

総務チーム作成

証券会社の検証について

1. 平成19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) 平成19年4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618億円。
 - (2) 証券会社別の購入額は、1社当たり35億円～107億円、全体に対する1社当たりの比率は、5.65%～17.29%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
100億円以上	1
80億円以上 100億円未満	2
60億円以上 80億円未満	2
40億円以上 60億円未満	2
40億円未満	2

2. 平成19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たが、期間内に問題が生じた社はなかった。
 - ・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、平成19年度第2四半期末における定量評価、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があるとは言えず、問題はないと判断した。
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、担当理事を含む8名によって多面的な検証を行った。その結果、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。

以上