

平成23年10月31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

1. 処分を受けた協会員名  
カブドットコム証券株式会社
2. 処分内容  
謹 責
3. 処分理由

同社は、同社が平成23年7月よりサービス開始予定の「くりっく365(取引所FX)」のリリース前最終検証において、既にリリース済みである大阪証券取引所外国為替証拠金取引(以下「大証FX取引」。)との設定要件の付け合わせを行ったところ、大証FX取引において、受入証拠金額が証拠金所要額に対し所定の割合を下回った場合に行われる「ロスカット」におけるシステム設定値に誤りがあり、「取引所外国為替証拠金取引(大証FX)約款」、「取引所外国為替証拠金取引ルール」等、当社約款・規程、取引ルールに規定された証拠金維持率によってロスカットが履行されていなかったことを発見した。当該事象について開発元へ照会をおこなったところ本来の設計値とは相違する数値設定になっていることを確認した。

平成22年9月17日から平成23年6月27日までの間、ロスカット維持率の設定値は25%となっており、約款規程、取引ルールに記載された75%のロスカット維持率によりロスカットが履行されていない事象が発生した。また、所定時間ごとに口座別維持率をチェックしロスカット未実施口座の有無を点検するシステム上の設定値も相違しており早期発見には至らなかった。

開発元ベンダーによる単体検証、結合テスト等が実施されていたが、その検証は75%ではなく、25%基準での検証であった。また、同社の受入テストについては、資料から、ロスカットに関する検証が実施されていることのみを確認に留まり、数値の検証まで行っていなかった。事後チェック機会については、ロスカットに着目した検証機会はなく、日次でロスカット処理結果は事務部宛に通知されていたが、事務部においてその内容の検証まではされていなかった。

同社の行った違反行為は、金融商品取引法第40条に基づく金融商品取引業等に関する内閣府令第123条第1項第21号の2及び第21号の3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。

#### 4. その他

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