

平成30年度行政事業レビューシート (金融庁)

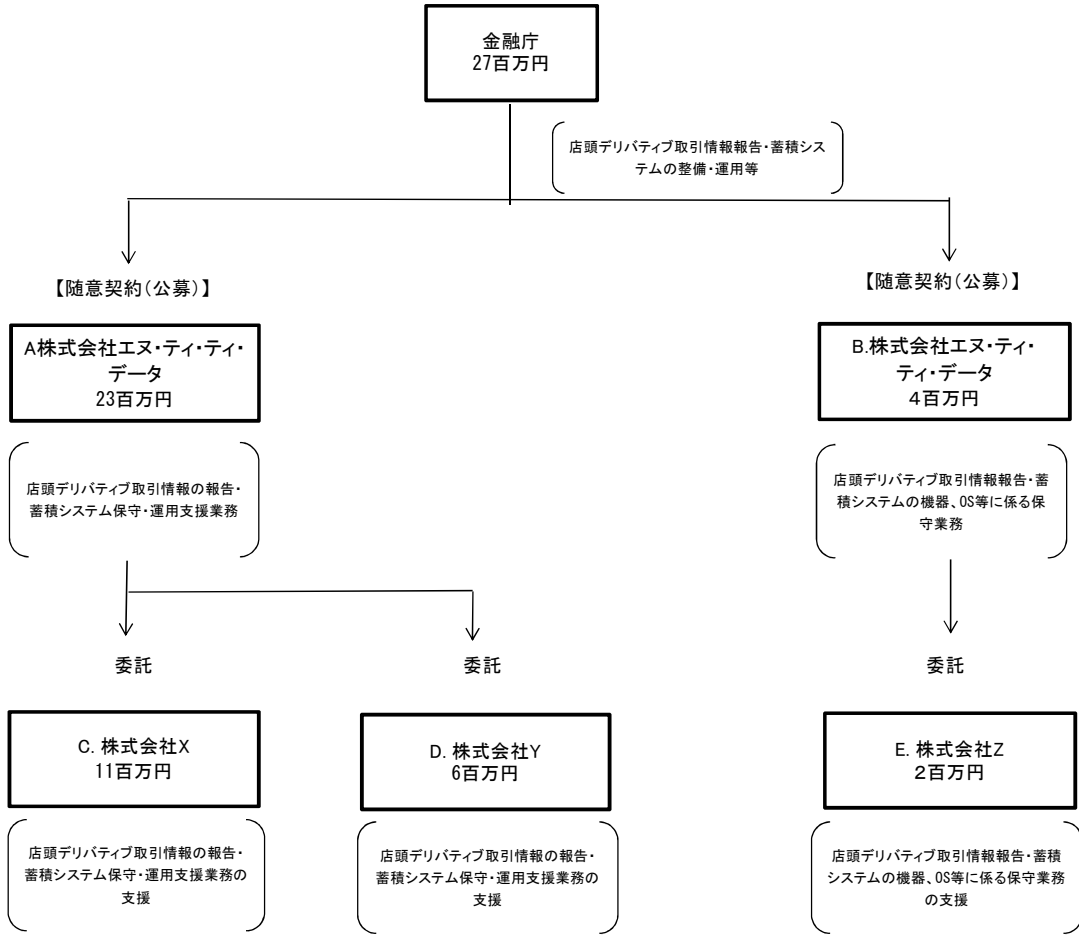
事業名	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システム経費			担当部局庁	企画市場局		作成責任者			
事業開始年度	平成24年度	事業終了(予定)年度	終了予定なし	担当課室	市場課市場業務室		八幡 道典			
会計区分	一般会計									
根拠法令 (具体的な条項も記載)	金融商品取引法第156条の63~66			関係する計画、通知等	・G20ピッツバーグ・サミット首脳声明(平成21年(2009年)9月) ・金融・資本市場に係る制度整備について(平成22年(2010年)1月) ・「店頭デリバティブ市場規制にかかる検討会」における議論のとりまとめ(平成23年(2011年)12月) ・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し、公表。 ○上記集計のため、「店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システム」を運用。									
実施方法	直接実施、委託・請負									
予算額・執行額 (単位:百万円)		27年度	28年度	29年度	30年度	31年度要求				
	予算の状況	当初予算	40	40	29	118	110			
		補正予算	4	-	-	-	-			
		前年度から繰越し	-	4	-	-	-			
		翌年度へ繰越し	▲4	-	-	-	-			
		予備費等	-	-	-	-	-			
		計	40	44	29	118	110			
		執行額	34	43	27					
		執行率(%)	85%	98%	93%					
		当初予算+補正予算に対する執行額の割合(%)	77%	108%	93%					
	歳出予算目	30年度当初予算	31年度要求	主な増減理由						
平成30・31年度予算内訳 (単位:百万円)	情報処理業務庁費	118	110	○30年度においてはサーバ機器交換を伴う開発経費を計上したが、31年度においてはプログラム修正のみの開発経費のため、予算要求額は減少。						
	計	118	110							
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	27年度	28年度	29年度	中間目標 30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または増加させていく。	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	%	65	77		-	-	
			目標値	%	64	65	77		-	
			達成度	%	101.6	118.5		-	-	
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> ※30年度行政事業レビューより集計方法及び根拠データを変更。また、29年度データについては集計中(2018年8月現在)									
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	27年度	28年度	29年度	中間目標 30年度	目標最終年度 -年度	
	金融商品取引業者等による店頭デリバティブ取引量(想定元本ベース)を前年度比で維持または増加させていく。	金融商品取引業者等による店頭デリバティブ取引量(想定元本ベース)	成果実績	兆円	3,659	4,193		-	-	
			目標値	兆円	3,726	3,659	4,193		-	
			達成度	%	98.2	114.6		-	-	
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> ※30年度行政事業レビューより集計方法及び根拠データを変更。また、29年度データについては集計中(2018年8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	27年度	28年度	29年度	30年度 活動見込	31年度 活動見込	
	活動実績	当初見込み							
店頭デリバティブ取引情報の集計結果を金融庁ウェブサイト公表	活動実績	件	件	3	1	2	-	-	
	当初見込み	件	件	3	2	1	1	1	
単位当たりコスト	算出根拠		単位	27年度	28年度	29年度	30年度活動見込		
	予算執行額/稼働日数	単位当たりコスト					千円	94	119
		計算式	百万円/日		34/360	43/360	27/360	118/360	
政策評価、経済・財政再生アクション・プログラムとの関係	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を促す。	29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の結果及び増加要因分析の結果を公表(29年9月、30年3月の2回公表)。								
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。									
事業所管部局による点検・改善									
国費投入の必要性	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・透明性の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。			○	金融システムのリスク低減の観点から、店頭デリバティブ取引の決済の安定性・透明性の向上させるため、国が自ら店頭デリバティブ情報を蓄積、集計する必要があると考えられる。				
	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。			○	G20における合意事項であり、かつデリバティブ市場の透明性を向上させるため、取引情報を収集するものであり、必要かつ適切な事業である。また、デリバティブ市場の透明性を向上させることは優先度の高い事業であると考えられる。				
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。			○	平成29年度の本システムの保守・運用に係る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ほか、入札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。				
	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負担関係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。			○	30年度当初予算額については、サーバ機器交換を伴う開発費用が含まれるために上昇しているものの、CIO補佐官による工数や単価の確認を受けており、単位当たりコスト等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・用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・用途はシステムの保守・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、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。 (保守・運用費用:25百万円(平成28年度)→23百万円(平成29年度))。					

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及び金融商品取引業者等による店頭デリバティブ取引量は対前年度比で向上しており、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を金融庁ウェブサイト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、検査・監督部局と情報の共有を図っている。				
点検・改善結果	点検結果	<ul style="list-style-type: none"> ○ 清算集中された金利関連店頭デリバティブ取引の割合(27年度:65%→28年度:77%)(29年度の実績は未確定)が増加していること、平成29年度においても、店頭デリバティブ取引情報(28年9月末及び29年3月末のデータ)を集計し、金融商品取引法の規定に基づき公表したことから、本事業の予算は適切に執行されているものとする。 ○ 取引情報が膨大(約130万件(29年3月末時点))であり、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(これまでに、業務委託先に対してコスト削減の働きかけを行い、29年度保守・運用費用を前年度比で2百万円削減)。 					
	改善の方向性	<ul style="list-style-type: none"> ○ 引き続き競争性の確保に留意した調達を実施し、経費削減を図っていく。 ○ 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。 					
外部有識者の所見							
<ul style="list-style-type: none"> ○ BCP推進の観点から、蓄積情報のバックアップデータを遠隔地でも保管し、その安全性を高めてはどうか。 ○ 取得している店頭デリバティブ取引情報に関し、海外の事例を参考に、開示内容の見直しや更なる活用方法について検討していただきたい。 							
行政事業レビュー推進チームの所見							
一部の内容改善	<ul style="list-style-type: none"> ○ 外部有識者の所見も踏まえ、バックアップデータの遠隔地保管の実施や蓄積情報の活用方法等の検討を行うこと。 ○ 引き続き調達時における競争性の確保等により、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							
年度内に改善を検討	<ul style="list-style-type: none"> ○ BCP推進の観点から、バックアップデータの遠隔地保管を実施するための予算要求を行っていくこととした。 ○ 取引情報の報告項目の見直しや蓄積情報の活用に関する国際的な議論を注視していくとともに、公表する情報の内容や活用方法について検討していく。 ○ 経費削減の観点から、競争性の確保に留意した調達の実施に努めていく。また、31年度においては開発経費の減少により、前年度比8百万円の減額要求を行う。 						
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29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株式会社エヌ・ティ・ティ・データ			B株式会社エヌ・ティ・ティ・データ		
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	7	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	2
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	16	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等に係る保守業務の支援	2
計		23	計		4
C株式会社X			D株式会社Y		
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	11	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	6
計		11	計		6
E株式会社Z			F.		
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報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務	2			
計		2	計		0

費目・使途欄についてさらに記載が必要な場合はチェックの上【別紙2】に記載

チェック

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	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ	9010601021385	店頭デリバティブ取引情報報告・蓄積システム保守・運用支援業務	23	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	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ	9010601021385	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	4	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	株式会社X	-	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 (マスタ修正、障害対応等)	11	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	株式会社Y	-	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 (プロジェクト管理等)	6	その他	-	-	-

E

	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	株式会社Z	-	店頭デリバティブ取引情報の報告・蓄積システムの機器、OS等に係る保守業務	2	その他	-	-	-

国庫債務負担行為等による契約先上位10者リスト

	ブロック名	契約先	法人番号	業務概要	契約額 (百万円)	契約方式	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 (契約額10億円以上)
1	B	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ	9010601021385	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	8	随意契約 (公募)	1	-	-