

総務チーム作成

証券会社の検証について

1. 平成18年度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) 平成18年4月から平成19年3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2,966億円であった。
- (2) 証券会社別の購入額は、1社当たり232億円～436億円、全体に対する1社当たりの比率は、7.82%～14.71%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社あたりの約定金額	証券会社数
400億円以上	1
350億円以上 400億円未満	3
300億円以上 350億円未満	3
300億円未満	2

2. 平成18年度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いる。
- ・コンプライアンス上問題はないか
 - ・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

平成18年度下半期において取引先証券会社の1社の親会社が法令違反により課徴金納付命令を受け、東京証券取引所から監理ポストへの移設処分を受けたことから取引を一時停止。また他の1社も法令違反により業務改善命令を受けたことから同様に取引を一時停止した。両社

とも事態の收拾が図られたことを確認後、取引を再開した。

- (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、平成18年度末における証券会社との取引状況について定量評価、定性評価を行った。

定量評価では上記1. の約定金額実績に加え、国債とその他の債券、新規発行債と既発行債等の区分毎に入札における落札(約定)結果を金額、件数別に集計して分析したが、極度に取引が劣後している社はなく、問題はないと判断した。

定性評価では、取引執行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、当該評価につき担当理事を含む8名による多面的な検証を行った。その結果、取引を一時停止した2社を含め9社いずれも問題は認められなかった。

- (3) 従って現時点において、入替の必要性はないと判断し、9社との取引を継続することとした。

以上