

# 平成21年3月期 第3四半期決算短信

平成21年1月30日

会社名 **みずほ証券株式会社**

U R L <http://www.mizuho-sc.com/>

代表者 (役職名) 代表取締役社長

(氏名) 横尾 敬介

問合せ先責任者 (役職名) 執行役員 リスク管理・財務グループ長

(氏名) 染河 清剛

T E L (03)5208-2030

(百万円未満切捨て)

## 1. 平成21年3月期第3四半期の連結業績 (平成20年4月1日～平成20年12月31日)

### (1) 連結経営成績 (累計)

(%表示は対前年同四半期増減率)

	営業収益		純営業収益		営業利益		経常利益	
	百万円	%	百万円	%	百万円	%	百万円	%
21年3月期第3四半期	254,147	( - )	79,936	( - )	8,354	( - )	6,790	( - )
20年3月期第3四半期	347,267	( 25.1 )	115,541	( - )	218,640	( - )	220,698	( - )

	四半期純利益		1株当たり 四半期純利益		潜在株式調整後 1株当たり四半期純利益	
	百万円	%	円 銭		円 銭	
21年3月期第3四半期	16,172	( - )	2,419	25	-	-
20年3月期第3四半期	196,709	( - )	52,045	80	-	-

### (2) 連結財政状態

	総資産		純資産		自己資本比率		1株当たり純資産	
	百万円		百万円		%	円 銭		
21年3月期第3四半期	19,940,530		273,204		1.4	40,807	68	
20年3月期	21,122,253		331,031		1.6	49,437	93	

(参考) 自己資本 21年3月期第3四半期 272,799 百万円 20年3月期 330,492 百万円

## 2. 配当の状況

(基準日)	1株当たり配当金				
	第1四半期末	第2四半期末	第3四半期末	期末	年間
	円 銭	円 銭	円 銭	円 銭	円 銭
20年3月期	-	0 00	-	0 00	0 00
21年3月期	-	0 00	-	-	未定

## 3. その他

(1) 期中における重要な子会社の異動 (連結範囲の変更を伴う特定子会社の異動) 無

(2) 簡便な会計処理及び四半期連結財務諸表の作成に特有の会計処理の適用 有

(注) 詳細は、9ページ「簡便な会計処理及び四半期連結財務諸表の作成にあたり適用した特有の会計処理」をご覧ください。

(3) 四半期連結財務諸表作成に係る会計処理の原則・手続、表示方法等の変更 (四半期連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項等の変更) に記載されるもの

会計基準等の改正に伴う変更 有

以外の変更 有

(注) 詳細は、10ページ「四半期連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項等の変更」をご覧ください。

(4) 発行済株式数 (普通株式)

期末発行済株式数 (自己株式を含む)	21年3月期第3四半期	6,685,000 株	20年3月期	6,685,000 株
期末自己株式数	21年3月期第3四半期	- 株	20年3月期	- 株
期中平均株式数 (四半期連結累計期間)	21年3月期第3四半期	6,685,000 株	20年3月期第3四半期	3,779,545 株

### その他特記事項

当連結会計年度より「四半期財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第12号)および「四半期財務諸表に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第14号)を適用しております。また、「四半期連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」に従い四半期連結財務諸表を作成しております。

(参考)

個別業績の概要

1. 平成21年3月期第3四半期の個別業績 (平成20年4月1日～平成20年12月31日)

(1) 個別経営成績(累計)

(%表示は対前年同四半期増減率)

	営業収益	純営業収益	営業利益	経常利益
	百万円 %	百万円 %	百万円 %	百万円 %
21年3月期第3四半期	89,896 ( - )	55,297 ( - )	3,614 ( - )	7,901 ( - )
20年3月期第3四半期	84,455 ( 13.5 )	53,377 ( 36.6 )	6,604 ( - )	783 ( - )

	四半期純利益	1株当たり 四半期純利益	潜在株式調整後 1株当たり四半期純利益
	百万円 %	円 銭	円 銭
21年3月期第3四半期	4,263 ( - )	637 77	- -
20年3月期第3四半期	174,754 ( - )	46,236 85	- -

(2) 個別財政状態

	総資産	純資産	自己資本比率	1株当たり純資産	自己資本規制比率
	百万円	百万円	%	円 銭	%
21年3月期第3四半期	9,979,889	328,808	3.3	49,186 00	263.7
20年3月期	12,695,032	326,151	2.6	48,788 55	266.9

(参考) 自己資本 21年3月期第3四半期 328,808 百万円 20年3月期 326,151 百万円

その他特記事項

当事業年度より「四半期財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第12号)および「四半期財務諸表に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第14号)を適用しております。また、「四半期財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」に従い四半期個別財務諸表を作成しております。

【企業集団の状況】

当社および当社の子会社・関連会社は、証券・インベストメントバンキング分野において、デット、エクイティ、M & A、ストラクチャードファイナンス等をコアビジネス領域とし、内外機関投資家や事業法人・金融法人・公共法人を中心とした幅広いニーズに対して、先進の金融技術を活かし、高付加価値のプロダクツやサービスを提供しております。

海外ネットワークに関しては英国、スイス、米国、香港等の金融市場に子会社を配し、株・公社債の引受・売買を中心に、グローバルなインベストメントバンキング業務の運営体制を整えております。

当企業集団の主たる会社は、以下の通りであります。

会社名	所在地	資本金	主要な事業の内容	議決権に対する 当社の保有割合
<b>(親会社)</b>				
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都 千代田区	百万円 1,540,965	金融持株会社	-
株式会社みずほコーポレート銀行	東京都 千代田区	百万円 1,070,965	銀行業務	-
<b>(子会社)</b>				
みずほセキュリティーズアジアリミテッド Mizuho Securities Asia Limited	中華人民共和国 香港特別行政区	百万香港ドル 330	証券業務	100.00%
株式会社日本投資環境研究所	東京都 千代田区	百万円 100	コンサルティング業務、 情報提供サービス業務	97.00%
ブリッジフォード・グループ The Bridgeford Group, Inc.	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	米ドル 1,000,000	M&A業務	100.00%
スイスみずほ銀行 Mizuho Bank (Switzerland) Ltd	スイス連邦 チューリッヒ市	百万スイスフラン 53	銀行業務・信託業務	100.00%
みずほインターナショナル Mizuho International plc	英国 ロンドン市	百万英ポンド 2,426	証券業務・銀行業務	100.00%
米国みずほ証券 Mizuho Securities USA Inc.	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	米ドル 231,300	証券業務	100.00%
ベーシック・キャピタル・マネジメント株式会社	東京都 千代田区	百万円 100	金融業務	100.00%
瑞穂投資諮詢(上海)有限公司	中華人民共和国 上海市	百萬元 10	コンサルティング業務	100.00%
株式会社インダストリアル・ディジションズ	東京都 品川区	百万円 40	コンサルティング業務	50.00%
みずほ証券・新光ブリッジビルインベストメント株式会社	東京都 千代田区	百万円 3,500	投資業務	98.49%
<b>(関連会社)</b>				
モバイル・インターネットキャピタル株式会社	東京都 港区	百万円 100	ベンチャーキャピタル業務	30.00%
日本産業パートナーズ株式会社	東京都 千代田区	百万円 100	金融業務	25.00%
株式会社環境エネルギー投資	東京都 品川区	百万円 100	金融業務	50.00%

(注) みずほ証券・新光ブリッジビルインベストメント株式会社は、平成20年7月の増資により資本金が1,000百万円から3,500百万円、当社の議決権保有割合が90%から98.49%にそれぞれ増加しております。

## 【四半期連結財務諸表】

## 四 半 期 連 結 貸 借 対 照 表

(単位:百万円)

科 目	当第3四半期連結会計期間末 (20.12.31現在)	前連結会計年度末 (20.3.31現在)
(資産の部)		
流 動 資 産	19,853,630	21,038,371
現 金 ・ 預 金	137,011	148,286
預 託 金	51,515	16,915
有 価 証 券	58,028	7,967
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	7,010,066	8,531,592
商 品 有 価 証 券 等	5,973,612	7,850,567
貸 付 債 権	38,047	40,279
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	998,406	640,746
営 業 有 価 証 券 等	73,925	74,157
営 業 貸 付 債 権	2,040	2,012
信 用 取 引 資 産	1,539	4,177
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	11,737,421	11,423,819
募 集 等 払 込 金	496	820
短 期 差 入 保 証 金	428,490	274,601
有 価 証 券 等 引 渡 未 了 勘 定	240,521	413,407
支 払 差 金 勘 定	44,450	58,051
短 期 貸 付 金	2,897	2,076
未 収 収 益	38,759	48,807
繰 延 税 金 資 産	8,055	11,900
そ の 他	18,453	19,830
貸 倒 引 当 金	43	55
固 定 資 産	86,899	83,882
有 形 固 定 資 産	12,176	14,822
建 物	4,708	5,762
器 具 ・ 備 品	7,467	9,060
無 形 固 定 資 産	14,146	14,223
ソ フ ト ウ ェ ア	14,087	14,163
そ の 他	58	60
投 資 そ の 他 の 資 産	60,577	54,836
投 資 有 価 証 券	17,832	22,664
出 資 金	214	591
長 期 差 入 保 証 金	7,103	6,441
長 期 前 払 費 用	1,127	1,397
繰 延 税 金 資 産	25,040	20,472
そ の 他	10,908	3,269
貸 倒 引 当 金	1,650	-
資 産 合 計	19,940,530	21,122,253

(単位:百万円)

科 目	当第3四半期連結会計期間末 (20.12.31現在)	前連結会計年度末 (20.3.31現在)
(負債の部)		
流 動 負 債	18,621,783	19,713,733
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	4,060,168	4,845,986
商 品 有 価 証 券 等	2,981,002	4,034,648
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	1,079,165	811,338
約 定 見 返 勘 定	486,604	206,352
信 用 取 引 負 債	2,533	7,771
有 価 証 券 担 保 借 入 金	10,431,679	10,697,060
預 り 金	15,241	20,525
受 入 保 証 金	248,339	202,727
有 価 証 券 等 受 入 未 了 勘 定	271,787	436,170
短 期 借 入 金	2,609,120	2,830,083
コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー	253,500	287,900
一 年 以 内 償 還 社 債	172,791	104,472
未 払 費 用	31,456	46,783
未 払 法 人 税 等	3,859	1,128
賞 与 引 当 金	16,292	21,345
繰 延 税 金 負 債	35	6
そ の 他	18,372	5,420
固 定 負 債	1,044,125	1,075,460
社 債	529,257	597,701
長 期 借 入 金	508,116	469,287
繰 延 税 金 負 債	22	641
退 職 給 付 引 当 金	5,994	7,315
役 員 退 職 慰 労 引 当 金	652	468
そ の 他	82	46
特 別 法 上 の 準 備 金	1,416	2,027
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金	1,416	-
証 券 取 引 責 任 準 備 金	-	1,922
金 融 先 物 取 引 責 任 準 備 金	-	104
負 債 合 計	19,667,325	20,791,222
(純資産の部)		
株 主 資 本	344,623	360,796
資 本 金	250,000	395,146
資 本 剰 余 金	75,742	325,288
利 益 剰 余 金	18,881	359,638
評 価 ・ 換 算 差 額 等	71,823	30,303
そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	448	1,185
為 替 換 算 調 整 勘 定	71,375	31,489
少 数 株 主 持 分	404	538
純 資 産 合 計	273,204	331,031
負 債 ・ 純 資 産 合 計	19,940,530	21,122,253

四 半 期 連 結 損 益 計 算 書

(単位:百万円)

科 目	当第3四半期連結累計期間
	〔 自20.4.1 至20.12.31 〕
営 業 収 益	254,147
受 入 手 数 料	38,410
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	9,966
営 業 有 価 証 券 等 損 益	3,515
金 融 収 益	209,286
金 融 費 用	174,211
純 営 業 収 益	79,936
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	88,291
取 引 関 係 費	16,238
人 件 費	43,621
不 動 産 関 係 費	12,189
事 務 費	3,740
減 価 償 却 費	6,141
の れ ん 償 却 額	23
租 税 公 課	1,497
そ の 他	4,838
営 業 損 失	8,354
営 業 外 収 益	2,366
営 業 外 費 用	802
持 分 法 に よ る 投 資 損 失	30
そ の 他	772
経 常 損 失	6,790
特 別 利 益	2,321
特 別 損 失	3,552
税 金 等 調 整 前 四 半 期 純 損 失	8,020
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税	7,830
法 人 税 等 調 整 額	409
少 数 株 主 損 失 ( )	87
四 半 期 純 損 失	16,172

(参考)

## 前年四半期連結損益計算書

(単位:百万円)

科 目	前年第3四半期連結累計期間
	〔 自19.4.1 至19.12.31 〕
営 業 収 益	347,267
受 入 手 数 料	51,136
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	190,985
営 業 有 価 証 券 等 損 益	3,147
金 融 収 益	483,968
金 融 費 用	462,808
純 営 業 損 失	115,541
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	103,099
取 引 関 係 費	20,363
人 件 費	53,393
不 動 産 関 係 費	13,171
事 務 費	5,823
減 価 償 却 費	5,612
の れ ん 償 却 額	45
租 税 公 課	1,369
そ の 他	3,320
営 業 損 失	218,640
営 業 外 収 益	2,297
持 分 法 に よ る 投 資 利 益	572
そ の 他	1,725
営 業 外 費 用	4,354
経 常 損 失	220,698
特 別 利 益	20,071
特 別 損 失	6,990
税 金 等 調 整 前 四 半 期 純 損 失	207,617
法 人 税 、 住 民 税 及 び 事 業 税	3,585
法 人 税 等 調 整 額	14,497
少 数 株 主 利 益	4
四 半 期 純 損 失	196,709

## 【四半期連結財務諸表の作成について】

当社の四半期連結財務諸表は、「四半期連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」(平成19年内閣府令第64号、以下「四半期連結財務諸表規則」という。)ならびに同規則第61条および第82条の規定に基づき、「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)、「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)、および「特定金融会社等の会計の整理に関する内閣府令」(平成11年総理府・大蔵省令第32号)に準拠して作成しております。

## 【四半期連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項】

## 1. 連結の範囲に関する事項

連結子会社 ( 22 社)

## 主要な連結子会社の名称

みずほセキュリティーズアジアリミテッド  
株式会社日本投資環境研究所  
ブリッジフォード・グループ  
スイスマイズほ銀行  
みずほインターナショナル  
米国みずほ証券  
ベーシック・キャピタル・マネジメント株式会社  
瑞穂投資諮詢(上海)有限公司  
株式会社インダストリアル・ディシジョンズ  
みずほ証券・新光プリンシパルインベストメント株式会社

## 2. 持分法の適用に関する事項

持分法を適用した関連会社 ( 8 社)

## 主要な会社名

モバイル・インターネットキャピタル株式会社  
日本産業パートナーズ株式会社  
株式会社環境エネルギー投資

## 3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社のうち瑞穂投資諮詢(上海)有限公司ほか4社の決算日は、12月31日であります。連結財務諸表の作成に当たっては、1社を除き同社の第3四半期決算日現在の財務諸表を使用することとしております。ただし、同決算日から連結決算日までの期間に発生し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. 会計処理基準に関する事項

## (1) トレーディング商品に属する有価証券およびデリバティブ取引等の評価基準ならびに評価方法

当社および連結子会社は、有価証券市場における公正な価格形成および円滑な流通を目的としてトレーディングを行っており、保有するトレーディング・ポジションは、顧客の資金運用やリスク・ヘッジなどのニーズに対応する為に行う顧客との取引、自己の計算において行っている取引(ディーリング業務)および市場リスクを中心とした各種リスクを回避する為に行うヘッジ取引から発生しております。

トレーディング商品に属する有価証券およびデリバティブ取引等については、時価法を採用しております。

## (2) トレーディング関連以外の有価証券の評価基準および評価方法

その他有価証券等のうち、時価のあるものについては時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価(移動平均法による原価)ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入法を採用しております。

時価のないものについては移動平均法による原価法を採用しております。

なお、投資事業有限責任組合およびそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な直近の決算書に基づき、持分相当額を純額で取込む方法によっております。



(3) 重要な減価償却資産の減価償却の方法

有形固定資産

当社および国内連結子会社においては、定率法によっております。ただし、当社および国内連結子会社は、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く。)については定額法を採用しております。海外連結子会社は、主として定額法を採用しております。

無形固定資産

主として定額法を採用しております。なおソフトウェアの耐用年数は社内における利用可能期間(2年～10年)としております。

(4) 繰延資産の処理方法

社債発行費については、支出時に全額費用処理しております。

(5) 重要な引当金の計上基準

貸倒引当金

貸倒引当金は、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基づき、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上することとしております。

賞与引当金

賞与引当金は、従業員等に対する賞与の支払いに備えるため、各社所定の計算方法により算出した支払見積額のうち当第3四半期連結累計期間負担分を計上しております。

退職給付引当金

退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当連結会計年度末における退職給付債務および年金資産の見込額に基づき、当第3四半期末において発生していると認められる額を計上しております。

また、過去勤務債務および数理計算上の差異の費用処理方法は、以下のとおりであります。

過去勤務債務 : その発生連結会計年度に一時損益処理  
数理計算上の差異 : 各連結会計年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌連結会計年度から費用処理

役員退職慰労引当金

役員退職慰労引当金は、役員および執行役員の退職により支給する退職慰労金に備えるため、内規に基づく当第3四半期末要支給額を計上しております。

(6) 重要なヘッジ会計の方法

外貨建営業有価証券等の為替変動リスクをヘッジするための外貨建借入金については時価ヘッジ処理を採用しております。また、借入金の金利変動リスクをヘッジするための金利スワップ取引で、特例処理の要件を満たしているものについては特例処理を採用しております。

(7) その他四半期連結財務諸表作成のための重要な事項

消費税等の会計処理方法

消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

5. 連結子会社の資産および負債の評価に関する事項

連結子会社の資産および負債の評価については、全面時価評価法を採用しております。

【簡便な会計処理及び四半期連結財務諸表の作成にあたり適用した特有の会計処理】

(簡便な会計処理)

1. 減価償却費の算定方法

定率法を採用している有形固定資産については、年度に係る減価償却費の額を期間按分する方法により算定しております。

2. 税金費用の計算

法人税等につきましては、年度決算と同様の方法により計算しておりますが、納付税額の算出に係る加減算項目および税額控除項目は、重要性の高い項目に限定して適用しております。

(四半期連結財務諸表の作成にあたり適用した特有の会計処理)

該当事項はございません。

## 【四半期連結財務諸表作成のための基本となる重要な事項等の変更】

## 1. 四半期連結財務諸表の作成に関する事項

当連結会計年度より「四半期財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第12号)および「四半期財務諸表に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第14号)を適用しております。

## 2. リース取引に関する事項

所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号)および「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号)が平成20年4月1日以後開始する連結会計年度に係る四半期連結財務諸表から適用することができることになったため、当連結会計年度よりこれらの会計基準等を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、原則として、リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとする定率法を採用しております。

なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引について、会計処理の変更による影響額は特別損益として処理する方法によっております。これによる損益に与える影響は軽微であります。

## 3. 特別法上の準備金に関する事項

従来、証券取引責任準備金および金融先物取引責任準備金につきまして、金融商品取引法の施行に伴い、当連結会計年度より「金融商品取引責任準備金」として計上する方法に変更しております。この影響により、四半期純損失が113百万円減少しております。

## 4. 劣後債務の支払利息に関する事項

従来、劣後債務に係る支払利息につきましては、「営業外費用」に計上しておりましたが、資金使途の変化の実態をより正確に反映させるため、当連結会計年度より「金融費用」に計上しております。この変更により、従来と同様の方法によった場合と比べ、営業損失が3,326百万円増加しております。なお経常損失、税金等調整前四半期純損失に与える影響はありません。

## 【注記事項】

## (継続企業の前提に関する注記)

該当事項はございません。

## (株主資本の金額に著しい変動があった場合の注記)

剰余金の欠損填補を目的として、平成20年6月30日を効力発生日とした減資を行っております。この結果、資本金が145,146百万円、資本準備金が325,288百万円、利益準備金が870百万円それぞれ減少しております。なお、当第3四半期連結会計期間末において、資本金が250,000百万円、資本剰余金が75,742百万円、利益剰余金が18,881百万円となっております。

## 【四半期連結業績資料】

## 1. 手数料収入

## (1) 科目別内訳

(単位:百万円)

	前年第3四半期 連結累計期間	当第3四半期 連結累計期間	前年同期比 (%)	前 期
委 託 手 数 料	17,015	11,461	67.4%	20,039
( 株 券 等 )	( 11,316 )	( 6,936 )	( 61.3% )	( 13,326 )
( 債 券 等 )	( 5,689 )	( 4,521 )	( 79.5% )	( 6,701 )
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	13,183	10,789	81.8%	16,345
( 株 券 等 )	( 4,412 )	( 3,705 )	( 84.0% )	( 4,790 )
( 債 券 等 )	( 8,206 )	( 6,877 )	( 83.8% )	( 10,651 )
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	1,065	365	34.3%	2,134
( 株 券 等 )	( 420 )	( - )	( - )	( 855 )
( 債 券 等 )	( 125 )	( 7 )	( 5.6% )	( 371 )
( 受 益 証 券 )	( 434 )	( 76 )	( 17.6% )	( 500 )
その他の受入手数料	19,872	15,794	79.5%	36,722
合 計	51,136	38,410	75.1%	75,241

## (2) 商品別内訳

(単位:百万円)

	前年第3四半期 連結累計期間	当第3四半期 連結累計期間	前年同期比 (%)	前 期
株 券 等	16,287	10,758	66.1%	19,591
債 券 等	16,002	11,892	74.3%	20,197
受 益 証 券	3,020	1,824	60.4%	4,959
そ の 他	15,825	13,935	88.1%	30,492
合 計	51,136	38,410	75.1%	75,241

## 2. トレーディング損益

(単位:百万円)

	前年第3四半期 連結累計期間	当第3四半期 連結累計期間	前年同期比 (%)	前 期
株 券 等 ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	1,436	16,417	-	16,077
債 券 ・ 為 替 等 ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	192,421	26,383	-	397,182
合 計	190,985	9,966	-	413,259

(参考)

連結損益計算書の四半期推移

(単位:百万円)

科 目	前年第3四半期 連結会計期間	前年第4四半期 連結会計期間	当第1四半期 連結会計期間	当第2四半期 連結会計期間	当第3四半期 連結会計期間
	( 19.10.1 19.12.31 )	( 20.1.1 20.3.31 )	( 20.4.1 20.6.30 )	( 20.7.1 20.9.30 )	( 20.10.1 20.12.31 )
営 業 収 益	4,465	123,590	110,503	96,689	46,953
受 入 手 数 料	16,108	24,105	14,196	13,921	10,292
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	174,992	222,274	2,258	6,272	13,980
営 業 有 価 証 券 等 損 益	887	241	1,589	3,323	1,780
金 融 収 益	164,237	74,337	92,459	92,364	24,461
金 融 費 用	156,265	57,436	82,022	79,418	12,770
純営業収益又は純営業損失( )	151,799	181,026	28,481	17,271	34,183
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	34,315	30,626	31,844	31,147	25,299
取 引 関 係 費	4,908	7,209	5,924	7,012	3,302
人 件 費	18,944	11,404	15,720	12,894	15,006
不 動 産 関 係 費	4,626	4,609	4,531	4,084	3,573
事 務 費	1,843	2,054	1,445	1,641	652
減 価 償 却 費	2,159	2,059	2,272	2,036	1,832
の れ ん 償 却 額	15	7	-	23	-
租 税 公 課	507	725	390	520	586
そ の 他	1,311	2,557	1,557	2,934	345
営業利益又は営業損失( )	186,115	211,652	3,363	13,876	8,884
営 業 外 収 益	625	729	362	598	1,406
持 分 法 に よ る 投 資 利 益	185	181	32	32	-
そ の 他	439	910	330	630	1,406
営 業 外 費 用	1,781	2,051	4	708	89
持 分 法 に よ る 投 資 損 失	-	-	-	25	4
そ の 他	1,781	2,051	4	682	85
経常利益又は経常損失( )	187,272	212,974	3,004	13,986	10,201
特 別 利 益	18,358	190	1,208	1,221	108
特 別 損 失	771	6,169	3,059	244	247
税金等調整前四半期純利益又は 税金等調整前四半期純損失( )	169,685	219,334	4,856	13,010	9,845
法人税、住民税及び事業税	1,502	1,215	1,090	1,995	4,745
法人税等調整額	1,543	1,453	1,906	2,971	1,474
少数株主利益又は少数株主損失( )	3	43	49	25	12
四 半 期 純 利 益 又 は 四 半 期 純 損 失 ( )	169,647	221,960	7,802	12,007	3,638

(参考)  
【四半期個別財務諸表】

### 四 半 期 貸 借 対 照 表

(単位:百万円)

科 目	当第3四半期会計期間末 (20.12.31現在)	前事業年度末 (20.3.31現在)
(資産の部)		
流 動 資 産	9,728,628	12,476,240
現 金 ・ 預 金	51,607	39,462
預 託 金	51,515	16,915
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	5,649,228	7,543,860
商 品 有 価 証 券 等	4,769,450	7,002,202
貸 付 債 権	38,047	40,279
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	841,730	501,379
営 業 有 価 証 券 等	24,107	33,433
営 業 貸 付 債 権	0	2,012
信 用 取 引 資 産	362	1,974
有 価 証 券 担 保 貸 付 金	3,615,187	4,657,424
募 集 等 払 込 金	496	820
短 期 差 入 保 証 金	207,653	99,606
支 払 差 金 勘 定	-	8,644
短 期 貸 付 金	102,539	27,915
未 収 収 益	13,832	22,460
未 収 法 人 税 等	877	5,949
繰 延 税 金 資 産	7,511	11,497
そ の 他	3,711	4,267
貸 倒 引 当 金	1	4
固 定 資 産	251,261	218,791
有 形 固 定 資 産	9,155	10,435
建 物	2,747	2,846
器 具 ・ 備 品	6,408	7,588
無 形 固 定 資 産	13,096	12,370
ソ フ ト ウ ェ ア	13,049	12,320
そ の 他	47	49
投 資 そ の 他 の 資 産	229,008	195,986
投 資 有 価 証 券	4,585	7,260
関 係 会 社 株 式	169,434	148,781
関 係 会 社 長 期 貸 付 金	19,851	8,970
長 期 差 入 保 証 金	6,812	6,197
長 期 前 払 費 用	1,127	1,397
繰 延 税 金 資 産	25,866	22,018
そ の 他	2,501	1,361
貸 倒 引 当 金	1,169	0
資 産 合 計	9,979,889	12,695,032

(単位:百万円)

科 目	当第3四半期会計期間末 (20.12.31現在)	前事業年度末 (20.3.31現在)
(負債の部)		
流 動 負 債	8,895,250	11,561,216
ト レ ー デ ィ ン グ 商 品	3,408,378	4,155,816
商 品 有 価 証 券 等	2,614,829	3,655,375
デ リ バ テ ィ ブ 取 引	793,548	500,440
約 定 見 返 勘 定	128,773	197,253
信 用 取 引 負 債	2,533	7,771
有 価 証 券 担 保 借 入 金	2,357,820	4,118,380
預 り 金	10,160	14,974
受 入 保 証 金	91,133	34,789
有 価 証 券 等 受 入 未 了 勘 定	-	6
受 取 差 金 勘 定	1,208	-
短 期 借 入 金	2,500,093	2,658,236
コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー	253,500	287,900
一 年 以 内 償 還 社 債	122,300	65,700
前 受 金	51	11
未 払 費 用	16,140	16,698
賞 与 引 当 金	2,906	3,243
そ の 他	249	433
固 定 負 債	754,413	805,636
社 債	248,700	331,100
長 期 借 入 金	246,979	244,878
関 係 会 社 長 期 借 入 金	252,000	222,000
退 職 給 付 引 当 金	5,994	7,189
役 員 退 職 慰 労 引 当 金	651	468
そ の 他	89	-
特 別 法 上 の 準 備 金	1,416	2,027
金 融 商 品 取 引 責 任 準 備 金	1,416	-
証 券 取 引 責 任 準 備 金	-	1,922
金 融 先 物 取 引 責 任 準 備 金	-	104
負 債 合 計	9,651,081	12,368,880
(純資産の部)		
株 主 資 本	330,005	325,742
資 本 金	250,000	395,146
資 本 剰 余 金	75,742	325,288
資 本 準 備 金	-	325,288
そ の 他 資 本 剰 余 金	75,742	-
利 益 剰 余 金	4,263	394,692
利 益 準 備 金	-	870
そ の 他 利 益 剰 余 金	4,263	395,562
別 途 積 立 金	-	1,500
繰 越 利 益 剰 余 金	4,263	397,062
評 価 ・ 換 算 差 額 等	1,197	409
そ の 他 有 価 証 券 評 価 差 額 金	1,197	409
純 資 産 合 計	328,808	326,151
負 債 ・ 純 資 産 合 計	9,979,889	12,695,032

## 四 半 期 損 益 計 算 書

(単位:百万円)

科 目	当第3四半期累計期間 〔 自20.4.1 至20.12.31 〕
営 業 収 益	89,896
受 入 手 数 料	30,299
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	19,020
営 業 有 価 証 券 等 損 益	976
金 融 収 益	41,553
金 融 費 用	34,599
純 営 業 収 益	55,297
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	51,682
取 引 関 係 費	10,465
人 件 費	19,165
不 動 産 関 係 費	10,652
事 務 費	2,492
減 価 償 却 費	4,946
租 税 公 課	1,376
そ の 他	2,582
営 業 利 益	3,614
営 業 外 収 益	4,315
営 業 外 費 用	28
経 常 利 益	7,901
特 別 利 益	1,383
特 別 損 失	3,531
税 引 前 四 半 期 純 利 益	5,753
法 人 税、住 民 税 及 び 事 業 税	237
法 人 税 等 調 整 額	1,252
四 半 期 純 利 益	4,263

## 前年四半期損益計算書

(単位:百万円)

科 目	前年第3四半期累計期間
	〔 自19.4.1 〕 〔 至19.12.31 〕
営 業 収 益	84,455
受 入 手 数 料	41,739
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	3,103
営 業 有 価 証 券 等 損 益	3,405
金 融 収 益	36,206
金 融 費 用	31,077
純 営 業 収 益	53,377
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	59,982
取 引 関 係 費	17,112
人 件 費	21,007
不 動 産 関 係 費	10,925
事 務 費	4,161
減 価 償 却 費	3,745
の れ ん 償 却 額	45
租 税 公 課	1,315
そ の 他	1,668
営 業 損 失	6,604
営 業 外 収 益	9,864
営 業 外 費 用	4,043
経 常 損 失	783
特 別 利 益	18,368
特 別 損 失	192,027
税 引 前 四 半 期 純 損 失	174,442
法 人 税、住 民 税 及 び 事 業 税	1,094
法 人 税 等 調 整 額	782
四 半 期 純 損 失	174,754



【注記事項】

(四半期貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額	(当第3四半期会計期間末)	(前事業年度末)
	10,978 百万円	9,266 百万円
2. 劣後債務		
社債(一年以内償還社債を含む。)、短期借入金、長期借入金および関係会社長期借入金には「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)第176条に定める以下の劣後債務が含まれております。		
	(当第3四半期会計期間末)	(前事業年度末)
劣後特約付社債(社債)	40,000 百万円	40,000 百万円
劣後特約付借入金	266,000 百万円	236,000 百万円
(短期借入金・長期借入金・関係会社長期借入金)		
3. 「貸金業の規制等に関する法律」(昭和58年法律第32号)上の貸付債権残高	(当第3四半期会計期間末)	(前事業年度末)
	3,022 百万円	2,028 百万円

(四半期損益計算書関係)

1. 1株当たり四半期純利益	(当第3四半期累計期間)
	637 円 77銭
2. 特別損益の内訳	
特別利益	(当第3四半期累計期間)
投資有価証券売却益	606 百万円
金融商品取引責任準備金戻入	611 百万円
移転補償金	161 百万円
その他	4 百万円
特別損失	(当第3四半期累計期間)
固定資産除却損	146 百万円
リース資産売却損	40 百万円
投資有価証券売却損	0 百万円
ゴルフ会員権評価損	10 百万円
合併関連費用	1,449 百万円
希望退職に係る特別退職金	1,883 百万円

## 【四半期個別業績資料】

## 1. 手数料収入

## (1) 科目別内訳

(単位:百万円)

	前年第3四半期 累計期間	当第3四半期 累計期間	前年同期比 (%)	前 期
委託手数料	4,889	3,486	71.3%	6,274
(株券等)	(4,515)	(3,320)	(73.5%)	(5,823)
(債券等)	(356)	(157)	(44.2%)	(431)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	11,869	9,032	76.1%	14,725
(株券等)	(4,242)	(3,208)	(75.6%)	(4,537)
(債券等)	(7,064)	(5,618)	(79.5%)	(9,284)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	1,065	365	34.3%	2,145
(株券等)	(420)	(-)	(-)	(866)
(債券等)	(125)	(7)	(5.6%)	(371)
(受益証券)	(434)	(76)	(17.6%)	(500)
その他の受入手数料	23,915	17,414	72.8%	36,668
合 計	41,739	30,299	72.6%	59,813

## (2) 商品別内訳

(単位:百万円)

	前年第3四半期 累計期間	当第3四半期 累計期間	前年同期比 (%)	前 期
株券等	11,391	7,990	70.1%	13,976
債券等	13,937	9,194	66.0%	18,108
受益証券	3,027	1,829	60.4%	4,968
その他	13,382	11,285	84.3%	22,759
合 計	41,739	30,299	72.6%	59,813

## 2. トレーディング損益

(単位:百万円)

	前年第3四半期 累計期間	当第3四半期 累計期間	前年同期比 (%)	前 期
株券等トレーディング損益	4,556	18,760	-	12,362
債券等トレーディング損益	7,254	42,692	-	26,813
その他のトレーディング損益	5,801	4,911	-	12,783
(うち外国通貨に係る取引)	(5,358)	(3,042)	(-)	(13,737)
合 計	3,103	19,020	612.9%	26,393

## 3. 自己資本規制比率

(単位:百万円)

		前年 第 3 四 半 期 末	当 第 3 四 半 期 末	前 期 末	
基本的項目	(A)	337,960	328,808	325,742	
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	-	-	409	
	金融商品取引責任準備金等	2,027	1,416	2,027	
	一般貸倒引当金	12	1	4	
	長期劣後債務	128,000	161,000	153,000	
	短期劣後債務	100,000	132,941	123,000	
計	(B)	230,039	295,360	278,441	
控除資産	(C)	224,181	262,337	228,333	
控除後自己資本	(A) + (B) - (C)	(D)	343,818	361,830	375,849
リスク相当額	市場リスク相当額	111,874	78,051	90,833	
	取引先リスク相当額	15,109	31,470	21,171	
	基礎的リスク相当額	27,390	27,669	28,802	
	計	(E)	154,373	137,191	140,808
自己資本規制比率	(D)/(E)	222.7%	263.7%	266.9%	

(注) 1. 市場リスク相当額の算出に関しては、内部管理モデル方式を用いております。

2. 当第3四半期末の長期・短期劣後債務の内訳は以下の通りです。

(単位:百万円)

	発行日・借入日	償還・弁済期日	金額	区分	備考	
劣後特約付社債	平成16年3月19日	平成21年3月19日	40,000	短期	期限一括償還	
劣後特約付借入金	平成16年3月19日	平成21年3月19日	11,000	短期	最終弁済	
	平成17年3月29日	平成27年4月20日	20,000	長期	期限一括弁済	
	平成18年5月30日	平成28年5月30日	10,000	長期	期限一括弁済	
	平成18年5月30日	平成22年3月31日	5,000	5,000	短期	分割弁済
				5,000	短期	
				2,000	短期	
				3,000	長期	
	平成18年9月28日	平成22年9月28日	5,000	5,000	短期	分割弁済
				2,000	短期	
				3,000	長期	
				3,000	短期	
	平成19年1月31日	平成23年1月31日	5,000	5,000	短期	最終弁済
				5,000	短期	
				1,000	短期	
				4,000	長期	
	平成19年7月20日	平成23年7月20日	5,000	5,000	短期	最終弁済
				5,000	短期	
				1,000	短期	
				4,000	長期	
	平成20年3月28日	平成25年4月28日	10,000	2,000	短期	分割弁済
8,000				短期		
10,000				長期		
平成20年3月28日	平成26年4月28日	10,000	10,000	長期	最終弁済	
			10,000	長期		
			10,000	長期		
平成20年3月28日	平成24年2月28日	10,000	10,000	短期	分割弁済	
			15,000	短期		
平成20年9月30日	平成25年2月28日	15,000	15,000	短期	最終弁済	
			15,000	短期		
平成20年9月30日	平成24年9月28日	15,000	短期	期限一括弁済		
平成20年9月30日	平成26年9月30日	15,000	長期	期限一括弁済		
長期劣後債務計			161,000			
短期劣後債務計			145,000		(算入限度額 132,941百万円)	

## 損益計算書の四半期推移

(単位:百万円)

科 目	前年第3四半期 会計期間	前年第4四半期 会計期間	当第1四半期 会計期間	当第2四半期 会計期間	当第3四半期 会計期間
	( 19.10.1 ) ( 19.12.31 )	( 20.1.1 ) ( 20.3.31 )	( 20.4.1 ) ( 20.6.30 )	( 20.7.1 ) ( 20.9.30 )	( 20.10.1 ) ( 20.12.31 )
営 業 収 益	26,718	9,460	33,739	24,003	32,154
受 入 手 数 料	12,227	18,074	9,427	11,239	9,632
ト レ ー デ ィ ン グ 損 益	1,022	29,496	10,977	2,631	10,673
営 業 有 価 証 券 等 損 益	843	2,220	474	742	709
金 融 収 益	14,311	18,662	12,858	16,137	12,557
金 融 費 用	12,297	13,122	11,595	11,358	11,645
純営業収益又は純営業損失( )	14,420	3,661	22,143	12,644	20,508
販 売 費 ・ 一 般 管 理 費	19,172	19,986	18,125	17,412	16,144
取 引 関 係 費	4,838	4,544	3,504	3,642	3,319
人 件 費	6,791	7,006	7,290	5,571	6,303
不 動 産 関 係 費	3,923	4,197	3,888	3,557	3,206
事 務 費	1,166	1,244	785	1,069	637
減 価 償 却 費	1,474	1,740	1,729	1,543	1,673
の れ ん 償 却 額	15	15	-	-	-
租 税 公 課	482	697	360	466	549
そ の 他	480	541	567	1,561	453
営業利益又は営業損失( )	4,751	23,648	4,018	4,767	4,363
営 業 外 収 益	306	923	3,582	309	423
営 業 外 費 用	1,812	2,125	1	6	20
経常利益又は経常損失( )	6,258	24,850	7,599	4,464	4,766
特 別 利 益	18,362	83	1,210	162	10
特 別 損 失	191,379	247,047	3,055	238	238
税引前四半期純利益又は 税引前四半期純損失( )	179,275	271,813	5,755	4,540	4,539
法人税、住民税及び事業税	771	116	29	206	1
法人税等調整額	1,619	8,591	2,359	2,795	1,688
四半期純利益又は四半期純損失( )	178,427	263,106	3,366	1,951	2,848

# 〔ご参考〕証券化商品の状況（みずほ証券（含む海外現法）分）

## 1. 外貨建て証券化商品の状況

（単位：億円、概数）

[管理会計ベース]

◆みずほ証券（含む海外現法）…トレーディング勘定

	H20/3末 残高	H20/3末 マーク率 (%)	H20/12末 残高	H20/12末 マーク率 (%)	H20第3Q累計 実現損益
	(時価)	(時価÷額面)	(時価)	(時価÷額面)	(H20/4～12)
1 外貨建て証券化商品	1,050	22	*1 400	14	△90
2 ABSCDO、CDO	500	18	70	3	△60
3 RMBSを裏付資産とするもの	240	10	*2 70	3	△60
4 非投資適格先とのCDSによるヘッジ分	*3 110	*3 17	*3 -	*3 -	*3 -
5 その他のCDO	*4,5 260	*5 83	*5 -	*5 -	*5 0
6 事業法人向け債権を裏付資産とするもの	160	92	-	-	-
7 非投資適格先とのCDSによるヘッジ分	*3 -	*3 -	*3 -	*3 -	*3 -
8 CMBSを裏付資産とするもの	0	8	-	-	0
9 RMBS	530	27	10	2	△10
10 米国サブプライムRMBS	150	31	0	3	△0
11 上記以外のRMBS (ミッドプライムローン、プライムローン等を裏付資産とするもの)	*6 380	*6 26	*6 10	*6 2	*6 △10
12 ミッドプライムローン(Alt-A)	190	26	0	2	
13 ABS、CLO等	20	67	320	82	△20
14 CLO	*5 20	*5 73	*5 240	*5 84	*5 △20
15 CMBS	0	43	0	41	△0
16 SIV関連	-	-	*7 80	79	△0

\*1: H20/3 末比増減(約△650 億円)のうち、約△100 億円は為替影響(主として米ドルに対する円高要因)によるもの

\*2: 裏付資産に占める米国サブプライム関連資産の比率は約 1 割  
時価残高に占める最優先部分(スーパーシニアトランシェ)の比率は約 5 割

\*3: 非投資適格先(H20/3 末における外部格付を基準)の米国金融保証会社(モノライン)との間でクレジットデフォルトスワップ(CDS)によりヘッジを行っている部分(引当金控除後)のエクスポージャーを記載(なお当該ヘッジ取引は H20/8 に終了)

\*4: 全て一次証券化商品

\*5: 区分見直しにより、H20/3 末に項番 5 に計上していたものにつき、第 1 四半期決算資料より項番 14 に計上

\*6: 米国政府系機関債・政府支援機関債を除く(なお、当グループが保有するそれらの残高については「その他の関連情報」をご参照)

\*7: CDO 組成のため行っていたクレジットデフォルトスワップ(CDS)取引の決済に伴い、担保となっていた SIV 発行のシニア債券の受渡しにより取得したもの

(ご参考) 証券化商品に係るクレジットデフォルトスワップ(CDS)の状況(H20/12 末)

- みずほ証券における証券化商品を参照債権とするクレジットデフォルトスワップ(CDS)\*1の想定元本は約 3,300 億円(H20/3 末約 3,660 億円)、参照債権の時価評価額は約 2,330 億円(H20/3 末約 3,020 億円)。差額のうち、ヘッジ先に対する請求可能見積額は約 780 億円(ヘッジ先より当該差額に係るキャッシュ受領済み分(約 180 億円\*2)を除く)。なお、当該請求可能見積額から引当を除いた金額は約 620 億円(上記 CDS 契約のうち、米国モノライン(H20/12 末現在の外部格付 AA-\*3)をヘッジ先とする CDS 想定元本は約 750 億円、その参照債権の時価評価額は約 610 億円…いずれも内数)

※1 上記表項番 4 及び 7 に記載のものは除く

※2 外貨キャッシュ相当額を H20/12 末為替レートで換算

※3 格付は H20/12 末における外部格付のうち最も低い格付を基準に分類

- 上記 CDS 契約の大部分は、外部格付 AA 格以上の先(H20/12 末現在)をヘッジ先とするものであり、かつ、参照債権は主に事業法人向け債権を裏付資産とするもの

## 2. その他の関連情報(H20/12 末)

(計数は 10 億円ベースでの概数)

▶ 米国政府系機関債(ジニーメイ)、政府支援機関(GSE)債(ファニーメイ、フレディーマック)(トレーディング勘定)

- 米国政府系機関、GSE による住宅ローン担保証券(RMBS)の保有額は僅少

- 米連邦住宅抵当公社(ファニーメイ)及び米連邦住宅貸付抵当公社(フレディーマック)の発行する社債を、米国市場におけるマーケットメイク目的等で約 3,950 億円保有、全額時価評価を行っており含み損はなし(H20 年度 3Q(H20/4～12)における実現損益は僅少)

なお、これらの機関の株式は保有せず