

四半期報告書

(第108期第1四半期)

自 平成29年4月1日

至 平成29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	16
-------	----

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29年8月9日
【四半期会計期間】	第108期第1四半期（自平成29年4月1日至平成29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 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
【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1四半期連結 累計期間	第108期 第1四半期連結 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6月30日	自平成29年4月1日 至平成29年6月30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)	5,650	6,472	23,066
経常利益 (百万円)	1,293	1,671	3,611
親会社株主に帰属する四半期 (当期)純利益 (百万円)	1,065	1,317	3,078
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	△1,189	2,387	△469
純資産額 (百万円)	140,066	140,960	139,712
総資産額 (百万円)	3,561,063	4,525,026	4,645,051
1株当たり四半期(当期)純利 益金額 (円)	11.00	13.70	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 (%)	3.93	3.11	3.01

(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、第107期及び第108期第1四半期連結累計期間の「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29年4月1日 至平成29年6月30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、利益確定売りなどから20,000円を挟んだ展開となりましたが、中旬以降は米国利上げ実施に伴うドル高・円安推移などを好感し、6月20日には当期間の最高値となる20,230円を付け、6月末は20,033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2兆350億円台をピークに漸減基調で推移し、5月上旬には1兆8,000億円程度まで減少しましたが、6月末は1兆9,900億円台まで回復しました。一方、期初に5,800億円台であった同売り残高は、4月中旬の株価下落局面で5,700億円台まで減少しましたが、その後は株価上昇につれて新規売りが増加し、6月上旬に当期間のピークとなる7,700億円台まで回復し、6月末は7,000億円台となりました。

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5,253億円と前年同期比438億円の増加となりました。

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有価証券貸付料が増収となったことなどから、6,472百万円（前年同期比14.5%増）となりました。一方、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から3,099百万円（同16.2%増）となりました。また、一般管理費はほぼ前年同期並みの1,903百万円（同1.6%減）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1,469百万円（同40.2%増）、同経常利益は1,671百万円（同29.2%増）となり、親会社株主に帰属する四半期純利益は1,317百万円（同23.6%増）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3,084億円と前年同期比246億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3,732億円と前年同期比1,488億円増加し、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大幅に増加したことから、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3,207百万円（前年同期比55.9%増）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374億円と前年同期比181億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、216百万円（同8.5%減）となりました。

有価証券貸付業務の営業収益は、一般貸株部門においては有価証券貸付料が前年同期を下回ったものの、債券営業部門において有価証券貸付料が増収となったことから、当業務の営業収益は1,081百万円（同4.6%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、保有投資信託の分配金収入が増加したことなどから、1,169百万円（同21.7%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が減少したほか、信託銀行貸付金が期中平均残高で1,788億円と前年同期比442億円増加したものの貸付金利の低下に伴い貸付金利息が減収となったことなどから、当業務の営業収益は578百万円（同49.8%減）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219百万円（同4.3%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6月30日)		当第1四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30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	4,288	75.9	5,674	87.7	19,407	84.1
貸借取引業務	2,057	36.4	3,207	49.6	10,721	46.5
貸借取引貸付金利息	448	7.9	489	7.6	1,694	7.3
借入有価証券代り金利息	142	2.5	288	4.5	887	3.8
有価証券貸付料	1,398	24.8	2,330	36.0	7,771	33.7
公社債貸付・一般貸付業務	236	4.2	216	3.3	907	3.9
有価証券貸付業務	1,033	18.3	1,081	16.7	4,453	19.3
株券	250	4.4	232	3.6	941	4.1
債券	782	13.9	848	13.1	3,512	15.2
その他	961	17.0	1,169	18.1	3,325	14.4
信託銀行業	1,152	20.4	578	8.9	2,792	12.1
貸付金利息	43	0.8	27	0.4	147	0.6
信託報酬	156	2.8	174	2.7	668	2.9
その他	951	16.8	375	5.8	1,977	8.6
不動産賃貸業	209	3.7	219	3.4	865	3.8
合計	5,650	100.0	6,472	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6月30日)		当第1四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30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	2,837	58.9	3,084	58.7	2,654	56.8
公社債貸付金・一般貸付金 (うち一般信用ファイナンス)	555 (96)	11.5 (2.0)	374 (94)	7.1 (1.8)	448 (95)	9.6 (2.0)
信託銀行貸付金	1,346	28.0	1,788	34.1	1,499	32.1
その他	75	1.6	6	0.1	70	1.5
合計	4,815	100.0	5,253	100.0	4,672	100.0
(参考) 貸借取引貸付有価証券	2,244	—	3,732	—	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6月30日)		当第1四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30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	2,554	58.4	3,316	60.8	3,685	62.7
公社債貸付金・一般貸付金 (うち一般信用ファイナンス)	415 (83)	9.5 (1.9)	342 (74)	6.3 (1.4)	408 (113)	7.0 (1.9)
信託銀行貸付金	1,331	30.4	1,792	32.9	1,763	30.0
その他	75	1.7	—	—	20	0.3
合計	4,377	100.0	5,450	100.0	5,877	100.0
(参考) 貸借取引貸付有価証券	2,110	—	4,157	—	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29年6月30日)	提出日現在 発行数(株) (平成29年8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4月1日 ～平成29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29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29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 3,170,500	—	単元株式数 100株
完全議決権株式（その他）	普通株式 96,541,200	965,167	同上
単元未満株式	普通株式 288,300	—	—
発行済株式総数	100,000,000	—	—
総株主の議決権	—	965,167	—

- (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24,500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245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）」にかかる信託口が所有する株式640,000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36株が含まれております。

② 【自己株式等】

平成29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	3,170,500	—	3,170,500	3.17
計	—	3,170,500	—	3,170,500	3.17

(注) 直前の基準日（平成29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29年6月30日現在で3,471,033株（議決権の数は34,710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29年4月1日から平成29年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成29年4月1日から平成29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29年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成29年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	1,076,761	1,321,343
コールローン	33,000	63,000
有価証券	238,498	215,294
営業貸付金	587,752	545,069
繰延税金資産	278	249
借入有価証券代り金	1,930,722	1,494,389
その他	75,682	71,758
貸倒引当金	△254	△240
流動資産合計	3,942,440	3,710,865
固定資産		
有形固定資産	6,621	6,537
無形固定資産	4,346	4,152
投資その他の資産		
投資有価証券	690,208	802,109
固定化営業債権	1,160	1,107
その他	1,431	1,358
貸倒引当金	△1,158	△1,105
投資その他の資産合計	691,642	803,470
固定資産合計	702,610	814,161
資産合計	4,645,051	4,525,026
負債の部		
流動負債		
コールマネー	626,898	880,487
短期借入金	13,010	13,010
コマーシャル・ペーパー	185,000	113,000
未払法人税等	387	193
賞与引当金	534	252
役員賞与引当金	67	—
貸付有価証券代り金	2,492,578	2,197,459
信託勘定借	1,095,054	1,072,869
その他	63,908	77,022
流動負債合計	4,477,440	4,354,294

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (平成29年3月31日)	当第1四半期連結会計期間 (平成29年6月30日)
固定負債		
長期借入金	4,000	4,000
繰延税金負債	9,410	9,999
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	51
退職給付に係る負債	2,941	2,943
資産除去債務	50	50
デリバティブ債務	10,680	11,969
その他	648	640
固定負債合計	27,898	29,771
負債合計	4,505,339	4,384,065
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	106,545
自己株式	△2,207	△2,378
株主資本合計	125,314	125,492
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	23,553
繰延ヘッジ損益	△5,083	△7,845
土地再評価差額金	168	168
退職給付に係る調整累計額	△423	△407
その他の包括利益累計額合計	14,397	15,467
純資産合計	139,712	140,960
負債純資産合計	4,645,051	4,525,026

(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28年4月1日 至平成28年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年6月30日)
営業収益		
貸付金利息	686	683
借入有価証券代り金利息	242	438
有価証券貸付料	2,376	3,286
その他	2,344	2,063
営業収益合計	5,650	6,472
営業費用		
支払利息	311	303
有価証券借入料	1,632	2,479
その他	724	317
営業費用合計	2,668	3,099
営業総利益	2,982	3,372
一般管理費	1,934	1,903
営業利益	1,047	1,469
営業外収益		
受取利息	57	56
受取配当金	257	231
その他	20	7
営業外収益合計	334	296
営業外費用		
持分法による投資損失	89	92
自己株式取得費用	—	1
その他	0	0
営業外費用合計	89	94
経常利益	1,293	1,671
税金等調整前四半期純利益	1,293	1,671
法人税、住民税及び事業税	125	234
法人税等調整額	102	119
法人税等合計	227	353
四半期純利益	1,065	1,317
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	1,065	1,317

【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28年4月1日 至 平成28年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30日)
四半期純利益	1,065	1,317
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	1,167	3,812
繰延ヘッジ損益	△3,331	△2,762
退職給付に係る調整額	26	11
持分法適用会社に対する持分相当額	△117	8
その他の包括利益合計	△2,255	1,070
四半期包括利益	△1,189	2,387
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	△1,189	2,387
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。当第1四半期連結会計期間における当該自己株式の帳簿価額及び株式数は、267百万円及び640千株であります。

(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28年4月1日 至 平成28年6月30日)	当第1四半期連結累計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年6月30日)
減価償却費	149百万円	340百万円

(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

II 当第1四半期連結累計期間(自平成29年4月1日至平成29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

(注) 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. 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6月にかけて300,000株を170百万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170百万円増加し、当第1四半期連結会計期間末において自己株式が2,378百万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

II 当第1四半期連結累計期間(自平成29年4月1日至平成29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	5,674	578	219	6,472
セグメント間の内部営業収益又は振替高	1	0	97	99
計	5,676	578	316	6,571
セグメント利益	1,607	98	187	1,894

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	1,894
セグメント間取引消去	△130
持分法投資損失	△92
その他の調整額	—
四半期連結損益計算書の経常利益	1,671

(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R E I T (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1四半期連結会計期間末 (平成29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	5,291百万円	14,305百万円	9,013百万円
(2) 債券	955,585 "	979,262 "	23,676 "
①国債・地方債等	644,185 "	668,056 "	23,871 "
②社債	284,788 "	284,772 "	△15 "
③その他	26,611 "	26,433 "	△178 "
(3) その他	5,237 "	6,277 "	1,039 "
計	966,115 "	999,844 "	33,729 "

(注) 非上場株式 (連結貸借対照表計上額 2,900百万円)、非上場R E I T (連結貸借対照表計上額 9,542百万円) 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 127百万円) 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28年 4 月 1 日 至 平成28年 6 月 30 日)	当第 1 四半期連結累計期間 (自 平成29年 4 月 1 日 至 平成29年 6 月 30 日)
1 株当たり四半期純利益金額	11円00銭	13円70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)	1,065	1,317
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)	1,065	1,317
普通株式の期中平均株式数 (千株)	96,816	96,117

- (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 1 四半期連結累計期間一千株、当第 1 四半期連結累計期間640千株)。

(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29年8月4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1四半期連結会計期間（平成29年4月1日から平成29年6月30日まで）及び第1四半期連結累計期間（平成29年4月1日から平成29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29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。