

令和2年度行政事業レビューシート (金融庁)

事業名	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム経費			担当部局庁	企画市場局		作成責任者		
事業開始年度	平成24年度	事業終了(予定)年度	終了予定なし	担当課室	市場課市場業務室		繁本 賢也		
会計区分	一般会計								
根拠法令(具体的な条項も記載)	金融商品取引法第156条の63~66			関係する計画、通知等	・G20ピッツバーグ・サミット首脳声明(平成21年(2009年)9月) ・金融・資本市場に係る制度整備について(平成22年(2010年)1月) ・「店頭デリバティブ市場規制にかかる検討会」における議論のとりまとめ(平成23年(2011年)12月) ・CPMI/IOSCO「金融市場インフラのための原則」(平成24年(2012年)4月)				
主要政策・施策	IT戦略			主要経費	その他の事項経費				
事業の目的(目指す姿を簡潔に。3行程度以内)	店頭デリバティブ取引の決済の安定性・透明性の向上を図り、信頼性が高く、魅力ある金融資本市場を構築すること。								
事業概要(5行程度以内。別添可)	○金融商品取引法第156条の66第1項の規定に基づき、金融商品取引業者等、取引情報蓄積機関、清算機関から提出される店頭デリバティブ取引情報を集計・分析し、公表する。 ○上記集計のための「店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システム」の運用を行う。なお、平成30年度においては、耐用年数を経過したハード機器の入れ替えを行っている。								
実施方法	直接実施、委託・請負								
予算額・執行額(単位:百万円)	予算の状況		平成29年度	30年度	令和元年度	2年度	3年度要求		
		当初予算	29	118	32	31	37		
		補正予算	-	-	-	-	-		
		前年度から繰越し	-	-	-	-	-		
		翌年度へ繰越し	-	-	-	-	-		
		予備費等	-	-	-	-	-		
	計	29	118	32	31	37			
	執行額	27	100	32					
	執行率(%)	93%	85%	100%					
当初予算+補正予算に対する執行額の割合(%)	93%	85%	100%						
令和2・3年度予算内訳(単位:百万円)	歳出予算目	2年度当初予算	3年度要求	主な増減理由					
	情報処理業務庁費	31	37	店頭デリバティブシステムの根幹となるミドルウェアのメーカーサポートが終了となり、保守・運用を継続するにはサポート対象となる製品へのバージョンアップが不可欠となるため。					
	計	31	37						
成果目標及び成果実績(アウトカム)	定量的な成果目標	成果指標		単位	平成29年度	30年度	令和元年度	中間目標 2年度	目標最終年度 年度
	清算集中された金利関連店頭デリバティブ取引の割合を対前年度比で維持・増加させていく。	清算集中された金利関連店頭デリバティブ取引の割合(清算集中された金利関連店頭デリバティブ取引の金額/報告されている全体の金利関連店頭デリバティブ取引の金額(想定元本ベース))	成果実績	%	82	82		-	-
		目標値	%	77	82	82		-	-
		達成度	%	106.5	100		-	-	
根拠として用いた統計・データ名(出典)	店頭デリバティブ取引情報<金融庁> 令和元年度データについては集計中(令和2年9月現在)								
活動指標及び活動実績(アウトプット)	活動指標		単位	平成29年度	30年度	令和元年度	2年度 活動見込	3年度 活動見込	
	店頭デリバティブ取引情報の集計結果及び増加要因分析の結果を金融庁ウェブサイト公表	活動実績	件	2	1	1	-	-	
		当初見込み	件	1	1	1	1	1	

単位当たりコスト	算出根拠		単位	平成29年度	30年度	令和元年度	2年度活動見込			
	運用経費/稼働日数	単位当たりコスト		千円	75	75	89	86		
		計算式	百万円/日	27/360	27/360	32/360	31/360			
政策評価、新経済・財政再生計画との関係	政策	基本施策Ⅲ 市場の公正性・透明性と市場の活力の向上								
	施策	施策Ⅲ-3 市場の機能強化、インフラの構築、公正性・透明性の確保のための制度・環境整備								
	測定指標	定量的指標		単位	平成29年度	30年度	令和元年度	中間目標	目標年度	
					-年度	-年度	-年度	-年度	-年度	
				実績値	-	-	-	-	-	
				目標値	-	-	-	-	-	
	定性的指標		目標	目標年度	施策の進捗状況(目標)					
	清算・振替機関等における財務基盤・システムの安定性の確保に向けた態勢整備、及び市場の利便性を向上するための取組みの状況		清算・振替機関等に対して、財務基盤・システムの安定性が確保されているか等の観点から監督を実施するとともに、市場の利便性を向上するための取組みを促す	令和元年度	信頼性の高い市場インフラの構築及び市場の利便性向上。					
					施策の進捗状況(実績)					
					金融商品取引業者等から報告を受けている店頭デリバティブ取引情報の集計結果及び増減要因分析を公表しました(令和2年3月)。					
本事業の成果と上位施策・測定指標との関係										
店頭デリバティブ取引情報の集計の結果及び増加要因分析の結果を公表することにより、デリバティブ市場の透明性の確保に寄与。										
新経済・財政再生計画改革工程表 2019	取組事項	分野:	-							
	(第一階層) KPI	KPI (第一階層)		単位	計画開始時	元年度	2年度	中間目標	目標最終年度	
					-年度	-年度	-年度	-年度	-年度	
				成果実績	-	-	-	-	-	
			目標値	-	-	-	-	-		
			達成度	%	-	-	-	-		
	(第二階層) KPI	KPI (第二階層)		単位	計画開始時	元年度	2年度	中間目標	目標最終年度	
					-年度	-年度	-年度	-年度	-年度	
				成果実績	-	-	-	-	-	
			目標値	-	-	-	-	-		
		達成度	%	-	-	-	-			
本事業の成果と取組事項・KPIとの関係										
-										

事業所管部局による点検・改善

項目		評価	評価に関する説明
国費投入の必要性	事業の目的は国民や社会のニーズを的確に反映しているか。	○	本事業は、リーマンショックによる国際的な金融危機への反省を踏まえ、金融システムのリスクを低減するための対応について議論されたG20における合意に基づき、店頭デリバティブ取引の決済の安定性・透明性を向上させる事業であり、社会のニーズを的確に反映していると考えられる。
	地方自治体、民間等に委ねることができない事業なのか。	○	店頭デリバティブ取引情報の国際的集約に向けた議論の進捗により今後識別子等の報告項目の拡充が見込まれることを見据え、取引情報の集約・蓄積について民間専門機関である取引情報蓄積機関に集約することにより、当局において取引情報を効率的に分析・利活用することが可能になると考える。 以上を踏まえ、今般、金融商品取引法を改正し、金融商品取引業者等及び清算機関による取引情報の報告先を取引情報蓄積機関に一元化するための規定を整備したところである(令和2年6月12日公布)。
	政策目的の達成手段として必要かつ適切な事業か。政策体系の中で優先度の高い事業か。	○	デリバティブ市場の透明性を向上させるために、取引情報を収集するものであり、必要かつ適切で優先度が高い事業である。
事業の効率性	競争性が確保されているなど支出先の選定は妥当か。	○	令和元年度の本システムの保守・運用委託先の選定にあたっては、公募を実施。その際、公告期間を十分に確保した。また、調達情報について積極的な情報提供を行い、競争性の確保に努めたが、一者だけの応募となった。
	一般競争契約、指名競争契約又は随意契約(企画競争)による支出のうち、一者応札又は一者応募となったものはないか。	無	
	競争性のない随意契約となったものはないか。	無	
	受益者との負担関係は妥当であるか。	○	国民全体が受益者である事業のため、システムの開発、保守・運用について国が負担することは妥当であると考えられる。
	単位当たりコスト等の水準は妥当か。	○	CIO補佐官による工数や単価の確認を受ける等、精査しており、運用経費の単位当たりコスト等の水準は妥当であると考えられる。
	資金の流れの中間段階での支出は合理的なものとなっているか。	-	-
	費目・使途が事業目的に即し真に必要なものに限定されているか。	○	費目・使途はシステムの開発、保守・運用であり、事業目的に即し真に必要なものに限定されているものであると考えられる。
	不用率が大きい場合、その理由は妥当か。(理由を右に記載)	-	-
繰越額が大きい場合、その理由は妥当か。(理由を右に記載)	-	-	
その他コスト削減や効率化に向けた工夫は行われているか。	○	業務委託先に対し、作業単位での工数の可視化、知識定着のための文書化の徹底を指示するなど、コスト削減や効率化に向けた工夫を求め、コスト削減を図っている。	
事業の有効性	成果実績は成果目標に見合ったものとなっているか。	○	清算集中された金利スワップ取引の割合は成果目標を達成しており、成果実績は成果目標に見合ったものであると考えられる。
	事業実施に当たって他の手段・方法等が考えられる場合、それと比較してより効果的あるいは低コストで実施できているか。	-	-
	活動実績は見込みに見合ったものであるか。	○	店頭デリバティブ取引情報の集計結果及び増減要因分析を金融庁ウェブサイトにて定期的に公表しており、概ね見込みに見合ったものであると考えられる。
	整備された施設や成果物は十分に活用されているか。	○	開発したシステムを利用して店頭デリバティブ取引情報の集計・公表を実施しているほか、増減要因分析を行っている。また、必要に応じて、監督部局等と情報の共有を図っている。
関連事業	関連する事業がある場合、他部局・他府省等と適切な役割分担を行っているか。(役割分担の具体的な内容を各事業の右に記載)	-	-
	所管府省名	事業番号	事業名
点検・改善結果	点検結果	<ul style="list-style-type: none"> ○膨大な店頭デリバティブ取引情報(約397万件(令和元年度))について、本システムを用いて日々の処理を行い、取引情報(31年3月末のデータ)を集計の上、金融商品取引法の規定に基づき公表しており、本事業の予算は適切に執行されているものと考えられる。 ○本システムを用いた効率的な集計を引き続き行うため、システムの改善に努めるとともに、競争性の確保に留意した調達の実施により、経費削減を図る必要があると考えられる。 ○清算集中された金利関連店頭デリバティブ取引の割合は成果目標を達成している。 	
	改善の方向性	<ul style="list-style-type: none"> ○本事業の調達については、仕様書に問い合わせ件数やシステム修正等の前年度の実績を記入し、新規事業者にも参入しやすい環境を作るとともに、引き続き競争性の確保に留意した調達を実施していく。 ○委託先に対し、効率化に向けた工夫を引き続き求めていく。 ○店頭デリバティブ取引情報の国際的集約に向けた議論の進捗により、識別子等の報告項目の拡充が見込まれることを見据え、当局において取引情報を効率的に分析・利活用し投資家保護に活用するため、今般、金融商品取引法を改正し、金融商品取引業者等及び清算機関による取引情報の報告先を民間専門機関である取引情報蓄積機関に一元化するための規定を整備した(令和2年6月12日公布)。今後国際標準にも沿った当該制度の実施に向け、将来的な取引情報蓄積機関による取引情報の集計・公表に必要な具体的検討を行っていく。 	

外部有識者の所見

(外部有識者点検対象外)

行政事業レビュー推進チームの所見

現状
通り

○一者応募となった契約については、競争性を確保するための方策について検討するなど、引き続き予算執行における経費削減に努めること。

所見を踏まえた改善点/概算要求における反映状況

現状
通り

○令和元年度の本システムの保守・運用委託先の選定にあたっては、仕様書に前年度の問い合わせ件数やシステム修正等の実績を記入のうえ、公募期間を十分に確保して公募を実施したが、一者のみの応募となった。新規事業者が参入しやすい環境を作るため、引き続き仕様書に前年度実績を記入するとともに、調達情報について積極的に情報提供を行い、競争性確保に努めていく。
○本経費については、効率的な予算執行の観点から、コスト削減に努めていくこととするが、令和3年度においては、店頭デリバティブシステムの根幹となるミドルウェアのバージョンアップを予定しているため、前年比6百万円の増額となる予算要求を行っていく。
○令和元年度金融商品取引法改正(取引情報蓄積機関への取引情報報告の一元化)の実施に向け、国内外の関係機関と連携して議論し、識別子等の報告項目の検討や取引情報蓄積機関による取引情報の集計・公表に向けた検討を引き続き行っていく。

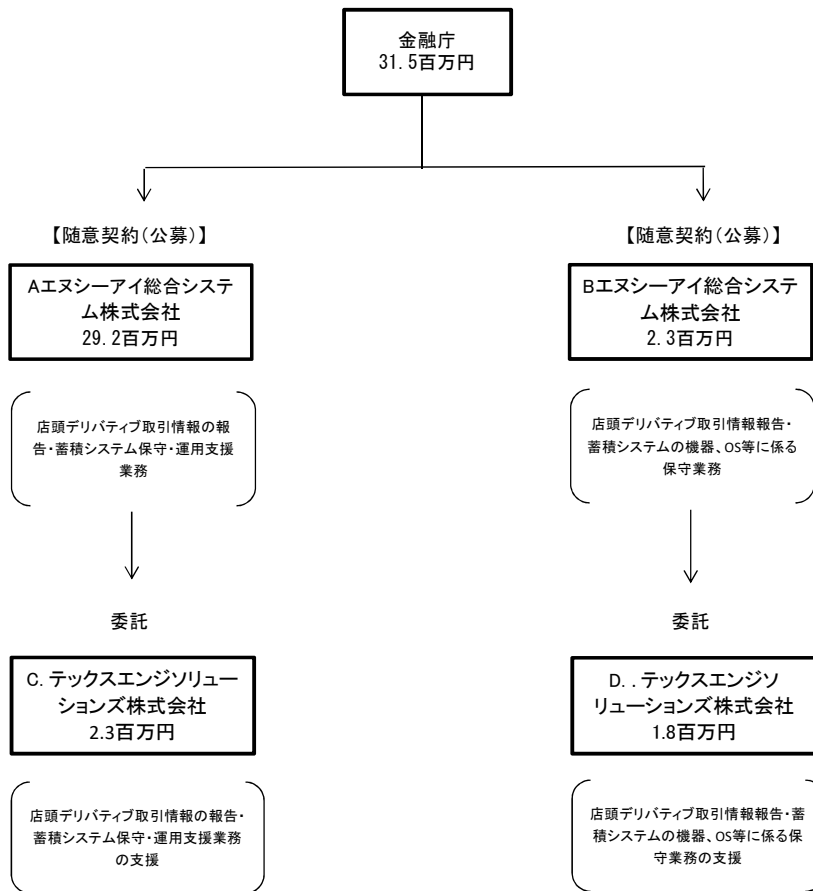
備考

関連する過去のレビューシートの事業番号

平成22年度	-	平成23年度	-	平成24年度	6	平成25年度	6
平成26年度	6	平成27年度	7	平成28年度	13	平成29年度	0014
平成30年度	0013						
平成31年度	金融庁 (0013)						

※令和元年度実績を記入。執行実績がない新規事業、新規要求事業については現時点で予定やイメージを記入。

資金の流れ
(資金の受け取り先が何を
行っているかについて
補足する)
(単位: 百万円)



費目・使途 （「資金の流れ」に おいてブロックご とに最大の金額 が支出されている 者について記載 する。費目と使途 の双方で実情が 分かるように記 載）	A.エヌシーアイ総合システム株式会社			B.エヌシーアイ総合システム株式会社		
	費目	使 途	金 額 (百万円)	費目	使 途	金 額 (百万円)
	事業費	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム保守・運用支援業務	26.9	事業費	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務	0.5
	委託費	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム保守・運用支援業務の支援	2.3	委託費	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務	1.8
	計		29.2	計		2.3
	C.テックスエンジニアリング株式会社			D.テックスエンジニアリング株式会社		
	費目	使 途	金 額 (百万円)	費目	使 途	金 額 (百万円)
	事業費	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム保守・運用支援業務	2.3	事業費	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務	1.8
計		2.3	計		1.8	

支出先上位10者リスト

A.

	支 出 先	法 人 番 号	業 務 概 要	支 出 額 (百万円)	契約方式等	入札者数 (応募者数)	落札率	一者応札・一者応募又は競争性のない随意契約となった理由及び改善策 (支出額10億円以上)
1	エヌシーアイ総合システム株式会社	5011201000816	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム保守・運用支援業務	29.2	随意契約 (公募)	1	--	

B

	支 出 先	法 人 番 号	業 務 概 要	支 出 額 (百万円)	契約方式等	入札者数 (応募者数)	落札率	一者応札・一者応募又は競争性のない随意契約となった理由及び改善策 (支出額10億円以上)
1	エヌシーアイ総合システム株式会社	5011201000816	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務	2.3	随意契約 (公募)	1	--	

C

	支 出 先	法 人 番 号	業 務 概 要	支 出 額 (百万円)	契約方式等	入札者数 (応募者数)	落札率	一者応札・一者応募又は競争性のない随意契約となった理由及び改善策 (支出額10億円以上)
1	テックスエンジニアリング株式会社	3011101037571	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム保守・運用支援業務の支援	2.3	その他	-	--	

D

	支 出 先	法 人 番 号	業 務 概 要	支 出 額 (百万円)	契約方式等	入札者数 (応募者数)	落札率	一者応札・一者応募又は競争性のない随意契約となった理由及び改善策 (支出額10億円以上)
1	テックスエンジニアリング株式会社	3011101037571	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務の支援	1.8	その他	-	--	