

平成24年3月30日

社団法人 金融先物取引業協会

会員に対する処分について

本協会は、本日、本協会の会員に対し、下記のとおり定款第19条第1項に基づく処分を行いました。

記

I シティグループ証券株式会社

1. 処分内容及びその理由等

(1) 処分内容

過怠金600万円の賦課

(2) 処分の対象となる行為

①同社は、同社役職員のユーロ円TIBOR（以下「TIBOR」という。）及び円LIBORへの関与等に関し、金融庁から、金融商品取引法第56条の2第1項の規定に基づく報告徴取命令を受けて同庁に報告書を提出している。

しかし、証券取引等監視委員会の検査において、報告書の内容について、その正確性及び十分性を検証したところ、呈示レートに関する不適切な働きかけに係る重要な事項について、記載に漏れがあり、かつ、事実と異なる記載及びこれに基づく結論付けが行われており、不適切な内容となっていた。

②同社常務執行役員金利商品本部長A（当時。以下「A本部長」という。）は、遅くとも平成22年4月頃から、TIBORのレートを呈示するシティバンク銀行株式会社の職員（以下「呈示担当者」という。）に対し、また、金利商品本部円金利トレーダーB（当時。以下「Bトレーダー」という。）は、同社に入社した平成21年12月から、TIBORのレートを呈示する他の銀行の職員（又は、そのグループ証券会社の職員。以下呈示担当者と合わせて「呈示担当者等」という。）に対し、A本部長及びBトレーダー（以下「A本部長等」という。）が行っていた円金利に係るデリバティブ取引に有利になるようTIBORを変動させることを目的として、呈示レートの変更を要請するなどの働きかけを継続的に行っていた。

A本部長等が行った当該行為は、TIBOR（3ヵ月）が株式会社東京金融取引所において上場されているユーロ円3ヵ月金利先物の取引対象であり、A本部長等が当該取引所において当該先物の取引を行っていたこと及びTIBORは金融機関が資金を調達・運用するときの基準金利となるなど極めて重要な金融指標であることに鑑みれば、著しく不当かつ悪質であり、市場の公正性を損なうおそれがあるなど、公益及び投資者保護上、重大な問題があると認められる。

更に、Bトレーダーは、平成21年12月から、シティバンクグループが呈示する円LIBORの呈示レートについても、変更を要請するなどの不適切な働きかけを継続的に行っていた。

金利商品本部の営業責任者でもある同社代表取締役社長は、上記行為を認識していながら、これを看過し、また、同社としても適切な対応を行っていない等、当社の内部管理態勢には重大な問題が認められた。

③同社は、平成21年4月15日、A本部長を金利商品本部の統括者として採用しており、金利商品本部のトレーディング、セールス及び信用リスク管理等の全般的な

マネジメント業務を行うとともに、平成21年9月17日以降、自らも金利に係る店頭デリバティブ取引を、同年11月12日から市場デリバティブ取引を開始している。

しかしながら、同社は、A本部長について、平成22年6月17日に至るまで、本協会における外務員登録を受けることなく外務行為を行っていた。

また、同社代表取締役社長は、A本部長が登録外の外務行為を行っていることを認識した後も、コンプライアンス本部長等の関係部署に対応を指示するなどの適切な措置を講じていない等、同社の内部管理態勢に不備が認められた。

(3) 処分理由

同社の行った違反行為は、①金融商品取引法第52条第1項第6号、②金融商品取引法第52条第1項第9号、③金融商品取引法第64条第2項並びに、金融先物取引業務取扱規則第3条及び金融先物取引業務の内部管理責任者等に関する規則第3条に違反するものであり、定款第19条第1項第3号の規定に該当すると認められること。

2. その他

本処分と併せて、同日付で、定款第16条に基づき、法令、諸規則の遵守及び内部管理体制の充実、強化を徹底するよう勧告を行いました。

II UBS証券会社

1. 処分内容及びその理由等

(1) 処分内容

過怠金300万円の賦課

(2) 処分の対象となる行為

同社債券本部金利商品部円レートトレーダーB(当時。以下「Bトレーダー」という。)は、遅くとも平成19年3月頃から、ユーロ円TIBOR(以下「TIBOR」という。)のレートを呈示するUBS銀行東京支店の職員(以下「呈示担当者」という。)に対し、また、遅くとも平成19年2月頃から、TIBORのレートを呈示する他の銀行の職員(以下、呈示担当者と合わせて「呈示担当者等」という。)に対し、Bトレーダーが行っていた円金利に係るデリバティブ取引に有利になるようTIBORを変動させることを目的として、呈示レートの変更を要請するなどの働きかけを継続的に行っていた。

Bトレーダーが行った当該行為は、TIBOR(3ヵ月)が株式会社東京金融取引所において上場されているユーロ円3ヵ月金利先物の取引対象であり、Bトレーダーが当該取引所において当該先物の取引を行っていたこと及びTIBORは金融機関が資金を調達・運用するときの基準金利となるなど極めて重要な金融指標であることに鑑みれば、著しく不当かつ悪質であり、市場の公正性を損なうおそれがあるなど、公益及び投資者保護上、重大な問題があると認められる。

更にBトレーダーは、遅くとも平成19年6月頃から、UBSグループが呈示する円LIBORの呈示レートについても、変更を要請するなどの不適切な働きかけを継続的に行っていた。また、こうした働きかけを長期間にわたり看過し、当該行為を放置し適切な対応を行っていないなど、当支店の内部管理態勢には重大な不備が認められた。

(3) 処分理由

同社の行った違反行為は、金融商品取引法第52条第1項第9号並びに、金融先物取引業務取扱規則第3条及び金融先物取引業務の内部管理責任者等に関する規則第3条に違反するものであり、定款第19条第1項第3号の規定に該当すると認められること。

2. その他

本処分と併せて、同日付で、定款第16条に基づき、法令、諸規則の遵守及び内部管理体制の充実、強化を徹底するよう勧告を行いました。

以 上