

証券会社の検証について

1. 平成17年度第2四半期末における証券会社別発注の検証

証券会社との取引状況が適正であるかどうかを判断するため、四半期毎に証券会社別発注高の検証を行うこととしている。

- (1) 運用を開始した本年3月から9月末までに証券会社9社から購入した債券の約定金額は 2,193億円。
- (2) 証券会社別の購入額は、1社当り353億円～133億円と差はあるものの、全体に対する1社当りの比率は、16.11%～6.06%となった。
9社における単純平均値11.1%に照らせば突出した証券会社はなく、特定の証券会社に発注が偏っている事態は生じていない。

< 約定金額別の証券会社分布 >

1社当り300億円以上	3社
1社当り150億円以上300億円未満	4社
1社当り150億円未満	2社

2. 平成17年度第2四半期末における証券会社入替の必要性の検証

取引先証券会社9社につき、半期毎に入替の必要性の検証を行うこととしている。

- (1) 安全・確実な取引を実施するという観点から、以下の検証を常時実施しており、平成17年度第1四半期・第2四半期末の間、9社いずれも問題はなかった。
 - ・コンプライアンスに抵触していないか
 - ・自己資本規制比率は適正か
 - ・国債市場特別参加者に指定されているか
 - ・経営に重大な問題が生じていないか
 - ・取引上の重大な事務ミスはないか
- (2) また、効率的かつ最善の取引を実施するという観点から、第2四半期末に定量評価、定性評価を行った。定量評価では1.の取引実績の通り、極度に取引が劣後している社はなく、また、定性評価では、商品提供能力や事務処理能力について担当者が5段階での評価を実施した上で、当該評価につき、7人の職員によって多面的な検証を行った結果、9社いずれも問題はなかった。
- (3) 従って入替の必要性はなく、9社との取引を継続する。

以上

(法人運営グループ作成)