

## 証券会社の検証について

## 1. 平成21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21年4月から平成22年3月末までに証券会社7社から購入した債券の約定金額は979億円であった。

(2) 証券会社別の発注額は、1社当たり80億円～272億円、全体に対する1社当たりの比率は8.2%～27.8%となった。

なお、1社当たりの約定金額分布は下表のとおり。

## ＜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
250億円以上	1
200億円以上 250億円未満	0
150億円以上 200億円未満	1
100億円以上 150億円未満	2
100億円未満	3

## 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。平成21年度下半期においては、7社いずれも問題はなかった。

- ・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

### 3. 平成21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、半期毎に入替の必要性の検証を行うことにより、効率的かつ最善の取引を実施するという観点から、平成21年度末における検証を行った。

- (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12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) 従って年度末時点における検証では、取引証券会社の入替は行わず、7社との取引を継続することとした。

なお、平成21年度下半期以降に次の取引証券会社が商号変更した。

平成22年 1月1日	(旧) 大和証券エスエムビーシー(株)
	(新) 大和証券キャピタル・マーケット(株)
5月1日	(旧) 三菱UFJ証券(株)
	(新) 三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)

以上