

事業番号 2021 - 金融 - 20 - 0015

令和3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	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)	○金融サービスの利用者の利便の向上及び保護を図るための金融商品の販売等に関する法律等の一部を改正する法律(令和2年6月5日成立)による改正前の金融商品取引法第156条の63～66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	当初予算	平成30年度	118	令和元年度	32	令和2年度	31	令和3年度	37	令和4年度要求	52
		補正予算		-		-		-		-		-
		前年度から繰越し		-		-		-		-		-
		翌年度へ繰越し		-		-		-		-		-
		予備費等		-		-		-		-		-
		計		118		32		31		37		52
	執行額		100		32		31					
	執行率(%)		85%		100%		100%					
	当初予算+補正予算に対する執行額の割合(%)		85%		100%		100%					
	令和3・4年度予算内訳 (単位:百万円)	歳出予算目	令和3年度当初予算	令和4年度要求	主な増減理由							
情報処理業務庁費		37	52	取引情報蓄積機関への報告一元化に伴い、システム保守・運用経費については前年比減額要求となっているものの、報告一元化に伴うBCPツールの開発、報告項目の拡充や報告フォーマットのXML対応に係る開発を予定していることから、前年度比15百万円の増額要求となっている。								
計		37	52									
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30年度	令和元年度	令和2年度	中間目標3年度	目標最終年度			
	店頭デリバティブ取引の決済の安定性・透明性の向上を図るため、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))	清算集中された金利関連店頭デリバティブ取引の割合	成果実績	%	82	83		-	-			
		目標値	%	82	82	83		-	-			
		達成度	%	100	101		-	-				
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2年度データについては集計中(令和3年7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30年度	令和元年度	令和2年度	3年度活動見込	4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	1	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30年度	令和元年度	令和2年度	3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	89	86	103					
		計算式	百万円/日	27/360	32/360	31/360	37/360					

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30年度	令和元年度	令和2年度	中間目標 - 年度	目標年度 - 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2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を集計・分析し、その結果を公表した(令和3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。								
	(第一階層) KPI	KPI (第一階層)		単位	計画開始時 - 年度	2年度	3年度	中間目標 - 年度	目標最終年度 - 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 - 年度	2年度	3年度	中間目標 - 年度	目標最終年度 - 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
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べく、金融商品取引法(令和2年度)及び店頭デリバティブ取引の規制に関する内閣府令(令和3年度)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。 一方で、金融システムリスクの継続的な監視等の観点から、民間の取引情報蓄積機関の機能不全に係るBCP対応として、国への直接報告(BCPシステム)を整備する必要がある。
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。

国費投入の必要性

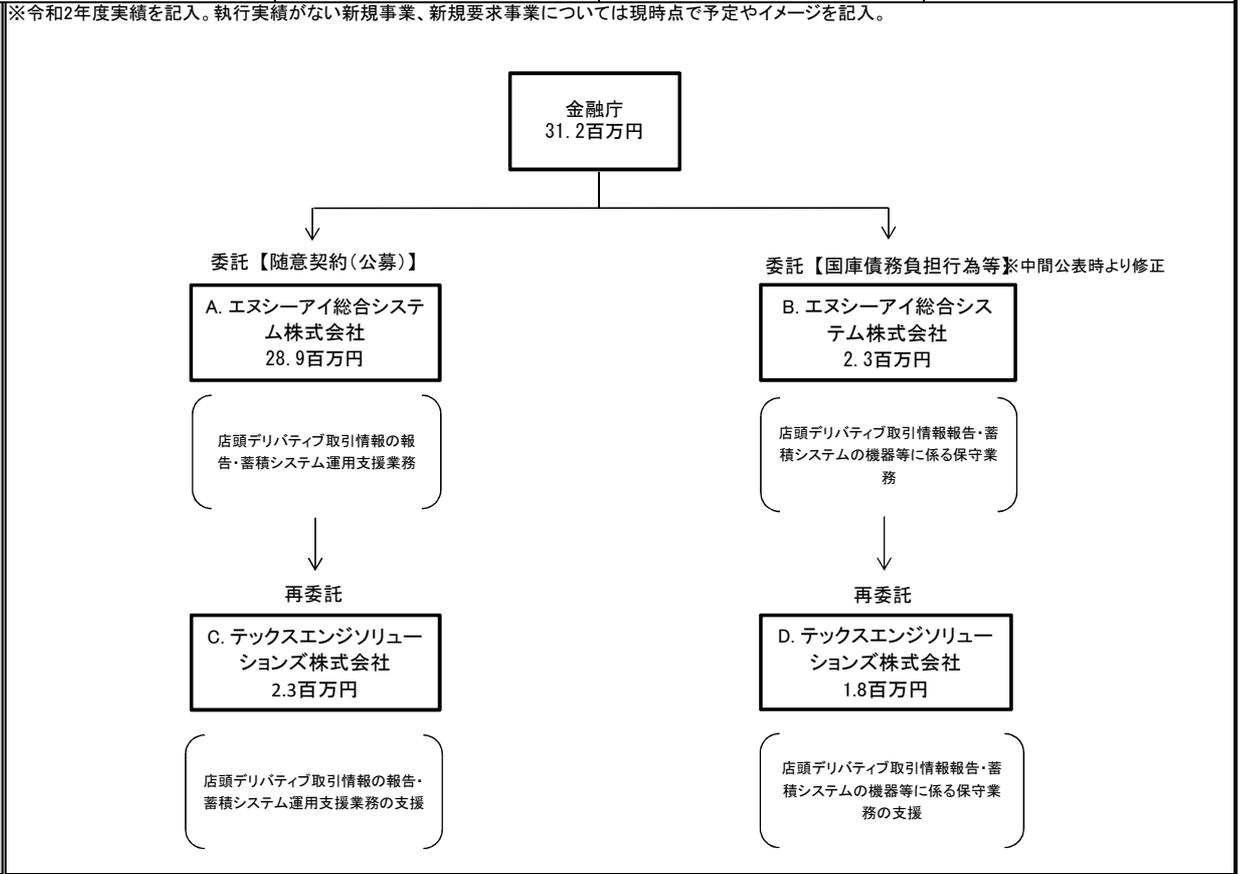
事業の効率性	競争性が確保されているなど支出先の選定は妥当か。	○	令和2年度の本システムの保守・運用委託先の選定にあたっては、公募を実施。その際、公告期間を十分に確保した。また、調達情報について積極的な情報提供を行い、競争性の確保に努めたが、一者のみ応募となった。					
	一般競争契約、指名競争契約又は随意契約(企画競争)による支出のうち、一者応札又は一者応募となったものはないか。	無						
	競争性のない随意契約となったものはないか。	無						
	受益者との負担関係は妥当であるか。	○	国民全体が受益者である事業のため、システムの開発、保守・運用について国が負担することは妥当であると考えている。					
	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ている。					
	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)	-	-					
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>所管府省名</th> <th>事業番号</th> <th>事業名</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> </tbody> </table>	所管府省名	事業番号	事業名		-	-	
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299万件(令和2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(令和2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する。 ○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。 ○金融商品取引法(令和2年度)及び関係府令(令和3年度)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。今後、取引情報蓄積機関による取引情報の集計・公表の円滑な実施を進めていく。 						
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	<ul style="list-style-type: none"> ○引き続き、安定運用及び情報セキュリティの確保に努めるとともに、調達においては、競争性を確保すること。 ○今後予定されている新規開発に当たっては、金融システムリスクの継続的な監視等の観点から、民間の取引情報蓄積機関のシステム障害時等においても安定的に機能するよう開発を行うなど適切な調達に努めること。 							
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	<ul style="list-style-type: none"> ○所見を踏まえ、引き続き安全運用及び情報セキュリティの確保に努めていく。 ○令和2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4年度においては、取引情報蓄積機関への報告一元化に伴い、当該機関のシステム障害が生じた場合等において、金融機関から当局への直接報告を可能とするためのBCPツールの開発等を予定している。 							
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			
令和元年度	金融庁 - 0013			
令和2年度	金融庁 - 0013			

※令和2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や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表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・蓄積システム運用支援業務	26.6	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等に係る保守業務の支援	1.8
計		28.9	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・蓄積システム運用支援業務	28.9	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等に係る保守業務	2.3	国庫債務負担行為等	1	--	

※「契約方式等」は
中間公表時より修正

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	テックスエンジンソリューションズ株式会社	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	テックスエンジンソリューションズ株式会社	3011101037571	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システムの機器等に係る保守業務の支援	1.8	その他	-	--	