

総務チーム作成

## 証券会社の検証について

## 1. 平成19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19年4月から平成20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1,217億円であった。
- (2) 証券会社別の購入額は、1社当り86億円～191億円、全体に対する1社当りの比率は、7.0%～15.7%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
180億円以上	1
140億円以上 180億円未満	3
100億円以上 140億円未満	2
100億円未満	3

## 2. 平成19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た。
- ・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19年度下半期において取引先証券会社の1社が法令違反により業務改善命令を受けたことから取引を一時停止したが、業務改善報告書が金融庁へ提出され、同社から経緯説明を受けたうえで、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19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、定性評価を行う

た。

定量評価では上記1. の約定金額実績のとおり、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、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