

2024年9月30日

一般社団法人 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
アヴァトレード・ジャパン株式会社
2. 処分内容
過怠金700万円
3. 処分理由

○ 改ざんしたデータを使用してストレステストを実施している状況

同社は、令和3年5月頃、ストレステストの結果が悪化しつつあった。近い将来、ストレステストの結果が更に悪化する蓋然性が高いとの不安を抱いた同社の代表取締役社長（以下「同社社長」という。）は、ストレステスト結果の悪化を回避するため、親会社のコンプライアンス部門の最高責任者に対し、ストレステストに使用する顧客データの改ざんを依頼した。その結果、令和3年5月末から令和5年3月末の各月末のうち、少なくとも13日について、ストレステストに使用する顧客データから大口取引顧客の上位数名のデータを削除したうえで、ストレステストを実施した。

令和5年5月頃、ストレステストの結果が再度悪化してきたことから、同社社長は親会社に対して資金提供を依頼した。しかし、親会社が積極的に応じる姿勢を示さなかったことから、同社社長は、同社監査室長に対し、顧客データを改ざんするよう指示した。その結果、同社監査室長は、令和5年5月から同年8月末までの少なくとも24日について、顧客データの一部を削除したうえで、ストレステストを実施した。

当該状況は、一般社団法人金融先物取引業協会（以下「協会」という。）の規則に基づき、ストレステストを実施すべきところ、正しく実施していないものと認められる。

また、協会にストレステストの結果を報告する必要があるところ、同社は改ざんしたデータを用いてストレステストを実施しており、正しいデータに基づくストレステストの結果の報告を行っていないものと認められる。

さらに、ストレステストの結果を踏まえ、必要な場合には、経営の健全性を確保するための措置を講じる必要があるところ、具体的な措置を講じていないものと認められる。

上記については、同社社長自らの法令等遵守意識の欠如に起因して改ざんが行われ、親会社のコンプライアンス部門の最高責任者がデータ改ざんに関与するなど、親会社を含めたガバナンスや内部けん制が機能していないことにより発生したと認められる。

同社の行った行為は、ストレステストを正しく実施していない状況については、金融商品取引法第40条第2号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4に該当するものと認められる。

また、協会への報告を行っていない状況については、同項第21号の6に、ストレステストの結果を踏まえ、経営の健全性を確保するための措置を講じる必要があるところ、講じていない状況については、同項第21号の5に違反するものである。

4. 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態勢の充実、強化を徹底するよう勧告を行いました。

以 上