

総務係作成

証券会社の検証について

1. 平成20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20年4月から平成21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878億円であった。
- (2) 証券会社別の発注額は、1社当たり6億円～172億円、全体に対する1社当たりの比率は0.7%～19.6%となった。(なお、最低比率0.7%は12月9日付の取引辞退申し出により取引を終了した証券会社である。残り8社のうちの最低は発注額61億円で比率7.0%である。)
- なお、1社当たりの約定金額分布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
150億円以上	1
120億円以上 150億円未満	2
90億円以上 120億円未満	2
60億円以上 90億円未満	3
60億円未満	1

2. 証券会社別の安全・確実な取引実施の検証

証券会社と安全・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年度下半期においては、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、その後、取引辞退の申し出があったため、取引を終了させた。同社以外の証券会社では特に問題はなかった。

3. 平成20年度末における証券会社入替の必要性の検証

取引証券会社につき、半期ごとに入替の必要性の検証を行なうことにしており、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年度末における検証を行なった。

- (1) 約定金額実績は上記1. のとおりであり、問題はないと判断した。
- (2) 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11名による多面的な検証を行った。その結果、8社いずれも問題は認められなかった。
- (3) 従って年度末時点における検証では、取引証券会社の入替は行なわず、8社との取引を継続することとした。

なお、5月7日にみずほ証券と新光証券が合併し、「みずほ証券」となったため、取引証券会社は7社となった。

以上