

四半期報告書

(第123期第3四半期)

みずほ証券株式会社

四 半 期 報 告 書

- 1 本書は四半期報告書を金融商品取引法第27条の30の2に規定する開示用電子情報処理組織(EDINET)を使用し提出したデータに目次及び頁を付して出力・印刷したものであります。
- 2 本書には、上記の方法により提出した四半期報告書に添付された四半期レビュー報告書及び上記の四半期報告書と同時に提出した確認書を末尾に綴じ込んでおります。

目 次

	頁
【表紙】	1
第一部 【企業情報】	2
第1 【企業の概況】	2
1 【主要な経営指標等の推移】	2
2 【事業の内容】	3
第2 【事業の状況】	4
1 【事業等のリスク】	4
2 【経営上の重要な契約等】	4
3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】	4
第3 【提出会社の状況】	12
1 【株式等の状況】	12
2 【役員の状況】	14
第4 【経理の状況】	15
1 【四半期連結財務諸表】	16
2 【その他】	29
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	30

四半期レビュー報告書

確認書

【表紙】

【提出書類】 四半期報告書

【根拠条文】 金融商品取引法第24条の4の7第2項

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年2月14日

【四半期会計期間】 第123期第3四半期(自平成23年10月1日至平成23年12月31日)

【会社名】 みずほ証券株式会社

【英訳名】 Mizuho Securities Co., Ltd.

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 本山博史

【本店の所在の場所】 東京都千代田区大手町一丁目5番1号

【電話番号】 03(5208)3210

【事務連絡者氏名】 主計部長 小西健夫

【最寄りの連絡場所】 東京都千代田区大手町一丁目5番1号

【電話番号】 03(5208)3210

【事務連絡者氏名】 主計部長 小西健夫

【縦覧に供する場所】 みずほ証券株式会社 千葉支店
(千葉市中央区富士見二丁目15番11号)

みずほ証券株式会社 横浜支店
(横浜市西区北幸一丁目8番4号)

みずほ証券株式会社 名古屋支店
(名古屋市中区栄二丁目3番1号)

みずほ証券株式会社 大阪支店
(大阪市中央区南本町四丁目1番1号)

みずほ証券株式会社 神戸支店
(神戸市中央区三宮町三丁目3番2号)

第一部 【企業情報】

第1 【企業の概況】

1 【主要な経営指標等の推移】

回次	第122期 第3四半期 連結累計期間	第123期 第3四半期 連結累計期間	第122期
			会計期間
営業収益 (百万円)	自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日	自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日	自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日
営業収益 (百万円)	225,901	166,785	268,595
純営業収益 (百万円)	169,013	124,945	192,827
経常利益又は経常損失 (△) (百万円)	1,608	△36,682	△33,720
四半期(当期)純損失 (△) (百万円)	△432	△63,383	△29,312
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	△11,189	△70,172	△36,930
純資産額 (百万円)	579,974	482,298	553,973
総資産額 (百万円)	22,160,600	21,346,037	21,784,855
1株当たり四半期(当期)純損失金額 (△) (円)	△0.27	△39.93	△18.45
潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)純利益金額 (円)	—	—	—
自己資本比率 (%)	2.5	2.2	2.4

回次	第122期 第3四半期 連結会計期間	第123期 第3四半期 連結会計期間	第122期
			会計期間
1株当たり四半期純損失金額 (△) (円)	自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日	自 平成23年10月1日 至 平成23年12月31日	自 平成22年10月1日 至 平成22年12月31日
1株当たり四半期純損失金額 (△) (円)	△4.30	△23.15	

- (注) 1. 当社は四半期連結財務諸表を作成しているため、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。
2. 第123期第3四半期連結累計期間の潜在株式調整後1株当たり四半期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
第122期第3四半期連結累計期間および第122期の潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)純利益金額は、1株当たり四半期(当期)純損失が計上されているため記載しておりません。
3. 消費税および地方消費税の課税取引には、消費税等は含まれておりません。
4. 第122期第3四半期連結累計期間の四半期包括利益の算定にあたり、「包括利益の表示に関する会計基準」(企業会計基準第25号 平成22年6月30日)を適用し、遡及処理しております。

2 【事業の内容】

当第3四半期連結累計期間において、当社グループが営む事業の内容に重要な変更はありません。

第2四半期連結会計期間においては、新たに設立したM I Cイノベーション3号投資事業有限責任組合およびE E Iクリーンテック投資事業有限責任組合を持分法適用関連会社を含める一方、株式を売却したことにより永和証券株式会社を持分法適用関連会社から除外いたしました。

当第3四半期連結会計期間においては、株式を売却したGreater China Investments GP (Cayman) Limited、および清算が終了したS P I第一号投資事業有限責任組合が連結の範囲から除外された結果、当社グループは、当社、子会社28社および関連会社12社となりました。

なお、子会社はすべて連結子会社であり、関連会社はすべて持分法適用関連会社であります。

第2 【事業の状況】

1 【事業等のリスク】

当第3四半期連結累計期間において、新たに発生した事業等のリスクはありません。

また、前連結会計年度の有価証券報告書に記載した事業等のリスクについて重要な変更はありません。

2 【経営上の重要な契約等】

当第3四半期連結会計期間において、経営上の重要な契約等の決定または締結等はありません。

3 【財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

1 業績の状況

当第3四半期連結累計期間（平成23年4月1日から平成23年12月31日まで）のわが国経済は、当初は東日本大震災の発生に伴い大幅に経済活動が落ち込む動きとなりましたが、その後、サプライチェーンの復旧が想定よりも前倒しで進んだことなどから、急速に持ち直す動きとなりました。ただし、夏場以降は、海外経済の減速や円高の進行、タイにおける大洪水の影響などから、輸出や生産の持ち直しの動きが足踏みする展開となりました。株式市場は、当初、米国経済の回復期待が強まるもとの、震災に伴う大幅な下落から持ち直す動きが続き、日経平均株価は7月には一時、10,200円台を回復する動きとなりましたが、世界経済の減速懸念が浮上したことや欧州における債務問題の再燃などから、7月下旬以降、株価は大幅に下落する動きとなり、11月には一時、8,100円台まで下落しました。その後は米国経済の持ち直しの動きやECBによる大量の流動性供給を受けて、株価の下落に歯止めが掛かり、結局、期末は8,400円台の水準で引けました。債券市場は、期初に米国長期金利の上昇に連動する形で1.335%まで上昇する場面もみられましたが、その後は世界経済の減速懸念や欧州債務問題の再燃を受けたリスク回避の動きによる低下基調を辿り、結局、期末は0.9%台後半の水準で終わりました。

一方、海外では、米国経済は夏場にかけて、商品市況の高騰や日本におけるサプライチェーンの寸断の影響により減速懸念が強まる動きとなりましたが、こうした動きが一巡した年後半は持ち直しの動きとなりました。欧州経済は債務問題が深刻化するなか、緊縮財政の強化や金融機関による資産圧縮の動き、海外経済の減速などから、緩やかながら悪化する動きとなりました。また、新興国ではインフレ圧力に対応した金融引き締めの影響により、成長ペースが鈍化する動きがみられました。株式市場は、欧米とも当初は景気回復期待を背景に上昇が続いたものの、世界経済の減速懸念の台頭や欧州債務問題の再燃により、夏場以降は総じて下落する動きとなりましたが、期末にかけては下落基調に歯止めが掛かり、持ち直しの動きとなりました。債券市場は、米国では期初には景気回復やFRBの金融緩和からの出口政策に対する期待が高まり、10年国債利回りは3.6%台まで上昇しました。その後は、FRBが追加緩和策を講じたことに加えて、世界経済の減速懸念や欧州債務問題の再燃を受けたリスク回避の動きにより低下基調を辿りました。欧州では、引き続きソブリンリスク問題を巡って国別には跛行性の目立つ動きが続きました。

このような経営環境のもと、当社グループの当第3四半期連結累計期間の営業収益は1,667億85百万円（前年同期比73.8%）、経常損失は366億82百万円（前年同期は16億8百万円の利益）、四半期純損失は633億83百万円（前年同期は4億32百万円の損失）となりました。業績の概況は以下のとおりであります。

2 経営成績の分析

(1) 損益の状況

① 受入手数料

当社グループの受入手数料は、株式および債券等の売買の受託による「委託手数料」、株式および債券の引受業務による「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、投資信託および個人向け国債等の販売による「募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料」、投資信託の信託報酬および各種コンサルティングに係る手数料等による「その他の受入手数料」から構成されております。

受入手数料は、836億7百万円（前年同期比82.1%）となりました。内訳は以下のとおりであります。

区分	前第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	前年同期比 (%)
委託手数料	22,662	18,234	80.5
(株券)	(18,219)	(11,721)	(64.3)
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	27,898	16,442	58.9
(株券)	(17,179)	(5,455)	(31.8)
(債券)	(10,486)	(10,713)	(102.2)
募集・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の取扱手数料	20,014	18,348	91.7
その他の受入手数料	31,304	30,582	97.7
合計	101,879	83,607	82.1

・委託手数料

東証1・2部の一平均売買代金は1兆2,554億円（前年同期比87.3%）となりました。当社の委託売買高は株数で81億3百万株（同74.7%）、金額で5兆6,981億円（同72.6%）となり、当社グループの株式委託手数料は117億21百万円（同64.3%）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2社を含む6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54億55百万円（前年同期比31.8%）となりました。

一方、債券発行市場では、普通社債で共同主幹事を含め103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107億13百万円（同102.2%）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。

上半期においては、「みずほ人民元建て債券ファンド」（米ドル建て）、「みずほ・ブラックロック グローバル農業関連株ファンド」の募集を行いました。また、昨年度取扱いを開始した「みずほGSハイブリッド証券ファンド」について、新たにユーロクラス及び英ポンドクラスの募集も開始致しました。更に、ハイイールド債券に投資を行う「DIAMケイマン・トラスト-グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション」、「DIAMグローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・通貨選択シリーズ」についても募集を行い、9月には、分配金の

目標払出し額をあらかじめ明示し、獲得した総合収益にかかわらず分配金を支払うという新たな仕組みの「新光ハイインカム・ポートフォリオ・ファンド（毎月決算/目標払出し型）」の募集を開始致しました。

当第3四半期連結会計期間においては、高成長が期待されるグレーターチャイナ地域の転換社債へ投資を行う「グレーターチャイナCBファンド」、日本株の割安な株価水準に着目した「みずほ日本割安株ファンド（繰上償還条項付）」の募集を開始致しました。

これらに加え、既存の投資信託の継続募集も行った結果、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183億48百万円（前年同期比91.7%）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、305億82百万円（前年同期比97.7%）となりました。

② トレーディング損益

当社グループはお客様のさまざまなニーズに対応するため、株式・債券等の現物取引および株価指数先物等のデリバティブ取引を行っており、取引により発生する損益をトレーディング損益に計上しております。また、バスケットトレーディング取引、裁定取引およびポジションのヘッジ取引等も行っております。

トレーディング損益は、128億70百万円（前年同期比37.7%）の利益となりました。内訳は以下のとおりであります。

区分	前第3四半期連結累計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	前年同期比 (%)
株券等トレーディング損益 (百万円)	729	△9,458	—
債券等・その他のトレーディング損益 (百万円)	33,372	22,329	66.9
(債券等トレーディング損益) (百万円)	(18,143)	(9,105)	(50.2)
(その他のトレーディング損益) (百万円)	(15,228)	(13,224)	(86.8)
合計 (百万円)	34,101	12,870	37.7

③ 営業有価証券等損益

営業有価証券等損益は、ベンチャーキャピタル業務に係る有価証券の売買等による損益および出資した投資事業有限責任組合から生じる損益を計上しており、7億15百万円の損失（前年同期は21億4百万円の利益）となりました。

④ 金融収支

当社グループの金融収益はお客様の信用取引に係る貸付金の利息や品貸料、トレーディング商品で保有する有価証券に係る配当金や債券利子、有価証券の貸借取引に係る担保金の受取利息や品貸料等を計上しております。

また、金融費用は金融機関からの借入金に対する支払利息および有価証券の貸借取引に係る担保金の支払利息や品借料等を計上しております。

金融収益710億22百万円（前年同期比80.9%）から金融費用418億40百万円（同73.5%）を差し引いた金融収支は、291億82百万円（同94.4%）の利益となりました。

⑤ 販売費・一般管理費

販売費・一般管理費につきまして、取引関係費は294億76百万円（前年同期比102.3%）、人件費は731億69百万円（同95.7%）、不動産関係費は212億17百万円（同100.2%）、事務費は139億48百万円（同84.6%）、減価償却費は160億95百万円（同90.9%）、その他は94億57百万円（同104.0%）となり、販売費・一般管理費は合計で1,633億64百万円（同96.2%）となりました。

⑥ 営業外損益

当社グループの営業外収益は、投資有価証券の受取配当金および不動産賃貸業やソフトウェア開発業を営む連結子会社のグループ外部への売上等を計上しており、29億56百万円（前年同期比89.0%）となりました。

また、営業外費用は営業外収益に計上している連結子会社のグループ外部への売上に係る売上原価等を計上しており、12億20百万円（同127.7%）となりました。

以上の結果、営業外収益から営業外費用を差し引いた営業外損益は17億36百万円（同73.3%）の利益となりました。

⑦ 特別損益

特別利益として金融商品取引責任準備金戻入1億67百万円、投資有価証券売却益1億円等を計上し、特別損失に計上した特別退職金105億93百万円、投資有価証券評価損40億58百万円および投資有価証券売却損19億1百万円等を差し引いた特別損益は、176億7百万円の損失（前年同期は32百万円の損失）となりました。

(2) セグメント別の状況

セグメント別の状況は、以下のとおりであります。

なお、第1四半期連結会計期間から、当社グループにおけるグローバル運営の強化に伴い報告セグメントとして記載する事業セグメントを変更しており、「グローバル投資銀行部門」「グローバル市場・商品部門」「国内営業部門」「海外子会社」の4事業区分としておりましたが、「グローバル投資銀行」「グローバル・マーケット」「国内営業」の3事業区分に変更しております。詳細は、「第4 経理の状況 1 四半期連結財務諸表 注記事項（セグメント情報等）」の「3. 報告セグメントの変更等に関する事項」に記載しております。

前第3四半期連結累計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日）

	グローバル 投資銀行 (百万円)	グローバル・マ ーケッツ (百万円)	国内営業 (百万円)	その他 (百万円)	四半期連結損益 計算書計上額 (百万円)
純営業収益	33,732	71,066	55,471	8,744	169,013
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（△）	7,675	12,180	△5,500	△12,779	1,576

（注）「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントおよび全社費用が含まれております。

当第3四半期連結累計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日）

	グローバル 投資銀行 (百万円)	グローバル・マ ーケッツ (百万円)	国内営業 (百万円)	その他 (百万円)	四半期連結損益 計算書計上額 (百万円)
純営業収益	20,807	46,954	45,307	11,876	124,945
税金等調整前四半期純損失（△）	△1,748	△5,674	△8,893	△37,972	△54,289

（注）「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントおよび全社費用が含まれております。

(グローバル投資銀行)

国内や米国における債券引受関連で収益を積上げたものの、株式発行市場が低水準で推移したことや投資銀行業務関連手数料等の減少等により、純営業収益は208億7百万円(前年同期比61.7%)、税金等調整前四半期純損失は17億48百万円(前年同期は76億75百万円の利益)となりました。

(グローバル・マーケット)

債券セカンダリー業務は、金利低下を捉えたポジション運営が奏功したものの前年同期水準までは及ばず、株券セカンダリー業務は、低調な株式市場の影響を受け、純営業収益は469億54百万円(前年同期比66.1%)、税金等調整前四半期純損失は56億74百万円(前年同期は121億80百万円の利益)となりました。

(国内営業)

株式市場の更なる低迷による影響で、株式委託及び株式引受手数料等の株券関連手数料が低調となり、純営業収益は453億7百万円(前年同期比81.7%)、税金等調整前四半期純損失は88億93百万円(前年同期は55億円の損失)となりました。

3 財政状態の分析

資産合計は、21兆3,460億37百万円となり、前連結会計年度末に比べ4,388億18百万円の減少となりました。これは、現金・預金が1,677億9百万円、有価証券担保貸付金が1,975億23百万円減少したこと等によるものです。

負債合計は、20兆8,637億39百万円となり、前連結会計年度末に比べ3,671億43百万円の減少となりました。これは、有価証券担保借入金が3,350億52百万円増加した一方、短期借入金が5,256億8百万円、コマーシャル・ペーパーが1,120億円減少したこと等によるものです。

純資産合計は、4,822億98百万円となり、前連結会計年度末に比べ716億75百万円の減少となりました。これは、利益剰余金が633億83百万円、為替換算調整勘定が35億30百万円減少したこと等によるものです。この結果、自己資本比率は2.2%となりました。

4 事業上および財務上の対処すべき課題

「業務基盤再構築プログラム」の実施について

当社は、足許の不安定な市場環境を踏まえ、収支改善に向けた努力を継続してまいりましたが、厳しい経営環境の長期化の可能性を睨み、収支改善に向けた取組みを加速化する観点で、平成23年10月3日付で新たに下記の「業務基盤再構築プログラム」を実施することを発表し、各々の施策に取り組んでおります。

(1) 「業務基盤再構築プログラム」の内容について

① 業務基盤の強化および一部業務体制の見直し

平成21年5月の合併以来の事業戦略である、顧客ビジネス中心の収益モデルを推進すべく、業務の選択と集中を徹底し、トップライン収益力の回復・強化を目指してまいります。

投資銀行業務(株式・債券引受、M&Aアドバイザー等)においては、株式会社みずほコーポレート銀行との連携を強化し、かつ当社におけるカバレッジ機能、プロダクツ機能の再構築を進めていくことで、特にクロスボーダーM&A案件でのプレゼンス向上を基点として、M&A業務以外にも含めた投資銀行業務全般における収益拡大を目指してまいります。

市場・商品業務においては、国内外の機関投資家との取引の拡大およびネットワークの拡充に向けて取り組むとともに、同業務と密接な関係を有するリサーチ業務においてもセクターアナリストの強化等に取り組んでまいります。また、トレーディング戦略の多様化への対応も並行して進めてまいります。

リテール業務においては、支店を中心とした対面チャネルおよびインターネットやコールセンター等の非対面チャネル双方での取引拡充のための施策の推進に加え、お客さまのニーズに合わせた商品ラインアップの更なる充実化への取り組み等を通じて、富裕層営業を軸とした預り資産型営業のための基盤強化を進めてまいります。また、支店における法人営業においても、サポート体制の充実化やプロフェッショナルな人材の育成・配置等に取り組んでまいります。

② 効率的な業務運営

当社業務運営の効率化の観点から、組織の更なるスリム化を実施いたします。また、人員につきましても、希望退職の募集を実施（平成23年10月より300名程度の募集を予定）し、その他の施策と合わせて今年度において700人程度（平成23年度初の当社全従業員数の約10%に相当）の削減を実施いたします。

③ 経費の削減

合併後取り組んでまいりました経費削減努力の継続的な推進に加え、オフィスの一部返却等を含めた本プログラムにおける各種取組みを徹底することにより、各種経費の削減を広範に実施し、平成23年度第4四半期における経費（単体販売費・一般管理費（取引関係費除く））を前年同期比で約15%削減いたします。

④ グローバル運営体制の強化

平成23年度よりフロントセクションを中心としたグローバルマトリクス運営を本格的に導入しておりますが、これを更に徹底・高度化していくことにより、グローバルベースで機動力ある業務運営体制を実現し、プロダクツ毎の収益力の強化を実現してまいります。また、かねてより注力しているアジア地域におけるビジネス展開についても、株式会社みずほコーポレート銀行との積極的な連携を通じて、プレゼンス向上を図ってまいります。

⑤ グループ内外との連携強化

従前からの株式会社みずほコーポレート銀行との連携・協働をこれまで以上に推進してまいります。併せて、平成23年9月1日のプレスリリースにてご案内させていただきましたとおり、当社は農林中央金庫との間で業務協力契約を締結しており、業務協力分野の拡大・連携関係の更なる強化を図ってまいります。なお、平成23年7月29日のプレスリリースにてご案内させていただきましたとおり、当社はみずほインバスターズ証券株式会社との間で合併に関する基本合意書を締結しており、平成24年度下期中の合併効力発生に向けた準備作業を円滑に推進しております。

⑥ 適切なリスクコントロール

今後の資本規制強化の動きを踏まえ、メリハリをつけたアセットアロケーションを実施する等、資本効率の向上に向けた体制整備に多面的に取り組んでまいります。

(2) 支店の統廃合等について

当社は、上記「業務基盤再構築プログラム」の一環として、国内営業部門において拠点の集約を通じた多様な顧客サービスの提供および営業基盤の拡充、ならびに業務運営の効率化の観点から、以下のとおり、支店の統廃合等を実施することを平成24年1月31日付で発表いたしました。

当該支店の統廃合等により、国内営業部門の拠点は「93支店・3カスタマープラザ・2FA営業部」体制から「77支店・6営業所・3カスタマープラザ・2FA営業部」体制となります。

① 支店の統廃合

廃止支店	統合先支店	統合予定日
光が丘支店	池袋支店	平成24年4月23日（月）
新瑞橋支店 藤が丘支店	名古屋支店	
大垣支店	岐阜支店	平成24年5月1日（火）
舞鶴支店 宮津支店	福知山支店	
新浦安支店	本店営業部	平成24年5月7日（月）
亀戸支店 荒川支店	上野支店	
尾道支店	福山支店	

② 支店の営業所への変更

対象支店	営業所名	実施予定日
大宮支店	大宮営業所	平成24年4月2日（月）
立川支店	立川営業所	
自由が丘支店	自由が丘営業所	
たまプラーザ支店	たまプラーザ営業所	
大森支店	大森営業所	
ミューザ川崎支店	ミューザ川崎営業所	

5 研究開発活動

該当事項はありません。

6 従業員数

提出会社の状況

当第3四半期累計期間において、当社業務運営の効率化の観点から組織の更なるスリム化を実施し、人員につきましても希望退職の募集を実施したこと等により、前事業年度末に比べ668名減少いたしました。その結果、当第3四半期会計期間末の従業員数は5,455名となりました。

7 その他

(1) 自己資本規制比率（提出会社）

区分		前会計期間末 (平成23年3月31日)	当第3四半期会計期間末 (平成23年12月31日)
基本的項目	(百万円) (A)	478,134	422,215
補完的項目	その他有価証券評価 差額金(評価益)等(百万円)	5,665	7,872
	金融商品取引責任準備金等 (百万円)	1,173	1,006
	一般貸倒引当金(百万円)	39	9
	長期劣後債務(百万円)	108,000	81,000
	短期劣後債務(百万円)	200,300	297,300
	計(百万円) (B)	315,179	387,187
控除資産	(百万円) (C)	249,627	256,821
固定化されていない自己資本の額 (A) + (B) - (C)	(百万円) (D)	543,686	552,581
リスク相当額	市場リスク相当額(百万円)	68,493	54,731
	取引先リスク相当額(百万円)	30,497	34,549
	基礎的リスク相当額(百万円)	46,569	43,888
	計(百万円) (E)	145,559	133,169
自己資本規制比率(%)	(D) / (E) × 100	373.5	414.9

(注) 上記は、金融商品取引法第46条の6第1項の規定に基づき、「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)の定めにより算出したものであります。

(2) 連結自己資本規制比率

区分		前連結会計期間末 (平成23年3月31日)	当第3四半期連結会計期間末 (平成23年12月31日)
基本的項目	(百万円) (A)	—	533,676
補完的項目	その他有価証券評価 差額金(評価益)等(百万円)	—	146
	金融商品取引責任準備金等 (百万円)	—	1,027
	一般貸倒引当金(百万円)	—	2
	長期劣後債務(百万円)	—	81,000
	短期劣後債務(百万円)	—	308,959
	少数株主持分(百万円)	—	19,557
	為替換算調整勘定(百万円)	—	△71,082
	計(百万円) (B)	—	339,610
控除資産	(百万円) (C)	—	200,422
固定化されていない自己資本の額 (A) + (B) - (C)	(百万円) (D)	—	672,865
リスク相当額	市場リスク相当額(百万円)	—	116,694
	取引先リスク相当額(百万円)	—	69,338
	基礎的リスク相当額(百万円)	—	58,067
	計(百万円) (E)	—	244,101
連結自己資本規制比率(%)	(D) / (E) × 100	—	275.6

(注) 第1四半期連結会計期間末より、金融商品取引法第57条の5第1項および第2項の規定に基づき、「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)の定めにより算出しております。

第3 【提出会社の状況】

1 【株式等の状況】

(1) 【株式の総数等】

① 【株式の総数】

種類	発行可能株式総数(株)
普通株式	3,000,000,000
計	3,000,000,000

② 【発行済株式】

種類	第3四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成23年12月31日)	提出日現在発行数(株) (平成24年2月14日)	上場金融商品取引所 名又は登録認可金融 商品取引業協会名	内容
普通株式	1,584,312,962	1,584,312,962	—	普通株式は全て譲渡制限株式です。当社の株式の譲渡による取得については、取締役会の承認を要します。なお、当社は単元株制度を採用しておりません。
計	1,584,312,962	1,584,312,962	—	—

(2) 【新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

(3) 【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

(4) 【ライツプランの内容】

該当事項はありません。

(5) 【発行済株式総数、資本金等の推移】

年月日	発行済株式 総数増減数 (千株)	発行済株式 総数残高 (千株)	資本金増減額 (百万円)	資本金残高 (百万円)	資本準備金 増減額 (百万円)	資本準備金 残高 (百万円)
平成23年12月31日	—	1,584,312	—	125,167	—	380,194

(6) 【大株主の状況】

当四半期会計期間は第3四半期会計期間であるため、記載事項はありません。

(7) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

(平成23年12月31日現在)

区分	株式数(株)	議決権の数(個)	内容
無議決権株式	—	—	—
議決権制限株式(自己株式等)	—	—	—
議決権制限株式(その他)	—	—	—
完全議決権株式(自己株式等)	—	—	—
完全議決権株式(その他)	普通株式 1,584,312,962	1,584,312,962	—
単元未満株式	—	—	—
発行済株式総数	1,584,312,962	—	—
総株主の議決権	—	1,584,312,962	—

② 【自己株式等】

該当事項はありません。

2 【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書提出日後、当四半期累計期間における役員の異動は、次のとおりであります。

新任役員

役名	職名	氏名	生年月日	略歴	任期	所有株式数(株)	就任年月日
常務取締役兼 常務執行役員	グローバル マーケット ヘッド兼グ ローバル市 場・商品部 門長兼グ ローバル・リ サーチ本部 共同本部長	揚村 康男	昭和29年2 月19日生	平成12年6月 野村証券株式会社 取締役グローバル金融市場担当 平成13年5月 取締役グローバル金融市場兼ストラクチャード・ファイナンス部（共管）担当 平成13年10月 取締役金融市場本部兼ストラクチャード・プロダクト・マーケティング部（共管）兼ストラクチャード・ファイナンス部（共管）兼デット・キャピタル・マーケット部（共管）担当 平成15年6月 執行役金融市場本部兼アセット・ファイナンス部（共管）担当（野村ホールディングス株式会社執行役（平成15年6月から平成18年3月まで）、同業務推進ボード・メンバー（平成18年4月から平成19年10月まで）） 平成16年4月 常務執行役金融市場本部兼エクイティ本部担当兼シンジケート部長嘱託 平成17年4月 常務執行役金融市場本部兼エクイティ本部兼グローバル・マーケット企画部兼シンジケート部兼キャピタル・ソリューション部（共管）担当兼ストラクチャード・プロダクト・マーケティング部長嘱託 平成19年11月 常務執行役統合リスク管理プロジェクト担当 平成20年4月 参事統合リスク管理プロジェクト担当 平成21年4月 顧問統合リスク管理プロジェクト担当 平成23年10月 当社 常務取締役兼常務執行役員グローバル・マーケットヘッド兼グローバル市場・商品部門長兼グローバル・リサーチ本部共同本部長（現任）	平成23年10月 から 平成25年 6月	—	平成23年10月 1日

第4 【経理の状況】

1. 四半期連結財務諸表の作成方法について

当社の四半期連結財務諸表は、「四半期連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（平成19年内閣府令第64号）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）に準拠して作成しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3四半期連結会計期間（平成23年10月1日から平成23年12月31日まで）および第3四半期連結累計期間（平成23年4月1日から平成23年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表について、新日本有限責任監査法人により四半期レビューを受けております。

1 【四半期連結財務諸表】
 (1) 【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成23年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	377,668	209,959
預託金	103,765	64,667
トレーディング商品	8,035,368	7,982,106
商品有価証券等	7,274,959	7,009,826
貸付債権	10,000	10,004
デリバティブ取引	750,408	962,275
営業有価証券等	84,106	80,556
営業貸付債権	6,075	8,608
信用取引資産	46,503	42,040
信用取引貸付金	26,028	22,040
信用取引借証券担保金	20,475	19,999
有価証券担保貸付金	12,717,153	12,519,629
借入有価証券担保金	4,732,533	4,321,500
現先取引貸付金	7,984,619	8,198,129
立替金	1,094	5,356
有価証券等引渡未了勘定	10,249	3,304
短期貸付金	4,596	6,896
有価証券	10,681	9,790
繰延税金資産	13,914	14,634
その他の流動資産	143,821	194,618
貸倒引当金	△62	△51
流動資産計	21,554,937	21,142,117
固定資産		
有形固定資産	40,771	39,482
無形固定資産	92,566	86,376
投資その他の資産	96,580	78,061
投資有価証券	58,495	44,053
長期差入保証金	14,437	14,188
繰延税金資産	5,813	4,253
その他	21,454	19,102
貸倒引当金	△3,619	△3,536
固定資産計	229,917	203,919
資産合計	21,784,855	21,346,037

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成23年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	4,263,415	4,180,186
商品有価証券等	3,621,920	3,338,457
デリバティブ取引	641,494	841,729
約定見返勘定	323,891	239,306
信用取引負債	24,103	14,429
信用取引借入金	10,829	2,996
信用取引貸証券受入金	13,274	11,432
有価証券担保借入金	10,640,959	10,976,012
有価証券貸借取引受入金	1,746,838	1,563,849
現先取引借入金	8,894,121	9,412,162
預り金	80,454	85,919
受入保証金	217,211	295,095
有価証券等受入未了勘定	18,558	30,802
短期借入金	3,866,122	3,340,513
コマーシャル・ペーパー	484,100	372,100
1年内償還予定の社債	49,169	53,940
リース債務	632	418
未払法人税等	1,534	876
賞与引当金	14,706	10,784
役員賞与引当金	45	—
繰延税金負債	522	158
ポイント引当金	440	326
その他の流動負債	48,465	48,591
流動負債計	20,034,332	19,649,463
固定負債		
社債	554,068	529,132
長期借入金	621,361	657,019
リース債務	519	197
繰延税金負債	2,564	11,616
退職給付引当金	14,566	13,195
役員退職慰労引当金	337	238
執行役員退職慰労引当金	215	192
その他の固定負債	1,721	1,655
固定負債計	1,195,354	1,213,248
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	1,194	1,027
特別法上の準備金計	1,194	1,027
負債合計	21,230,882	20,863,739

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成23年 3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	125,167	125,167
資本剰余金	389,716	381,614
利益剰余金	90,278	26,895
自己株式	△7,367	—
株主資本合計	597,794	533,676
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	1,768	146
為替換算調整勘定	△67,551	△71,082
その他の包括利益累計額合計	△65,783	△70,935
新株予約権	582	—
少数株主持分	21,380	19,557
純資産合計	553,973	482,298
負債純資産合計	21,784,855	21,346,037

(2) 【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】
【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22年4月1日 至平成22年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日)
営業収益		
受入手数料	101,879	83,607
委託手数料	22,662	18,234
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘 等の手数料	27,898	16,442
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料	20,014	18,348
その他の受入手数料	31,304	30,582
トレーディング損益	34,101	12,870
営業有価証券等損益	2,104	△715
金融収益	87,815	71,022
営業収益計	225,901	166,785
金融費用	56,888	41,840
純営業収益	169,013	124,945
販売費・一般管理費	169,773	163,364
取引関係費	28,819	29,476
人件費	76,475	73,169
不動産関係費	21,180	21,217
事務費	16,489	13,948
減価償却費	17,716	16,095
租税公課	2,079	2,757
その他	7,012	6,699
営業損失(△)	△759	△38,418
営業外収益	3,323	2,956
受取配当金	403	456
受取賃貸料	686	398
為替差益	526	—
その他	1,708	2,101
営業外費用	955	1,220
賃貸費用	490	269
為替差損	—	215
その他	465	734
経常利益又は経常損失(△)	1,608	△36,682

(単位：百万円)

	前第3四半期連結累計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日)
特別利益	1,076	524
投資有価証券売却益	374	100
負ののれん発生益	—	2
訴訟関連戻入益	—	253
金融商品取引責任準備金戻入	693	167
貸倒引当金戻入額	8	—
特別損失	1,108	18,131
固定資産除却損	582	1,088
投資有価証券売却損	435	1,901
投資有価証券評価損	9	4,058
ゴルフ会員権評価損	45	26
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	36	—
減損損失	—	131
特別退職金	—	10,593
合併関連費用	—	331
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(△)	1,576	△54,289
法人税、住民税及び事業税	1,289	364
法人税等調整額	1,014	9,279
法人税等合計	2,303	9,644
少数株主損益調整前四半期純損失(△)	△727	△63,933
少数株主損失(△)	△294	△550
四半期純損失(△)	△432	△63,383

【四半期連結包括利益計算書】
【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22年4月1日 至平成22年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年12月31日)
少数株主損益調整前四半期純損失(△)	△727	△63,933
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△2,761	△1,624
為替換算調整勘定	△7,602	△4,545
持分法適用会社に対する持分相当額	△98	△69
その他の包括利益合計	△10,462	△6,239
四半期包括利益	△11,189	△70,172
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	△9,218	△68,536
少数株主に係る四半期包括利益	△1,970	△1,636

【連結の範囲又は持分法適用の範囲の変更】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	
1. 連結の範囲の重要な変更	
(1) 連結の範囲の変更	当第3四半期連結累計期間において、株式を売却したGreater China Investments GP (Cayman) Limited、および清算が終了したS P I 第一号投資事業有限責任組合を連結の範囲から除外しております。
(2) 変更後の連結子会社の数	28社
2. 持分法適用の範囲の重要な変更	
(1) 持分法適用関連会社の変更	第2四半期連結会計期間において、新たに設立したM I Cイノベーション3号投資事業有限責任組合およびE E Iクリーンテック投資事業有限責任組合を持分法適用関連会社を含める一方、株式を売却したことにより永和証券株式会社を持分法適用関連会社から除外しております。
(2) 変更後の持分法適用関連会社の数	12社

【会計方針の変更等】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	
該当事項はありません。	

【追加情報】

当第3四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日)	
第1四半期連結会計期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。	
一部の海外証券子会社は、サブプライムローン等に関する証券化商品の組成と販売に関して、米国証券取引委員会より文書提出等の情報提供要請を受け、現在対応中であります。	

【注記事項】

(四半期連結貸借対照表関係)

保証債務

連結会社以外の会社の金融機関からの借入金等に対して保証している債務の額は次のとおりであります。

	前連結会計年度 (平成23年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成23年12月31日)
みずほ証券住宅組合	425 (425) 百万円	317 (317) 百万円
その他	103 (ー)	58 (ー)
計	528 (425)	376 (317)

なお、日本公認会計士協会委員会報告第61号「債務保証及び保証類似行為の会計処理及び表示に関する監査上の取扱い」に従い、実質的に債務保証義務を負っていると認められるものについては、債務保証に準ずるものとして注記の対象に含めております。（保証予約残高を（ ）内書きしております。）

（四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係）

当第3四半期連結累計期間に係る四半期連結キャッシュ・フロー計算書は作成しておりません。なお、第3四半期連結累計期間に係る減価償却費（のれんを除く無形固定資産に係る償却費を含む。）は、次のとおりであります。

	前第3四半期連結累計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日）	当第3四半期連結累計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日）
減価償却費	17,716百万円	16,095百万円

（株主資本等関係）

I 前第3四半期連結累計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年12月31日）

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）	基準日	効力発生日	配当の原資
平成22年6月22日 定時株主総会	普通株式	7,942	5.00	平成22年3月31日	平成22年6月23日	利益剰余金

（注）1株当たり配当額は、普通配当3円と記念配当2円であります。

2. 基準日が前第3四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が前第3四半期連結会計期間の末日後となるもの
該当事項はありません。

3. 株主資本の著しい変動
該当事項はありません。

II 当第3四半期連結累計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日）

1. 配当金支払額

該当事項はありません。

2. 基準日が当第3四半期連結累計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当第3四半期連結会計期間の末日後となるもの
該当事項はありません。

3. 株主資本の著しい変動

当社は、平成23年7月20日開催の取締役会決議に基づき、平成23年7月26日付で35,000,000株を、平成23年9月1日付で7,375,721株の自己株式を消却したことにより、自己株式が7,367百万円減少し、資本剰余金が同額減少いたしました。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

I 前第3四半期連結累計期間(自平成22年4月1日至平成22年12月31日)

1. 報告セグメントごとの利益または損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	グローバル投資銀行部門	グローバル市場・商品部門	国内営業部門	海外子会社	その他	四半期連結損益計算書計上額
純営業収益	27,911	54,005	55,471	34,879	△3,255	169,013
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(△)	5,828	17,674	△5,500	△8,544	△7,882	1,576

(注) 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントおよび全社費用が含まれております。

2. 報告セグメントの利益または損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額および当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益	金額
報告セグメント計	9,458
全社費用(注)	△7,230
その他の調整額	△651
四半期連結損益計算書の税金等調整前四半期純利益	1,576

(注) 全社費用は、主に報告セグメントに帰属しない本社管理部門における販売管理費等であります。

3. 地域に関する情報(純営業収益)

(単位：百万円)

	日本	アジア	欧州	米州	合計
純営業収益	144,264	2,351	9,937	12,459	169,013

(注) 1. 国また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または地域

- (1) アジア …… 中国、シンガポール等
- (2) 欧州 …… イギリス、スイス等
- (3) 米州 …… アメリカ

II 当第3四半期連結累計期間(自平成23年4月1日至平成23年12月31日)

1. 報告セグメントごとの利益または損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	グローバル投資銀行	グローバル・マーケット	国内営業	その他	四半期連結損益計算書計上額
純営業収益	20,807	46,954	45,307	11,876	124,945
税金等調整前四半期純損失(△)	△1,748	△5,674	△8,893	△37,972	△54,289

(注) 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントおよび全社費用が含まれております。

2. 報告セグメントの利益または損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額および当該差額の主な内容(差異調整に関する事項)

(単位：百万円)

利益	金額
報告セグメント計	△16,316
全社費用(注)	△11,828
報告セグメントに属さないビジネス部門	△7,672
投資有価証券関連損益	△5,859
特別退職金	△10,593
その他の調整額	△2,018
四半期連結損益計算書の税金等調整前四半期純損失(△)	△54,289

(注) 全社費用は、主に報告セグメントに帰属しない本社管理部門における販売管理費等であります。

3. 報告セグメントの変更等に関する事項

第1四半期連結会計期間から、当社グループにおけるグローバル運営の強化に伴い報告セグメントとして記載する事業セグメントを変更しており、「グローバル投資銀行部門」「グローバル市場・商品部門」「国内営業部門」「海外子会社」の4事業区分としておりましたが、「グローバル投資銀行」「グローバル・マーケット」「国内営業」の3事業区分に変更しております。

変更後の事業区分による前第3四半期連結累計期間のセグメント情報は、以下のとおりであります。

(報告セグメントごとの利益または損失の金額に関する情報)

前第3四半期連結累計期間(自平成22年4月1日至平成22年12月31日)

(単位：百万円)

	グローバル 投資銀行	グローバル・ マーケット	国内営業	その他	四半期連結損益 計算書計上額
純営業収益	33,732	71,066	55,471	8,744	169,013
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(△)	7,675	12,180	△5,500	△12,779	1,576

(注) 「その他」の区分は報告セグメントに含まれない事業セグメントおよび全社費用が含まれております。

(報告セグメントの利益または損失の金額の合計額と四半期連結損益計算書計上額との差額および当該差額の主な内容(差異調整に関する事項))

前第3四半期連結累計期間(自平成22年4月1日至平成22年12月31日)

(単位：百万円)

利益	金額
報告セグメント計	14,355
全社費用(注)	△8,869
報告セグメントに属さないビジネス部門	△5,932
投資有価証券関連損益	△69
その他の調整額	2,092
四半期連結損益計算書の税金等調整前四半期純利益	1,576

(注) 全社費用は、主に報告セグメントに帰属しない本社管理部門における販売管理費等であります。

4. 地域に関する情報（純営業収益）

当第3四半期連結累計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年12月31日）

（単位：百万円）

	日本	アジア	欧州	米州	合計
純営業収益	101,932	1,654	6,893	14,465	124,945

（注）1. 国また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または地域

- （1） アジア …… 中国、シンガポール等
- （2） 欧州 …… イギリス、スイス等
- （3） 米州 …… アメリカ

（有価証券関係およびデリバティブ取引関係）

I 前連結会計年度末（平成23年3月31日）

1. トレーディングに係るもの

（1） トレーディングの状況に関する事項

トレーディングの利用目的および内容

証券会社におけるトレーディング業務は、金融商品取引における健全な市場機能の発揮と公正な価格形成、さらにその円滑な流通に資することを目的としており、当社グループにおいても、お客様のさまざまなニーズに対応したサービスや商品を提供する顧客取引、市場機能を補完するために自己の計算において行う取引（ディーリング業務）、およびその結果として発生する市場リスクを中心とした各種リスクを回避するために行うヘッジ取引等を行っております。具体的には、株式・債券等の有価証券の現物取引、金融商品市場で取引される株価指数先物・債券先物・金利先物およびこれらのオプション取引等の市場デリバティブ取引、金融商品市場によらないで行う先渡取引・オプション取引・スワップ取引等の店頭デリバティブ取引等を行っております。

（2） 商品有価証券等（売買目的有価証券）の時価

種類	資産(百万円)	負債(百万円)
株式・ワラント	503,599	36,232
債券	6,624,323	3,585,639
CPおよびCD	53,994	—
受益証券	8,083	48
その他（※）	94,957	—
合計	7,284,959	3,621,920

（※）貸付債権はその他に含めております。

(3) デリバティブ取引の契約額等および時価

種類	資産		負債	
	契約額等(百万円)	時価(百万円)	契約額等(百万円)	時価(百万円)
オプション取引	2,239,103	153,950	2,372,098	161,214
為替予約取引	86,495	1,057	201,575	6,091
先物・先渡取引	492,187	7,557	752,210	6,269
スワップ取引	32,966,645	595,838	31,334,430	467,918
MTMリザーブ	—	△7,994	—	—
合計	35,784,431	750,408	34,660,314	641,494

2. トレーディングに係るもの以外

(1) 満期保有目的の債券

種類	連結貸借対照表 計上額(百万円)	時価(百万円)	差額(百万円)
国債・地方債等	—	—	—
社債	3,519	3,534	15
その他	—	—	—
合計	3,519	3,534	15

(2) その他有価証券

種類	取得原価(百万円)	連結貸借対照表 計上額(百万円)	差額(百万円)
株式	19,638	20,890	1,251
債券	18,790	19,146	356
その他	24,740	24,015	△725
合計	63,169	64,052	882

(3) デリバティブ取引

① ヘッジ会計が適用されていないもの

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、種類ごとの連結決算日における契約額または契約において定められた元本相当額、時価および評価損益は以下のとおりであります。

種類	資産			負債		
	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
オプション取引	1,394	23	23	1,394	23	△23
為替予約取引	1,344	4	4	2,665	9	△9
先物・先渡取引	2,093	35	35	2,148	34	△34
合計	4,832	64	64	6,209	67	△67

② ヘッジ会計が適用されているもの

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、種類ごとの連結決算日における契約額または契約において定められた元本相当額、時価および評価損益は以下のとおりであります。

種類	資産			負債		
	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
オプション取引	—	—	—	—	—	—
為替予約取引	—	—	—	67,348	1,002	△1,002
先物・先渡取引	—	—	—	—	—	—
合計	—	—	—	67,348	1,002	△1,002

II 当第3四半期連結会計期間末（平成23年12月31日）

1. トレーディングに係るもの

(1) トレーディングの状況に関する事項

トレーディングの利用目的および内容

証券会社におけるトレーディング業務は、金融商品取引における健全な市場機能の発揮と公正な価格形成、さらにその円滑な流通に資することを目的としており、当社グループにおいても、お客様のさまざまなニーズに対応したサービスや商品を提供する顧客取引、市場機能を補完するために自己の計算において行う取引（ディーリング業務）、およびその結果として発生する市場リスクを中心とした各種リスクを回避するために行うヘッジ取引等を行っております。具体的には、株式・債券等の有価証券の現物取引、金融商品市場で取引される株価指数先物・債券先物・金利先物およびこれらのオプション取引等の市場デリバティブ取引、金融商品市場によらないで行う先渡取引・オプション取引・スワップ取引等の店頭デリバティブ取引等を行っております。

(2) 商品有価証券等（売買目的有価証券）の時価

種類	資産(百万円)	負債(百万円)
株式・ワラント	287,076	42,519
債券	6,606,137	3,295,938
CPおよびCD	40,995	—
受益証券	4,172	—
その他（※）	81,449	—
合計	7,019,831	3,338,457

(※) 貸付債権はその他に含めております。

(3) デリバティブ取引の契約額等および時価

種類	資産		負債	
	契約額等(百万円)	時価(百万円)	契約額等(百万円)	時価(百万円)
オプション取引	2,640,324	152,346	3,728,600	157,404
為替予約取引	193,742	3,467	216,169	4,093
先物・先渡取引	359,868	4,171	693,381	3,521
スワップ取引	39,401,315	817,530	37,984,006	676,709
MTMリザーブ	—	△15,241	—	—
合計	42,595,251	962,275	42,622,157	841,729

2. トレーディングに係るもの以外

(1) 満期保有目的の債券

種類	四半期連結貸借対照表 計上額(百万円)	時価(百万円)	差額(百万円)
国債・地方債等	—	—	—
社債	3,004	3,011	6
その他	—	—	—
合計	3,004	3,011	6

(2) その他有価証券

種類	取得原価(百万円)	四半期連結貸借対照表 計上額(百万円)	差額(百万円)
株式	16,869	16,680	△189
債券	14,431	14,903	472
その他	23,198	21,840	△1,358
合計	54,499	53,424	△1,075

(3) デリバティブ取引

① ヘッジ会計が適用されていないもの

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、種類ごとの連結決算日における契約額または契約において定められた元本相当額、時価および評価損益は以下のとおりであります。

種類	資産			負債		
	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
オプション取引	4,106	158	158	4,106	158	△158
為替予約取引	364	3	3	—	—	—
先物・先渡取引	515	24	24	491	23	△23
合計	4,985	185	185	4,597	181	△181

② ヘッジ会計が適用されているもの

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、種類ごとの連結決算日における契約額または契約において定められた元本相当額、時価および評価損益は以下のとおりであります。

種類	資産			負債		
	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	契約額等 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
オプション取引	—	—	—	—	—	—
為替予約取引	55,658	1,348	1,348	35,716	733	△733
先物・先渡取引	—	—	—	—	—	—
合計	55,658	1,348	1,348	35,716	733	△733

(1 株当たり情報)

1 株当たり四半期純損失金額および算定上の基礎、ならびに潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額および算定上の基礎は、次のとおりであります。

項目	前第 3 四半期連結累計期間 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年12月31日)	当第 3 四半期連結累計期間 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年12月31日)
(1) 1 株当たり四半期純損失金額 (△)	△ 0 円27銭	△39円93銭
(算定上の基礎)		
四半期純損失 (△) (百万円)	△432	△63,383
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—	—
普通株式に係る四半期純損失金額 (△) (百万円)	△432	△63,383
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,588,864	1,587,319
(2) 潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額	—	—
(算定上の基礎)		
四半期純利益調整額 (百万円)	—	—
普通株式増加数(千株)	—	—
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額の算定に含めなかった潜在株式で、前連結会計年度末から重要な変動があったものの概要	—	—

(注) 前第 3 四半期連結累計期間の潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額は、1 株当たり四半期純損失が計上されているため記載しておりません。

当第 3 四半期連結累計期間の潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額は、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

2 【その他】

該当事項はありません。

第二部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

平成24年2月10日

みずほ証券株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	英	公	一	印	
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深	田	豊	大	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	川	口	琢	磨	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、「経理の状況」に掲げられているみずほ証券株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの連結会計年度の第3四半期連結会計期間（平成23年10月1日から平成23年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成23年4月1日から平成23年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書及び注記について四半期レビューを行った。

四半期連結財務諸表に対する経営者の責任

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四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して四半期連結財務諸表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四半期連結財務諸表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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した四半期レビューに基づいて、独立の立場から四半期連結財務諸表に対する結論を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に準拠して四半期レビューを行った。

四半期レビューにおいては、主として経営者、財務及び会計に関する事項に責任を有する者等に対して実施される質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続が実施される。四半期レビュー手続は、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実施される年度の財務諸表の監査に比べて限定された手続である。

当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

監査人の結論

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、みずほ証券株式会社及び連結子会社の平成23年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する第3四半期連結累計期間の経営成績を適正に表示していないと信じさせる事項がすべての重要な点において認められなかった。

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

- (注) 1. 上記は、四半期レビュー報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(四半期報告書提出会社)が別途保管しております。
2. 四半期連結財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

【表紙】

【提出書類】	確認書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条の4の8第1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年2月14日
【会社名】	みずほ証券株式会社
【英訳名】	Mizuho Securities Co., Ltd.
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 本 山 博 史
【最高財務責任者の役職氏名】	—
【本店の所在の場所】	東京都千代田区大手町一丁目5番1号
【縦覧に供する場所】	みずほ証券株式会社 千葉支店 (千葉市中央区富士見二丁目15番11号)
	みずほ証券株式会社 横浜支店 (横浜市西区北幸一丁目8番4号)
	みずほ証券株式会社 名古屋支店 (名古屋市中区栄二丁目3番1号)
	みずほ証券株式会社 大阪支店 (大阪市中央区南本町四丁目1番1号)
	みずほ証券株式会社 神戸支店 (神戸市中央区三宮町三丁目3番2号)

1 【四半期報告書の記載内容の適正性に関する事項】

- (1) 当社代表取締役社長本山博史は、当社の第123期第3四半期（自平成23年10月1日至平成23年12月31日）の四半期報告書の記載内容が金融商品取引法令に基づき適正に記載されていることを確認いたしました。
- (2) 当該確認を行うに当たり、財務諸表等が適正に作成される以下の体制が整備されていることを確認いたしました。
 - ①財務諸表等の作成に当たって、その業務分担と責任部署が明確化されており、各責任部署において適切な業務体制が構築されていること。
 - ②内部監査部門が当該責任部署における業務プロセスの適切性・有効性を検証し、取締役へ報告を行う態勢にあること。
 - ③重要な経営情報が取締役会へ適切に付議・報告されていること。
- (3) なお、四半期報告書提出に当たり、当社はディスクロージャー委員会を開催し、同報告書が適正に記載されていることを確認いたしました。

2 【特記事項】

確認に当たり、特記すべき事項はありません。