

総務係作成

証券会社の検証について

1. 平成21年度上半期末における証券会社別約定金額の検証
四半期毎に、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、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21年4月から9月末までに証券会社7社からの約定金額は457億円となった。
 - * 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」となり、取引証券会社は7社となった。
 - (2) 証券会社別の約定金額は1社当たり31億円～117億円、全体に対する1社当たりの比率は6.8%～25.8%となった。
 - (3) 上半期の約定金額別の証券会社数は下表のようになった。

＜約定金額別の証券会社分布＞

1社当たりの約定金額		証券会社数
100億円以上		1
80億円以上	100億円未満	1
60億円以上	80億円未満	1
40億円以上	60億円未満	3
40億円未満		1

2. 上半期末における証券会社入替の必要性の検証
半期毎に、取引証券会社に対し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。
 - ・コンプライアンス基準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

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、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、極度に取引が劣後している社があるとは言えず、問題ないと判断した。

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9名による多面的な検証を行った。その結果、7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、7社との取引を継続することとした。

以上