

平成22年3月期 第1四半期決算短信

平成21年7月31日

上場会社名 みずほ証券株式会社

上場取引所 東 大名

コード番号 8606 URL <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) 主計部長 (氏名) 権田 哲也

TEL 03-5208-3210

四半期報告書提出予定日 平成21年8月14日

配当支払開始予定日 —

(百万円未満切捨て)

1. 平成22年3月期第1四半期の連結業績(平成21年4月1日～平成21年6月30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		四半期純利益	
	百万円	%	百万円	%	百万円	%	百万円	%	百万円	%
22年3月期第1四半期	95,325	—	77,361	—	28,030	—	28,891	—	129,514	—
21年3月期第1四半期	36,617	—	32,353	—	3,392	—	3,997	—	2,704	—

	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
	円 銭	円 銭
22年3月期第1四半期	97.31	—
21年3月期第1四半期	3.50	3.50

(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
22年3月期第1四半期	19,679,459	606,251	3.0	367.02
21年3月期	2,713,634	249,921	9.0	315.13

(参考) 自己資本 22年3月期第1四半期 583,031百万円 21年3月期 243,595百万円

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
21年3月期	—	—	—	3.00	3.00
22年3月期	—	—	—	—	—
22年3月期 (予想)	—	—	—	—	—

(注) 配当予想の当四半期における修正の有無 無

22年3月期の配当予想額は現時点で未定であります。

3. 平成22年3月期の連結業績予想(平成21年4月1日～平成22年3月31日)

(注) 連結業績予想数値の当四半期における修正の有無 無

証券業を主たる業務としている当社グループの業績は、株式市況等の影響により変動し易いため、業績予想は行っておりません。

4. 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) 有
新規 1社 (社名 みずほインターナショナル) 除外 1社 (社名)
(注)詳細は、4ページ【定性的情報・財務諸表等】4. その他をご覧ください。

(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、4ページ【定性的情報・財務諸表等】4. その他をご覧ください。

(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)

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
- ② ①以外の変更 有

(注)詳細は、5ページ【定性的情報・財務諸表等】4. その他をご覧ください。

(4) 発行済株式数(普通株式)

① 期末発行済株式数(自己株式を含む)	22年3月期第1四半期	1,626,688,683株	21年3月期	811,118,683株
② 期末自己株式数	22年3月期第1四半期	38,142,449株	21年3月期	38,116,521株
③ 期中平均株式数(四半期連結累計期間)	22年3月期第1四半期	1,330,886,039株	21年3月期第1四半期	773,173,952株

※業績予想の適切な利用に関する説明、その他特記事項

1. 当社は、期間業績に応じた柔軟な配当を実施していくことを基本的な考え方としておりますが、証券業を主たる業務としている当社グループは、株式市場等の影響により業績の変動が極めて大きく、適正な業績を予想することが困難なため、現時点では配当予想額は未定であります。
2. 当第1四半期連結累計期間(平成21年4月1日から平成21年6月30日まで)については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」(平成21年3月24日 内閣府令第5号)附則第7条第1項第1号ただし書きおよび第4号ただし書きにより、改正後の四半期連結財務諸表規則に基づいて作成しております。

(注記事項)

(1) 連結業績について

当社は、平成21年5月7日付で旧みずほ証券株式会社と合併しました。本合併は、企業結合会計上の逆取得に該当するため、当第1四半期については、旧みずほ証券株式会社の平成21年5月6日までの連結経営成績に、合併後のみずほ証券株式会社の平成21年5月7日以降の連結経営成績を合算したものとっております。そのため、「1. 平成22年3月期第1四半期の連結業績」の「(1) 連結経営成績(累計)」の対前年同四半期増減率は、記載を省略しております。

(2) 1株当たり四半期純利益について

平成21年4月1日から平成21年5月6日までは合併時に旧みずほ証券株式会社の株主に割り当てられた発行済株式数と、平成21年5月7日から平成21年6月30日までの合併後発行済株式数をもとに期中平均発行済株式数を計算し、1株当たり四半期純利益を算出しております。

【定性的情報・財務諸表等】

1. 連結経営成績に関する定性的情報

当第1四半期のわが国経済は、世界的な金融危機に端を発した景気後退が続くなか、内外での在庫調整の進展や政府の景気対策効果などに支えられる形で輸出や生産活動に下げ止まりから持ち直しの動きが出てきました。企業の設備や雇用の過剰感が根強いとみられますが、全体としては一層の景気後退に歯止めがかかる展開となりました。株式市場は、春先の世界同時株安から反発する動きとなり、日経平均株価は期初8,300円台でスタートした後、米国の金融安定化や景気回復期待を背景に戻りを試す展開が継続し、6月上旬には約8ヵ月ぶりに10,000円台を回復しました。その後は為替が円高に振れたこともあって上昇は一服し、9,900円台で期を終えました。債券市場は6月上旬にかけて株式市場の回復や米長期金利の上昇を背景に金利先高感が強まり、10年国債利回りは一時1.5%台半ばまで上昇しましたが、その後は良好な需給関係などに支えられて低下に転じ、期末は1.3%台後半で引けました。

一方、海外では、米国経済は大型景気対策への期待や金融市場が落ち着きを取り戻してきたことなどを背景に、景況感を中心に改善の動きが見られ、住宅販売にも底入れの動きが広がるなど、景気悪化に歯止めがかかってきました。また欧州でも、在庫調整の進展などにより企業景況感を中心に改善の動きが広がりました。株式市場は、米国では6月上旬にかけて反発の動きが続きましたが、期末にかけては景気の先行きに対する慎重な見方が再び広がるなか、上昇一服となりました。また、欧州も米国株の動向に同調する形での持ち直しの動きが期末にかけて足踏みする形となりました。債券市場は、欧米とも原油価格の上昇や財政赤字拡大懸念などから長期金利の上昇が続きましたが、期末にかけて株価の上値が重くなってきたことや投資マネーのリスク回避の動きもあって、落ち着いた動きとなりました。

当社は、平成21年5月7日に旧みずほ証券株式会社と合併し、同時に「みずほ証券株式会社」に商号変更を行い、新たな一步を踏み出しました。合併シナジーを早期に実現し、組織・営業体制を効率化するとともに、収益力を一層強化していくことが重要な課題となっております。

このような経営環境のもと、当社グループの連結営業収益は953億25百万円、経常利益は288億91百万円、四半期純利益は1,295億14百万円となりました。業績の概況は以下の通りであります。

(1) 受入手数料

受入手数料は、336億49百万円となりました。内訳は以下の通りであります。

・委託手数料

東証1・2部の日平均売買代金は1兆7,056億円となりました。当社の委託売買高は株数で33億65百万株、金額で2兆4,549億円となり、当社グループの株式委託手数料は65億3百万円を計上いたしました。

・引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料

株式発行市場におきましては、当社は新規上場企業1社を含む2社の株式の公募・売出しの引受けを主幹事として行いました。この結果、当社グループの株式引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は40億39百万円となりました。

一方、債券発行市場では、一般事業債で共同主幹事を含め34銘柄の主幹事、財投機関債でも14銘柄の主幹事を務めました。この結果、債券引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は51億22百万円となりました。

・募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料

これらの手数料は、投資信託の募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料が大半を占めております。

金融不安の後退や景気回復期待を背景に、信用リスク低下局面におけるメリットを享受すべく世界各国の転換社債に投資する投資信託「グローバルCBファンド」を導入し、新たに募集を行いました。

また、金融セクターに特化した投資信託や、BRICsなどの新興国に関連する投資信託を中心に、既存の投資信託の継続募集を行いました。

この結果、募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は30億83百万円となりました。

・その他の受入手数料

その他の受入手数料は、投資信託の信託報酬のほか、ラップ口座や年金保険の販売手数料、M&Aや株式公開に向けた各種コンサルティングに係る手数料等が含まれており、133億77百万円となりました。

(2) トレーディング損益

トレーディング損益は、株券等が13億82百万円、債券等・その他が312億9百万円となり、合計で325億92百万円となりました。

(3) 金融収支

金融収益292億20百万円から金融費用179億63百万円を差し引いた金融収支は、112億56百万円の利益となりました。

(4) 販売費及び一般管理費

販売費及び一般管理費は、合計で493億31百万円となりました。

(5) 特別損益

特別利益として負ののれん発生益1,102億19百万円等を計上し、特別損失に計上した合併関連費用29億19百万円、固定資産除却損6億5百万円等を差し引いた特別損益は、1,066億71百万円の利益となりました。

2. 連結財政状態に関する定性的情報

当第1四半期末における総資産は、旧みずほ証券株式会社との合併により、19兆6,794億59百万円となり、前連結会計年度末に比べて16兆9,658億25百万円増加しました。

流動資産は、前連結会計年度末比16兆8,176億48百万円増の19兆4,175億67百万円となりました。

負債は、前連結会計年度末比16兆6,094億94百万円増の19兆732億8百万円となりました。

純資産については、前連結会計年度末比3,563億30百万円増の6,062億51百万円となりました。この結果、自己資本比率は3.0%となりました。

3. 連結業績予想に関する定性的情報

証券業を主たる業務としている当社グループの業績は、株式市況等の影響により変動し易いため、業績予想を行っておりません。

4. 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）

平成21年5月7日付けで、旧みずほ証券株式会社と合併したことから、同社の子会社であったみずほインターナショナルについては、当第1四半期連結会計期間より連結の範囲に含めております。

(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

①簡便な会計処理

固定資産の減価償却費の算定方法

定率法等を採用している資産については、連結会計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。

②四半期連結財務諸表の作成に特有の会計処理

該当事項はありません。

(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

①会計基準等の改正に伴う変更
該当事項はありません。

②①以外の変更

1. 「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号平成20年12月26日)、「連結財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第22号平成20年12月26日)、「『研究開発費等に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第23号平成20年12月26日)、「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号平成20年12月26日)、「持分法に関する会計基準」(企業会計基準第16号平成20年12月26日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号平成20年12月26日)が平成21年4月1日以後開始する連結会計年度において最初に実施される企業結合及び事業分離等から適用することができることになったことに伴い、当第1四半期連結会計期間からこれらの会計基準等を適用しております。
2. 「連結財務諸表に関する会計基準」(企業会計基準第22号平成20年12月26日)に基づき「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」(平成21年3月24日内閣府令第5号)が平成21年4月1日以後開始する連結会計年度の期首から適用できることになったことに伴い、当第1四半期連結累計期間から「少数株主損益調整前四半期純利益」を表示しております。

5. 【四半期連結財務諸表】
 (1) 【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	148,383	172,838
預託金	82,300	42,297
トレーディング商品	6,828,799	1,317,692
商品有価証券等	5,905,962	1,294,088
貸付債権	36,583	—
デリバティブ取引	886,253	23,603
約定見返勘定	—	39,289
営業有価証券等	86,825	9,551
営業貸付債権	2,051	—
信用取引資産	50,997	31,502
信用取引貸付金	24,751	13,075
信用取引借証券担保金	26,245	18,426
有価証券担保貸付金	11,857,313	948,137
借入有価証券担保金	2,975,670	796,087
現先取引貸付金	8,881,643	152,050
立替金	3,201	739
有価証券等引渡未了勘定	26,375	—
短期貸付金	8,002	70
有価証券	8,464	7,627
繰延税金資産	11,511	4,130
その他の流動資産	303,897	26,571
貸倒引当金	△556	△530
流動資産計	19,417,567	2,599,918
固定資産		
有形固定資産	45,224	33,400
無形固定資産	112,990	28,221
投資その他の資産	103,677	52,094
投資有価証券	74,153	30,605
長期差入保証金	19,344	10,453
繰延税金資産	723	791
その他	14,031	13,171
貸倒引当金	△4,575	△2,926
固定資産計	261,892	113,716
資産合計	19,679,459	2,713,634

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	3,592,679	636,694
商品有価証券等	2,744,969	609,335
デリバティブ取引	847,710	27,358
約定見返勘定	134,460	—
信用取引負債	25,434	12,286
信用取引借入金	13,757	7,193
信用取引貸証券受入金	11,676	5,092
有価証券担保借入金	11,436,998	1,014,579
有価証券貸借取引受入金	1,834,929	667,767
現先取引借入金	9,602,068	346,811
預り金	63,645	31,976
受入保証金	215,365	17,527
有価証券等受入未了勘定	38,353	—
短期借入金	2,145,745	571,770
コマーシャル・ペーパー	188,900	81,500
1年内償還予定の社債	88,546	—
リース債務	1,319	96
未払法人税等	1,222	487
賞与引当金	9,286	2,754
役員賞与引当金	—	23
繰延税金負債	6	—
ポイント引当金	1,200	1,136
その他の流動負債	53,721	6,680
流動負債計	17,996,885	2,377,514
固定負債		
社債	478,296	33,000
長期借入金	574,423	40,300
リース債務	1,789	351
繰延税金負債	3,273	3,452
退職給付引当金	13,857	5,604
役員退職慰労引当金	291	796
執行役員退職慰労引当金	172	1,059
その他の固定負債	2,356	1,212
固定負債計	1,074,460	85,776
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	1,862	422
特別法上の準備金計	1,862	422
負債合計	19,073,208	2,463,713

(単位：百万円)

	当第1四半期連結会計期間末 (平成21年6月30日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	125,167	125,167
資本剰余金	389,660	82,973
利益剰余金	130,071	41,570
自己株式	△7,434	△7,426
株主資本合計	637,464	242,284
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,258	1,214
為替換算調整勘定	△57,691	95
評価・換算差額等合計	△54,433	1,310
少数株主持分	23,220	6,325
純資産合計	606,251	249,921
負債純資産合計	19,679,459	2,713,634

(2) 【四半期連結損益計算書】
【第1四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第1四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年6月30日)
営業収益		
受入手数料	15,396	33,649
委託手数料	5,748	7,937
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	415	9,250
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	3,192	3,083
その他の受入手数料	6,040	13,377
トレーディング損益	17,040	32,592
営業有価証券等損益	△17	△136
金融収益	4,197	29,220
営業収益計	36,617	95,325
金融費用	4,263	17,963
純営業収益	32,353	77,361
販売費及び一般管理費	28,961	49,331
取引関係費	4,425	7,570
人件費	13,257	24,797
不動産関係費	4,056	6,059
事務費	2,462	3,896
減価償却費	3,314	5,021
租税公課	367	510
貸倒引当金繰入れ	21	—
その他	1,055	1,475
営業利益	3,392	28,030
営業外収益	1,153	1,481
営業外費用	548	619
経常利益	3,997	28,891
特別利益	361	110,257
投資有価証券売却益	3	1
負ののれん発生益	—	110,219
在外子会社清算に伴う為替換算調整勘定取崩益	357	—
貸倒引当金戻入額	—	37
特別損失	316	3,586
固定資産除却損	33	605
投資有価証券売却損	0	1
投資有価証券評価損	6	8
ゴルフ会員権評価損	—	28
合併関連費用	254	2,919
金融商品取引責任準備金繰入れ	20	23
税金等調整前四半期純利益	4,042	135,563
法人税、住民税及び事業税	151	1,684
法人税等調整額	1,086	3,907
法人税等合計	1,238	5,591
少数株主損益調整前四半期純利益	—	129,971
少数株主利益	99	456
四半期純利益	2,704	129,514

(3) 継続企業の前提に関する注記

該当事項はありません。

(4) 株主資本の金額に著しい変動があった場合の注記

当社は、平成21年5月7日付けで旧みずほ証券株式会社と合併いたしました。本合併は企業結合会計上の逆取得に該当するため、当第1四半期連結累計期間の株主資本の期首残高は旧みずほ証券株式会社の連結期首残高となっております。そのため、前連結会計年度の株主資本の連結会計年度末残高と当第1四半期連結累計期間の株主資本の期首残高との間には連続性がなくなっております。

当第1四半期連結累計期間における株主資本の各項目の主な変動事由およびその金額は、次のとおりであります。

	株主資本（百万円）				
	資本金	資本 剰余金	利益 剰余金	自己株式	株主資本 合計
平成21年3月31日残高(注1.)	250,000	75,742	556	—	326,298
当第1四半期連結累計期間中の変動額					
四半期純利益			129,514		129,514
自己株式の取得				△5	△5
自己株式の処分		1		2	4
合併による増加(注2.)		313,916		△7,431	306,484
合併による減少(注2.)	△124,832				△124,832
当第1四半期連結累計期間中の変動額合計	△124,832	313,917	129,514	△7,434	311,166
平成21年6月30日残高	125,167	389,660	130,071	△7,434	637,464

注1. 「平成21年3月31日残高」は、旧みずほ証券株式会社の連結期首残高を記載しております。

注2. 「合併による増加」および「合併による減少」は、旧みずほ証券株式会社を取得企業、当社を被取得企業としてパーチェス法を適用したことによる増加および減少（被取得企業の取得原価等）であります。

(追加情報)

企業結合等関係

当社および旧みずほ証券株式会社は、両社の合併に関して、平成20年4月28日に「合併基本合意書」を締結、平成21年3月4日に「合併契約書」を締結し、平成21年5月7日に合併いたしました。

1. 被取得企業の名称および事業の内容、企業結合を行った主な理由、企業結合日、企業結合の法的形式、結合後企業の名称、取得企業を決定するに至った主な根拠

I. 被取得企業の名称および事業の内容

被取得企業	当社
事業の内容	金融商品取引業

II. 企業結合を行った主な理由 みずほフィナンシャルグループの一員として、銀行系の証券会社としての強みを生かし、先行きの不透明感の強い市場の中で競争力をつけるとともに、お客さまへのサービス提供力を向上させ、更には、グローバルベースで競争力のある最先端の総合金融サービスを提供できる体制への再構築が必要であると判断したため

III. 企業結合日 平成21年5月7日

IV. 企業結合の法的形式 当社を吸収合併存続会社とし、旧みずほ証券株式会社を吸収合併消滅会社とした合併

V. 結合後企業の名称 みずほ証券株式会社

VI. 取得企業を決定するに至った主な根拠 法的に消滅会社となる旧みずほ証券株式会社の株主である株式会社みずほコーポレート銀行が、本合併により新会社の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上は旧みずほ証券株式会社が取得企業に該当し、当社が被取得企業となったもの

2. 四半期連結財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間
平成21年5月7日から平成21年6月30日まで

3. 被取得企業の取得原価およびその内訳

取得の対価	旧みずほ証券株式会社の普通株式等	181,658百万円
取得に直接要した費用	アドバイザー費用等	118百万円
取得原価		181,777百万円

4. 株式の種類別の交換比率およびその算定方法ならびに交付した株式数

I. 株式の種類別の交換比率

当社の普通株式1株：旧みずほ証券株式会社の普通株式122株

II. その算定方法

旧みずほ証券株式会社および当社は、本合併に用いられる合併比率の算定にあたって公正性を期すため、それぞれ合併比率算定のための第三者評価機関を任命し、その算定結果を参考に、それぞれ両社の財務の状況、資産の状況等の要因を総合的に勘案し、両社で合併比率について慎重に協議を重ねた結果、最終的に上記合併比率が妥当であるとの判断に至り合意したもの

Ⅲ. 交付株式数

普通株式 815,570,000株

5. 発生した負ののれんの金額、発生原因、会計処理

Ⅰ. 発生した負ののれんの金額

110,219百万円

Ⅱ. 発生原因

連結財務諸表上、企業結合時の当社時価純資産が取得原価を上回ったため、当該差額を負ののれんとして認識したもの

Ⅲ. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）の早期適用により、負ののれんが生じた連結会計年度の利益として処理

6. 企業結合日に受け入れた資産および引き受けた負債の額ならびにその主な内訳

流動資産	2,132,487百万円
うち、トレーディング商品	1,008,003百万円
固定資産	190,825百万円
資産合計	2,323,312百万円
流動負債	1,911,981百万円
うち、トレーディング商品	671,840百万円
固定負債	111,036百万円
負債合計	2,023,440百万円

7. のれん以外の無形固定資産に配分された金額および主要な種類別の内訳ならびに全体および主要な種類別の加重平均償却期間

Ⅰ. 無形固定資産に配分された金額

73,949百万円

Ⅱ. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 73,949百万円

Ⅲ. 全体および主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16年

6. その他の情報

(1) 受入手数料

①科目別内訳 (単位：百万円)

	前年第1四半期	当第1四半期
	旧新光証券	
委託手数料	5,748	7,937
(株券)	(5,727)	(6,503)
(債券)	(8)	(1,419)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	415	9,250
(株券)	(72)	(4,039)
(債券)	(343)	(5,122)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	3,192	3,083
その他の受入手数料	6,040	13,377
合計	15,396	33,649

②商品別内訳 (単位：百万円)

	前年第1四半期	当第1四半期
	旧新光証券	
株券	5,859	10,779
債券	530	6,559
受益証券	7,412	5,399
その他	1,593	10,911
合計	15,396	33,649

(2) トレーディング損益

(単位：百万円)

	前年第1四半期	当第1四半期
	旧新光証券	
株券等	5,602	1,382
債券等・その他	11,438	31,209
(債券等)	(14,124)	(34,029)
(その他)	(△ 2,686)	(△ 2,819)
合計	17,040	32,592

(3) 自己資本規制比率

(単位：百万円)

		当第1四半期末	前期末
			旧新光証券
基 本 的 項 目 資 本 合 計 (A)		575,420	231,191
補 完 的 項 目	その他有価証券 評価差額金(評価益)等	2,898	1,544
	金融商品取引責任準備金等	1,839	397
	一般貸倒引当金	60	87
	長期劣後債務	166,000	17,000
	短期劣後債務	170,650	43,650
	計 (B)	341,448	62,679
控 除 資 産 (C)		334,450	88,274
固定化されていない自己資本の額 (A) + (B) - (C) (D)		582,417	205,596
リ ス ク 相 当 額	市場リスク相当額	82,008	25,767
	取引先リスク相当額	35,104	7,076
	基礎的リスク相当額	49,841	26,653
	計 (E)	166,953	59,497
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100		348.8 %	345.5 %

(注) 自己資本規制比率は単体の決算数値をもとに算出しております。

(4) 連結損益計算書の四半期推移

(単位：百万円)

科 目	前年第1四半期 〔20. 4. 1〕 〔20. 6. 30〕	前年第2四半期 〔20. 7. 1〕 〔20. 9. 30〕	前年第3四半期 〔20.10. 1〕 〔20.12.31〕	前年第4四半期 〔21. 1. 1〕 〔21. 3.31〕	当第1四半期 〔21. 4. 1〕 〔21. 6.30〕
	旧新光証券	旧新光証券	旧新光証券	旧新光証券	
営業収益	36,617	26,783	21,681	21,999	95,325
受入手数料	15,396	13,998	11,877	11,727	33,649
委託手数料	5,748	3,769	4,142	3,285	7,937
(株券)	(5,727)	(3,749)	(4,064)	(3,229)	(6,503)
(債券)	(8)	(5)	(26)	(22)	(1,419)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	415	498	904	378	9,250
(株券)	(72)	(181)	(72)	(45)	(4,039)
(債券)	(343)	(316)	(832)	(333)	(5,122)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	3,192	4,030	2,635	4,193	3,083
その他の受入手数料	6,040	5,700	4,195	3,869	13,377
トレーディング損益	17,040	9,047	6,628	6,826	32,592
株券等	5,602	408	598	1,624	1,382
債券等・その他	11,438	8,638	6,030	5,202	31,209
(債券等)	(14,124)	(4,995)	(△ 955)	(9,072)	(34,029)
(その他)	(△ 2,686)	(3,643)	(6,985)	(△ 3,870)	(△ 2,819)
営業有価証券等損益	△ 17	△ 533	△ 278	△ 426	△ 136
金融収益	4,197	4,270	3,454	3,872	29,220
金融費用	4,263	3,874	3,384	2,057	17,963
純営業収益	32,353	22,908	18,297	19,941	77,361
販売費及び一般管理費	28,961	27,317	26,973	26,134	49,331
取引関係費	4,425	4,000	3,923	3,254	7,570
人件費	13,257	12,184	11,979	11,876	24,797
不動産関係費	4,056	3,845	3,603	3,753	6,059
事務費	2,462	2,612	2,497	2,231	3,896
減価償却費	3,314	3,333	3,417	3,636	5,021
租税公課	367	276	199	186	510
その他	1,077	1,064	1,352	1,195	1,475
営業利益	3,392	△ 4,408	△ 8,676	△ 6,192	28,030
営業外収益	1,153	1,162	564	1,059	1,481
営業外費用	548	551	418	778	619
経常利益	3,997	△ 3,797	△ 8,530	△ 5,912	28,891
特別利益	361	1,892	4,084	248	110,257
特別損失	316	1,805	1,890	1,365	3,586
税金等調整前四半期純利益	4,042	△ 3,710	△ 6,335	△ 7,028	135,563
法人税、住民税及び事業税	151	254	△ 74	192	1,684
法人税等調整額	1,086	△ 1,411	215	△ 116	3,907
少数株主損益調整前四半期純利益	—	—	—	—	129,971
少数株主利益	99	94	△ 23	△ 32	456
四半期純利益	2,704	△ 2,647	△ 6,453	△ 7,071	129,514

【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1四半期 (21.6.30)	科 目	当第1四半期 (21.6.30)
(資産の部)		(負債の部)	
流動資産	9,059,606	流動負債	7,993,955
現金・預金	76,317	トレーディング商品	3,236,077
預託金	78,874	商品有価証券等	2,560,810
トレーディング商品	5,459,048	デリバティブ取引	675,266
商品有価証券等	4,625,268	信用取引負債	23,828
貸付債権	36,583	信用取引借入金	12,630
デリバティブ取引	797,196	信用取引貸証券受入金	11,198
約定見返勘定	72,127	有価証券担保借入金	2,318,064
営業有価証券等	32,660	有価証券貸借取引受入金	1,837,391
信用取引資産	47,151	現先取引借入金	480,672
信用取引貸付金	21,416	預り金	49,592
信用取引借証券担保金	25,735	受入保証金	76,672
有価証券担保貸付金	3,075,131	有価証券等受入未了勘定	8
借入有価証券担保金	2,975,974	短期借入金	2,016,025
現先取引貸付金	99,157	コマーシャル・ペーパー	188,900
立替金	845	1年内償還予定の社債	57,272
有価証券等引渡未了勘定	0	リース債務	1,248
短期貸付金	67,210	未払法人税等	299
繰延税金資産	10,383	賞与引当金	3,025
その他の流動資産	140,392	ポイント引当金	1,200
貸倒引当金	△ 539	関係会社整理損失引当金	890
固定資産	340,310	その他の流動負債	20,850
有形固定資産	17,408	固定負債	825,803
無形固定資産	38,632	社債	255,890
投資その他の資産	284,270	長期借入金	555,231
投資有価証券	223,998	リース債務	1,720
長期差入保証金	16,675	退職給付引当金	11,098
繰延税金資産	31,387	その他の固定負債	1,863
その他	16,123	特別法上の準備金	1,839
貸倒引当金	△ 3,914	金融商品取引責任準備金	1,839
		負債合計	8,821,597
		(純資産の部)	
		株主資本	575,420
		資本金	125,167
		資本剰余金	411,310
		利益剰余金	46,375
		自己株式	△ 7,432
		評価・換算差額等	2,898
		その他有価証券評価差額金	4,258
		繰延ヘッジ損益	△ 1,359
		純資産合計	578,318
資産合計	9,399,916	負債純資産合計	9,399,916

(注) この四半期貸借対照表は、四半期財務諸表等規則に基づいて作成しておりますが、法定開示におけるレビュー対象ではありません。

四半期損益計算書

(単位：百万円)

科 目	当第1四半期
	(21. 4. 1 21. 6. 30)
営業収益	54,957
受入手数料	29,028
トレーディング損益	19,541
営業有価証券等損益	△ 168
金融収益	6,554
金融費用	4,698
純営業収益	50,258
販売費・一般管理費	36,888
取引関係費	5,290
人件費	15,408
不動産関係費	5,702
事務費	4,759
減価償却費	4,406
租税公課	433
その他	887
営業利益	13,369
営業外収益	887
営業外費用	81
経常利益	14,175
特別利益	78
投資有価証券売却益	14
貸倒引当金戻入	64
特別損失	4,856
固定資産売却損	0
固定資産除却損	610
投資有価証券売却損	3
投資有価証券評価損	6
ゴルフ会員権評価損	28
過年度減価償却費	1,634
合併関連費用	2,547
金融商品取引責任準備金繰入	24
税引前四半期純利益	9,397
法人税、住民税及び事業税	30
法人税等調整額	△ 6,079
四半期純利益	15,447

(注) この四半期損益計算書は、四半期財務諸表等規則に基づいて作成しておりますが、法定開示におけるレビュー対象ではありません。

〔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

[管理会計ベース]

(単位:億円、概数)

◆みずほ証券(含む海外現法)…トレーディング勘定

	H21/3末		H21/6末		H21年度累計 実現損益
	残高	マーク率 (%)	残高	マーク率 (%)	
	(時価)	(時価÷額面)	(時価)	(時価÷額面)	(H21/4~ H21/6)
1 外貨建て証券化商品	390	12	*1 360	11	10
2 ABSCDO、CDO	60	2	10	0	△0
3 RMBSを裏付資産とするもの	60	2	*2 10	0	△0
4 その他のCDO	-	-	-	-	0
5 事業法人向け債権を裏付資産とするもの	-	-	-	-	-
6 CMBSを裏付資産とするもの	-	-	-	-	0
7 RMBS	10	1	0	1	0
8 米国サブプライムRMBS	0	2	0	1	△0
9 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)	*3 10	*3 1	*3 0	*3 1	*3 0
10 ミッドプライムローン(Alt-A)	0	1	0	1	
11 ABS、CLO等	320	79	350	80	10
12 CLO	240	83	240	82	△0
13 CMBS	0	14	0	14	△0
14 SIV関連	*4 80	72	*4 110	78	10

*1: H21/3 末比増減(約△30 億円)のうち、約△10 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 2 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 4 割

*3: 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)

*4: 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(H21/6 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)の想定元本は、約 2,650 億円(H21/3 末約 2,980 億円)、参照債権の時価評価額は約 2,220 億円(H21/3 末約 2,080 億円)。ヘッジ先に対する請求可能見積額は差額の約 430 億円。なお、当該請求可能見積額から引当(約 100 億円)を除いた金額は約 330 億円。

(上記 CDS 契約のうち、米国モノライン(H21/6 末現在の外部格付 AA-^{*1})をヘッジ先とする CDS 想定元本は約 210 億円、その参照債権の時価評価額は約 160 億円…いずれも内数)

※1 格付は H21/6 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 契約の想定元本のうち、4 割超は外部格付 AA 格相当以上の先(H21/6 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(H21/6 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 1,370 億円保有、全額時価評価を行っており含み損はなし(H21 年度第 1 四半期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