

ポートフォリオ分析ツールの調達

「ポートフォリオ分析ツールの調達」を以下の要領で公募に付す。
なお、本件に係る契約締結は、当該案件に係る予算が成立することを条件とする。

1 公募に付する事項

(1) 件名

ポートフォリオ分析ツールの調達

(2) 調達の目的

ポートフォリオ分析ツール（証券化の裏付資産となる貸付債権又は社債（以下、「貸付債権等」という。）全体のリスク量（期待損失、最大損失等）を算出できるソフトウェアのことをいう。）を調達するもの。

(3) 調達に必要な機能等

次のアからケを全て満たしていること。

ア 証券化の裏付資産となる貸付債権等個々の予想デフォルト率、業種及び期間等のパラメータを公庫が入力することにより、デフォルト時期や参加金融機関毎に設定するサブプールの毀損速度等を勘案しつつ、モンテカルロシミュレーションによるポートフォリオの期待損失、VaR によるリスク量の算出が可能であること。

イ 貸付債権等の償還方法をブレット償還、アモチ償還及び据置期間ありの元金均等償還の全ての方法でシミュレーションが可能であること。

ウ 各トランシェにおける償還停止トリガー機能があること。

エ 5年（5期間）以上の期間でシミュレーションが可能であること。

オ サブプールの設定限度数が50以上であること。

カ 相関を勘案する機能があること。

キ Microsoft Excel for Microsoft365での利用が可能であること。

ク リスク量の結果がMicrosoft Excel for Microsoft365でアウトプットできること。

ケ 操作方法等の問合せに対し、電話又はメールによるサポート体制があること。

(4) 契約期間

令和4年4月1日から令和5年3月31日（予定）までとする。

2 参加資格

項番1(3)「調達に必要な機能等」の全てが提供可能であり、かつ次の各号に掲げる条件を全て満たしている者であること。

(1) ポートフォリオ分析ツール等のリスク計量に係るモデルの提供業務において、平成21年4月以降に3年以上の実績を有していること。

(2) 令和01・02・03年度全省庁統一資格、「物品の販売」において「A」、「B」、「C」又は「D」の等級に格付けされている者であること、又は申請書類により同等であると確認できる者であること。

(3) 次の各項に該当しない者であること。

- ア 契約を締結する能力を有しない者、破産者で復権を得ない者及び反社会的勢力に該当する者。
- イ 公庫の契約に関し次の各号のいずれかに該当すると認められたときから公庫が定めた3年以内の期間を経過しない者。
 - (ア) 契約の履行に当たり故意に工事、製造その他役務を粗雑にし、又は物件の品質若しくは数量に関して不正の行為をしたとき。
 - (イ) 公正な競争の執行を妨げたとき又は公正な価格を害し若しくは不正な利益を得るために連合したとき。
 - (ウ) 契約者が契約を結ぶこと又は契約を履行することを妨げたとき。
 - (エ) 監督又は検査の実施に当たり職員の職務の執行を妨げたとき。
 - (オ) 正当な理由なく契約を履行しなかったとき。
 - (カ) 契約により、契約の後に代価の額を確定する場合において、当該代価の請求を故意に虚偽の事実に基づき過大な額で行ったとき。
 - (キ) この項（この号を除く。）の規定により競争に参加できないこととされている者を契約の締結又は契約の履行に当たり、代理人、支配人、その他の使用人として使用したとき。
- ウ 参加申込書及びその添付書類に虚偽の記載をした者。
- (4) 経営の状況又は信用度が極端に悪化していないと認められる者であり適正な契約の履行が確保される者。
- (5) 会社更生法に基づき更生手続開始の申立てがなされている者又は民事再生法に基づき再生手続の申立てがなされている者でないこと。
- (6) 参加申込書及び参加資格確認資料の提出期限の日から契約締結までの期間に、公庫から契約規則に基づく契約資格喪失措置を受けていない者。
- (7) その他公庫が不相当と認めた者でないこと。

3 申込方法

参加を希望する者は、令和4年2月24日（木）15時00分までに、参加申込書（別添1）及び項番4に示す提出書類を項番5の申込・問合せ先へ、項番6の提出方法にて提出すること。

4 提出書類

(1) 参加資格があることを証明する書類

- ア 法人登記簿謄本（申込前3ヵ月以内に発行されたもの（原本））
- イ 財務諸表（直近2期分）
- ウ 法人税（法人の場合）、所得税（個人の場合）、消費税及び地方消費税に係る納税証明書（その3）又は同（その3の2）若しくは同（その3の3）
- エ 適合証明書（別添2）
- オ 個人情報等管理体制確認書（別添3）
- カ 誓約書（別添4）

（注）ア、イ及びウは、令和01・02・03年度全省庁統一入札参加資格の資格審査結果通知書の写しをもってかえることができる。

(2) 見積書(様式適宜)

5 申込・問合せ先

〒100-0004

東京都千代田区大手町1丁目9番4号（大手町フィナンシャルシティ ノースタワー）

株式会社日本政策金融公庫 管財部 契約課

担当： 都丸 勝己

電話： 03-3270-1552

FAX： 03-3270-1411

6 提出方法

持参又は郵送による。

持参の場合には、項番5における「日本公庫エントランス1階総合受付」で公庫担当名及び当該案件の公募参加申請書等を持参した旨を伝えること。

郵送の場合には、簡易書留郵便にて、申込期限必着で送付すること。

7 その他

- (1) 参加者は、提出した書類、添付書類等について説明を求められた時はこれに応じなければならない。
- (2) 書類等の作成及び提出にかかる費用は、提出者の負担とする。
- (3) 提出された書類は、返却しない。
- (4) 提出された書類の差し替え及び再提出は認めない。

以 上

令和 年 月 日

参加申込書

株式会社日本政策金融公庫
管財部長 本西 正人 殿

郵便番号

住 所

商号又は名称
代表者氏名

代表者印

株式会社日本政策金融公庫が令和4年2月8日付で公告した「ポートフォリオ分析ツールの調達」の公募に参加することを希望します。

○連絡先

(担当部署)

(担当者名)

(電話番号)

(FAX 番号)

(E-MAIL)

令和 年 月 日

適 合 証 明 書

株式会社日本政策金融公庫
管財部長 本西 正人 殿

住 所
商号又は名称
代表者氏名

本件にかかる「参加資格」について、以下のとおり適合することを証明いたします。

参加資格	合否判定の根拠となる事由
<p>次のアからケを全て満たしていること。</p> <p>ア 証券化の裏付資産となる貸付債権等個々の予想デフォルト率、業種及び期間等のパラメータを公庫が入力することにより、デフォルト時期や参加金融機関毎に設定するサブプールの毀損速度等を勘案しつつ、モンテカルロシミュレーションによるポートフォリオの期待損失、VaRによるリスク量の算出が可能であること。</p> <p>イ 貸付債権等の償還方法をブレット償還、アモチ償還及び据置期間ありの元金均等償還の全ての方法でシミュレーションが可能であること。</p> <p>ウ 各トランシュにおける償還停止トリガー機能があること。</p> <p>エ 5年（5期間）以上の期間でシミュレーションが可能であること。</p> <p>オ サブプールの設定限度数が50以上であること。</p> <p>カ 相関を勘案する機能があること。</p> <p>キ Microsoft Excel for Microsoft365での利用が可能であること。</p> <p>ク リスク量の結果がMicrosoft Excel for Microsoft365でアウトプットできること。</p> <p>ケ 操作方法等の問合せに対し、電話又はメールによるサポート体制があること。</p>	<p>【参加資格の条件の有無を選択し、証拠書類を添付すること。】</p> <p style="text-align: center;">有・無</p> <p>添付書類名：</p>
<p>ポートフォリオ分析ツール等のリスク計量に係るモデルの提供業務において、平成21年4月以降に3年以上の実績を有していること。</p>	<p>〔提供実績〕</p> <p>件名： 発注者： 契約期間： 業務内容： 受注金額：</p>

（注1）発注者名は、株式会社A社等の記載で可とする。

（注2）必要に応じて証拠書類を添付する場合は、添付書類名を記載すること。

個人情報等管理体制確認書

項目	内容
会社の概要	会社名： 代表者氏名： 従業員数： 所在地： 概要： (1) 沿革： (2) 資本金： (3) 事業内容： (4) その他：
受託業務の担当人員等	
個人情報及び顧客情報（以下「個人情報等」という。）の安全管理に係る基本方針が整備されていること。	
個人情報等の安全管理に係る取扱い規定が整備されていること。	
個人情報等の取扱い状況の点検及び監査に係る規定が整備されていること。	
再委託（子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいう。）に対する再委託を含み、再々委託以降の委託を含む。）に係る規定が整備されていること。	
取締役、執行役その他の業務執行に責任を有する者が個人情報等の管理の責任者であること。	【個人情報等の管理の責任者： 】
従業員と個人情報等の非開示契約がなされていること。	
個人情報等の漏えいが生じていないこと又は漏えいが生じた後、適切な防止策を実施し、再発のおそれがないと認められること。	
その他、経営の健全性の確保のために実施していること。	

上記のとおり相違ありません。

令和 年 月 日

個人情報等管理体制確認書（記載例）

項目	内容
会社の概要	会社名 株式会社〇〇〇〇 代表者氏名 〇〇 〇〇 従業員数 〇〇名 所在地 東京都〇〇区〇〇町1-2-3 概要 (1) 沿革 昭和〇年〇月創業 (2) 資本金 金1億円 (3) 事業内容 情報通信業 (4) その他 プライバシーマーク認証番号 〇〇〇〇
受託業務の担当人員等	担当部署 金融担当第〇部 担当人員 5人
個人情報及び顧客情報（以下「個人情報等」という。）の安全管理に係る基本方針が整備されていること。	個人情報の保護に関する法律及びその他関連法令を遵守し、弊社で定めている安全管理規定に従って個人情報及び顧客情報を取扱うことを基本方針に掲げています。
個人情報等の安全管理に係る取扱い規定が整備されていること。	個人情報等の取扱者を指定し、指定された者以外は個人情報等を取扱えないことを規定しています。また、個人情報等データベースのアクセス及び持ち出しを制限することを規定しています。
個人情報等の取扱い状況の点検及び監査に係る規定が整備されていること。	担当部の部長が、個人情報等の取扱い状況について年1回点検すること、監査委員会を設置し、監査委員長が年1回監査することを規定しています。
再委託（子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいう。）に対する再委託を含み、再々委託以降の委託を含む。）に係る規定が整備されていること。	個人情報等の取扱いを外部業者に委託する場合は、委託先を弊社で定める選定基準に従って選定し、安全管理措置を盛り込んだ契約を締結することを規定しています。
取締役、執行役その他の業務執行に責任を有する者が個人情報等の管理の責任者であること。	【個人情報等の管理の責任者： 代表取締役 〇〇 〇〇】
従業員と個人情報等の非開示契約がなされていること。	全従業員及び派遣職員から情報の非開示に係る誓約書を受けています。
個人情報等の漏えいが生じていないこと又は漏えいが生じた後、適切な防止策を実施し、再発のおそれがないと認められること。	令和〇年〇月〇日、当社従業員が出張中に、顧客情報〇〇件を含むデータを収録した可搬性記録媒体（USBメモリ）の盗難事故に遭い、顧客情報流出の可能性が生じました。 事故発生後、以下の再発防止策を徹底しております。 (1)・・・ (2)・・・
その他、経営の健全性の確保のために実施していること。	安全管理を推進するために従業員への教育及び訓練を計画的に行っています。 就業規則において、法令及び社内規定を違反した従業員に対して懲戒処分を課すことにしています。

上記のとおり相違ありません。

令和〇〇年〇〇月〇〇日

株式会社〇〇〇〇

代表取締役 〇〇 〇〇

【個人情報及び顧客情報を取り扱う業務の受託条件】

- ・個人情報及び顧客情報（以下「個人情報等」という。）の安全管理に係る基本方針が整備されていること。
- ・個人情報等の安全管理に係る取扱い規定が整備されていること。
- ・個人情報等の取扱い状況の点検及び監査に係る規定が整備されていること。
- ・再委託に係る規定が整備されていること。
- ・取締役、執行役その他の業務執行に責任を有する者が個人情報等の管理の責任者であること。
- ・従業員と個人情報等の非開示契約がなされていること。
- ・個人情報等の漏えいが生じていないこと又は漏えいが生じた後、適切な防止策を実施し、再発のおそれがないと認められること。
- ・経営の健全性が認められること。

令和 年 月 日

株式会社日本政策金融公庫
管財部長 本西 正人 殿

住 所
商号又は名称
代表者氏名

代表者印

誓 約 書

今般、「ポートフォリオ分析ツールの調達」に係る公募（令和4年2月8日付公告）に関し、下記項目の全てを満たすことを誓約するとともに、万一、後日、不正な行為等が判明した場合は、公庫のとられる処置には一切異議の申し立ては行いません。

記

- 1 次の各項に該当しない者であること。
 - (1) 契約を締結する能力を有しない者、破産者で復権を得ない者及び反社会的勢力に該当する者
 - (2) 公庫の契約に関し次の各号のいずれかに該当すると認められたときから公庫が定めた3年以内の期間を経過しない者
 - イ 契約の履行に当たり故意に工事、製造その他役務を粗雑にし、又は物件の品質若しくは数量に関して不正の行為をしたとき。
 - ロ 公正な競争の執行を妨げたとき又は公正な価格を害し若しくは不正の利益を得るために連合したとき。
 - ハ 契約者が契約を結ぶこと又は契約を履行することを妨げたとき。
 - ニ 監督又は検査の実施に当たり職員の職務の執行を妨げたとき。
 - ホ 正当な理由がなくて契約を履行しなかったとき。
 - ヘ 契約により、契約の後に代価の額を確定する場合において、当該代価の請求を故意に虚偽の事実に基づき過大な額で行ったとき。
 - ト この項（この号を除く。）の規定により競争に参加できないこととされている者を契約の締結又は契約の履行に当たり、代理人、支配人、その他の使用人として使用したとき。
 - (3) 参加申込書及びその添付書類に虚偽の記載をした者
- 2 経営の状況又は信用度が極端に悪化していないと認められる者であり適正な契約の履行が確保される者
- 3 会社更生法に基づき更生手続き開始の申立てがなされている者又は民事再生法に基づき再生手続きの申立てがなされている者でないこと。

以上