

四半期報告書

(第124期第2四半期)

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】	10
1 【株式等の状況】	10
2 【役員の状況】	11
第4 【経理の状況】	12
1 【四半期連結財務諸表】	13
2 【その他】	28
第二部 【提出会社の保証会社等の情報】	29

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11月14日
【四半期会計期間】	第124期第2四半期(自 平成24年7月1日 至 平成24年9月30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】	該当事項はありません。

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123期 第2四半期 連結累計期間	第124期 第2四半期 連結累計期間	第123期
会計期間	自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日	自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日	自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日
営業収益 (百万円)	117,928	138,100	228,516
純営業収益 (百万円)	88,443	106,742	167,117
経常利益又は経常損失 (△) (百万円)	△21,014	9,748	△49,796
四半期純利益又は 四半期(当期)純損失 (△) (百万円)	△26,700	8,361	△95,671
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	△31,427	5,586	△97,233
純資産額 (百万円)	521,048	459,403	454,103
総資産額 (百万円)	22,849,877	23,834,578	21,163,850
1株当たり四半期純利益金額又は 四半期(当期)純損失金額 (△) (円)	△16.81	5.28	△60.30
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 (%)	2.2	1.9	2.1
営業活動による キャッシュ・フロー (百万円)	383,336	330,279	237,610
投資活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△2,318	△7,544	△8,145
財務活動による キャッシュ・フロー (百万円)	△574,194	△306,013	△402,110
現金及び現金同等物の 四半期末(期末)残高 (百万円)	174,193	208,598	197,082

回次	第123期 第2四半期 連結会計期間	第124期 第2四半期 連結会計期間
会計期間	自 平成23年7月1日 至 平成23年9月30日	自 平成24年7月1日 至 平成24年9月30日
1株当たり四半期純利益金額又は 四半期純損失金額 (△) (円)	△11.45	1.84

- (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. 潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)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。
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。

2 【事業の内容】

当第2四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1四半期連結会計期間においては、Shinko Securities (U.S.A.) Inc. の清算が終了したことにより、連結子会社から除外いたしました。

当第2四半期連結会計期間においては、株式を売却した新和証券株式会社、および清算が終了した新光IPO投資事業組合2号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26社および関連会社10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会社であります。

第2 【事業の状況】

1 【事業等のリスク】

当第2四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2四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2四半期連結累計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）のわが国経済は、当初は東日本大震災からの復旧・復興事業を中心に内需が底堅く推移し、米国向けを中心に輸出も持ち直したことで、回復の動きが続きました。しかし、期末にかけては、世界経済の減速傾向が続くなかで、輸出が弱含みに転じたほか、エコカー補助金の終了もあり、回復の動きが足踏みする展開となりました。株式市場は、期初から6月上旬にかけては世界経済の減速懸念や欧州債務問題の再燃などから、下落傾向が続き、日経平均株価は一時8,200円台まで下落しました。その後、欧州当局による債務問題への対応が進展したことや欧米中央銀行による金融緩和の強化が打ち出されたことなどから、株価の下落にも歯止めが掛かり、期末は8,800円台の水準で引けました。債券市場は、世界的に安全資産への需要が強まるなかで、10年国債利回りは7月下旬に一時0.72%まで低下するなど、低下基調が続きました。その後も金利は低位での推移が継続し、期末は0.7%台半ばの水準で終わりました。

一方、海外では、米国経済は金融危機以降の低成長が続くなか、欧州債務問題や米国「財政の崖」を巡る不透明感の高まりなどから、企業や家計のマインドが慎重化し、回復ペースが減速する展開となりました。ただ、期末にかけては株価の上昇などから、持ち直しの兆しもみられています。欧州経済は緊縮財政や信用収縮の影響による南欧諸国の悪化に加えて、ドイツなど中核国の成長ペースも低下するなど、全体として景気後退の動きが続きました。また、新興国では、中国において欧州向けを中心とする輸出の減速に加えて、不動産市場の引き締めや過剰供給による生産調整圧力の高まりなどから、減速感が強まる展開となりました。株式市場は、欧米とも6月上旬にかけては調整の動きとなりましたが、その後、期末にかけては欧州債務問題への対応の進展や金融緩和の強化を受けて、上昇傾向となりました。債券市場は、米国では期初以降、7月にかけて長期金利が低下する展開が続きました。その後は金利低下にも歯止めが掛かりましたが、引き続き2%を下回る水準での推移となりました。欧州では、期初から7月にかけては、ドイツなど中核国の金利は低下基調を辿る一方、南欧諸国の金利が一段と上昇するなど、引き続き債務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。その後、ECBによる国債買い入れなど欧州債務問題への対応が進展したことで、期末にかけては南欧諸国の金利が大幅に低下する展開となりました。

このような経営環境のもと、当社グループの当第2四半期連結累計期間の営業収益は1,381億円（前年同期比117.1%）、経常利益は97億48百万円（前年同期は210億14百万円の損失）、四半期純利益は83億61百万円（前年同期は267億円の損失）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、577億72百万円（前年同期比97.7%）となりました。内訳は以下のとおりであります。

区分	前第2四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	前年同期比 (%)
委託手数料 (百万円)	13,024	12,145	93.3
(株券) (百万円)	(9,098)	(6,735)	(74.0)
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料 (百万円)	13,279	12,570	94.7
(株券) (百万円)	(5,049)	(4,587)	(90.9)
(債券) (百万円)	(8,031)	(7,764)	(96.7)
募集・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の取扱手数料 (百万円)	12,787	9,897	77.4
その他の受入手数料 (百万円)	20,066	23,159	115.4
合計 (百万円)	59,158	57,772	97.7

・委託手数料

東証1・2部の一日平均売買代金は1兆1,267億円（前年同期比83.4%）となりました。当社の委託売買高は株数で53億30百万株（同91.1%）、金額で3兆3,719億円（同80.1%）となり、当社グループの株式委託手数料は67億35百万円（同74.0%）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3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45億87百万円（前年同期比90.9%）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94銘柄の主幹事を務めたほか、サムライ債や財投機関債等でも主幹事案件を幅広く獲得しました。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77億64百万円（同96.7%）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、売出しの取扱手数料が大半を占めております。

当第2四半期連結累計期間においては、株価純資産倍率（PBR）と自己資本利益率（ROE）の2つのファクターに注目して銘柄選択を行う日本株ファンドとして「日本株ダブルフォーカス・ファンド」、国債利回りと比較しても魅力的な配当利回りである豪州株式を投資対象とした「ニッセイオーストラリア高配当株ファンド（毎月決算型）」、投資家のインカム志向に応える為、獲得した総合収益にかかわらず一定のルールに基づき分配金を支払う仕組みの、「ニュー・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）」の募集を行いました。

また、マネージド・フューチャーズ戦略、グローバル・マクロ戦略という伝統的資産との相関が低い戦略により分散投資効果を提供する「ツーピース・セレクト」の募集を開始しました。

これらを含む新規設定商品に加え、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98億97百万円（前年同期比77.4%）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、231億59百万円（前年同期比115.4%）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も行っております。

トレーディング損益は、315億31百万円（前年同期比311.6%）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2四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	前年同期比 (%)
株券等トレーディング損益 (百万円)	△10,438	△4,357	—
債券等・その他のトレーディング損益 (百万円)	20,556	35,888	174.6
(債券等トレーディング損益) (百万円)	(2,965)	(△28,874)	(—)
(その他のトレーディング損益) (百万円)	(17,591)	(64,762)	(368.2)
合計 (百万円)	10,117	31,531	311.6

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、4億34百万円の利益（前年同期は2億24百万円の損失）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483億62百万円（前年同期比98.9%）から金融費用313億58百万円（同106.4%）を差し引いた金融収支は、170億4百万円（同87.7%）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198億62百万円（前年同期比101.2%）、人件費は413億98百万円（同83.6%）、不動産関係費は135億6百万円（同95.6%）、事務費は72億77百万円（同75.1%）、減価償却費は95億51百万円（同86.0%）、その他は61億6百万円（同95.3%）となり、販売費・一般管理費は合計で977億1百万円（前年同期比88.4%）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、18億92百万円（前年同期比103.1%）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、11億85百万円（同144.6%）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7億7百万円（同69.6%）の利益となりました。

⑦ 特別損益

特別利益として事業譲渡益34億90百万円、投資有価証券売却益3億99百万円等を計上し、特別損失に計上した投資有価証券評価損20億89百万円、合併関連費用18億52百万円、偶発損失引当金繰入額14億30百万円等を差し引いた特別損益は、23億11百万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、報告セグメント利益について税金等調整前四半期純利益または税金等調整前四半期純損失から経常利益または経常損失に変更しております。また、組織区分等を第1四半期連結会計期間から変更したことに伴い、前第2四半期連結累計期間のセグメント情報については変更後の組織区分等により作成しております。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2四半期連結累計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日）

	グローバル 投資銀行 (百万円)	グローバル・ マーケット (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	15,633	31,657	33,211	7,940	88,443
経常利益又は経常損失(△)	392	△4,513	△2,538	△14,355	△21,014

(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等が含まれております。

当第2四半期連結累計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日）

	グローバル 投資銀行 (百万円)	グローバル・ マーケット (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	18,799	47,797	32,328	7,817	106,742
経常利益又は経常損失(△)	3,398	11,939	4,494	△10,083	9,748

(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等が含まれております。

(グローバル投資銀行)

国内での複数の大型エクイティ主幹事案件獲得、ストラクチャードファイナンス案件積上げ等により、純営業収益は187億99百万円（前年同期比120.2%）、経常利益は33億98百万円（同866.2%）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低迷する株式市場の影響を受け苦戦を強いられたものの、債券セカンダリー業務がグローバルな金利低下局面におけるポジション運営やクレジットスプレッドの安定を受け、純営業収益は477億97百万円（前年同期比151.0%）、経常利益は119億39百万円（前年同期は45億13百万円の損失）となりました。

(国内営業)

債券トレーディング損益が増加したものの、株式市場の低迷による影響で株式委託手数料および投資信託の募集、売出しの取扱手数料等が減少し、純営業収益は323億28百万円（前年同期比97.3%）となりました。なお、経常利益は経費削減効果により、44億94百万円（前年同期は25億38百万円の損失）となりました。

3 財政状態の分析

資産合計は、23兆8,345億78百万円となり、前連結会計年度末に比べ2兆6,707億27百万円の増加となりました。これは、有価証券担保貸付金が1兆7,457億61百万円、トレーディング商品が9,526億20百万円増加したことなどによるものです。

負債合計は、23兆3,751億74百万円となり、前連結会計年度末に比べ2兆6,654億27百万円の増加となりました。これは、短期借入金が2,854億51百万円、トレーディング商品が2,767億58百万円減少した一方、有価証券担保借入金が3兆1,547億88百万円増加したことなどによるものです。

純資産合計は、4,594億3百万円となり、前連結会計年度末に比べ53億円の増加となりました。

この結果、自己資本比率は1.9%となりました。

4 キャッシュ・フローの状況

当第2四半期連結累計期間における現金及び現金同等物の期末残高は2,085億98百万円（前年同期は1,741億93百万円）となりました。

営業活動によるキャッシュ・フローは、有価証券担保貸付金の増加による支出2兆1,015億5百万円、トレーディング商品のポジションの増加による支出1兆1,560億円を計上したものの、有価証券担保借入金の増加による収入3兆5,708億75百万円を計上したことなどにより、3,302億79百万円の資金増加（前年同期は3,833億36百万円の資金増加）となりました。

投資活動によるキャッシュ・フローは、有価証券の売却・償還による収入77億44百万円を計上したものの、定期預金の預入による支出152億26百万円、無形固定資産の取得による支出67億7百万円を計上したことなどにより、75億44百万円の資金減少（前年同期は23億18百万円の資金減少）となりました。

財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金が2,236億10百万円減少し、長期借入金を1,473億2百万円返済したことなどにより、3,060億13百万円の資金減少（前年同期は5,741億94百万円の資金減少）となりました。

5 事業上および財務上の対処すべき課題

当第2四半期連結累計期間において、事業上および財務上の対処すべき課題に重要な変更および新たに生じた課題はありません。

6 研究開発活動

該当事項はありません。

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24年3月31日)	当第2四半期会計期間末 (平成24年9月30日)
基本的項目	(百万円) (A)	410,998	415,684
補完的項目	その他有価証券評価 差額金(評価益)等(百万円)	4,271	6,735
	金融商品取引責任準備金等 (百万円)	1,013	995
	一般貸倒引当金(百万円)	23	17
	長期劣後債務(百万円)	72,900	141,000
	短期劣後債務(百万円)	271,458	230,300
	計(百万円) (B)	349,666	379,049
控除資産	(百万円) (C)	275,269	288,039
固定化されていない自己資本の額 (A)+(B)-(C)	(百万円) (D)	485,395	506,693
リスク相当額	市場リスク相当額(百万円)	103,254	90,669
	取引先リスク相当額(百万円)	32,797	35,621
	基礎的リスク相当額(百万円)	42,095	40,412
	計(百万円) (E)	178,147	166,703
自己資本規制比率(%)	(D)÷(E)×100	272.4	303.9

(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		前連結会計年度末 (平成24年3月31日)	当第2四半期連結会計期間末 (平成24年9月30日)
基本的項目	(百万円) (A)	501,039	509,417
補完的項目	その他有価証券評価 差額金(評価益)等(百万円)	1,942	1,372
	金融商品取引責任準備金等 (百万円)	1,034	1,014
	一般貸倒引当金(百万円)	54	48
	長期劣後債務(百万円)	72,900	141,000
	短期劣後債務(百万円)	285,621	238,061
	少数株主持分(百万円)	19,721	17,997
	為替換算調整勘定(百万円)	△68,616	△69,383
	計(百万円) (B)	312,656	330,110
控除資産	(百万円) (C)	222,142	205,713
固定化されていない自己資本の額 (A)+(B)-(C)	(百万円) (D)	591,554	633,814
リスク相当額	市場リスク相当額(百万円)	157,910	142,589
	取引先リスク相当額(百万円)	51,056	60,113
	基礎的リスク相当額(百万円)	56,782	55,231
	計(百万円) (E)	265,749	257,934
連結自己資本規制比率(%)	(D)÷(E)×100	222.5	245.7

(注) 上記は、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たものであります。

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2四半期会計期間末 現在発行数(株) (平成24年9月30日)	提出日現在発行数(株) (平成24年11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24年9月30日	—	1,584,312	—	125,167	—	285,831

(6) 【大株主の状況】

(平成24年9月30日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数 (千株)	発行済株式総数に対する 所有株式数の割合(%)
株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区丸の内1丁目3番3号	1,499,710	94.66
農林中央金庫	東京都千代田区有楽町1丁目13番2号	84,602	5.34
計	—	1,584,312	100.00

(7) 【議決権の状況】

① 【発行済株式】

(平成24年9月30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】

該当事項はありません。

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2四半期連結会計期間(平成24年7月1日から平成24年9月30日まで)および第2四半期連結累計期間(平成24年4月1日から平成24年9月30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24年 3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (平成24年 9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	207,528	227,715
預託金	57,467	56,167
トレーディング商品	8,665,939	9,618,560
商品有価証券等	7,728,940	8,510,561
デリバティブ取引	936,998	1,107,998
営業有価証券等	75,282	70,489
営業貸付債権	7,900	5,648
信用取引資産	52,598	32,893
信用取引貸付金	21,321	16,011
信用取引借証券担保金	31,276	16,881
有価証券担保貸付金	11,591,972	13,337,733
借入有価証券担保金	4,367,651	4,246,945
現先取引貸付金	7,224,320	9,090,788
立替金	4,730	4,247
有価証券等引渡未了勘定	6,064	20,524
短期貸付金	9,664	6,036
有価証券	10,331	7,783
繰延税金資産	12,863	13,450
その他の流動資産	265,309	245,904
貸倒引当金	△1,063	△57
流動資産計	20,966,590	23,647,096
固定資産		
有形固定資産	39,778	38,277
無形固定資産	87,608	86,439
投資その他の資産	69,873	62,764
投資有価証券	43,229	37,607
長期差入保証金	14,179	13,791
繰延税金資産	1,426	1,194
その他	14,610	13,223
貸倒引当金	△3,571	△3,053
固定資産計	197,260	187,481
資産合計	21,163,850	23,834,578

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成24年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (平成24年9月30日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	4,668,990	4,392,231
商品有価証券等	3,793,941	3,384,352
デリバティブ取引	875,049	1,007,879
約定見返勘定	296,239	391,669
信用取引負債	16,477	15,528
信用取引借入金	2,674	3,119
信用取引貸証券受入金	13,802	12,409
有価証券担保借入金	10,070,318	13,225,107
有価証券貸借取引受入金	1,271,647	2,855,293
現先取引借入金	8,798,670	10,369,814
預り金	84,490	83,040
受入保証金	287,150	301,267
有価証券等受入未了勘定	4,713	22,148
短期借入金	3,674,834	3,389,382
コマーシャル・ペーパー	333,300	249,300
1年内償還予定の社債	95,794	105,916
リース債務	344	617
未払法人税等	1,918	1,978
賞与引当金	13,133	7,055
役員賞与引当金	50	15
ポイント引当金	373	437
偶発損失引当金	9,035	—
その他の流動負債	50,412	38,643
流動負債計	19,607,578	22,224,341
固定負債		
社債	483,844	489,812
長期借入金	586,018	628,727
リース債務	157	2,378
繰延税金負債	16,129	13,980
退職給付引当金	12,836	12,587
役員退職慰労引当金	265	231
執行役員退職慰労引当金	201	139
その他の固定負債	1,681	1,962
固定負債計	1,101,135	1,149,818
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	1,034	1,014
特別法上の準備金計	1,034	1,014
負債合計	20,709,747	23,375,174
純資産の部		
株主資本		
資本金	125,167	125,167
資本剰余金	381,614	264,181
利益剰余金	△5,725	120,069
株主資本合計	501,056	509,417
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	1,942	1,372
為替換算調整勘定	△68,616	△69,383
その他の包括利益累計額合計	△66,674	△68,011
少数株主持分	19,721	17,997
純資産合計	454,103	459,403
負債純資産合計	21,163,850	23,834,578

(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2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
営業収益		
受入手数料	59,158	57,772
委託手数料	13,024	12,145
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	13,279	12,570
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	12,787	9,897
その他の受入手数料	20,066	23,159
トレーディング損益	10,117	31,531
営業有価証券等損益	△224	434
金融収益	48,876	48,362
営業収益計	117,928	138,100
金融費用	29,484	31,358
純営業収益	88,443	106,742
販売費・一般管理費	110,475	97,701
取引関係費	※1 19,625	※1 19,862
人件費	※2 49,513	※2 41,398
不動産関係費	14,129	13,506
事務費	9,687	7,277
減価償却費	11,111	9,551
租税公課	1,938	1,744
その他	4,468	4,362
営業利益又は営業損失(△)	△22,032	9,041
営業外収益	1,836	1,892
受取配当金	411	349
受取賃貸料	297	230
システム子会社外部売上高	236	488
その他	890	824
営業外費用	819	1,185
持分法による投資損失	52	398
賃貸費用	199	156
システム子会社外部売上原価	211	446
為替差損	70	58
その他	284	124
経常利益又は経常損失(△)	△21,014	9,748

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
特別利益	469	3,953
固定資産売却益	—	46
投資有価証券売却益	47	399
負ののれん発生益	2	—
訴訟関連戻入益	250	—
金融商品取引責任準備金戻入	169	17
事業譲渡益	—	3,490
特別損失	7,077	6,265
固定資産除却損	215	157
投資有価証券売却損	1,520	277
投資有価証券評価損	3,664	2,089
ゴルフ会員権評価損	13	3
減損損失	—	455
特別退職金	1,663	—
合併関連費用	—	1,852
偶発損失引当金繰入額	—	1,430
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(△)	△27,622	7,437
法人税、住民税及び事業税	1,023	2,240
法人税等調整額	△1,647	△2,378
法人税等合計	△624	△138
少数株主損益調整前四半期純利益又は少数株主損益 調整前四半期純損失(△)	△26,998	7,575
少数株主損失(△)	△297	△785
四半期純利益又は四半期純損失(△)	△26,700	8,361

【四半期連結包括利益計算書】
【第2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
少数株主損益調整前四半期純利益又は少数株主損益 調整前四半期純損失(△)	△26,998	7,575
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△184	△649
為替換算調整勘定	△4,210	△1,349
持分法適用会社に対する持分相当額	△33	9
その他の包括利益合計	△4,429	△1,988
四半期包括利益	△31,427	5,586
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	△30,079	7,023
少数株主に係る四半期包括利益	△1,347	△1,436

(3) 【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
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(△)	△27,622	7,437
減価償却費	11,111	9,551
貸倒引当金の増減額(△は減少)	△114	△1,377
賞与引当金の増減額(△は減少)	△4,857	△5,677
退職給付引当金の増減額(△は減少)	△2,263	△57
役員退職慰労引当金の増減額(△は減少)	△158	△96
偶発損失引当金の増減額(△は減少)	—	1,430
金融商品取引責任準備金の増減額(△は減少)	△169	△17
為替差損益(△は益)	317	834
受取利息及び受取配当金	△49,448	△48,845
支払利息	29,484	31,358
持分法による投資損益(△は益)	52	398
固定資産除却損	215	157
減損損失	—	455
投資有価証券売却損益(△は益)	1,473	△122
投資有価証券評価損益(△は益)	3,664	2,089
ゴルフ会員権評価損	13	3
負ののれん発生益	△2	—
事業譲渡益	—	△3,490
預託金の増減額(△は増加)	41,748	200
トレーディング商品の増減額	△1,467,621	△1,156,000
信用取引資産の増減額(△は増加)	4,534	19,051
信用取引負債の増減額(△は減少)	△7,520	△510
有価証券担保貸付金の増減額(△は増加)	△107,463	△2,101,505
有価証券担保借入金の増減額(△は減少)	2,011,183	3,570,875
立替金及び預り金の増減額	8,932	1,661
その他	△79,104	△2,114
小計	366,383	325,690
利息及び配当金の受取額	48,155	49,904
利息の支払額	△30,852	△34,284
法人税等の支払額	△350	△1,063
和解金の支払額	—	△9,967
営業活動によるキャッシュ・フロー	383,336	330,279

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
投資活動によるキャッシュ・フロー		
定期預金の預入による支出	△4,663	△15,226
定期預金の払戻による収入	3,959	6,190
有価証券の取得による支出	△2,050	△4,613
有価証券の売却及び償還による収入	5,493	7,744
有形固定資産の取得による支出	△1,721	△1,313
無形固定資産の取得による支出	△5,233	△6,707
投資有価証券の取得による支出	△182	△976
投資有価証券の売却及び償還による収入	2,725	2,064
短期貸付金の増減額 (△は増加)	△531	4
長期差入保証金の差入による支出	△456	△376
長期差入保証金の回収による収入	456	734
連結範囲の変更を伴う子会社株式の売却による収入	—	860
事業譲渡による収入	—	3,490
その他	△113	579
投資活動によるキャッシュ・フロー	△2,318	△7,544
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入金の純増減額 (△は減少)	△480,954	△223,610
コマーシャル・ペーパーの増減額 (△は減少)	△59,300	△84,000
長期借入れによる収入	31,400	136,900
長期借入金の返済による支出	△48,921	△147,302
社債の発行による収入	23,942	61,853
社債の償還による支出	△39,785	△49,601
自己株式の取得による支出	△10	—
自己株式の売却による収入	1	—
配当金の支払額	△32	△11
少数株主への配当金の支払額	△175	△21
リース債務の返済による支出	△359	△219
財務活動によるキャッシュ・フロー	△574,194	△306,013
現金及び現金同等物に係る換算差額	△2,871	△5,206
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	△196,048	11,515
現金及び現金同等物の期首残高	370,241	197,082
現金及び現金同等物の四半期末残高	※1 174,193	※1 208,598

【連結の範囲又は持分法適用の範囲の変更】

当第2四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1	<p>連結の範囲の重要な変更</p> <p>(1) 連結の範囲の変更</p> <p>第1四半期連結会計期間において、Shinko Securities(U.S.A.)Inc.の清算が終了したことにより連結子会社から除外しております。</p> <p>当第2四半期連結会計期間において、株式を売却した新和証券株式会社、および清算が終了した新光IPO投資事業組合2号を連結子会社から除外しております。</p> <p>(2) 変更後の連結子会社の数</p> <p>26社</p>
2	<p>持分法適用の範囲の重要な変更</p> <p>該当事項はありません。</p>

【会計方針の変更等】

当第2四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)	
<p>当社および国内連結子会社は、法人税法の改正に伴い、第1四半期連結会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。</p> <p>なお、これによる当第2四半期連結累計期間の営業利益、経常利益および税金等調整前四半期純利益に与える影響額は軽微であります。</p>	

【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24年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (平成24年9月30日)
みずほ証券住宅組合	258 (258) 百万円	209 (209) 百万円
その他	63 (-)	60 (-)
計	322 (258)	270 (209)

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。)

(四半期連結損益計算書関係)

※1 販売費・一般管理費のうち取引関係費の内訳および金額は次のとおりであります。

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
支払手数料	10,023百万円	11,226百万円
取引所・協会費	710	684
通信・運送費	6,079	5,534
旅費・交通費	1,516	1,355
広告宣伝費	849	590
ポイント引当金繰入れ	87	86
交際費	358	384
計	19,625	19,862

※2 販売費・一般管理費のうち人件費の内訳および金額は次のとおりであります。

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
報酬・給料	33,799百万円	28,916百万円
退職給付費用	1,684	1,732
役員退職慰労引当金繰入れ	66	56
執行役員退職慰労引当金繰入れ	19	27
株式報酬費用	187	112
賞与引当金繰入れ	8,796	6,291
福利厚生費	4,959	4,260
計	49,513	41,398

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

※1 現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係は次のとおりであります。

	前第2四半期連結累計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
現金・預金	180,627百万円	227,715百万円
預入期間が3か月を超える定期預金	△6,434	△19,117
現金及び現金同等物	174,193	208,598

(株主資本等関係)

I 前第2四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1. 配当金支払額

該当事項はありません。

2. 基準日が前第2四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2四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。

II 当第2四半期連結累計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30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2四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2四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24年6月22日開催の定時株主総会決議に基づき、資本準備金94,363百万円をその他資本剰余金に振り替え、振替後のその他資本剰余金残高117,433百万円を繰越利益剰余金に振り替えることにより、欠損填補を行っております。この結果、資本剰余金が117,433百万円減少し、利益剰余金が117,433百万円増加いたしました。

なお、株主資本の合計金額には、著しい変動はありません。

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

I 前第2四半期連結累計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1 報告セグメントごとの純営業収益、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	15,633	31,657	33,211	7,940	88,443
経常利益又は経常損失(△)	392	△4,513	△2,538	△14,355	△21,014

(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等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	△6,659
全社費用	△8,530
報告セグメントに属さないビジネス部門	△5,011
その他の調整額	△814
四半期連結損益計算書の経常損失(△)	△21,014

(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	73,858	846	4,052	9,685	88,443

(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

4 報告セグメントごとの固定資産の減損損失またはのれん等に関する情報

(固定資産に係る重要な減損損失)

該当事項はありません。

II 当第2四半期連結累計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

1 報告セグメントごとの純営業収益、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	18,799	47,797	32,328	7,817	106,742
経常利益又は経常損失(△)	3,398	11,939	4,494	△10,083	9,748

(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等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	19,832
全社費用	△6,708
報告セグメントに属さないビジネス部門	△2,474
その他の調整額	△900
四半期連結損益計算書の経常利益	9,748

(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、報告セグメント利益について税金等調整前四半期純利益または税金等調整前四半期純損失から経常利益または経常損失に変更しております。また、組織区分等を第1四半期連結会計期間から変更したことに伴い、前第2四半期連結累計期間のセグメント情報については変更後の組織区分等により作成しており、「1. 報告セグメントごとの純営業収益、利益または損失の金額に関する情報」に記載しております。

4 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	87,994	1,470	3,638	13,639	106,742

(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

5 報告セグメントごとの固定資産の減損損失またはのれん等に関する情報

(固定資産に係る重要な減損損失)

「グローバル・マーケット」および「その他」における一部の固定資産について、減損損失として特別損失を計上しております。

なお、当該減損損失の計上額は、「グローバル・マーケット」が430百万円、「その他」が25百万円であります。

(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24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	380,022	59,634
債券	7,260,530	3,734,306
CPおよびCD	20,995	—
受益証券	11,407	—
その他	55,985	—
合計	7,728,940	3,793,941

(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	2,894,983	175,118	3,176,720	200,348
為替予約取引	195,767	2,453	217,559	10,417
先物・先渡取引	461,986	1,348	795,601	15,113
スワップ取引	43,511,834	768,444	40,697,703	649,169
MTMリザーブ	—	△10,367	—	—
合計	47,064,573	936,998	44,887,584	875,049

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	1,502	1,506	3
その他	—	—	—
合計	1,502	1,506	3

(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	16,301	17,762	1,461
債券	14,575	15,115	540
その他	23,186	22,627	△558
合計	54,062	55,505	1,443

(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	5,174	178	178	5,174	178	△178
為替予約取引	11,067	5	5	27,232	105	△105
先物・先渡取引	683	8	8	660	7	△7
合計	16,925	192	192	33,066	291	△291

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	1,124	51	51	92,332	6,552	△6,552
先物・先渡取引	—	—	—	—	—	—
合計	1,124	51	51	92,332	6,552	△6,552

Ⅱ 当第2四半期連結会計期間末（平成24年9月30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	277,074	34,058
債券	8,152,117	3,350,293
CPおよびCD	40,393	—
受益証券	5,492	—
その他	35,483	—
合計	8,510,561	3,384,352

(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	2,926,457	152,991	3,109,834	166,123
為替予約取引	126,018	919	131,172	1,365
先物・先渡取引	2,393,078	18,857	3,053,776	22,990
スワップ取引	46,236,312	942,483	43,162,545	817,399
MTMリザーブ	—	△7,253	—	—
合計	51,681,868	1,107,998	49,457,328	1,007,879

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	500	502	2
その他	—	—	—
合計	500	502	2

(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	11,683	13,207	1,524
債券	13,714	14,243	529
その他	20,390	19,742	△647
合計	45,788	47,194	1,406

(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	598	10	10	598	10	△10
為替予約取引	—	—	—	—	—	—
先物・先渡取引	877	9	9	813	7	△7
スワップ取引	20,886	670	670	—	—	—
合計	22,361	690	690	1,412	18	△18

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	35,552	314	314	62,313	1,827	△1,827
先物・先渡取引	—	—	—	—	—	—
スワップ取引	—	—	—	—	—	—
合計	35,552	314	314	62,313	1,827	△1,827

(1株当たり情報)

1株当たり四半期純利益金額または四半期純損失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2四半期連結累計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり四半期純利益金額又は四半期純損失金額 (△)	△16円81銭	5円28銭
(算定上の基礎)		
四半期純利益又は四半期純損失(△)(百万円)	△26,700	8,361
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利益金額又は四半期純損失金額 (△)(百万円)	△26,700	8,361
普通株式の期中平均株式数(千株)	1,588,822	1,584,312

(注) 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。

(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11月13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	江	見	睦	生	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福	村		寛	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24年4月1日から平成25年3月31日までの連結会計年度の第2四半期連結会計期間（平成24年7月1日から平成24年9月30日まで）及び第2四半期連結累計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30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、四半期連結キャッシュ・フロー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24年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する第2四半期連結累計期間の経営成績及びキャッシュ・フローの状況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11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】	該当事項はありません。

1 【四半期報告書の記載内容の適正性に関する事項】

当社代表取締役社長本山博史は、当社の第124期第2四半期（自平成24年7月1日至平成24年9月30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しました。

2 【特記事項】

四半期報告書提出にあたり、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しました。