

総務係作成

証券会社の検証について

1. 平成20年度上半期末における証券会社別約定金額の検証
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約定金額の検証を行うこととしている。
 - (1) 平成20年4月から9月末までに証券会社9社からの約定金額は233億円となった。
 - (2) 証券会社別の約定金額は1社当り1億円～67億円、全体に対する1社当りの比率は0.4%～28.6%となった。
 - (3) 上半期は10年限の社債購入が中心となったが、新発債の主幹事証券会社や流通市場における10年限の社債を保有している証券会社が限定されたため、証券会社別の約定金額は下表のようになった。

＜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
50億円以上	1
40億円以上 50億円未満	1
30億円以上 40億円未満	2
20億円以上 30億円未満	1
10億円以上 20億円未満	2
10億円未満	2

2. 平成20年度上半期末における証券会社入替の必要性の検証
取引証券会社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

平成20年度上半期においては、取引証券会社の1社が金融庁より行政処分を受けたことから取引を一時停止した。しかし、業務改善報告書が

金融庁へ提出されたため、同社から経緯説明を受けた上で、取引を再開した。同社以外の取引証券会社では特に問題はなかった。

(2)効率的かつ最善の取引を実施するという観点から、平成20年度上半期末における定量評価、定性評価を行った。

定量評価では上記1. の約定金額実績のとおりであり、2社は全体に占める比率はそれぞれ0.4%と劣後している。しかしながら、昨年度までと異なり上半期は上記1.(3)の事情があったことを考慮すると、上半期の取引状況だけでは判断は困難である。

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9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)従って上半期末時点における検証では取引証券会社の入替えを行わず、9社との取引を継続することとした。

なお、12月9日にビー・エヌ・ピー・パリバ証券から本財団との取引を辞退したいという申し出があり、取引を終了した。この結果、取引証券会社は8社となる。

以上