 2 監査の結果

- (1)事業報告等の監査結果
  - ①事業報告及びその附属明細書は、法令及び定款に従い、会社の状況を正しく示しているものと認めます。
  - ②取締役及び執行役の職務の執行に関する不正の行為又は法令若しくは定款に違反する重大な事実は認められません。
  - ③内部統制システムに関する取締役会の決議の内容は相当であると認めます。また、当該内部統制システムに関する事業報告の記載内容並びに取締役及び執行役の職務の執行についても、指摘すべき事項は認められません。
- (2)連結計算書類の監査結果

会計監査人有限責任 あずさ監査法人の監査の方法及び結果は相当であると認めます。

(3)計算書類及びその附属明細書の監査結果

会計監査人有限責任 あずさ監査法人の監査の方法及び結果は相当であると認めます。

2020年5月13日

株式会社大和証券グループ本社 監査委員会 監査委員長

監督安員長 西川 郁 生 印 監査委員

花岡幸子邸

監査委員

小笠原 倫 明 🗊

監査委員

河 合 江理子 ⑩ 監査委員

西川克行邸

(注) 監査委員 西川 郁生、小笠原 倫明、河合 江理子及び西川 克行は、会社法第2条第15号及び第400条第3項に規定する社外取締役であります。

<メモ>	

## 株式についてのご案内

### ●事業年度

4月1日から翌年3月31日まで

●配当金基準日

期末配当3月31日、中間配当9月30日

●定時株主総会

6月末日までに開催(基準日3月31日)

●株主名簿管理人及び特別口座の口座管理機関 東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 三井住友信託銀行株式会社

●株主名簿管理人事務取扱場所

東京都千代田区丸の内一丁目4番1号 三井住友信託銀行株式会社 証券代行部

### ●各種お問い合わせ及び郵便物送付先(電話照会先)

〒168-0063 東京都杉並区和泉二丁目8番4号 三井住友信託銀行株式会社 証券代行部 0120-782-031

(受付時間:平日9:00~17:00/フリーダイヤル)

●公告の方法

電子公告により当社ウェブサイトに掲載 http://www.daiwa-grp.jp/ir/shareholders/ やむを得ない事由により電子公告をすることが できない場合は、日本経済新聞に掲載

### 100株未満の株式をお持ちの株主様へ

単元 (100株) 未満の株式をお持ちの株主様は、単元未満株式の買増・買取制度をご利用いただけます。

買増制度

株主様がご所有の単元未満株式とあわせて1単元となるべき単元未満株式の売り渡しを当社にご請求いただく制度です。

買取制度

株主様がご所有の単元未満株式を当社にて買い取らせていただく制度です。

お手続の詳細につきましては、お取引先の証券会社等までお問い合わせください。なお、特別□座に記録された株式の買増・買取請求は、特別□ 座の□座管理機関である三井住友信託銀行の電話照会先までお問い合わせください。

### 特別口座に株式をお持ちの株主様へ

特別口座に記録された株式については、単元未満株式の買増・買取請求を除き、**そのままでは売買することができません**。 売買するためには、証券会社等に一般口座を開設し、特別口座から株式を振り替える(株数等の記録を移す)手続が必要です。 振替手続は無料ですが、所定の日数を要することから、あらかじめ特別口座の口座管理機関である三井住友信託銀行の電話 照会先までお問い合わせください。

定時株主総会の決議の結果につきましては、当社ウェブサイト(https://www.daiwa-grp.jp/ir/shareholders/meeting/)又は臨時報告書において開示いたします。なお、当該開示をもって決議通知に代えさせていただきますので、ご了承くださいますようお願い申し上げます。

### 株主総会会場ご案内図

開催 日時

### 2020年6月25日(木曜日)

午前10時〔午前9時開場〕

### ザ・プリンス パークタワー東京 地下2階 コンベンションホール 東京都港区芝公園四丁目8番1号

電話(03)5400-1111

- ※新型コロナウイルス感染拡大防止の観点から、本年は株主総会へのご来場をお控えいただき、 書面又はインターネット等による議決権行使を強くご推奨申し上げます。
- ※今後の状況により会場や開始時刻が変更となる可能性がございますので、ご来場される株主様 は、事前に必ず当社ウェブサイト (https://www.daiwa-grp.jp/ir/shareholders/meeting/) をご確認いただきますようお願い申し上げます。





ユニバーサルデザイン (UD) の考え方に基づき、 より多くの人へ適切に情報を伝えられるよう配慮 した見やすいユニバーサルデザインフォントを採用







出発地から株主総会会場まで スマートフォンがご案内します。



# 第83回定時株主総会招集ご通知に際してのインターネット開示事項

I. 新株予約権等の状況 … 1~3ページ

Ⅱ. 業務の適正を確保するための体制及び当該体制の運用状況 … 4~8ページ

Ⅲ. 連結株主資本等変動計算書 … 9~10ページ

Ⅳ. 連結計算書類の注記 … 11~22ページ

V. 株主資本等変動計算書 … 23ページ

Ⅵ. 計算書類の注記 … 24~26ページ

### 株式会社大和証券グループ本社

上記の事項につきましては、法令及び当社定款第23条の定めにより、インターネット上の当社 ウェブサイト (https://www.daiwa-grp.jp/ir/shareholders/meeting/) に掲載することにより株主の皆様へご提供しております。

### I. 新株予約権等の状況

### (1) 当期末における新株予約権(ストック・オプション)の状況

### ①旧商法第280条ノ20及び第280条ノ21の規定に基づく新株予約権

名 称 (割当日)	新株予約権の数 (目的となる株式の種類及び数)	新株予約権の 払込金額	行使に際して 出資される財産の価額	行使期間
2005年6月発行新株予約権	138個	無償	1,000円	2005年7月 1 日から
(2005年6月24日)	(普通株式138,000株)	無順	(1株当たり1円)	2025年6月30日まで

### ②会社法第236条、第238条及び第239条の規定に基づく新株予約権

名 称	新株予約権の数	新株予約権の	行使に際して	行使期間
(割当日)	(目的となる株式の種類及び数)	払込金額	出資される財産の価額	
2006年7月発行新株予約権	96個	無償	1,000円	2006年7月 1 日から
(2006年7月1日)	(普通株式96,000株)		(1株当たり1円)	2026年6月30日まで
2007年7月発行新株予約権	134個	無償	1,000円	2007年7月 1 日から
(2007年7月1日)	(普通株式134,000株)		(1株当たり1円)	2027年6月30日まで
2008年7月発行新株予約権	167個	無償	1,000円	2008年7月 1 日から
(2008年7月1日)	(普通株式167,000株)		(1株当たり1円)	2028年6月30日まで
2009年7月発行新株予約権	396個	無償	1,000円	2009年7月 1 日から
(2009年7月1日)	(普通株式396,000株)		(1株当たり1円)	2029年6月30日まで
2010年7月発行新株予約権	728個	無償	1,000円	2010年7月 1 日から
(2010年7月1日)	(普通株式728,000株)		(1株当たり1円)	2030年6月30日まで
第7回新株予約権	2,561個	無償	380,000円	2015年7月 1 日から
(2010年9月1日)	(普通株式2,561,000株)		(1株当たり380円)	2020年6月25日まで
2011年7月発行新株予約権	997個	無償	1,000円	2011年7月 1 日から
(2011年7月1日)	(普通株式997,000株)		(1株当たり1円)	2031年6月30日まで
第8回新株予約権	2,625個	無償	326,000円	2016年7月 1 日から
(2011年9月5日)	(普通株式2,625,000株)		(1株当たり326円)	2021年6月24日まで
2013年2月発行新株予約権	722個	無償	1,000円	2013年2月12日から
(2013年2月12日)	(普通株式722,000株)		(1株当たり1円)	2032年6月30日まで
第9回新株予約権 (2013年2月12日)	5,459個 (普通株式5,459,000株)	無償	598,000円 (1株当たり598円)	2017年7月 1 日から 2022年6月26日まで
2014年2月発行新株予約権 (2014年2月10日)	360個 (普通株式360,000株)	無償	1,000円 (1株当たり1円)	2014年2月10日から 2033年6月30日まで
第10回新株予約権 (2014年2月10日)	3,963個 (普通株式3,963,000株)	無償	1,062,000円 (1株当たり1,062円)	2018年7月 1 日から 2023年6月25日まで
2015年2月発行新株予約権 (2015年2月9日)	438個 (普通株式438,000株)	無償	1,000円 (1株当たり1円)	2015年2月 9 日から 2034年6月30日まで
第11回新株予約権	5,418個	無償	931,000円	2019年7月 1 日から
(2015年2月9日)	(普通株式5,418,000株)		(1株当たり931円)	2024年6月25日まで
2016年2月発行新株予約権	559個	無償	1,000円	2016年2月16日から
(2016年2月16日)	(普通株式559,000株)		(1株当たり1円)	2035年6月30日まで
第12回新株予約権	4,484個	無償	733,000円	2020年7月 1 日から
(2016年2月16日)	(普通株式4,484,000株)		(1株当たり733円)	2025年6月24日まで
2017年2月発行新株予約権 (2017年2月8日)	563個 (普通株式563,000株)	無償	1,000円 (1株当たり1円)	2017年2月8日から2036年6月30日まで

名 称	新株予約権の数	新株予約権の	行使に際して	行使期間
(割当日)	(目的となる株式の種類及び数)	払込金額	出資される財産の価額	
第13回新株予約権 (2017年2月8日)	7,448個 (普通株式7,448,000株)	無償	767,000円 (1株当たり767円)	2021年7月 1 日から 2026年6月27日まで
2018年2月発行新株予約権	595個	無償	1,000円	2018年2月 8 日から
(2018年2月8日)	(普通株式595,000株)		(1株当たり1円)	2037年6月30日まで
第14回新株予約権	7,462個	無償	815,000円	2022年7月 1 日から
(2018年2月8日)	(普通株式7,462,000株)		(1株当たり815円)	2027年6月27日まで
第15回新株予約権 (2018年8月10日)	74,695個 (普通株式7,469,500株)	無償	68,600円 (1株当たり686円)	2023年7月 1 日から 2028年6月26日まで
第16回新株予約権	84,625個	無償	50,200円	2024年7月 1 日から
(2019年8月26日)	(普通株式8,462,500株)		(1株当たり502円)	2029年7月30 日まで
合 計	204,495個 (普通株式61,107,000株)			

- (注1) 各新株予約権の一部行使はできません。
- (注2) 2005年6月発行新株予約権・2006年7月発行新株予約権・2007年7月発行新株予約権・2008年7月発行新株予約権・2009年7月発行新株予約権・2010年7月発行新株予約権・2011年7月発行新株予約権・2013年2月発行新株予約権・2014年2月発行新株予約権・2015年2月発行新株予約権・2016年2月発行新株予約権・2017年2月発行新株予約権・2018年2月発行新株予約権については、各新株予約権の発行要項及び割当契約において、当社、当社子会社及び当社関連会社のうち当社取締役会又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本新株予約権を行使できるものとしております。但し、行使期間の末日の30日前の日より、他の権利行使の条件に従い行使できるものとしております。
- (注3) その他の行使条件について、各新株予約権の割当契約に定めております。
- (注4)上記の新株予約権の数には自己新株予約権を含んでおります。
- (注5) 第15回新株予約権・第16回新株予約権については、普通株式の単元株数が100株に変更されたことに伴い、新株予約権1個当たりの目的である普通株式の数は100株としております。

# (2) 当期末に当社役員が保有する新株予約権 (ストック・オプション) の状況

(211 22 1322 = 1	, , ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	
新株予約権の名称	保有者数 (取締役及び執行役)	新株 予約権の数
2005年6月発行新株予約権	2名	12個
2006年7月発行新株予約権	3名	10個
2007年7月発行新株予約権	4名	13個
2008年7月発行新株予約権	5名	18個
2009年7月発行新株予約権	7名	49個
2010年7月発行新株予約権	9名	91個
第7回新株予約権	1名	2個
2011年7月発行新株予約権	9名	131個
第8回新株予約権	2名	10個
2013年2月発行新株予約権	9名	100個
第9回新株予約権	6名	61個
2014年2月発行新株予約権	9名	52個
第10回新株予約権	7名	35個
2015年2月発行新株予約権	11名	67個
第11回新株予約権	5名	30個
2016年2月発行新株予約権	14名	100個
第12回新株予約権	2名	11個
2017年2月発行新株予約権	14名	100個
第13回新株予約権	2名	17個
2018年2月発行新株予約権	15名	112個
第14回新株予約権	1名	7個
第15回新株予約権	1名	70個

<sup>(</sup>注1) 社外取締役に対するストック・オプションとしての新株予 約権の割当はございません。

# (3) 当期中に使用人等に交付した新株予約権 (ストック・オプション) の状況

新株予約権 の名称	区	分	保有者数	新株 予約権の数
笠16日	子会社	取締役	8名	500個
第16回 新株予約権	子会社使用人		3,818名	84,125個
利14人 12小月佳	合	計	3,826名	84,625個

- (注1) 上記は各新株予約権の割当日時点の状況です。
- (注2) 子会社の執行役員は、区分上、子会社使用人に含まれております。
- (注3) 子会社の監査役に対するストック・オプションとしての新 株予約権の割当はございません。

<sup>(</sup>注2) 当期末の役員は第16回新株予約権を保有しておりません。

### Ⅱ.業務の適正を確保するための体制及び 当該体制の運用状況

取締役会が業務の適正を確保するための体制として決議した事項及び当該体制の運用状況の概要は次のとおりであります。(注)

### 1. 監査委員会の職務の執行のため必要な事項 の概要

# (1)当社の監査委員会の職務を補助すべき取締役及び使用人に関する事項

監査委員会の業務を補佐する専任部室として監査委員会室を設置する。

### <運用状況の概要>

当社は、監査委員会室を設置し、監査委員会室では、監査委員会の監査業務を補佐するために、監査方は 針及び監査計画の企画・立案や、監査に必要な情報・ 資料の収集・整理・分析等を行っている。

また、監査委員会室は、必要に応じて追加調査等を 行い、監査委員会の職務を補助している。

### (2)前号の取締役及び使用人の当社の執行役からの独立 性及び当社の監査委員会からの指示の実効性の確保 に関する事項

- ・監査委員会室は、監査委員会直轄部室とする。
- ・執行役は、監査委員会の重要性を踏まえ、監査委員会 室の人事(人事異動、評価等)、組織変更等につい て、予め監査委員会又は監査委員会が選定する監査委 員(以下、選定監査委員という。)の同意を得なけれ ばならない。
- ・監査委員会又は選定監査委員は、監査委員会室に必要な知識・能力を備えた適切な員数を確保するよう、執行役に要請することができ、執行役は、当該要請を尊重する。
- ・監査委員会室は、内部監査部をはじめとする各部署

に対し監査委員会の調査・情報収集に関する協力体制 の確保を要請することができ、各部署は、当該要請を 尊重する。

・監査委員会室は、必要に応じ各種会議等へ出席することができる。

### <運用状況の概要>

当社は、監査委員会室を監査委員会直轄部室として 設置し、監査委員会規程に基づき、監査委員会室の人 事について、選定監査委員の事前の同意を取得し、適 切な員数を確保することにより、執行役からの独立性 を確保している。

また、同規程に基づき、監査委員会室は各種会議体 に出席することで広範な情報収集を図り、監査委員会 からの指示の実効性の確保に努めている。

### (3) 当社の監査委員会への報告に関する体制

① 当社の取締役(監査委員である取締役を除く。)、執 行役及び使用人が当社の監査委員会に報告をするた めの体制

監査委員会等への報告に関する規程において以下 の事項を定める。

- ・当社の取締役(監査委員である取締役を除く。)、 執行役及び使用人は、監査委員会又は選定監査委員 に対し、内部通報を含む適宜の方法により、以下の 報告を行わなければならない。
- 1) 当社又は当社グループに著しい損害を及ぼすおそれのある事実を発見した場合は、直ちにその事実
- 2) 当社又は当社グループの役職員が法令若しくは定 款に違反する行為をし、又はこれらの行為をする おそれがあると考えられるときは、その旨
- 3) 当社の監査委員会又は選定監査委員が報告を求めた事項、その他監査上有用と判断される事項
- ② 当社の子会社の取締役、監査役及び使用人又はこれらの者から報告を受けた者が当社の監査委員会に報告をするための体制

当社の子会社の監査役等への報告に関する規程において以下の事項を定める。

- ・当社の子会社の取締役、監査役及び使用人又はこれらの者から報告を受けた者は、当社の監査委員会又は選定監査委員に対し、内部通報を含む適宜の方法により、以下の報告を行わなければならない。
- 1) 子会社又は当社グループに著しい損害を及ぼすお それのある事実を発見した場合は、直ちにその事 実
- 2) 子会社又は当社グループの役職員が法令若しくは 定款に違反する行為をし、又はこれらの行為をす るおそれがあると考えられるときは、その旨
- 3) 当社の監査委員会又は選定監査委員が報告を求めた事項、その他監査上有用と判断される事項

### <運用状況の概要>

当社及び当社の子会社において、それぞれ、監査委員会等への報告に関する規程・監査役等への報告に関する規程に基づき、当社については取締役(監査委員である取締役を除く。)、執行役及び使用人に対し、当社の子会社については取締役、監査役及び使用人又はこれらの者から報告を受けた者に対し、内部通報を含む適宜の方法により、当社又は当社グループに著しい損害を及ぼすおそれのある事実を発見した場合や、当社又は当社グループの役職員が法令若しくは定款に違反する行為をし、又はするおそれがあると考えられるときは、当社の監査委員会又は選定監査委員に対し報告を行う義務を課し、適宜報告を受ける体制を確保している。

### (4)前号の報告をした者が当該報告をしたことを理由と して不利な取扱いを受けないことを確保するための 体制

前号の報告をした者は、当該報告を行ったことを理由として、解雇、降格、減給等のいかなる不利益も受けないものとする。その実効性を確保するため、当社の監査委員会等への報告に関する規程及び子会社の監査役等への報告に関する規程において詳細を定める。

### <運用状況の概要>

当社の監査委員会等への報告に関する規程及び子会社の監査役等への報告に関する規程を整備し、前号の報告をした者が当該報告を行ったことに関して、解雇、降格、減給、派遣契約の解除、交代等いかなる不利な取扱いも実施されていない。

- (5)当社の監査委員の職務の執行(監査委員会の職務の 執行に関するものに限る。)について生ずる費用の前 払又は償還の手続その他の当該職務の執行について 生ずる費用又は債務の処理に係る方針に関する事項
- ・監査委員会又は監査委員がその職務の執行(外部専門家の任用を含むが、それに限られない。)について当社に対して次に掲げる請求をしたときは、当社は、当該請求に係る費用又は債務が監査委員会又は監査委員の職務の執行に必要でないことを証明したときを除き、これを拒むことができない。
  - イ. 費用の前払の請求
  - 立. 支出をした費用及び支出の日以後におけるその利息の償還の請求
  - ハ. 負担した債務の債権者に対する弁済(当該債務が 弁済期にない場合にあっては、相当の担保の提 供)の請求

### <運用状況の概要>

当社は、監査委員会規程に基づき、監査委員会又は 監査委員の職務の執行により生ずる費用や利息の償 還又は負担した債務の弁済につき、これを適正に負担 している。

# (6) その他当社の監査委員会の監査が実効的に行われることを確保するための体制

・監査委員は、グループリスクマネジメント会議及びグループ内部監査会議に出席し、説明を求め意見を述べることができる。また、その他重要会議へ出席することができる。

- ・監査委員は、各リスクを所管する部署より当社グループのリスク管理態勢及びリスクの状況等について、また、内部監査部門より当社グループの内部監査の実施 状況について定期的に報告を受ける。
- ・内部監査に係る監査方針及び監査計画、内部監査規程 の改廃並びに内部監査担当の委嘱については、監査委 員会又は選定監査委員の同意を得なければならな い。
- ・監査委員会又は選定監査委員は、必要に応じ内部監査 部等に調査を委嘱することができる。
- ・監査委員会は、会計監査人よりグループ各社の監査状 況について定期的に報告を受ける。
- ・監査委員会又は選定監査委員は、業務執行部門から独立した外部専門家に監査業務を補助させることができる。

### <運用状況の概要>

当社の選定監査委員は、監査委員会監査基準に基づしき、執行役会等の重要な会議への出席、決裁書等重要し書類の閲覧、及び内部監査部からの内部監査結果等の報告聴取により取締役及び執行役の職務執行状況にしいて情報収集を図るとともに、会計監査人から会計監査の状況について定期的に報告を受け、それらの結果を監査委員と共有している。

また、監査委員会又は選定監査委員は、監査委員会 | 監査基準に基づき、内部監査に係る監査方針及び監査 | 計画の策定等、内部監査に関する重要な事項について | 同意を行い、内部監査部との連携強化を通じて監査委 | 員会の監査の実効性の確保に努めている。

- 2. 執行役の職務の執行が法令及び定款に適合することを確保するための体制その他株式会社の業務並びに当該株式会社及びその子会社から成る企業集団の業務の適正を確保するために必要な体制の概要
  - (1)当社の執行役及び使用人並びに当社の子会社の取締 役等及び使用人の職務の執行が法令及び定款に適合 することを確保するための体制

### ① コンプライアンス体制

- ・当社グループにおける法令・諸規則及び諸規程に反す る行為等を早期に発見し是正することを目的とし、内 部通報制度を導入する。
- ・役職員の法令等遵守を目的とし、倫理規程及び倫理行動規範を制定する。
- ・役職員に対し、グループ各社において各社の業務の特性に応じたコンプライアンス研修を実施する。
- ・当社グループの企業倫理遵守体制の整備及び推進全 般に関する責任者をおき、企業倫理の役職員への浸 透・定着の推進を行う部室を設置する。
- ・当社グループの法律問題全般に関する助言を行い、グループ各社における法令諸規則等の遵守体制の整備 に関する活動を支援する部室を設置する。

### ② グループリスクマネジメント会議

・グループリスクマネジメント会議は、執行役会の分科会として、当社グループのリスク管理態勢及びリスクの状況等を把握し、リスク管理に係る方針及び具体的な施策を審議・決定する。

### ③ グループ内部監査会議

・グループ内部監査会議は、CEO直轄の機関として、当 社グループの業務に係る内部監査態勢の整備及び内 部統制の検証に関する事項を審議・決定する。

### 4) 内部監査部門

- ・当社グループの健全かつ効率的な内部統制の構築を 図るため、内部監査を重要な機能と位置付け、内部監 査部門を設置するとともに、主要なグループ各社にも 内部監査部門を設置する。
- ・内部監査部門は、当社グループの内部統制の有効性

を評価・検証するとともに、業務の改善・効率化に資する提言を行う。

・内部監査部門は、内部監査の計画及び結果についてグループ内部監査会議に付議・報告を行う。

### ⑤ 財務報告に係る内部統制

- ・財務計算に関する書類その他の情報の適正性を確保 するために必要な体制の構築を図るため、財務報告に 係る内部統制に関する基本規程を制定する。
- ・ディスクロージャー委員会及びグループ内部監査会 議は、財務報告に係る内部統制の重要事項につき審議 決定する。

### <運用状況の概要>

当社では、当社の体制記載の項目について、規程、部室、制度等を整備済みであり、適切な運用を行っている。また、全役職員を対象としたコンプライアンス研修や、新入社員や新任役職者に対する教育や啓発活動を実施し、法令諸規則及び社内規程等の周知、コンプライアンス意識の向上と企業倫理の浸透を図っている。また、当期は、9回のグループリスクマネジメント会議を開催し、当社グループのリスクの状況等の把握に努めるとともに、5回のグループ内部監査会議を開催し、内部監査部門が実施した内部監査に関する報告を行った。さらに、内部監査部門は、財務報告に係る内部統制の評価・検証を行い、内部統制評価報告書をCEO及びCFOに提出し、必要に応じグループ内部監査会議にも報告した。

# (2)当社の執行役の職務の執行に係る情報の保存及び管理に関する体制

執行役の職務執行に係る情報については、文書整理保存規程に従い適切に保存及び管理を行う。

### <運用状況の概要>

当社は、文書整理保存規程において、文書の種類に 応じた保存期間を設定し、執行役の職務執行に係る情 報について保存部署の責任において適切に保存及び 管理を行っている。

# (3)当社及び子会社の損失の危険の管理に関する規程その他の体制

- ・当社グループが経営上保有する各種リスクについて、その特性に応じて適切に管理するための基本的事項を定め、財務の健全性及び業務の適切性を確保することを目的としてリスク管理規程を定め、これにリスク管理方針、管理の対象とするリスク、各リスクを管理する執行役及び所管する部署等を定めることによりリスク管理態勢を明確化する。
- ・各リスクを所管する部署は所管するリスクの管理規程を別途定めることとし、所管するリスクの管理態勢及びリスクの状況等についてグループリスクマネジメント会議等に報告する。

### <運用状況の概要>

当社は、リスク管理規程において、市場リスク・信用リスク・流動性リスク・オペレーショナルリスク・ レピュテーショナルリスク・会計・税務リスクを管理の対象とするリスクとして定めている。また、リスクの特性に応じ、投資に係るリスク等についても、態勢の整備に努めている。

当期は、9回開催されたグループリスクマネジメント会議等において、各リスクを所管する部署が、当該リスクの管理態勢及びリスクの状況等について報告を行い、リスク管理態勢及びリスクの状況等を適切に把握している。

### (4)当社の執行役及び当社の子会社の取締役等の職務の 執行が効率的に行われることを確保するための体制

- ・執行役の職務及びその執行方法、統括する業務について執行役規程により明確化する。
- ・当社又は当社グループに影響を及ぼす重要事項について執行役会規程及び海外部門経営会議規程等により決議事項及び報告事項を明確化する。
- ・当社の執行役が主要なグループ各社の代表者を兼務 すること等により、グループ各社においてグループ戦 略に基づく事業戦略を機動的かつ効率的に実践す る。

・当社は、三事業年度を期間とするグループ中期経営計画を策定し、当該中期経営計画を具体化するため、毎事業年度ごとのグループ全体の経営方針及び予算配分等を定める。

### <運用状況の概要>

当社は、各執行役が分担して業務執行を行うことで、迅速な意思決定を行い効率的な業務執行を行っている。また、執行役が主要なグループ各社の代表者を兼務しており、これらの執行役を含む執行役全員をもって構成される執行役会において、子会社の業務執行の状況について情報を共有している。

当期は、20回の執行役会を開催し、当社又は当社グループに影響を及ぼす重要事項について審議決定を行い、また、取締役会に対し、執行役会の職務の執行状況を適宜報告し、取締役会は当社の執行役及び当社の子会社の取締役等の職務の執行の妥当性、効率性の監督を行っている。

- (5)当社の子会社の取締役等の職務の執行に係る事項の 当社への報告に関する体制その他の当社及びその子 会社から成る企業集団における業務の適正を確保す るための体制
  - ・国内外のグループ各社の事業活動を適切に管理する ことを目的として、グループ会社管理規程及び海外店 等の運営管理に関する規程等を定め、グループ各社か らの情報の徴求、承認・報告事項等の明確化を図る。
  - ・グループ各社の経営に関する重要な情報を把握し、当該情報が法令・諸規則に従い公正かつ適時適切に開示されることを確保するため、グループ各社において規程を定める。

### (運用状況の概要>

当社は、グループ会社管理規程や海外店等の運営管理に関する規程等に基づき、必要に応じて、国内外のグループ各社から報告を受けるとともに、重要な事項については当社の会議体において承認を行っている。当期は、20回の執行役会と6回の海外部門経営会議を開催し、審議決定・報告を行っている。

(注) 2020年3月26日開催の取締役会において、同年4月1日付の所要の改定をしておりますが、当期末現在(改定前)のものを記載しております。

### Ⅲ. 連結株主資本等変動計算書

第83期

(自 2019年4月1日) 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
項目	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式 申込証拠金	株主資本合計
2019年4月1日残高	247,397	230,633	805,761	△87,320	5	1,196,476
連結会計年度中の変動額						
剰 余 金 の 配 当	_	_	△31,164	_	_	△31,164
親会社株主に帰属する当期純利益	_	_	60,346	_	_	60,346
自 己 株 式 の 取 得	_	_	_	△25,102	_	△25,102
自 己 株 式 の 処 分	_	_	△501	2,071	_	1,570
そ の 他	_	175	_	_	8	183
連結会計年度中の変動額合計	_	175	28,681	△23,030	8	5,834
2020年3月31日残高	247,397	230,808	834,442	△110,351	13	1,202,310

	その他の包括利益累計額					
項目	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	為替換算 調整勘定	新株予約権	非支配株主持分	
2019年4月1日残高	47,668	△5,611	5,942	8,741	3,211	
連結会計年度中の変動額						
株主資本以外の項目の連結 会計年度中の変動額(純額)	△20,815	△7,981	△11,499	159	35,638	
連結会計年度中の変動額合計	△20,815	△7,981	△11,499	159	35,638	
2020年3月31日残高	26,853	△13,592	△5,556	8,901	38,849	

### 第82期 (ご参考) (自 2018年4月1日) 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
項目	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式 申込証拠金	株主資本合計
2018年4月1日残高	247,397	230,713	785,730	△54,310	3	1,209,535
連結会計年度中の変動額						
剰 余 金 の 配 当	_	_	△43,575	_	_	△43,575
親会社株主に帰属する当期純利益	_	_	63,813	_	_	63,813
自 己 株 式 の 取 得	_	_	_	△34,819	_	△34,819
自 己 株 式 の 処 分	_	_	△207	1,808	_	1,600
そ の 他	_	△80	_	_	1	△79
連結会計年度中の変動額合計	_	△80	20,030	△33,010	1	△13,059
2019年3月31日残高	247,397	230,633	805,761	△87,320	5	1,196,476

	その他の包括利益累計額				
項目	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	為替換算 調整勘定	新株予約権	非支配株主持分
2018年4月1日残高	61,176	△129	2,550	8,790	88,596
連結会計年度中の変動額					
株主資本以外の項目の連結 会計年度中の変動額(純額)	△13,508	△5,481	3,392	△48	△85,385
連結会計年度中の変動額合計	△13,508	△5,481	3,392	△48	△85,385
2019年3月31日残高	47,668	△5,611	5,942	8,741	3,211

### Ⅳ. 連結計算書類の注記

当社の連結計算書類は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)並びに同規則第118条の規定に基づき、当社グループの主たる事業である有価証券関連業を営む会社の貸借対照表及び損益計算書に適用される「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。

記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

### (連結計算書類作成のための基本となる重要な事項)

- 1. 連結の範囲に関する事項
  - (1) 連結子会社の数及び主要な連結子会社の名称 連結子会社の数 66社

主要な連結子会社の名称

大和証券株式会社

大和証券投資信託委託株式会社 (注)

株式会社大和総研ホールディングス

株式会社大和証券ビジネスセンター

大和プロパティ株式会社

株式会社大和ネクスト銀行

株式会社大和総研

株式会社大和総研ビジネス・イノベーション

大和企業投資株式会社

大和PIパートナーズ株式会社

大和エナジー・インフラ株式会社

大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社 サムティ・レジデンシャル投資法人

大和証券キャピタル・マーケッツヨーロッパリミテッド 大和証券キャピタル・マーケッツ香港リミテッド

大和証券キャピタル・マーケッツシンガポールリミテッド 大和証券キャピタル・マーケッツアメリカホールディングスInc. 大和証券キャピタル・マーケッツアメリカInc.

当連結会計年度において、サムティ・レジデンシャル投資法人は、追加取得により持分比率が増加したため、持分法適用の関連会社から除外し、連結子会社としております。また、新規設立により5社を連結の範囲に含めております。

(注) 大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日 に大和アセットマネジメント株式会社に商号変更しております。

(2) 主要な非連結子会社の名称等

主要な非連結子会社の名称

大和インベスター・リレーションズ株式会社

連結の範囲から除いた理由

非連結子会社の総資産、営業収益(又は売上高)、当期純 損益(持分に見合う額)及び利益剰余金(持分に見合う額) 等それぞれの合計額は、いずれも連結計算書類に及ぼす影響 が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためでありま す。 (3) 議決権の過半数を自己の計算において所有している会社等のうち子会社としなかった会社等

当該会社等の数 6社

子会社としなかった主要な会社の名称

セカイエ株式会社

子会社としなかった理由

当社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等の意思決定機関を支配していないことが明らかであると認められるためであります。

(4) 開示対象特別目的会社

開示対象特別目的会社の概要及び開示対象特別目的会社を 利用した取引の概要等

一部の連結子会社は、顧客の資金運用ニーズに応える目的で仕組債を販売しており、仕組債の組成に際し特別目的会社を利用しております。この取引において、当該連結子会社は、取得した債券をケイマン法人の特別目的会社に譲渡し、当該特別目的会社は取得した債券を担保とする仕組債を発行しております。当該特別目的会社は6社でありますが、いずれの特別目的会社についても、当社及び当該連結子会社は議決権のある出資等は有しておらず、役員や従業員の派遣もありません。なお、当連結会計年度末における特別目的会社の債券の発行額は677.458百万円であります。

### 2. 持分法の適用に関する事項

(1) 持分法を適用した非連結子会社及び関連会社の数並びに主要な会社等の名称

持分法適用の非連結子会社の数 0社 持分法適用の関連会社の数 15社

主要な持分法適用の関連会社の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

大和証券オフィス投資法人

当連結会計年度において、株式の新規取得により4社、新規設立により2社、合併により1社を持分法の適用範囲に含めております。また、サムティ・レジデンシャル投資法人が持分比率の上昇に伴い持分法適用の関連会社から連結子会社となったことにより1社、合併消滅により1社を持分法の適用範囲から除外しております。

持分法適用会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、2社についてはその他の基準日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、その他の会社については当該会社の事業年度に係る財務諸表を使用しております。

(2) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の名称等 主要な会社の名称

大和インベスター・リレーションズ株式会社

持分法を適用しない理由

持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の当期純 損益(持分に見合う額)、利益剰余金(持分に見合う額)等 それぞれの合計額は、いずれも連結計算書類に及ぼす影響が 軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

(3) 議決権の20%以上、50%以下を自己の計算において所有している会社等のうち関連会社としなかった会社等の名称等

当該会計等の数 12計

関連会社としなかった主要な会社の名称

NJT銅管株式会社

関連会社としなかった理由

当社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等に重要な影響を与えることができないことが明らかであると認められるためであります。

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社の決算日は以下のとおりであります。

3月 60社

1月及び7月 1社

12月 5社

連結子会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、4社については当該会社の決算日現在の財務諸表を使用し、他の2社については連結決算日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、連結決算日との間に生じた重要な取引については連結上必要な調整を行っております。

- 4. 会計方針に関する事項
  - (1) 重要な資産の評価基準及び評価方法
    - ① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び 評価方法

連結子会社における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等については時価法で計上しております。

② トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及 び評価方法

トレーディング商品に属さない有価証券等については 以下のとおりであります。

ア. 売買目的有価証券

時価法(売却原価は移動平均法により算定)によっております。

イ. 満期保有目的の債券

償却原価法によっております。

ウ. その他有価証券

時価のあるものについては連結決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定)、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移動平均法による原価法で計上しております。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、主として組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券又は投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。

また、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。

### エ. デリバティブ

時価法によっております。

③ たな卸資産の評価基準及び評価方法 仕掛品は、主として個別法による原価法(収益性の低 下による簿価切下げの方法)で計上しております。

- (2) 重要な減価償却資産の減価償却の方法
  - ① 有形固定資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

② 無形固定資産、投資その他の資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

- (3) 重要な引当金の計上基準
  - ①貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権について は貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等 については財務内容評価法により計上しております。

② 投資損失引当金

一部の連結子会社において、当連結会計年度末に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資先会社の実情を勘案のうえ、その損失見込額を計上しております。

③ 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、 各社所定の計算基準による支払見積額の当連結会計年度 負担分を計上しております。

④ 訴訟損失引当金

証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当連結会計年度末における支払見積額を計上しております。

(4) 退職給付に係る負債の計上基準

退職給付に係る負債は、当社及び国内連結子会社については、従業員の退職給付に備えるため、社内規程に基づく当連結会計年度末における退職金要支給額を計上しております。これは、当該各社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためであります。その他一部の連結子会社については、当連結会計年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当連結会計年度末において発生していると認められる金額を計上しております。

(5) 重要な収益及び費用の計上基準

完成工事高及び完成工事原価の計上基準

一部の国内連結子会社における受注制作ソフトウェアに係る収益については、当連結会計年度末までの進捗部分について成果の確実性が認められる場合については工事進行基準(工事の進捗率の見積りは原価比例法)を、その他の場合については工事完成基準を適用しております。

### (6) 重要なヘッジ会計の方法

原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。

当社及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係る金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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ます。

ヘッジの有効性の検証については、ヘッジ手段の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とヘッジ対象の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とを比較する方法によっております。なお、一部の連結子会社においては、相場変動を相殺するヘッジのうちヘッジ対象とヘッジ手段に関する重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているものは、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えております。また、特例処理及び振当処理を採用しているものについては、その判定をもってヘッジの有効性の判定に代えております。

また、銀行業務を行う子会社では、外貨建金融資産・負債から生ずる為替変動リスクに対するヘッジ会計の方法は、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」(日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号 平成14年7月29日)に規定する繰延ヘッジによっております。ヘッジ有数世評価の方法については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを減殺する目的で行う通貨スワップ取引及び為替スワップ取引をヘッジ手段とし、ヘッジ対象である外貨建金銭債権債務等に見合うヘッジ

(7) のれんの償却方法及び償却期間

のれんについては、発生の都度、子会社等の実態に基づいて償却期間を見積り、20年以内の年数で均等償却しております。なお、のれんの金額に重要性が乏しい場合には、発生した連結会計年度に一括して償却しております。

手段の外貨ポジション相当額が存在することを確認するこ

(8) その他連結計算書類作成のための重要な事項

とによりヘッジの有効性を評価しております。

① 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

② 連結納税制度の適用

当社及び株式会社大和キャピタル・ホールディングスをそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

③ 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効 果会計の適用

当社及び一部の国内連結子会社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務

対応報告第39号 2020年3月31日) 第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日) 第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

### (連結貸借対照表に関する注記)

- 1. 担保に供している資産及び担保に係る債務
  - (1) 担保に供している資産

有価証券	92,385百万円
トレーディング商品	531,870
営業貸付金	845,230
投資有価証券	18,095
計	1,487,581

- (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185.873百万円を担保として差し入れております。
- (2) 担保に係る債務

信用取引借入金	3,994百万円
短期借入金	442,439
長期借入金	294,800
	741.233

- (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。
- 2. 差し入れた有価証券等の時価

消費貸借契約により 貸し付けた有価証券 現先取引で売却した 有価証券 その他 計 2,064,787 461,924 8,379,973

- (注) 1.(1) 担保に供している資産に属するものは除いております。
- 3. 差し入れを受けた有価証券等の時価

消費貸借契約により 借り入れた有価証券 現先取引で買い付けた 有価証券 その他 242,713 計 7.697,060

4. 資産から直接控除した貸倒引当金

投資その他の資産・その他

6,147百万円

5. 有形固定資産の減価償却累計額 126.648百万円

6. 保証債務

被保証者	被保証債務の内容	金額(百万円)
従業員	借入金	29
グッドタイム リビング株式会社	入居一時金等 返還債務	12,115
その他	債務	15
計		12,160

7. 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項 金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5第1項

### (連結株主資本等変動計算書に関する注記)

- 当連結会計年度末における発行済株式の種類及び総数 普通株式 1,699,378,772株
- 2. 配当に関する事項
  - (1) 配当金支払額

決 議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)
2019年5月16日取締役会	普通株式	14,096	9
2019年10月30日取締役会	普通株式	17,067	11
計		31,164	

決 議	基準日	効力発生日
2019年5月16日取締役会	2019年3月31日	2019年6月3日
2019年10月30日取締役会	2019年9月30日	2019年12月2日
計		

(2) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの 2020年5月8日開催の取締役会において、普通株式の配当に関する事項を次のとおり決議する予定であります。

① 配当金の総額

13,675百万円

② 1株当たり配当額

9円

③ 基準日

2020年3月31日

④ 効力発生日

2020年6月1日

(注) 配当原資は利益剰余金とする予定であります。

### 3. 当連結会計年度末の新株予約権の目的となる株式の種類及び数

	計 牛皮木の利林 ア 州権の自動となる株式の程規及の数 新株予約権の目的となる株式の数(株)							
区分	内訳	当連結会計 年度期首	増加	減少	当連結会計 年度末	当連結会計 年度末残高 (百万円)		
	2006年7月発行 新 株 予 約 権	119,000	_	23,000	96,000	130		
	2007年7月発行 新 株 予 約 権	160,000	_	26,000	134,000	175		
	2008年7月発行 新 株 予 約 権	202,000		35,000	167,000	162		
	2009年7月発行 新 株 予 約 権	450,000		54,000	396,000	229		
	第6回新株予約権(自己新株予約権)	1,383,000 (323,000)	_ (-)	1,383,000 (323,000)	_ (-)	_ (-)		
	2010年7月発行 新 株 予 約 権	820,000	_	92,000	728,000	273		
	第7回新株予約権 (自己新株予約権)	2,598,000 (490,000)	_ (8,000)	535,000 (-)	2,063,000 (498,000)	171 (-)		
	2011年7月発行 新 株 予 約 権	1,036,000	_	39,000	997,000	356		
	第8回新株予約権 (自己新株予約権)	2,443,000 (460,000)	_ (10,000)	288,000 (-)	2,155,000 (470,000)	192 (-)		
	2013年2月発行 新 株 予 約 権	738,000	_	16,000	722,000	410		
	第9回新株予約権 (自己新株予約権)	4,998,000 (461,000)	_ (77,000)	77,000 (-)	4,921,000 (538,000)	962 (-)		
当社	2014年2月発行 新 株 予 約 権	375,000	_	15,000	360,000	344		
	第10回新株予約権 (自己新株予約権)	3,680,000 (283,000)	_ (83,000)	83,000 (-)	3,597,000 (366,000)	1,082 (-)		
	2015年2月発行 新 株 予 約 権	441,000	_	3,000	438,000	372		
	第11回新株予約権 (自己新株予約権)	5,065,000 (353,000)	_ (129,000)	129,000 (-)	4,936,000 (482,000)	951 (-)		
	2016年2月発行 新 株 予 約 権	567,000	ı	8,000	559,000	370		
	第12回新株予約権 (自己新株予約権)	4,228,000 (256,000)	— (96,000)	96,000 (-)	4,132,000 (352,000)	472 (-)		
	2017年2月発行 新 株 予 約 権	571,000	_	8,000	563,000	398		
	第13回新株予約権 (自己新株予約権)	7,165,000 (283,000)	_ (190,000)	190,000 (-)	6,975,000 (473,000)	639 (-)		
	2018年2月発行 新 株 予 約 権	599,000	_	4,000	595,000	432		
	第14回新株予約権 (自己新株予約権)	7,287,000 (175,000)	_ (223,000)	223,000 (-)	7,064,000 (398,000)	445 (-)		
	第15回新株予約権 (自己新株予約権)	7,388,000 (81,500)	_ (219,500)	219,500 (-)	7,168,500 (301,000)	264 (-)		
	第16回新株予約権 (自己新株予約権)	_ (-)	8,462,500 (169,000)	169,000 (-)	8,293,500 (169,000)	62 (-) 8,901		
合 計								

(注1) 上記の新株予約権の目的となる株式は、全て普通株式であります。 (注2) 「第12回新株予約権」、「第13回新株予約権」、「第14回新株予約権」、「第15回新株予約権」及び「第16回新株予約権」は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

### (金融商品に関する注記)

- 1. 金融商品の状況に関する事項
  - (1) 金融商品に対する取組方針

当社グループは有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業を行っております。具体的には、有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び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、その他有価証券関連業並びに銀行業務、金融業等を営んでおります。

これらの業務において、当社グループでは商品有価証券等、デリバティブ取引、営業投資有価証券、貸出金、投資有価証券等の金融資産・負債を保有するほか、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、現先取引、レポ取引等による資金調達を行っております。資金調達を行う際には、ビジネスを継続するうえで十分な流動性を効率的に確保するという金調選の基本方針の下、消達手段及び償還期限の多様化を図りながら、資産と負債の適正なバランスの維持に努め、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。また、主に金利スワップ及び通貨スワップ等を金融資産・負債に関する金利変動及び為替変動の影響をヘッジする目的で利用しております。

当社グループでは保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクをその特性に応じて適切に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社グループはトレーディング業務において、①有価証券等(株券・ワラント、債券及び受益証券等)、有価証券担保貸付金・借入金、信用取引資産・負債等、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引のデリバティブ商品、③金利スワップ及び通貨スワップ・先物外国為替取引・選択権付債券売買・通貨オプション・FRA・有価証券店頭デリバティブ等の取引所取引以外のデリバティブ商品(店頭デリバティブ取引)等の金融商品を保有しております。また、投資業務において営業投資有価証券等、銀行業務において貸出金・有価証券等を保有するほか、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。

これらの金融商品に内在する様々なリスクのうち、主要なものは市場リスクと信用リスクです。市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等の市場で取引される商品の価格やレートが変化することによって、保有する金融商品又は金融取引により損失を被るリスク及び市場の流動性の著しい低下により市場における取引が成立せず、又は著しく不利な条件での取引を余儀なくされることにより、損失を被るリスクを指します。また、信用リスクとは、金融取引の取引先や保有する金融商品の発行体のデフォルト、あるいは信用力の変化等によって損失を被るリスクを指します。

なお、トレーディング業務において、顧客のニーズに対応するために行っている単独又は仕組債等に組込まれたデリバティブ取引の中には、対象資産である株式・金利・為替・コモディティ等の変動並びにそれらの相関に対する変動率が大きいものや、複雑な変動をするものが含まれており対象資産に比べたリスクが高くなっております。これらのデリバティブ取引は、連結貸借対照表のトレーディング商品等に含めており、また、時価変動による実現・未実現の損益は、トレーディング損益として計上しております。

また、当社グループは金融商品を保有するとともに、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、現先取引、レポ取引等による資金調達を行っており、流動性リスクに晒されております。流動性リスクとは、市場環境の変化や当社グループの財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、あるいは通常よりも著しく高い調達コストを余儀なくされることにより損失を被るリスクを指します。

トレーディング業務を行う証券子会社では、デリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者としてデリバティブ取引を利用しております。デリバティブ商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば、顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供資産があります。最終利用者としては、当社グループの金融資産・負債に係る金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は、リスクアペタイト・フレームワークに基づいて当社グループ全体のリスク管理を行ううえで、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスクごとの担当役員・所管部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定しております。さらに、実効的なリスクガバナンス態勢を構築するため、「3つの防衛線」に係るガイドラインを定め、リスク管理の枠組みを整備しています。

子会社はリスク管理の基本方針に基づき、各事業のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行い、当社は子会社のリスク管理態勢及びリスクの状況をモニタリングしております。また、子会社のモニタリングを通して掌握した子会社のリスクの状況のほか、各社におけるリスク管理態勢上の課題等については、当社の執行役会の分科会であるブループリスクマネジメント会議に報告し、審議しております。主要な子会社においてもリスクマネジメント会議等を定期的に開催し、リスク管理の強化を図っております。

### ① トレーディング目的の金融商品に係るリスク管理

### (i) 市場リスクの管理

当社グループのトレーディング業務では、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案したうえで、バリュー・アット・リスク(一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額。以下「VaR」という。)、ポジション、感応度等に限度枠を設定しております。当社のリスク管理部署では市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出したVaRの限界を補うべく、過去の大幅なマーケット変動に基づくシナリオや、仮想的なストレスイベントに基づくシナリオを用いて、ストレステストを実施しております。

### <市場リスクに係る定量的情報>

当社グループにおける主要な証券子会社は、トレーディング商品に関するVaRの算定にあたって、ヒストリカル・シミュレーション法(保有期間1日、信頼区間99%、観測期間520営業日)を採用しております。

連結決算日における当社グループのトレーディング 業務のVaRは、全体で12億円であります。

なお、当社グループでは算出されたVaRと損益を比較するバックテスティングを実施し、モデルの有効性を検証しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

### (ii) 信用リスクの管理

当社グループのトレーディング業務における信用リスクには取引先リスクと発行体リスクがあります。取引先リスクについては、当社グループが一取引先グループに対して許容できる与信相当額の上限を設定し、定期的にモニタリングしています。加えて、取引先リスク全体のリスク量を計測しています。また、マーケットメイクにより保有する金融商品の発行体リスクについてもリスク量をモニタリングしています。

当社グループは、商品提供や資産運用・投資を行うことに伴い、様々な商品・取引のエクスポージャーが特定の取引先グループに集中するリスクがあります。当該取引先グループの信用状況が悪化した場合、大幅な損失が発生する可能性があるため、一取引先グループに対するエクスポージャーの合計に対し限度額を設定し、定期的にモニタリングしています。

信用取引においては顧客への与信が発生しますが、 担保として定められた委託保証金を徴求しております。また、有価証券貸借取引については、取引先に対する与信枠を設定したうえで、必要な担保を徴求するとともに日々の値洗い等を通じて信用リスクの削減を 図っております。

### ② トレーディング目的以外の金融商品に係るリスク管理

当社グループはトレーディング業務以外でも、投資業務における営業投資有価証券等、銀行業務における貸出金・有価証券等のほか、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。これらの金融商品についても市場リスク、信用リスクが生じますが、各業務における特有のリスク特性があるため、それらに応じたリスク管理を行っております。

投資業務を行う子会社では、投資委員会等で投資案件 を精査したうえで投資の可否を判断しております。投資 後は、投資先の状況を定期的にモニタリングし、リスク マネジメント会議等に報告しています。

銀行業務を行う子会社では、管理すべきリスクカテゴリーを特定し、その管理方針及び管理体制を定めています。また、リスク管理の協議・決定機関として、取締役会の下部組織であるALM委員会(信用・市場・流動性リスク等の管理・運営に関する重要事項を審議)等を設置しています。取締役会やALM委員会等で各種限度額を設定し、その範囲内で業務運営を行うことによりリスクをコントロールしております。

取引関係上の目的等の投資有価証券等は、関連規程等に定められた方針に基づき取得・売却の決定を行います。また、定期的にリスクの状況をモニタリングし、経営陣に報告しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

(ア) 金融資産及び金融負債(銀行業務を行う子会社が保有する金融資産及び金融負債を除く)

市場リスクの影響を受ける主たる金融資産は投資業務で保有する「営業投資有価証券」、取引関係上の目的で保有する「投資有価証券」となります。なお、2020年3月31日現在、指標となる東証株価指数(TOPIX)等が10%変動したものと想定した場合には「営業投資有価証券」及び「投資有価証券」のうち、時価のある株式等において時価が92億円変動するものと把握しております。

また、市場リスクの影響を受ける主たる金融負債は「社債」及び「長期借入金」であります。なお、2020年3月31日現在、その他全てのリスク変数が一定であると仮定し、金利が10ベーシス・ポイント(0.1%)変動したものと想定した場合、「社債」の時価が23億円、「長期借入金」の時価が2億円それぞれ変動するものと把握しております。

(イ)銀行業務を行う子会社で保有する金融資産及び金融負債銀行業務を行う子会社では、金融資産及び金融負債について、市場リスク(金利、為替、株式等の様々な市場のリスク・ファクターの変動により、資産・負債(オフ・バランスを含む。)の価値が変動し損失を被るリスク、資産・負債から生み出される収益が変動し損失を被るリスク)の管理にあたり、VaRを用いております。

VaR計測の方法は、ヒストリカル・シミュレーション法 (保有期間20日、信頼区間99%、観測期間750営業日)で算出した値を保有期間125日に換算することとしております。2020年3月31日現在における当該数値は57億円であります。

なお、当該子会社では、リスク計測モデルによって 算出されたVaRと仮想損益額との比較を行うバックテストを定期的に実施し、当該モデルの有効性を検証し ております。2019年度に実施したバックテストの結果、当該子会社が使用するリスク計測モデルは市場リスクを適切に捕捉しているものと認識しております。 ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

このようなVaRによる管理の限界を補完するため、各種シナリオを用いた損失の計測(ストレステスト)を実施しております。

### ③ 流動性の管理

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、平成26年金融庁告示第61号による連結流動性カバレッジ比率(以下、「LCR」という。)の最低基準の遵守が求められております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCRのほかに、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理態勢を構築しております。即ち、1年以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らモニタリングしております。また、当社な、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・は給整を行うとともに、グループ内で資金融通を可能とする整勢を整えることで、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。

当社グループは、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを 策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生 的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレス の逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの 方針を定めており、これにより当社グループは機動的な 対応により流動性を確保する態勢を整備しております。

当社グループのコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、グループ全体のストレスを踏まえて策定しており、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

また、金融市場の変動の影響が大きく、その流動性確保の重要性の高い大和証券株式会社、株式会社大和ネクスト銀行及び海外証券子会社においては、更に個別のコンティンジェンシー・ファンディング・プランも策定し、同様に定期的な見直しを行っております。

なお、当社は、子会社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランの整備状況について定期的にモニタリングしており、必要に応じて想定すべき危機シナリオを考慮して子会社の資金調達プランやコンティンジェンシー・ファンディング・プランそのものの見直しを行い、更には流動性の積み増しを実行すると同時に資産圧縮を図るといった事前の対策を講じることとしております。

### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が変動することもあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項 当連結会計年度末における連結貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握 することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません ((注2) に記載のとおりであります)。

(単位:百万円)

	連結貸借対照表計上額	時価	差額
·	72.107 (12.73/11.201) 22.07	- 5 100	/=3/
(1) 現金・預金	3,964,512	3,964,512	_
(2) 預託金	415.953	415.953	
	415,955	415,955	_
(3) トレーディング商品			
②辛口左供款 ************************************	4 200 600	1 200 600	
①商品有価証券等	4,300,600	4,300,600	_
②デリバティブ取引	3,726,689	3,726,689	_
		3,7 20,003	
(4) 営業貸付金	1,768,471		
貸倒引当金	△108		
	1 760 262	1 7 47 220	A 01 040
	1,768,363	1,747,320	△21,042
(5) 信用取引資産			
	105 202	105 202	
信用取引貸付金	105,203	105,203	_
信用取引借証券担保金	9.180	9.180	
	3,100	3,100	
(6) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	4,813,361	4,813,361	
現先取引貸付金	1,872,394	1,872,394	_
(7) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券	1	-	
①満期保有目的の債券	141,696	142,552	855
②子会社株式及び関連会社株式	117.314		
	117,514		
投資損失引当金			
	117,314	131,349	14,034
			14,034
③その他有価証券	910,396	910,396	_
資産計	22,145,665	22,139,514	△6,151
	22,1 13,003	22,133,311	
<u>負債</u>			
(1) トレーディング商品			
	1 005 010	1 005 010	
①商品有価証券等	1,805,910	1,805,910	_
②デリバティブ取引	3.556.351	3.556.351	_
			_
(2) 約定見返勘定	544,689	544,689	_
(3) 信用取引負債			
	2 22 4	2.004	
信用取引借入金	3,994	3,994	_
信用取引貸証券受入金	55.261	55,261	_
	33,201	JJ,ZU I	
(4) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	4,839,095	4,839,095	
日世紀が見旧収り区八立	4,039,093		_
現先取引借入金	2,359,635	2,359,635	_
(5) 銀行業における預金	4,037,201	4,038,440	△1,238
			∠ 1,∠38
(6) 預り金	353,943	353.943	_
(7) 受入保証金			
	414,641	414,641	_
(8) 短期借入金	1,276,948	1,276,948	_
(9) コマーシャル・ペーパー	178,000	178,000	_
(10) 1年内償還予定の社債	277,852	277.852	_
(1) 計信			904
	1 270 224		911/1
	1,379,226	1,378,321	
(12) 長期借入金	1,379,226 1,183,272		
(12) 長期借入金	1,183,272	1,179,227	4,044
	1,379,226 1,183,272 22,266,024		
	1,183,272	1,179,227	4,044
負債計 トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※)	1,183,272 22,266,024	1,179,227 22,262,313	4,044
負債計 トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※) ヘッジ会計が適用されていないもの	1,183,272 22,266,024 $\triangle$ 4,073	1,179,227 22,262,313 $\triangle$ 4,073	4,044 3,710
負債計	1,183,272 22,266,024 $\triangle$ 4,073	1,179,227 22,262,313 $\triangle$ 4,073	4,044 3,710
負債計 トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※)	1,183,272 22,266,024	1,179,227 22,262,313	4,044

<sup>※</sup>トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

### (注1) 金融商品の時価の算定方法

### (ア) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

#### (イ) 預託金

主に顧客分別金信託で構成され、国債等の有価証券投資を行っているものについては類似の債券を含めた直前の取引値段から計算される各期間に応じた指標金利との利回り格差を用いて合理的に算出する価格に基づいて算定しております。その他運用商品については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

### (ウ)トレーディング商品

### ① 商品有価証券等

株式等	主たる取引所の最終価格又は最 終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の 取引値段(当社店頭、ブローカ ースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、 指標金利との格差等を用いて、 合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終 気配値又は基準価額

### ② デリバティブ取引

取引所取引の デリバティブ取引	主に取引所の清算値段又は証拠 金算定基準値段
金利スワップ取引等	イールドカーブより算出される 予想キャッシュ・ポンレートト 券の価格・クーポンレートトシー 利、ディスティカウントレートショ ラティリスティ 等を基に、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、 、
店頭エクイティ・ デリバティブ取引	株価又は株価指数、金利、配当、 ボラティリティ、ディスカウキ トレート、田の大田に 用い一般に認識されているモデル で一般に認識されるしたも 若しくはこれらを拡張した ル)により算出した価格
クレジット・ デリバティブ取引	金利、参照先の信用スプレッド等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相 手先の信用リスク相当額及び流動性リスク相当額を 必要に応じて時価に追加しております。

#### (工) 約定見返勘定

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

### (オ) 営業貸付金

主に銀行業における貸出金や顧客から保護預かりしている有価証券を担保として金銭を貸付する証券担保ローンであります。

銀行業における貸出金については、貸出金の種類、期間等に基づき、元利金の合計額を同様の新規貸付を行った場合に想定される利率で割り引いて時価を算定しております。また、変動金利によるものは、短期間で市場金利を反映するため、貸出先の信用状態が実行後大きく異なっていない限り、時価低等価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。ただし、一部の資産流動化ローンについては、第三者から入手した時価を使用しております。

証券担保ローンについては、返済見込期間及び金利条件等から、時価は帳簿価額と近似しているものと想定されるため、帳簿価額を時価としております。

### (カ) 信用取引資産、信用取引負債

信用取引資産は顧客の信用取引に伴う顧客への貸付金と証券金融会社への担保金であり、前者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われ、後者は貸借取引業務において値洗いされる担保金であることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

信用取引負債は顧客の信用取引に伴う証券金融会社からの借入金と顧客の信用取引に係る有価証券の売付代金相当額であり、前者は値洗いされ、後者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

### (キ) 有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金

これらは、そのほとんどが短期間で決済されるため、 時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。

### (ク) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終 気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格、又は裏付資産の価値から合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気 配値又は基準価額
組合出資金	組合出資金のうち、不動産による回収見込額等に基づき投資損失引当金を算定しているものについては、時価は連結決算日における貸借対照表の投資損失引当金をでいた金額に近似しており、当該金額をもって時価としている

### (ケ) 銀行業における預金

預金のうち、要求払預金については、決算日に要求された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

また、定期預金の時価は、将来のキャッシュ・フロー を見積り、一定の割引率で割り引いて時価を算定してお ります。

割引率は当社の信用スプレッドを加味したイールドカーブから算出しております。

#### (コ) 預り金

主として顧客から受入れている預り金であり、当連結会計年度末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。その他の預り金については短期間に支払いが行われるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

### (サ) 受入保証金

主としてデリバティブ取引における保証金であり、取引に応じて値洗いされる特性から、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。その他の顧客からの保証金については、当連結会計年度末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

(シ) 短期借入金、コマーシャル・ペーパー、1年内償還予定 の社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

### (ス) 社債

償還まで1年超の社債の時価について、市場価格(売買参考統計値等)が入手可能な場合には、その時価を市場価格から算定しております。市場価格が入手不可能な場合は、発行時からの金利変動及び当社自身の信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

### (セ) 長期借入金

その他

借入当初からの金利変動及び信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

- (ソ) トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引 「(ウ)トレーディング商品 ②デリバティブ取引」と同様 となっております。
- (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、資産(7) 「②子会社株式及び関連会社株式」及び「③その他有価証券」には含まれておりません。 (単位:百万円)

区分 連結貸借対照表 計上額 99,654 非上場株式 99,654 その他有価証券 非上場株式 32,181 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 237,284

28,753

(注) 市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見 積ること等ができず、時価を把握することが極めて 困難と認められることから時価開示の対象とはして おりません。

### (賃貸等不動産に関する注記)

- 1. 賃貸等不動産の状況に関する事項 当社グループは、東京都その他の地域において、賃貸住宅等 及び再開発事業用地等を有しております。
- 2. 賃貸等不動産の時価に関する事項

当連結会計年度末における連結貸借対照表計上額、期中増減 額及び時価は、次のとおりであります。

(単位:百万円)

		当連結 会計年度
>+ (+ (3 H)   1 D7	期首残高	
連結貸借対照表 計上額	期中増減額	116,601
01200	期末残高	116,601
	期末時価	117,580

- (注) 1.貸借対照表計上額は、取得価額から減価償却累計額を 控除した金額です。
  - 2.期末の時価は、社外の不動産鑑定士による鑑定評価額 又は調査価額を記載しております。
  - 3.再開発中の資産は、大規模な複合再開発などの開発段階にあり、時価を把握することが極めて困難であるため、上表には含めておりません。これら不動産の連結貸借対照表計上額は、前連結事業年度末31,544百万円、当連結事業年度末37,755百万円であります。

### (1株当たり情報に関する注記)

1株当たり純資産額 1株当たり当期純利益 796円33銭 39円11銭

### V. 株主資本等変動計算書

第83期

(自 2019年4月1日) 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

		株主資本						
		資本剰余金		利益剰余金				
項目	資本金	資本	その他利益	益剰余金	自己株式	自己株式申込	株主資本 合計	
		準備金	利益 準備金	圧縮積立金	繰越利益 剰余金		証拠金	
2019年4月1日残高	247,397	226,751	45,335	1,860	442,620	△87,320	5	876,650
事業年度中の変動額								
剰余金の配当	_	_	_	_	△31,164	_	_	△31,164
当 期 純 利 益	_	_	_	_	52,132	_	_	52,132
自己株式の取得	_	_	_	_	_	△25,102	_	△25,102
自己株式の処分	_	_	_	_	△501	2,071	_	1,570
そ の 他	_	_	_	_	_	_	8	8
事業年度中の変動額合計	_	_			20,466	△23,030	8	△2,555
2020年3月31日残高	247,397	226,751	45,335	1,860	463,087	△110,351	13	874,095

	評価・換		
項目	その他 有価 証券 評価 差額金	繰延 ヘッジ 損益	新株 予約権
2019年4月1日残高	31,550	_	8,741
事業年度中の変動額			
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額 (純額)	△21,481	75	159
事業年度中の変動額合計	△21,481	75	159
2020年3月31日残高	10,068	75	8,901

### Ⅵ. 計算書類の注記

当社の計算書類は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)の規定に基づいて作成しております。

記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

- 1. 資産の評価基準及び評価方法
- (1) 売買目的有価証券

時価法(売却原価は移動平均法により算定)によっております。

(2) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法によっております。

(3) その他有価証券

時価のあるものについては決算日の市場価格等に基づく 時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原 価は移動平均法により算定)、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移動平均法による原価法 で計上しております。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該 組合等の財務諸表に基づいて、主として組合等の純資産を出 資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております (組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持 分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。

(4) デリバティブ

時価法によっております。

- 2. 固定資産の減価償却の方法
  - (1) 有形固定資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、法 人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

(2) 無形固定資産、投資その他の資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、法 人税法に規定する方法と同一の基準によっております。た だし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内におけ る利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

- 3. 引当金の計 ト基準
  - (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸 倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等について は財務内容評価法により計上しております。

### (2) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、当社 所定の計算基準による支払見積額の当期負担分を計上して おります。

- 4. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項
  - (1) 繰延資産の処理方法

社債発行費は、全額支出時の費用として処理しております。

(2) ヘッジ会計の処理

原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。

当社は、一部の借入金及び発行社債等に係る金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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ます。

ヘッジの有効性の検証については、ヘッジ手段の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とヘッジ対象の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とを比較する方法によっております。なお、特例処理及び振当処理を採用しているものについては、その判定をもってヘッジの有効性の判定に代えております。

(3) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(4) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(5) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

### (貸借対照表に関する注記)

1. 差し入れた有価証券

投資有価証券のうち54.809百万円を貸し付けております。

2. 資産から直接控除した貸倒引当金

投資その他の資産・その他

3.193百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額 1,577百万円

4. 保証債務

被保証者	被保証債務の内容	金額(百万円)
従業員	借入金	25
関係会社	デリバティブ債務	5,091
グッドタイム リビング株式会社	入居一時金等 返還債務	12,115
計		17,232

5. 関係会社に対する金銭債権及び金銭債務

短期金銭債権 325.372百万円 長期金銭債権 888,057百万円 短期金銭債務 38.338百万円 長期金銭債務 1,431百万円

### (損益計算書に関する注記)

関係会社との取引高

営業取引高 85,038百万円 営業取引以外の取引による取引高 3,653百万円

### (株主資本等変動計算書に関する注記)

当期末における自己株式の種類及び株式数 普通株式 179.906.470株

### (税効果会計に関する注記)

繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産

投資有価証券評価損	7,940百万円			
繰越欠損金	5,735			
貸倒引当金	4,521			
関係会社株式評価損	1,041			
その他	3,213			
繰延税金資産小計	22,451			
評価性引当額	△21,736			
繰延税金資産合計	715			
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	4,735			
その他	1,393			
繰延税金負債合計	6,128			
繰延税金負債の純額	5,413			

### (関連当事者との取引に関する注記)

子会社及び関連会社等 (単位:百万円)

属性	会社等の名称	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引のP	内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	大和証券株式会社	所有	資金の貸付	資金の貸付	(注1)	194,082	長期貸付金	336,037
		直接100.0%	担保金の受入	利息の受取	(注1)	9,281	短期貸付金	305,730
			株券の貸付	担保金の受入	(注2)	52,877	未収収益	2,111
			役員の兼任	利息の支払	(注2)	△9	有価証券担保借入金	34,263
			デリバティブ取引先	株券の貸付	(注2)	54,809	未収収益	0
				品貸料の受取	(注2)	5	未払費用	0
				デリバティ	ブ取引 (注3,4)	_	投資その他の資産 その他(デリバティブ資産)	255
							その他の流動負債(デ リバティブ負債)	1
							その他の固定負債(デ リバティブ負債)	51
							未収収益	31
							未払費用	32
子会社	大和プロパティ株式会社	1,,,,,,	資金の貸付	資金の貸付	(注1)	3,400	長期貸付金	21,650
		直接100.0%		利息の受取	(注1)	267		
子会社	大和PIパートナーズ株式会社	 所有	資金の貸付	資金の貸付	(注1)	75,100	長期貸付金	120,600
		間接100.0%		利息の受取	(注1)	783	短期貸付金	2,176
							未収収益	1
子会社	株式会社大和インベストメント・	所有	資金の貸付	資金の貸付	(注1)	400	長期貸付金	63,600
	マネジメント	直接100.0%		利息の受取	(注1)	646		
子会社	株式会社大和インターナショナル・	所有	資金の貸付	資金の貸付	(注1)	8,000	長期貸付金	263,190
	ホールディングス	直接100.0%	役員の兼任					
子会社	大和エナジー・インフラ株式会社		1	資金の貸付	(注1)		長期貸付金	78,056
		間接100.0%		利息の受取	(注1)	623	未収収益	35

### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 取引金額には、短期貸付金は月末平均残高、長期貸付金は貸付金額を記載しております。 また、貸付利率は市場実勢を勘案して決定しております。なお、担保は受け入れておりません。
- (注2) 取引金額には、当期末における貸株の時価及び受入担保金額の月末平均残高を記載しております。 また、品貸料率及び担保金金利は市場実勢を勘案して決定しております。
- (注3) 反復的取引であるため取引金額の記載を省略しております。
- (注4) 当該取引条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

### (1株当たり情報に関する注記)

1株当たり純資産額581円93銭1株当たり当期純利益33円79銭