

A L Mモデルに関する保守及び改修業務委託

株式会社日本政策金融公庫（以下「公庫」という。）で使用するA L Mモデルに関する保守及び改修の業務委託を、以下の要領で公募に付す。

本件は、公庫の貸出金のリスク・プロファイルや資金調達方法を理解した上で、公庫に適したA L Mモデルを構築した特定業者のみが履行可能と考えるが、他に業務履行が可能である者の有無を確認するために公募を実施するものである。

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
A L Mモデルに関する保守及び改修業務委託
- (2) 目的及び概要等
別添「公募仕様書」のとおり。
- (3) 委託期間
別添「公募仕様書」のとおり。

2 参加資格

次の要件に適合する者であること。

- (1) A L Mモデルの理解に関して、次に掲げる条件を満たしていること。
 - ア 公庫の貸出金に係るリスク・プロファイル（返済期間、元金据置期間、繰上償還等）を理解していること。
 - イ 公庫の資金調達方法（調達種類、返済年限、返済方法等）を理解していること。
 - ウ A L Mモデルの仕様（将来キャッシュフローの推計方法、イールドカーブの推計方法、金利パスの作成方法、リスク指標の算出方法等）を理解していること。
- (2) 要員がシステムに精通している要件として、次に掲げる事項を満たしていること。
システムのアプリケーション開発又は保守の経験を3年以上有すること。
- (3) 令和04・05・06年度全省庁統一資格、「役務の提供等」において「A」、「B」又は「C」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。
- (4) 個人情報等管理体制が確立されていること。
- (5) 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の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) 正当な理由が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
- (6) 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
- (7) 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。
- (8) 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。
- (9) 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5年2月22日（水）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04・05・06年度全省庁統一参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（様式任意）
別添「公募仕様書」に基づき、作成すること。

5 申込・問合せ先

〒100-0004

東京都千代田区大手町一丁目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：小田 景子

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

- 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

別添1

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

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5年2月8日付けで公告した「ALMモデルに関する保守及び改修業務委託」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

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
1	<p>【ALMモデルの理解に関して、次に掲げる条件を理解していること】</p> <p>イ 公庫の貸出金に関するリスク・プロファイル（返済期間、元金据置期間、繰上償還等）を理解していること。</p> <p>ロ 公庫の資金調達方法（調達種類、返済年限、返済方法等）を理解していること。</p> <p>ハ 公庫のALMモデルの仕様（将来キャッシュフローの推計方法、イールドカーブの推計方法、金利パスの作成方法、リスク指標の算出方法等）を理解していること。</p>	<p>〔参加資格の有無を選択し、適宜理由を記載すること。〕</p> <p>有 ・ 無</p> <p>理由：</p>
2	<p>【要員がシステムに精通していることを要件として、次に掲げる事項を満たしていること】</p> <p>システムのアプリケーション開発又は保守の経験を3年以上有すること。</p>	<p>〔参加資格の有無を選択し、適宜理由を記載すること。〕</p> <p>有 ・ 無</p> <p>理由：</p>

個人情報等管理体制確認書（記載例）

項目	内容
会社の概要	<p>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</p> <p>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</p>
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。	<p>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。</p> <p>事故発生後、以下の再発防止策を徹底しております。</p> <p>(1) (2)</p>
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。
公庫の承諾なく、取得情報を複写し、複製し、又は所定の場所から搬出してはならない。
取得情報は、施錠可能な場所に保管し、所定の担当者以外によるアクセスが不能とする（電磁的記録についても同じ。）等、適切に管理する。
- ・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、株式会社日本政策金融公庫が行う「ALMモデルに関する保守及び改修業務委託」に係る公募（令和5年2月8日付公告）に関し、「2 参加資格」にある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 正当な理由なく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

令和 5 年 2 月
株式会社日本政策金融公庫

ALMモデルに関する保守及び改修業務委託
公募仕様書

1 目的

株式会社日本政策金融公庫（以下「公庫」という。）では、ALM及び市場リスク管理において、貸出金の将来キャッシュフローの予測や市場リスク指標を計測するモデル（以下「ALMモデル」という。）を使用している。本件は、ALMモデルの保守及び改修の業務委託を行うことにより、ALM及び市場リスク管理を適切に実行する態勢を整備することを目的としている。

本件は、公庫の貸出金のリスク・プロファイルや資金調達方法などを理解した上で、公庫に適したALMモデルを構築した特定業者のみが履行可能と考えるが、他に公募要件を満たし、業務履行が可能である者の有無を確認するために公募を実施するものである。

なお、ALMモデルの概要は、次表のとおりである。

項目	内容
稼働環境	OS : Windows 10 Enterprise (64bit) 20H2 CPU : Intel(R) Core™i5-7Y54 1.20GHz 1.61GHz メモリ : 8.00GB ソフトウェア : Microsoft Office Excel 365 MSO (32bit) (VBA を使用) .NET Framework 4.8 Visual Studio Tools for Office
	OS : Windows 10 Enterprise (64bit) 21H2 CPU : Intel(R) Core™i5-1130G7 1.10GHz 1.80GHz メモリ : 8.00GB ソフトウェア : Microsoft Office Excel 365 MSO (32bit) (VBA を使用) .NET Framework 4.8 Visual Studio Tools for Office
	OS : Windows 10 Pro (64bit) CPU : Intel(R) Core™i7-9700 @ 3.00GHz 3.00GHz メモリ : 16.0GB ソフトウェア : Microsoft Office Excel 2019(64bit) (VBA を使用) .NET Framework 4.8 Visual Studio Tools for Office
主な機能	貸出金及び借入金の将来キャッシュフローの推計 イールドカーブの作成 金利パスの作成 リスク指標の作成 (デュレーション、VaR、BPV、EAR)

2 契約期間

令和5年4月1日から令和6年3月末日までとする。

3 本件業務の内容

(1) 保守業務

- ア ALMモデルに関する問い合わせ対応
 - イ 障害発生時の原因調査及び復旧対応
 - ウ 保守業務に係る定期報告（月1回）及び障害対応時の臨時報告
- なお、詳細は【別紙】保守業務内容のとおり。

(2) 改修業務

- ア 60人日を超えない範囲での仕様変更作業
- イ 前アに伴う計算定義書及び操作マニュアルの変更作業

4 履行体制

- (1) 一元的に対応可能な問い合わせ窓口を設置すること。
- (2) 複数の要員が対応できる体制であること。
- (3) 体制表（組織編制、作業分担等を記載したもの）を提出すること。

5 参加資格

募集公告項番2記載のとおり。

6 その他要件

(1) 著作権等

本件におけるドキュメント等の所有権及び著作権は甲に帰属するものとする。
また、納入物に第三者が権利を有する著作物が含まれている場合、受託者は当該著作物の使用に関する費用負担を含む一切の手続きを行うこと。

(2) 再委託

本件業務を原則第三者に再委託してはならない。やむを得ず再委託する場合は、甲に対して書面により再委託について事前の承認を得ること。

以上

【別紙】保守業務内容

項目	詳細内容
サービス対象ソフトウェア	次のソフトウェアを対象とする。 ALMモデル
サービス内容※	<p>① 受付時間 月～金曜日 9：00～17：00（土日、祝祭日、年末年始(12/29-1/4)を除く。）</p> <p>② 受付方法 QAシートによる質問及び調査依頼等をメールにて受付するものとする。 なお、緊急を要する場合は、電話にて受付後QAシート送付とするものとする。</p> <p>③ 対応内容 ア ALMモデルに関する問い合わせ対応 一次回答はQAシートの受領から2営業日以内、受付時間内の受領であれば受領日を含む。 イ 障害発生時の原因調査及び復旧対応 復旧するための最善の努力を行うが、復旧が困難な場合は双方協議の上、対応方針を確定するものとする。 ウ 保守業務に係る定期報告（月1回）及び障害対応時の臨時報告</p> <p>※上記記載外の作業は別途見積りとする。</p>