

証券会社の検証について

取引証券会社については、半期毎に入替の必要性の検証を行うこととしている。よって、証券会社との安全・確実な取引実施及び効率的かつ最善な取引実施という観点から、平成22年度末における証券会社入替の必要性の検証を行った。

1. 平成22年度における証券会社別債券購入実績

本財団は債券の購入にあたり、個別債券毎に複数の証券会社へ条件の提示を求め、最良の条件を提示した証券会社から購入している。

(1) 平成22年4月から平成23年3月末までに証券会社7社から999億円の債券を購入した。

(2) 証券会社別の購入金額は、1社当たり37億円～320億円、1社当たりの比率は3.7%～32.1%となった。

なお、1社当たりの購入金額別の証券会社分布は下表のとおり。

<購入金額別の証券会社分布>

1社当たりの購入金額	証券会社数
280億円以上	1
200億円以上 280億円未満	1
120億円以上 200億円未満	1
40億円以上 120億円未満	3
40億円未満	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、担当者が以下の5点の確認を常時実施しており、その報告について担当理事を含む11名による検証を行った。その結果、平成22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^(※)が金融商品取引法で定める基準を上回っているか
- ・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

(※) 自己資本規制比率とは、証券会社が金融商品取引法第46条の6の規定に基づき算出した証券会社の財務の健全性を測る指標。

3. 証券会社別の効率的かつ最善な取引実施の検証

証券会社と効率的かつ最善な取引を実施するという観点から、取引執行能力及び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うえで、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、平成22年度下半期においては、7社いずれも問題はなかった。

上記の結果から、平成22年度末においては、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23年4月1日に次の取引証券会社が商号変更した。

(旧)日興コーディアル証券(株)

(新)SMBC日興証券(株)

以上