

四半期報告書

(第107期第1四半期)

自 平成28年4月1日

至 平成28年6月30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	5
(2) 新株予約権等の状況	5
(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	5
(4) ライツプランの内容	5
(5) 発行済株式総数、資本金等の推移	5
(6) 大株主の状況	5
(7) 議決権の状況	6

2 役員の状況	6
---------	---

第4 経理の状況

1 四半期連結財務諸表

(1) 四半期連結貸借対照表	8
(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	10
四半期連結損益計算書	10
四半期連結包括利益計算書	11

2 その他	15
-------	----

第二部 提出会社の保証会社等の情報

[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28年8月8日
【四半期会計期間】	第107期第1四半期（自平成28年4月1日至平成28年6月30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
【事務連絡者氏名】	経営企画部長 田原 徹也
【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
【事務連絡者氏名】	経営企画部長 田原 徹也
【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106期 第1四半期連結 累計期間	第107期 第1四半期連結 累計期間	第106期
会計期間	自平成27年4月1日 至平成27年6月30日	自平成28年4月1日 至平成28年6月30日	自平成27年4月1日 至平成28年3月31日
営業収益 (百万円)	6,111	5,650	22,035
経常利益 (百万円)	1,406	1,293	3,349
親会社株主に帰属する四半期 (当期)純利益 (百万円)	1,118	1,065	2,645
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	1,397	△1,189	8,410
純資産額 (百万円)	137,370	140,066	142,030
総資産額 (百万円)	3,065,946	3,561,063	3,249,170
1株当たり四半期(当期)純利 益金額 (円)	11.21	11.00	26.90
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 (%)	4.48	3.93	4.37

(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 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1四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1四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1四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1四半期連結累計期間（自平成28年4月1日 至平成28年6月30日）の株式市場についてみますと、期初16,164円で始まった日経平均株価は、欧米株高や円高の一服、原油価格の持ち直しなどを受けて上昇し、4月22日には当期間の最高値となる17,572円をつけた後、4月末には日本銀行の追加緩和見送りへの失望感から16,100円台まで下落しました。その後、6月上旬までは概ね16,000円から17,000円のボックス圏で推移しましたが、6月24日には、英国のEU離脱決定に伴う欧州情勢懸念の高まりから、円相場の急伸とともに大幅に下落し、当期間の最安値となる14,952円をつけ、6月末は15,575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2兆2,200億円台から概ね漸減基調で推移し、6月中旬以降は株価急落等に伴う個人投資家による持ち高整理の処分売りがみられたことから、6月末は1兆8,000億円台となりました。一方、期初に3,900億円台であった同売り残高は、株価上昇時の新規売りにより、4月下旬に当期間のピークとなる5,300億円台となりました。その後、6月下旬の株価急落局面において買戻しが進み、6月末は3,400億円台となりました。

このような株式市場の動向の下で、当第1四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4,815億円と前年同期比2,324億円の減少となりました。

当第1四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貸付金利息が減収となったことなどから、5,650百万円（前年同期比7.5%減）となりました。一方、日本銀行によるマイナス金利政策の導入を受けて、資金調達コストが減少したことなどから、同営業費用は2,668百万円（同13.0%減）となりました。また、一般管理費はほぼ前年同期並みの1,934百万円（同2.0%増）となりました。

この結果、当第1四半期連結累計期間の連結営業利益は1,047百万円（同8.6%減）となりました。同経常利益は、受取配当金および受取利息が増加したものの、持分法による投資損失が拡大したことなどから、1,293百万円（同8.0%減）となり、親会社株主に帰属する四半期純利益は1,065百万円（同4.7%減）となりました。

次に当第1四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

貸借取引業務においては、貸借取引貸付金が期中平均で2,837億円と前年同期比1,415億円減少したことから、貸付金利息は減収となりました。また、貸借取引貸付有価証券は期中平均で2,244億円と前年同期比632億円減少したことから、貸株料が減収となったことに加え、貸株超過銘柄にかかる品貸料も減少したことから、これらをあわせた有価証券貸付料は減収となりました。この結果、当業務の営業収益は2,057百万円（前年同期比32.1%減）となりました。

公社債貸付・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555億円と前年同期比1,483億円の減少となりました。また、現金担保付株券等貸借取引の利用も金融商品取引業者による資金需要の低下により減少しました。この結果、当業務の営業収益は、236百万円（同52.7%減）となりました。

有価証券貸付業務の営業収益は、債券営業部門において有価証券貸付料が大幅な増収となったほか、一般貸株部門において有価証券貸付料が前年同期並みの水準となった結果、当業務の営業収益は1,033百万円（同85.3%増）となりました。

その他の収益は、保有国債の利息収入が減少した一方で、保有株式の受取配当金収入および保有国債の売却益がともに増加したことから961百万円（同1.5%増）となりました。

②信託銀行業

信託銀行業務においては、保有国債等の売却益などが増加したことに加え、信託銀行貸付金が期中平均残高で1,346億円と前年同期比823億円増加して貸付金利息が増収となったことから、当業務の営業収益は1,152百万円（同31.2%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209百万円(同5.4%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27年4月1日 至平成27年6月30日)		当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)		前連結会計年度(通期) (自平成27年4月1日 至平成28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	5,033	82.3	4,288	75.9	17,776	80.6
貸借取引業務	3,029	49.6	2,057	36.4	10,579	48.0
貸借取引貸付金利息	726	11.9	448	7.9	2,720	12.3
借入有価証券代り金利息	206	3.4	142	2.5	575	2.6
有価証券貸付料	2,031	33.2	1,398	24.8	6,840	31.0
公社債貸付・一般貸付業務	499	8.1	236	4.2	1,753	7.9
有価証券貸付業務	557	9.1	1,033	18.3	2,241	10.2
株券	251	4.1	250	4.4	907	4.1
債券	305	5.0	782	13.9	1,334	6.1
その他	946	15.5	961	17.0	3,201	14.5
信託銀行業	878	14.4	1,152	20.4	3,451	15.7
貸付金利息	39	0.6	43	0.8	144	0.7
信託報酬	155	2.5	156	2.8	627	2.8
その他	683	11.2	951	16.8	2,679	12.2
不動産賃貸業	199	3.3	209	3.7	807	3.7
合計	6,111	100.0	5,650	100.0	22,035	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27年4月1日 至平成27年6月30日)		当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)		前連結会計年度(通期) (自平成27年4月1日 至平成28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	4,253	59.6	2,837	58.9	4,014	62.0
公社債貸付金・一般貸付金 (うち一般信用ファイナンス)	2,039 (221)	28.6 (3.1)	555 (96)	11.5 (2.0)	1,623 (155)	25.1 (2.4)
信託銀行貸付金	522	7.3	1,346	28.0	545	8.4
その他	325	4.5	75	1.6	287	4.5
合計	7,140	100.0	4,815	100.0	6,470	100.0
(参考) 貸借取引貸付有価証券	2,876	—	2,244	—	2,274	—

(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27年4月1日 至 平成27年6月30日)		当第1四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)		前連結会計年度（通期） (自 平成27年4月1日 至 平成28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	4,667	64.8	2,554	58.4	3,241	57.1
公社債貸付金・一般貸付金 (うち一般信用ファイナンス)	1,708 (155)	23.8 (2.2)	415 (83)	9.5 (1.9)	950 (114)	16.7 (2.0)
信託銀行貸付金	498	6.9	1,331	30.4	1,360	24.0
その他	325	4.5	75	1.7	125	2.2
合計	7,200	100.0	4,377	100.0	5,677	100.0
(参考) 貸借取引貸付有価証券	3,120	—	2,110	—	2,586	—

(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28年6月30日現在	0.60%	0.00%	0.40%

(6) 対処すべき課題

当第1四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。

(7) 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1四半期会計期間 末現在発行数(株) (平成28年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成28年8月8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28年4月1日 ～平成28年6月30日	—	100,000	—	10,000	—	5,181

(6)【大株主の状況】

当四半期会計期間は第1四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1四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28年3月31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28年6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）	普通株式 3,172,500	—	単元株式数 100株
完全議決権株式（その他）	普通株式 96,520,500	963,822	同上
単元未満株式	普通株式 307,000	—	—
発行済株式総数	100,000,000	—	—
総株主の議決権	—	963,822	—

(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138,300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1,383個が含まれておりません。

2. 「単元未満株式」欄の普通株式には自己株式87株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成28年6月30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	3,172,500	—	3,172,500	3.17
計	—	3,172,500	—	3,172,500	3.17

(注) 直前の基準日（平成28年3月31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28年6月30日現在で3,172,662株（議決権の数は31,726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1四半期連結会計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30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28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	266,377	683,311
コールローン	—	3,000
有価証券	431,565	325,230
営業貸付金	567,748	437,739
繰延税金資産	167	72
借入有価証券代り金	1,025,617	1,163,720
その他	45,122	51,716
貸倒引当金	△236	△243
流動資産合計	2,336,363	2,664,548
固定資産		
有形固定資産	6,982	6,911
無形固定資産	4,229	4,180
投資その他の資産		
投資有価証券	900,167	880,822
固定化営業債権	1,562	1,197
その他	1,423	4,595
貸倒引当金	△1,557	△1,192
投資その他の資産合計	901,595	885,422
固定資産合計	912,806	896,514
資産合計	3,249,170	3,561,063
負債の部		
流動負債		
コールマネー	720,900	592,700
短期借入金	198,010	13,010
コマーシャル・ペーパー	122,000	47,500
未払法人税等	297	143
繰延税金負債	—	2
賞与引当金	484	238
役員賞与引当金	76	—
貸付有価証券代り金	1,549,653	1,862,019
信託勘定借	452,773	835,478
その他	31,258	28,701
流動負債合計	3,075,453	3,379,793

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成28年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成28年6月30日)
固定負債		
長期借入金	3,000	4,000
繰延税金負債	11,553	12,423
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
退職給付に係る負債	3,382	3,348
資産除去債務	49	49
デリバティブ債務	12,859	20,610
その他	725	654
固定負債合計	31,686	41,203
負債合計	3,107,139	3,420,996
純資産の部		
株主資本		
資本金	10,000	10,000
資本剰余金	11,470	11,470
利益剰余金	104,668	104,959
自己株式	△2,053	△2,053
株主資本合計	124,085	124,376
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	27,877	28,922
繰延ヘッジ損益	△9,248	△12,579
土地再評価差額金	168	168
退職給付に係る調整累計額	△851	△820
その他の包括利益累計額合計	17,944	15,689
純資産合計	142,030	140,066
負債純資産合計	3,249,170	3,561,063

(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27年4月1日 至平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)
営業収益		
貸付金利息	1,104	686
借入有価証券代り金利息	521	242
有価証券貸付料	2,449	2,376
その他	2,035	2,344
営業収益合計	6,111	5,650
営業費用		
支払利息	772	311
有価証券借入料	1,915	1,632
その他	380	724
営業費用合計	3,068	2,668
営業総利益	3,042	2,982
一般管理費	1,896	1,934
営業利益	1,146	1,047
営業外収益		
受取利息	52	57
受取配当金	201	257
償却債権取立益	11	—
その他	20	20
営業外収益合計	285	334
営業外費用		
持分法による投資損失	17	89
その他	8	0
営業外費用合計	25	89
経常利益	1,406	1,293
税金等調整前四半期純利益	1,406	1,293
法人税、住民税及び事業税	113	125
法人税等調整額	173	102
法人税等合計	287	227
四半期純利益	1,118	1,065
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	1,118	1,065

【四半期連結包括利益計算書】

【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27年4月1日 至 平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)
四半期純利益	1,118	1,065
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	397	1,167
繰延ヘッジ損益	△136	△3,331
土地再評価差額金	0	—
退職給付に係る調整額	△0	26
持分法適用会社に対する持分相当額	17	△117
その他の包括利益合計	278	△2,255
四半期包括利益	1,397	△1,189
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	1,397	△1,189
非支配株主に係る四半期包括利益	—	—

【注記事項】

(会計方針の変更)

(平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当第1四半期連結会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

これによる損益に与える影響は軽微であります。

(追加情報)

(繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当第1四半期連結会計期間から適用しております。

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

当第1四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1四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1四半期連結累計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)
減価償却費	149百万円	149百万円

(株主資本等関係)

I 前第1四半期連結累計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年6月30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27年6月24日 定時株主総会	普通株式	798百万円	8円	平成27年3月31日	平成27年6月25日	利益剰余金

2. 株主資本の金額の著しい変動

当社は、平成27年5月11日開催の取締役会において、平成27年5月12日から平成28年3月18日にかけて、取得する株式の総数3,000,000株、取得総額2,500百万円を上限に自己株式を取得することを決議し、平成27年5月から平成27年6月にかけて500,000株を372百万円で取得しております。この取得などにより、当第1四半期連結累計期間において自己株式が373百万円増加し、当第1四半期連結会計期間末において自己株式が487百万円となっております。

II 当第1四半期連結累計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年6月30日)

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

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

I 前第1四半期連結累計期間(自平成27年4月1日至平成27年6月30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	5,033	878	199	6,111
セグメント間の内部営業収益又は振替高	5	0	97	104
計	5,039	879	296	6,215
セグメント利益	1,146	264	163	1,574

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	1,574
セグメント間取引消去	△151
持分法投資損失	△17
その他の調整額	—
四半期連結損益計算書の経常利益	1,406

II 当第1四半期連結累計期間(自平成28年4月1日至平成28年6月30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	4,288	1,152	209	5,650
セグメント間の内部営業収益又は振替高	1	△0	97	98
計	4,290	1,151	307	5,749
セグメント利益	1,126	203	186	1,517

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	1,517
セグメント間取引消去	△134
持分法投資損失	△89
その他の調整額	—
四半期連結損益計算書の経常利益	1,293

(有価証券関係)

I 前連結会計年度末 (平成28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	5,529百万円	12,079百万円	6,550百万円
(2) 債券	1,231,265 "	1,264,085 "	32,820 "
①国債・地方債等	971,241 "	1,003,869 "	32,628 "
②社債	204,256 "	204,474 "	217 "
③その他	55,767 "	55,741 "	△26 "
(3) その他	1,939 "	2,615 "	675 "
計	1,238,734 "	1,278,780 "	40,045 "

(注) 非上場株式 (連結貸借対照表計上額 2,900百万円) 及び非上場R E I T (連結貸借対照表計上額 5,031百万円) 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1四半期連結会計期間末 (平成28年6月30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	5,492百万円	8,851百万円	3,358百万円
(2) 債券	1,100,577 "	1,138,525 "	37,947 "
①国債・地方債等	842,155 "	884,415 "	42,260 "
②社債	200,836 "	201,175 "	338 "
③その他	57,584 "	52,933 "	△4,650 "
(3) その他	3,872 "	4,282 "	410 "
計	1,109,942 "	1,151,658 "	41,716 "

(注) 非上場株式 (連結貸借対照表計上額 2,900百万円) 及び非上場R E I T (連結貸借対照表計上額 6,711百万円) 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)

当社及び一部の連結子会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1四半期連結累計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年6月30日)
1株当たり四半期純利益金額	11円21銭	11円00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)	1,118	1,065
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)	1,118	1,065
普通株式の期中平均株式数(千株)	99,785	96,816

(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)

(第三者割当による自己株式の処分)

当社は、平成28年7月29日開催の取締役会において、下記の通り、第三者割当による自己株式の処分(以下、「本自己株式処分」といいます。)を行うことについて決議しております。

1 本自己株式処分の概要

処分期日 : 平成28年8月15日
処分株式数 : 640,000株
処分価額 : 1株につき金418円
資金調達額 : 267,520,000円
処分方法 : 第三者割当の方法によります。
処分予定先 : 資産管理サービス信託銀行株式会社

2 処分の目的及び理由

当社は、平成28年5月12日開催の取締役会において当社の取締役(社外取締役を除く。)および執行役員に対する新たな株式報酬制度「株式給付信託(BBT(=Board Benefit Trust)以下、「本制度」といいます。)」を導入することを決議し、本制度に関する議案を平成28年6月24日開催の第106回定時株主総会に付議し、承認されました。本自己株式処分は、本制度の導入に際し設定される当社株式の保有及び処分を行う資産管理サービス信託銀行株式会社(本制度の受託者たるみずほ信託銀行株式会社から再信託を受けた再信託受託者)に対し、第三者割当により自己株式を処分するものです。

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28年8月3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 酒井 宏暢 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 小林 弥 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28年4月1日から平成29年3月31日までの連結会計年度の第1四半期連結会計期間（平成28年4月1日から平成28年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成28年4月1日から平成28年6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28年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する第1四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。