

四半期報告書

(第108期第3四半期)

自 平成29年10月1日

至 平成29年12月31日

日本証券金融株式会社

表 紙

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	1
2 事業の内容	1

第2 事業の状況

1 事業等のリスク	2
2 経営上の重要な契約等	2
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	2

第3 提出会社の状況

1 株式等の状況

(1) 株式の総数等	6
(2) 新株予約権等の状況	6
(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	6
(4) ライツプランの内容	6
(5) 発行済株式総数、資本金等の推移	6
(6) 大株主の状況	6
(7) 議決権の状況	7

2 役員の状況	7
---------	---

第4 経理の状況 8

1 四半期連結財務諸表

(1) 四半期連結貸借対照表	9
(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	11
四半期連結損益計算書	11
四半期連結包括利益計算書	12

2 その他	17
-------	----

第二部 提出会社の保証会社等の情報 17

[四半期レビュー報告書]

【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1項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成30年2月9日
【四半期会計期間】	第108期第3四半期（自平成29年10月1日 至平成29年12月31日）
【会社名】	日本証券金融株式会社
【英訳名】	JAPAN SECURITIES FINANCE CO., LTD.
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小林 英三
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋茅場町一丁目2番10号
【電話番号】	03(3666)3184（直通）
【事務連絡者氏名】	経営企画部長 杉山 慎一
【最寄りの連絡場所】	東京都中央区日本橋茅場町一丁目2番10号
【電話番号】	03(3666)3184（直通）
【事務連絡者氏名】	経営企画部長 杉山 慎一
【縦覧に供する場所】	日本証券金融株式会社 大阪支社 （大阪市中央区今橋二丁目4番10号） 株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1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107期 第3四半期連結 累計期間	第108期 第3四半期連結 累計期間	第107期
会計期間		自平成28年4月1日 至平成28年12月31日	自平成29年4月1日 至平成29年12月31日	自平成28年4月1日 至平成29年3月31日
営業収益	(百万円)	17,032	20,828	23,066
経常利益	(百万円)	3,366	4,582	3,611
親会社株主に帰属する四半期 (当期)純利益	(百万円)	2,848	3,775	3,078
四半期包括利益又は包括利益	(百万円)	687	6,952	△469
純資産額	(百万円)	140,869	144,076	139,712
総資産額	(百万円)	4,146,713	4,926,880	4,645,051
1株当たり四半期(当期)純利 益金額	(円)	29.48	39.44	31.90
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	(%)	3.39	2.92	3.01

回次		第107期 第3四半期連結 会計期間	第108期 第3四半期連結 会計期間
会計期間		自平成28年10月1日 至平成28年12月31日	自平成29年10月1日 至平成29年12月31日
1株当たり四半期純利益金額	(円)	11.43	16.24

- (注) 1 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、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 営業収益には、消費税等は含まれておりません。
- 3 「株式給付信託(BBT)」が保有する当社株式を、「1株当たり四半期(当期)純利益金額」の算定上、期中平均株式数の計算において控除する自己株式に含めております。
- 4 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。

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(当社および当社の関係会社)が営む事業の内容について、重要な変更はありません。また、主要な関係会社に異動はありません。

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、新たな事業等のリスクの発生、または、前事業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の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

当第3四半期連結累計期間（自平成29年4月1日 至平成29年12月31日）の株式市場についてみますと、期初18,983円で始まった日経平均株価は、北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりなどから4月14日には当期間の最安値となる18,335円まで下落しましたが、仏大統領選結果を好感して上昇に転じ6月上旬には約1年半ぶりに20,000円の大台を回復しました。その後は、北朝鮮情勢懸念の再燃を受け、9月上旬に19,200円台まで下落したものの、米国による追加利上げ期待などを背景としたドル高・円安推移やこれに伴う企業業績の上振れ期待などから、10月以降は騰勢を強めると、米税制改革法案の成立も好感され12月25日には平成4年1月以来の高値となる22,939円まで上伸し、12月末は22,764円で取引を終えました。

この期間における東京市場の制度信用取引買い残高をみますと、期初の2兆350億円台から漸減基調を辿り、5月上旬には当期間のボトムとなる1兆8,000億円程度まで減少したものの、その後は株価下落局面における個人投資家による押し目買いから増加に転じました。10月下旬以降は株価が上昇基調を辿る中で新規買いが見られ、12月中旬には当期間のピークとなる2兆5,000億円台まで回復し、12月末は2兆4,100億円台となりました。一方、期初に5,800億円台であった同売り残高は、4月中旬に当期間のボトムとなる5,700億円台まで減少したものの、その後は株価上昇局面において新規売りが見られ、10月中旬までは6,000億円台から7,000億円台で推移しました。10月下旬に当期間のピークとなる8,300億円台まで増加した以降は減少に転じ、12月末は6,300億円台となりました。

このような株式市場の動向の下で、当第3四半期連結累計期間における当社グループの貸付金総残高（期中平均）は5,915億円と前年同期比1,435億円の増加となりました。

当第3四半期連結累計期間の連結営業収益は、貸借取引業務における有価証券貸付料が増加となったことなどから、20,828百万円（前年同期比22.3%増）となりました。また、同営業費用は貸借取引および債券貸借取引における有価証券借入料が増加したことなどから10,907百万円（同33.7%増）となりました。なお、一般管理費はほぼ前年同期並みの6,063百万円（同0.7%増）となりました。

この結果、当第3四半期連結累計期間の連結営業利益は3,857百万円（同35.0%増）、同経常利益は4,582百万円（同36.1%増）となり、親会社株主に帰属する四半期純利益は3,775百万円（同32.6%増）となりました。

次に当第3四半期連結累計期間における各セグメントの営業概況は以下のとおりです。

①証券金融業

貸借取引業務では、貸借取引貸付金が期中平均で3,266億円と前年同期比683億円増加したことから、貸付金利息は増収となりました。また、貸借取引貸付有価証券が期中平均で3,843億円と前年同期比1,175億円増加し、貸株料が増収となったことに加え、貸株超過銘柄にかかる品貸料も増加したことから、これらをあわせた有価証券貸付料は増収となりました。この結果、当業務の営業収益は10,702百万円（前年同期比40.7%増）となりました。

一般貸付業務では、個人・一般事業法人向け貸付および金融商品取引業者向け貸付がともに低調に推移し、当業務の貸付金の期中平均は370億円と前年同期比85億円の減少となりました。一方、株式市況の回復に伴い、現金担保付株券等貸借取引の利用は増加しました。この結果、当業務の営業収益は、646百万円（同4.7%減）となりました。

有価証券貸付業務では、一般貸株部門が好調だったほか、債券営業部門において貸付残高の増加等により増収となった結果、当業務の営業収益は3,600百万円（同13.8%増）となりました。

その他の収益は、保有国債の利息収入および売却益が減少した一方で、保有投資信託の分配金等の収入が増加したことなどから、2,784百万円（同2.7%増）となりました。

②信託銀行業

信託銀行業務では、貸付金利の低下に伴い貸付金利息が減収となったものの、信託報酬が堅調に増加したほか、保有国債等の売却益が増加したことなどから、当業務の営業収益は2,437百万円（同9.7%増）となりました。

③不動産賃貸業

不動産賃貸業務における営業収益は655百万円（同1.1%増）となりました。

(2) 当社グループ業務別営業収益の状況

	前年同期間 (自平成28年4月1日 至平成28年12月31日)		当第3四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年12月31日)		前連結会計年度(通期) (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	
	金額(百万円)	構成比(%)	金額(百万円)	構成比(%)	金額(百万円)	構成比(%)
証券金融業	14,161	83.2	17,734	85.2	19,407	84.1
貸借取引業務	7,606	44.7	10,702	51.4	10,721	46.5
貸借取引貸付金利息	1,242	7.3	1,568	7.5	1,694	7.3
借入有価証券代り金利息	602	3.5	894	4.3	887	3.8
有価証券貸付料	5,528	32.5	7,925	38.0	7,771	33.7
一般貸付業務	677	4.0	646	3.1	907	3.9
有価証券貸付業務	3,164	18.6	3,600	17.3	4,453	19.3
株券	750	4.4	991	4.8	941	4.1
債券	2,413	14.2	2,609	12.5	3,512	15.2
その他	2,712	15.9	2,784	13.4	3,325	14.4
信託銀行業	2,222	13.0	2,437	11.7	2,792	12.1
貸付金利息	114	0.7	70	0.3	147	0.6
信託報酬	489	2.9	552	2.7	668	2.9
その他	1,618	9.5	1,814	8.7	1,977	8.6
不動産賃貸業	648	3.8	655	3.1	865	3.8
合計	17,032	100.0	20,828	100.0	23,066	100.0

(3) 当社グループ貸付金の状況（平均残高）

	前年同期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日)		当第3四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)		前連結会計年度（通期） (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	金額(億円)	構成比(%)	金額(億円)	構成比(%)	金額(億円)	構成比(%)
貸借取引貸付金	2,582	57.6	3,266	55.2	2,654	56.8
一般貸付金 (うち一般信用ファイナンス)	455 (96)	10.2 (2.2)	370 (90)	6.3 (1.5)	448 (95)	9.6 (2.0)
信託銀行貸付金	1,366	30.5	2,267	38.3	1,499	32.1
その他	75	1.7	11	0.2	70	1.5
合計	4,480	100.0	5,915	100.0	4,672	100.0
(参考) 貸借取引貸付有価証券	2,668	—	3,843	—	2,913	—

(4) 当社グループ貸付金の状況（期末残高）

	前年同期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日)		当第3四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)		前連結会計年度（通期） (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	金額(億円)	構成比(%)	金額(億円)	構成比(%)	金額(億円)	構成比(%)
貸借取引貸付金	2,615	51.3	3,711	43.1	3,685	62.7
一般貸付金 (うち一般信用ファイナンス)	420 (98)	8.2 (1.9)	508 (105)	5.9 (1.2)	408 (113)	7.0 (1.9)
信託銀行貸付金	1,990	39.0	4,290	49.8	1,763	30.0
その他	75	1.5	100	1.2	20	0.3
合計	5,100	100.0	8,610	100.0	5,877	100.0
(参考) 貸借取引貸付有価証券	4,085	—	3,627	—	3,936	—

(5) 貸借取引金利・貸株料の推移

年月日（約定日）	貸借取引融資金利	貸株等代り金金利	貸株料
平成13年5月1日	0.60%	0.00%	—
平成14年5月7日	0.60%	0.00%	0.40%
平成18年7月27日	0.74%（+0.14%）	0.00%	0.40%
平成18年9月22日	0.86%（+0.12%）	0.00%	0.40%
平成19年3月15日	1.02%（+0.16%）	0.00%	0.40%
平成19年4月5日	1.11%（+0.09%）	0.00%	0.40%
平成21年1月29日	0.97%（△0.14%）	0.00%	0.40%
平成22年11月22日	0.77%（△0.20%）	0.00%	0.40%
平成26年8月6日	0.64%（△0.13%）	0.00%	0.40%
平成28年3月9日	0.60%（△0.04%）	0.00%	0.40%
平成29年12月31日現在	0.60%	0.00%	0.40%

(6) 経営方針・経営戦略等

当第3四半期連結累計期間において、経営方針・経営戦略等について重要な変更はありません。

(7) 対処すべき課題

当第3四半期連結累計期間において、対処すべき課題について重要な変更はありません。

(8) 研究開発活動

該当事項はありません。

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	200,000,000
計	200,000,000

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29年12月31日)	提出日現在 発行数(株) (平成30年2月9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	100,000,000	100,000,000	東京証券取引所 (市場第一部)	完全議決権株式であり、権利 内容に何ら限定のない当社に おける標準となる株式 単元株式数 100株
計	100,000,000	100,000,000	—	—

(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29年10月1日 ～平成29年12月31日	—	100,000	—	10,000	—	5,181

(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】

当第3四半期会計期間末日現在の「議決権の状況」については、株主名簿の記載内容が確認できないため、記載することができないことから、直前の基準日（平成29年9月30日）に基づく株主名簿による記載をしております。

①【発行済株式】

平成29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）	普通株式 3,871,500	—	単元株式数 100株
完全議決権株式（その他）	普通株式 95,848,400	958,484	同上
単元未満株式	普通株式 280,100	—	—
発行済株式総数	100,000,000	—	—
総株主の議決権	—	958,484	—

- (注) 1. 「完全議決権株式（その他）」の欄には、当社名義の貸借取引担保保有株式等が69,900株含まれております。なお、「議決権の数」欄には、当社名義の貸借取引担保保有株式等にかかる議決権の数699個が含まれておりません。
2. 「完全議決権株式（その他）」の欄には、「株式給付信託（BBT）」に係る信託口が所有する株式627,700株が含まれております。
3. 「単元未満株式」欄の普通株式には自己株式43株が含まれております。

②【自己株式等】

平成29年12月31日現在

所有者の氏名又は名称	所有者の住所	自己名義所有株式数（株）	他人名義所有株式数（株）	所有株式数の合計（株）	発行済株式総数に対する所有株式数の割合（%）
日本証券金融株式会社	東京都中央区日本橋茅場町1-2-10	3,871,500	—	3,871,500	3.87
計	—	3,871,500	—	3,871,500	3.87

(注) 直前の基準日（平成29年9月30日）以降に実施した自己株式の取得により、自己保有株式は、平成29年12月31日現在で4,472,179株（議決権の数は44,721個）となっております。

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）に基づい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29年10月1日から平成29年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成29年4月1日から平成29年12月31日まで）に係る四半期連結財務諸表について、東陽監査法人による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29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	1,076,761	1,267,456
コールローン	33,000	70,000
有価証券	238,498	128,334
営業貸付金	587,752	861,010
繰延税金資産	278	295
借入有価証券代り金	1,930,722	1,736,637
その他	75,682	70,269
貸倒引当金	△254	△293
流動資産合計	3,942,440	4,133,710
固定資産		
有形固定資産	6,621	6,364
無形固定資産	4,346	4,036
投資その他の資産		
投資有価証券	690,208	781,232
固定化営業債権	1,160	846
その他	1,431	1,535
貸倒引当金	△1,158	△846
投資その他の資産合計	691,642	782,768
固定資産合計	702,610	793,169
資産合計	4,645,051	4,926,880
負債の部		
流動負債		
コールマネー	626,898	1,032,389
短期借入金	13,010	13,010
1年内返済予定の長期借入金	—	1,000
コマーシャル・ペーパー	185,000	173,000
未払法人税等	387	391
賞与引当金	534	329
役員賞与引当金	67	—
貸付有価証券代り金	2,492,578	2,400,048
信託勘定借	1,095,054	1,071,815
その他	63,908	67,170
流動負債合計	4,477,440	4,759,154

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成29年3月31日)	当第3四半期連結会計期間 (平成29年12月31日)
固定負債		
長期借入金	4,000	3,000
繰延税金負債	9,410	10,391
再評価に係る繰延税金負債	74	74
役員退職慰労引当金	41	41
役員株式給付引当金	51	44
退職給付に係る負債	2,941	320
資産除去債務	50	50
デリバティブ債務	10,680	9,067
その他	648	658
固定負債合計	27,898	23,649
負債合計	4,505,339	4,782,803
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000	10,000
資本剰余金	11,325	11,325
利益剰余金	106,196	108,138
自己株式	△2,207	△2,961
株主資本合計	125,314	126,502
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	19,736	24,076
繰延ヘッジ損益	△5,083	△6,217
土地再評価差額金	168	168
退職給付に係る調整累計額	△423	△452
その他の包括利益累計額合計	14,397	17,574
純資産合計	139,712	144,076
負債純資産合計	4,645,051	4,926,880

(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28年4月1日 至 平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)
営業収益		
貸付金利息	1,926	2,136
借入有価証券代り金利息	1,008	1,341
有価証券貸付料	8,346	11,150
その他	5,751	6,200
営業収益合計	17,032	20,828
営業費用		
支払利息	861	977
有価証券借入料	6,219	8,481
その他	1,075	1,448
営業費用合計	8,156	10,907
営業総利益	8,875	9,920
一般管理費	6,018	6,063
営業利益	2,856	3,857
営業外収益		
受取利息	172	175
受取配当金	418	410
持分法による投資利益	—	126
償却債権取立益	5	1
その他	56	18
営業外収益合計	653	732
営業外費用		
持分法による投資損失	139	—
自己株式取得費用	3	7
その他	0	0
営業外費用合計	143	7
経常利益	3,366	4,582
特別利益		
投資有価証券売却益	63	5
特別利益合計	63	5
特別損失		
投資有価証券売却損	—	2
ゴルフ会員権売却損	2	—
特別損失合計	2	2
税金等調整前四半期純利益	3,427	4,585
法人税、住民税及び事業税	497	698
法人税等調整額	82	112
法人税等合計	579	810
四半期純利益	2,848	3,775
非支配株主に帰属する四半期純利益	—	—
親会社株主に帰属する四半期純利益	2,848	3,775

【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28年4月1日 至 平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)
四半期純利益	2,848	3,775
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△4,918	4,425
繰延ヘッジ損益	2,597	△1,134
退職給付に係る調整額	78	△42
持分法適用会社に対する持分相当額	82	△71
その他の包括利益合計	△2,160	3,176
四半期包括利益	687	6,952
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	687	6,952
非支配株主に係る四半期包括利益	—	—

【注記事項】

(追加情報)

(取締役等に信託を通じて自社の株式を交付する取引)

当社は、当社取締役（社外取締役を除きます。）及び執行役員（以下あわせて「取締役等」といいます。）の報酬と当社の業績及び株式価値との連動性をより明確にし、中長期的な業績の向上と企業価値の増大への貢献意識を高めることを目的として、業績連動型株式報酬制度「株式給付信託（BBT（＝Board Benefit Trust））」（以下「本制度」といいます。）を導入しております。

1 取引の概要

本制度は、当社が拠出する金銭を原資として当社株式が信託を通じて取得され、取締役等に対して、取締役会が定める「役員株式給付規程」に従って、当社株式及び当社株式を時価で換算した金額相当の金銭（以下「当社株式等」といいます。）が信託を通じて給付される業績連動型の株式報酬制度です。

なお、取締役等が当社株式等の給付を受ける時期は、原則として取締役等の退任時とします。

2 信託に残存する自社の株式

本制度に関する会計処理については、「従業員等に信託を通じて自社の株式を交付する取引に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第30号 平成27年3月26日）に準じて、総額法を適用しております。これにより、信託に残存する当社株式を、信託における帳簿価額（付随費用の金額を除く。）で純資産の部に自己株式として計上しております。当該自己株式の帳簿価額及び株式数は、前連結会計年度267百万円、640千株、当第3四半期連結会計期間262百万円、627千株であります。

(退職給付信託の設定)

当社は、第2四半期連結会計期間において、退職給付財政の更なる健全化を目的として、退職給付信託を設定し、現金2,665百万円を拠出いたしました。これにより、退職給付に係る負債が同額減少しております。

(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28年4月1日 至 平成28年12月31日)	当第3四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)
減価償却費	433百万円	1,024百万円

(株主資本等関係)

I 前第3四半期連結累計期間(自平成28年4月1日至平成28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	1株当たり配当額	基準日	効力発生日	配当の原資
平成28年6月24日 定時株主総会	普通株式	774百万円	8円	平成28年3月31日	平成28年6月27日	利益剰余金
平成28年11月7日 取締役会	普通株式	775百万円	8円	平成28年9月30日	平成28年12月5日	利益剰余金

(注) 平成28年11月7日取締役会の決議による配当金の総額には、「株式給付信託(BBT)」が保有する当社株式に対する配当金5百万円が含まれております。

2. 株主資本の金額の著しい変動

当社は、平成28年5月12日開催の取締役会において、平成28年5月13日から平成29年3月22日にかけて、取得する株式の総数2,000,000株、取得総額1,000百万円を上限に自己株式を取得することを決議し、平成28年5月から平成28年12月にかけて635,800株を297百万円で取得しております。

また、当社は、「株式給付信託(BBT)」制度の導入に伴い、平成28年7月29日開催の取締役会決議に基づき、資産管理サービス信託銀行株式会社(信託E口)に対し、平成28年8月15日を払込期日として第三者割当により自己株式640,000株を処分しております。

これらにより、当第3四半期連結累計期間において資本剰余金が145百万円減少、自己株式が153百万円増加し、当第3四半期連結会計期間末において資本剰余金が11,325百万円、自己株式が2,206百万円となっております。

II 当第3四半期連結累計期間(自平成29年4月1日至平成29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	1株当たり配当額	基準日	効力発生日	配当の原資
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	968百万円	10円	平成29年3月31日	平成29年6月26日	利益剰余金
平成29年11月6日 取締役会	普通株式	865百万円	9円	平成29年9月30日	平成29年12月4日	利益剰余金

(注) 1 平成29年6月23日定時株主総会の決議による配当金の総額には、「株式給付信託(BBT)」が保有する当社株式に対する配当金6百万円が含まれております。

2 平成29年11月6日取締役会の決議による配当金の総額には、「株式給付信託(BBT)」が保有する当社株式に対する配当金5百万円が含まれております。

2. 株主資本の金額の著しい変動

当社は、平成29年5月11日開催の取締役会において、平成29年5月12日から平成30年3月16日にかけて、取得する株式の総数1,500,000株、取得総額1,000百万円を上限に自己株式を取得することを決議し、平成29年5月から平成29年12月にかけて1,300,000株を758百万円で取得しております。この取得などにより、当第3四半期連結累計期間において自己株式が754百万円増加し、当第3四半期連結会計期間末において自己株式が2,961百万円となっております。

(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28年4月1日 至平成28年12月31日）

1. 報告セグメントごとの営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	証券金融業	信託銀行業	不動産賃貸業	合計
営業収益				
外部顧客への営業収益	14,161	2,222	648	17,032
セグメント間の内部営業収益又は振替高	5	5	293	304
計	14,166	2,227	942	17,337
セグメント利益	2,750	397	492	3,640

2. 報告セグメントの利益又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及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	3,640
セグメント間取引消去	△134
持分法投資損失	△139
その他の調整額	—
四半期連結損益計算書の経常利益	3,366

II 当第3四半期連結累計期間（自平成29年4月1日 至平成29年12月31日）

1. 報告セグメントごとの営業収益及び利益又は損失の金額に関する情報

(単位：百万円)

	証券金融業	信託銀行業	不動産賃貸業	合計
営業収益				
外部顧客への営業収益	17,734	2,437	655	20,828
セグメント間の内部営業収益又は振替高	2	0	294	297
計	17,737	2,438	950	21,125
セグメント利益	3,778	311	497	4,587

2. 報告セグメントの利益又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及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	4,587
セグメント間取引消去	△132
持分法投資利益	126
その他の調整額	—
四半期連結損益計算書の経常利益	4,582

(有価証券関係)

I 前連結会計年度末 (平成29年3月31日)

その他有価証券

	取得原価	連結貸借対照表計上額	差額
(1) 株式	5,307百万円	11,824百万円	6,516百万円
(2) 債券	872,814 "	893,715 "	20,900 "
①国債・地方債等	630,557 "	655,082 "	24,524 "
②社債	197,392 "	197,558 "	166 "
③その他	44,864 "	41,073 "	△3,791 "
(3) その他	4,911 "	5,791 "	880 "
計	883,033 "	911,330 "	28,297 "

(注) 非上場株式 (連結貸借対照表計上額 2,900百万円)、非上場REIT (連結貸借対照表計上額 9,232百万円) 及び投資事業有限責任組合出資金 (連結貸借対照表計上額 130百万円) については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表には含めておりません。

II 当第3四半期連結会計期間末 (平成29年12月31日)

その他有価証券が、企業集団の事業の運営において重要なものとなっており、かつ、前連結会計年度の末日に比べて著しい変動が認められます。

	取得原価	四半期連結貸借対照表計上額	差額
(1) 株式	5,279百万円	14,020百万円	8,740百万円
(2) 債券	845,000 "	869,441 "	24,441 "
①国債・地方債等	654,329 "	678,266 "	23,937 "
②社債	170,250 "	170,251 "	1 "
③その他	20,420 "	20,923 "	502 "
(3) その他	3,892 "	5,325 "	1,433 "
計	854,172 "	888,787 "	34,615 "

(注) 非上場株式 (四半期連結貸借対照表計上額 2,913百万円)、非上場REIT (四半期連結貸借対照表計上額 12,239百万円) 及び投資事業有限責任組合出資金 (四半期連結貸借対照表計上額 509百万円) については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表には含めておりません。

(追加情報)

当社が保有する変動利付国債の評価については、「金融資産の時価の算定に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第25号 (平成20年10月28日 企業会計基準委員会))に基づき、情報ベンダーから入手した価格を合理的に算定された価額として適用しております。これは実際の売買事例が極めて少ない等の理由から市場価格が公正な評価額を示していないと考えられるためであります。

なお、情報ベンダーの採用している理論値モデルは、フォワードレート・プライシング・モデルであり、国債スポットレート及びスワップション・ボラティリティを価格決定変数としております。

(1 株当たり情報)

1 株当たり四半期純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前第3 四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年12月31日)	当第3 四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年12月31日)
1 株当たり四半期純利益金額	29円48銭	39円44銭
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益金額 (百万円)	2,848	3,775
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	—	—
普通株式に係る親会社株主に帰属する四半期 純利益金額 (百万円)	2,848	3,775
普通株式の期中平均株式数 (千株)	96,579	95,718

(注) 1 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。

2 「株式給付信託 (BBT)」が保有する当社株式を、「1 株当たり四半期純利益金額」の算定上、期中平均株式数の計算において控除する自己株式に含めております (前第3 四半期連結累計期間323千株、当第3 四半期連結累計期間632千株)。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

2 【その他】

平成29年11月6日開催の取締役会において、当期中間配当に関し、次のとおり決議いたしました。

1. 中間配当による配当金の総額 …………… 865百万円
2. 1 株当たりの金額 …………… 9 円00銭
3. 支払請求の効力発生日及び支払開始日 …………… 平成29年12月4日

(注) 平成29年9月30日現在の株主名簿に記録された株主又は登録株式質権者に対し、支払いを行っております。

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30年2月1日

日本証券金融株式会社

取締役会 御中

東陽監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 福田 光博 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 小林 弥 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 後藤 秀洋 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」に掲げられている日本証券金融株式会社の平成29年4月1日から平成30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29年10月1日から平成29年12月31日まで）及び第3四半期連結累計期間（平成29年4月1日から平成29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、日本証券金融株式会社及び連結子会社の平成29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. XBR Lデータは四半期レビューの対象には含まれていません。