

平成22年3月期 第3四半期決算短信

平成22年1月29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22年2月12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3四半期の連結業績(平成21年4月1日～平成21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		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3四半期	241,201	—	194,396	—	32,026	—	33,677	—	129,912	—
21年3月期第3四半期	85,081	—	73,559	—	△9,669	—	△8,307	—	△6,396	—

	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3四半期	86.46	86.42
21年3月期第3四半期	△8.27	—

(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3四半期	20,989,683	602,530	2.8	364.55
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3四半期 579,082百万円 21年3月期 243,595百万円

2. 配当の状況

	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	合計
	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やすいため、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(1)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(2)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(3)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3四半期	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3四半期	38,183,575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3四半期	1,502,641,587株	21年3月期第3四半期	773,113,793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3四半期連結累計期間(平成21年4月1日から平成21年12月31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3四半期については、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3四半期の連結業績」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12月31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3四半期連結累計期間のわが国経済は、アジアを始めとする海外経済の回復や景気対策の効果などによって景気後退に歯止めがかかり、輸出や生産活動が持ち直しの動きとなりました。一方で、企業による設備投資や雇用の抑制姿勢が続いたため、内需の回復は緩やかに留まりました。株式市場は、日経平均株価が期初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上昇、6月上旬に10,000円台を回復しました。夏場には為替が円高に振れたこともあって9,000円台割れ目前まで下落する場面もありましたが、8月下旬に平成20年10月上旬以来の高値となる10,639円まで回復しました。その後、政権交代による先行き不透明感や円高の進行、さらにエクイティ・ファイナンス増加による需給悪化懸念などから株価が再度下押しされる場面もありましたが、年末にかけては政府・日銀の政策協調や円高一服を好感する形で株価は持ち直し、10,500円台で期を終えました。債券市場は6月上旬に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%台半ばまで上昇した後、9月末に向けては良好な需給関係や海外金利の安定などに支えられて1.2%台まで低下しました。秋以降は、財政悪化懸念や海外の出口戦略の早期実施観測などを背景に11月上旬には1.4%台後半まで上昇する場面もありましたが、期末にかけては日銀の金融緩和姿勢継続などに支えられて再び低位での推移となり、1.2%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の安定化などを背景に企業景況感の改善の動きが継続したほか、個人消費や住宅販売も持ち直しの動きとなりました。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続きました。株式市場は、米国では企業収益の回復期待や投資家のリスク許容度の回復を背景に下値を切り上げながら上昇が継続しました。また、欧州も米国株の動向に同調する形で持ち直しの動きが続きました。債券市場は、欧米とも期末に発生したドバイ・ショックをきっかけに、投資マネーの安全資産への還流で利回りが低下する場面もありましたが、金融政策の出口戦略の時期を巡る思惑や財政赤字拡大による需給悪化懸念などを背景に、レンジの高値圏で期を終えました。

このような環境下、当社グループの連結営業収益は2,412億1百万円、経常利益は336億77百万円、四半期純利益は1,299億12百万円となりました。業績の概況は以下のとおりであります。

(1) 受入手数料

受入手数料は、1,048億90百万円となりました。内訳は以下のとおりであります。

・委託手数料

東証1・2部の一日平均売買代金は1兆5,504億円となりました。当社の委託売買高は株数で110億25百万株、金額で7兆7,960億円となり、当社グループの株式委託手数料は205億51百万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8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159億98百万円となりました。

一方、債券発行市場では、一般事業債で共同主幹事を含め102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138億98百万円となりました。

・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や良好なインカム収益を享受すべく、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」や、ハイブリッド証券に投資する「みずほハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)」を導入し、新たに募集を行いました。

また、主にイベント・ドリブン型戦略による投資収益を享受し、償還時に豪ドル建て元本の確保を目指す外国投信「豪ドル建満期時元本確保型dbX-ポールソン・パフォーマンス連動ファンド(2009-10)」や、不動産証券市場の回復及び成長期待からの収益を追求する「みずほ世界不動産投信(通貨選択型)」の募集を行いました。

この他、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161億52百万円となりました。

・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、337億23百万円となりました。

(2) トレーディング損益

トレーディング損益は、株券等が161億34百万円、債券等・その他が422億5百万円となり、合計で583億40百万円となりました。

(3) 金融収支

金融収益780億81百万円から金融費用468億5百万円を差し引いた金融収支は、312億76百万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1,623億69百万円となりました。

(5) 特別損益

特別利益は、当第1四半期連結累計期間で計上した負ののれん発生益1,102億19百万円を含め1,111億51百万円となり、特別損失に計上した合併関連費用50億52百万円、固定資産除却損14億20百万円等を差し引いた特別損益は、1,043億82百万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3四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、20兆9,896億83百万円となり、前連結会計年度末に比べて18兆2,760億49百万円増加しました。

流動資産は、前連結会計年度末比18兆1,342億59百万円増の20兆7,341億77百万円となりました。

負債は、前連結会計年度末比17兆9,234億39百万円増の20兆3,871億53百万円となりました。

純資産については、前連結会計年度末比3,526億9百万円増の6,025億30百万円となりました。この結果、自己資本比率は2.8%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やすいため、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3四半期連結会計期間末 (平成21年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	141,396	172,838
預託金	77,003	42,297
トレーディング商品	7,520,116	1,317,692
商品有価証券等	6,670,046	1,294,088
貸付債権	26,476	—
デリバティブ取引	823,593	23,603
約定見返勘定	—	39,289
営業有価証券等	86,625	9,551
営業貸付債権	3,561	—
信用取引資産	55,894	31,502
信用取引貸付金	27,559	13,075
信用取引借証券担保金	28,334	18,426
有価証券担保貸付金	12,415,868	948,137
借入有価証券担保金	3,644,543	796,087
現先取引貸付金	8,771,324	152,050
立替金	2,786	739
有価証券等引渡未了勘定	91,972	—
短期貸付金	8,061	70
有価証券	81,250	7,627
繰延税金資産	17,863	4,130
その他の流動資産	232,289	26,571
貸倒引当金	△511	△530
流動資産計	20,734,177	2,599,918
固定資産		
有形固定資産	44,392	33,400
無形固定資産	107,132	28,221
投資その他の資産	103,981	52,094
投資有価証券	75,263	30,605
長期差入保証金	17,726	10,453
繰延税金資産	2,383	791
その他	12,953	13,171
貸倒引当金	△4,345	△2,926
固定資産計	255,506	113,716
資産合計	20,989,683	2,713,634

(単位：百万円)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成21年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成21年3月31日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	4,140,735	636,694
商品有価証券等	3,372,407	609,335
デリバティブ取引	768,328	27,358
約定見返勘定	233,397	—
信用取引負債	19,361	12,286
信用取引借入金	11,205	7,193
信用取引貸証券受入金	8,156	5,092
有価証券担保借入金	10,357,641	1,014,579
有価証券貸借取引受入金	1,018,154	667,767
現先取引借入金	9,339,486	346,811
預り金	75,427	31,976
受入保証金	178,031	17,527
有価証券等受入未了勘定	96,803	—
短期借入金	3,756,489	571,770
コマーシャル・ペーパー	319,600	81,500
1年内償還予定の社債	73,682	—
リース債務	1,050	96
未払法人税等	1,238	487
賞与引当金	17,508	2,754
役員賞与引当金	—	23
繰延税金負債	76	—
ポイント引当金	822	1,136
その他の流動負債	34,732	6,680
流動負債計	19,306,598	2,377,514
固定負債		
社債	504,359	33,000
長期借入金	543,563	40,300
リース債務	1,388	351
繰延税金負債	11,862	3,452
退職給付引当金	14,603	5,604
役員退職慰労引当金	328	796
執行役員退職慰労引当金	176	1,059
その他の固定負債	2,323	1,212
固定負債計	1,078,606	85,776
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	1,947	422
特別法上の準備金計	1,947	422
負債合計	20,387,153	2,463,713

(単位：百万円)

	当第3四半期連結会計期間末 (平成21年12月31日)	前連結会計年度末に係る 要約連結貸借対照表 (平成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	130,469	41,570
自己株式	△7,447	△7,426
株主資本合計	637,849	242,284
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,455	1,214
為替換算調整勘定	△62,222	95
評価・換算差額等合計	△58,767	1,310
新株予約権	372	—
少数株主持分	23,075	6,325
純資産合計	602,530	249,921
負債純資産合計	20,989,683	2,713,634

(2) 【四半期連結損益計算書】
【第3四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年12月31日)
営業収益		
受入手数料	41,272	104,890
委託手数料	13,659	24,903
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	1,818	30,110
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	9,858	16,152
その他の受入手数料	15,936	33,723
トレーディング損益	32,717	58,340
営業有価証券等損益	△829	△111
金融収益	11,921	78,081
営業収益計	85,081	241,201
金融費用	11,522	46,805
純営業収益	73,559	194,396
販売費・一般管理費	83,228	162,369
取引関係費	12,349	25,341
人件費	37,421	78,205
不動産関係費	11,506	19,853
事務費	7,572	13,554
減価償却費	10,064	17,676
租税公課	843	1,993
貸倒引当金繰入れ	372	—
その他	3,097	5,744
営業利益又は営業損失(△)	△9,669	32,026
営業外収益	2,881	2,890
営業外費用	1,519	1,239
経常利益又は経常損失(△)	△8,307	33,677

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年12月31日)
特別利益	6,284	111,151
固定資産売却益	—	8
投資有価証券売却益	5,596	885
関係会社清算益	61	—
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	—	38
金融商品取引責任準備金戻入	268	—
特別損失	3,982	6,769
固定資産売却損	—	0
固定資産除却損	282	1,420
投資有価証券売却損	33	13
投資有価証券評価損	2,616	148
ゴルフ会員権評価損	10	25
合併関連費用	1,039	5,052
金融商品取引責任準備金繰入れ	—	108
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(△)	△6,004	138,060
法人税、住民税及び事業税	331	3,523
法人税等調整額	△109	4,335
法人税等合計	221	7,858
少数株主損益調整前四半期純利益	—	130,201
少数株主利益	170	288
四半期純利益又は四半期純損失(△)	△6,396	129,912

(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) セグメント情報

【事業の種類別セグメント情報】

前第3四半期連結累計期間(自平成20年4月1日至平成20年12月31日)および当第3四半期連結累計期間(自平成21年4月1日至平成21年12月31日)

当企業集団は、①有価証券の売買等、②有価証券の売買等の委託の媒介、③有価証券の引受および売出し、④有価証券の募集および売出しの取扱い、⑤有価証券の私募の取扱いなどの証券業を中心とする営業活動をグローバルに展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。従って、当企業集団の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一のセグメントに属しているため、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

【所在地別セグメント情報】

前第3四半期連結累計期間(自平成20年4月1日至平成20年12月31日)

全セグメントの営業収益の合計および全セグメントの資産の金額の合計額に占める本邦の割合が、いずれも90%を超えているため、所在地別セグメント情報の記載を省略しております。

当第3四半期連結累計期間(自平成21年4月1日至平成21年12月31日)

	日本 (百万円)	アジア (百万円)	欧州 (百万円)	米州 (百万円)	計 (百万円)	消去又は 全社 (百万円)	連結 (百万円)
純営業収益							
(1) 外部顧客からの 純営業収益	141,383	2,127	26,557	24,327	194,396	—	194,396
(2) セグメント間の内部 純営業収益	4,587	1,134	3,145	602	9,469	(9,469)	—
計	145,970	3,261	29,702	24,930	203,865	(9,469)	194,396
営業利益又は 営業損失(△)	17,151	△464	8,962	5,900	31,550	475	32,026

(注) 1. 国又は地域の区分は地理的近接度によっております。

2. 日本以外の区分に属する主な国又は地域
- (1) アジア・・・中国、シンガポール
 - (2) 欧州・・・イギリス、スイス等
 - (3) 米州・・・アメリカ

【海外売上高(純営業収益)】

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

海外営業収益が連結営業収益の10%未満のため、海外営業収益の記載を省略しております。

当第3四半期連結累計期間(自 平成21年4月1日 至 平成21年12月31日)

	アジア	欧州	米州	計
海外売上高(純営業収益) (百万円)	1,998	23,969	25,926	51,895
連結売上高(純営業収益) (百万円)				194,396
連結売上高(純営業収益)に占める海外売上高(純営業収益)の割合(%)	1.0	12.3	13.3	26.7

- (注) 1. 国又は地域の区分は地理的近接度によっております。
 2. 日本以外の区分に属する主な国又は地域
 (1) アジア・・・中国、シンガポール
 (2) 欧州・・・イギリス、スイス等
 (3) 米州・・・アメリカ
 3. 海外売上高(純営業収益)は、当社及び連結子会社の本邦以外の国又は地域における純営業収益であります。

(5) 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3四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3四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3四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3四半期連結累計期間中の変動額					
四半期純利益			129,912		129,912
自己株式の取得				△19	△19
自己株式の処分		2		3	5
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3四半期連結累計期間中の変動額合計	△124,832	313,918	129,912	△7,447	311,551
平成21年12月31日残高	125,167	389,660	130,469	△7,447	637,849

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。

6. その他の情報

(1) 受入手数料

①科目別内訳

(単位：百万円)

	前第3四半期 連結累計期間	当第3四半期 連結累計期間
	旧新光証券	
委託手数料	13,659	24,903
（株券）	（ 13,541 ）	（ 20,551 ）
（債券）	（ 39 ）	（ 4,285 ）
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	1,818	30,110
（株券）	（ 325 ）	（ 15,998 ）
（債券）	（ 1,492 ）	（ 13,898 ）
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	9,858	16,152
その他の受入手数料	15,936	33,723
合計	41,272	104,890

②商品別内訳

(単位：百万円)

	前第3四半期 連結累計期間	当第3四半期 連結累計期間
	旧新光証券	
株券	14,129	37,435
債券	1,940	19,141
受益証券	20,673	25,520
その他	4,527	22,793
合計	41,272	104,890

(2) トレーディング損益

(単位：百万円)

	前第3四半期 連結累計期間	当第3四半期 連結累計期間
	旧新光証券	
株券等	6,610	16,134
債券等・その他	26,106	42,205
（債券等）	（ 18,164 ）	（ 36,741 ）
（その他）	（ 7,942 ）	（ 5,464 ）
合計	32,717	58,340

(3) 自己資本規制比率

(単位：百万円)

		当第3四半期末	前 期 末
			旧新光証券
基 本 的 項 目 資 本 合 計 (A)		576,037	231,191
補 完 的 項 目	その他有価証券 評価差額金(評価益)等	4,371	1,544
	金融商品取引責任準備金等	1,924	397
	一般貸倒引当金	56	87
	長期劣後債務	151,000	17,000
	短期劣後債務	185,650	43,650
計 (B)		343,003	62,679
控 除 資 産 (C)		329,466	88,274
固定化されていない自己資本の額 (A) + (B) - (C) (D)		589,575	205,596
リ ス ク 相 当 額	市場リスク相当額	74,982	25,767
	取引先リスク相当額	32,699	7,076
	基礎的リスク相当額	47,068	26,653
	計 (E)	154,750	59,497
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100		380.9 %	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〕	当第2四半期 〔21.7.1〕 〔21.9.30〕	当第3四半期 〔21.10.1〕 〔21.12.31〕
	旧新光証券	旧新光証券			
営 業 収 益	21,681	21,999	95,325	80,372	65,503
受 入 手 数 料	11,877	11,727	33,649	39,478	31,761
委 託 手 数 料	4,142	3,285	7,937	9,055	7,910
(株 券)	(4,064)	(3,229)	(6,503)	(7,826)	(6,221)
(債 券)	(26)	(22)	(1,419)	(1,207)	(1,658)
引受け・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の手数料	904	378	9,250	12,532	8,328
(株 券)	(72)	(45)	(4,039)	(8,092)	(3,866)
(債 券)	(832)	(333)	(5,122)	(4,396)	(4,379)
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	2,635	4,193	3,083	6,547	6,521
その他の受入手数料	4,195	3,869	13,377	11,343	9,002
トレーディング損益	6,628	6,826	32,592	16,350	9,397
株 券 等	598	1,624	1,382	2,862	11,890
債 券 等 ・ そ の 他	6,030	5,202	31,209	13,488	△ 2,492
(債 券 等)	(△ 955)	(9,072)	(34,029)	(8,289)	(△ 5,577)
(そ の 他)	(6,985)	(△ 3,870)	(△ 2,819)	(5,199)	(3,085)
営業有価証券等損益	△ 278	△ 426	△ 136	115	△ 89
金 融 収 益	3,454	3,872	29,220	24,428	24,433
金 融 費 用	3,384	2,057	17,963	14,470	14,370
純 営 業 収 益	18,297	19,941	77,361	65,901	51,132
販 売 費 及 び 一 般 管 理 費	26,973	26,134	49,331	56,186	56,851
取 引 関 係 費	3,923	3,254	7,570	8,477	9,293
人 件 費	11,979	11,876	24,797	26,987	26,420
不 動 産 関 係 費	3,603	3,753	6,059	6,950	6,843
事 務 費	2,497	2,231	3,896	4,661	4,995
減 価 償 却 費	3,417	3,636	5,021	6,230	6,424
租 税 公 課	199	186	510	722	760
そ の 他	1,352	1,195	1,475	2,156	2,113
営 業 利 益	△ 8,676	△ 6,192	28,030	9,715	△ 5,719
営 業 外 収 益	564	1,059	1,481	744	665
営 業 外 費 用	418	778	619	339	280
経 常 利 益	△ 8,530	△ 5,912	28,891	10,120	△ 5,334
特 別 利 益	4,084	248	110,257	△ 34	928
特 別 損 失	1,890	1,365	3,586	1,584	1,598
税金等調整前四半期純利益	△ 6,335	△ 7,028	135,563	8,501	△ 6,004
法人税、住民税及び事業税	△ 74	192	1,684	1,017	821
法 人 税 等 調 整 額	215	△ 116	3,907	1,019	△ 591
少数株主損益調整前四半期純利益	—	—	129,971	6,464	△ 6,234
少 数 株 主 利 益	△ 23	△ 32	456	267	△ 435
四 半 期 純 利 益	△ 6,453	△ 7,071	129,514	6,196	△ 5,799

【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 (21.12.31)	科 目	当第3四半期 (21.12.31)
(資産の部)		(負債の部)	
流動資産	10,497,393	流動負債	9,390,729
現金・預金	89,032	トレーディング商品	3,672,231
預託金	74,469	商品有価証券等	3,009,343
トレーディング商品	6,369,980	デリバティブ取引	662,888
商品有価証券等	5,580,081	約定見返勘定	139,495
貸付債権	26,476	信用取引負債	18,300
デリバティブ取引	763,422	信用取引借入金	10,242
営業有価証券等	30,663	信用取引貸証券受入金	8,058
信用取引資産	51,744	有価証券担保借入金	1,426,151
信用取引貸付金	23,508	有価証券貸借取引受入金	1,021,403
信用取引借証券担保金	28,235	現先取引借入金	404,748
有価証券担保貸付金	3,671,713	預り金	58,828
借入有価証券担保金	3,645,715	受入保証金	76,718
現先取引貸付金	25,998	有価証券等受入未了勘定	25
立替金	513	短期借入金	3,597,290
短期貸付金	57,051	コマースナル・ペーパー	319,600
繰延税金資産	16,845	1年内償還予定の社債	54,735
その他の流動資産	135,873	リース債務	992
貸倒引当金	△ 495	未払法人税等	654
固定資産	330,397	賞与引当金	5,707
有形固定資産	17,427	ポイント引当金	822
無形固定資産	34,400	関係会社整理損失引当金	4
投資その他の資産	278,569	その他の流動負債	19,169
投資有価証券	228,906	固定負債	854,726
長期差入保証金	15,388	社債	311,636
繰延税金資産	23,257	長期借入金	527,696
その他	14,735	リース債務	1,345
貸倒引当金	△ 3,717	退職給付引当金	12,201
		その他の固定負債	1,847
		特別法上の準備金	1,924
		金融商品取引責任準備金	1,924
		負債合計	10,247,380
		(純資産の部)	
		株主資本	576,037
		資本金	125,167
		資本剰余金	411,310
		利益剰余金	47,005
		自己株式	△ 7,445
		評価・換算差額等	3,999
		その他有価証券評価差額金	4,441
		繰延ヘッジ損益	△ 442
		新株予約権	372
		純資産合計	580,409
資産合計	10,827,790	負債純資産合計	10,827,790

(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3四半期 〔21. 4. 1〕 〔21. 12. 31〕
営業収益	161,487
受入手数料	86,642
トレーディング損益	51,363
営業有価証券等損益	△ 1,514
金融収益	24,995
金融費用	17,921
純営業収益	143,566
販売費・一般管理費	126,171
取引関係費	20,709
人件費	51,278
不動産関係費	18,596
事務費	16,734
減価償却費	14,353
租税公課	1,762
その他	2,736
営業利益	17,394
営業外収益	1,811
営業外費用	164
経常利益	19,042
特別利益	177
投資有価証券売却益	105
貸倒引当金戻入	72
特別損失	8,262
固定資産売却損	0
固定資産除却損	1,352
投資有価証券売却損	14
投資有価証券評価損	431
ゴルフ会員権評価損	25
過年度減価償却費	1,634
合併関連費用	4,693
金融商品取引責任準備金繰入	110
税引前四半期純利益	10,957
法人税、住民税及び事業税	90
法人税等調整額	△ 5,210
法人税等合計	△ 5,120
四半期純利益	16,077

(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	H21/3末	H21/12末	H21/12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~ H21/12)
1 外貨建て証券化商品	390	12	*1 380	14	0
2 ABS/CMBS、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	0	0
8 米国サブプライムRMBS	0	2	0	0	△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 0	*3 0
10 ミッドプライムローン(Alt-A)	0	1	0	0	0
11 ABS、CLO等	320	79	370	80	△0
12 CLO	240	83	200	76	△20
13 CMBS	0	14	0	8	△0
14 SIV関連	*4 80	72	*4 170	89	20

*1: H21/3 末比増減(約△10 億円)のうち、約△20 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ジェ)の比率は約 6 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(H21/12 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)によるヘッジ取引の想定元本は、約 1,250 億円(H21/3 末約 2,980 億円)、参照債権の時価評価額は約 1,100 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 150 億円。なお、当該請求可能見積額から引当(約 10 億円)を除いた金額は約 140 億円。
(上記 CDS 契約のうち、米国モノライン(H21/12 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 200 億円、その参照債権の時価評価額は約 180 億円…いずれも内数)
※1 格付は H21/12 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 契約の想定元本のうち、大宗は外部格付 AA 格相当以上の先(H21/12 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(H21/12 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)
 - 米国市場におけるマーケットメイク目的等で、米国政府系機関、GSE による住宅ローン担保証券(RMBS)を約 910 億円、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)の発行する社債を約 1,260 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 3 四半期累計期間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