

株式会社パンタ・レイ証券に対する行政処分について

1. 株式会社パンタ・レイ証券に対する検査の結果、以下の法令違反行為が認められたことから、証券取引等監視委員会より行政処分を求める勧告が行われました(平成20年9月17日付)。

(1) 顧客の損失を補てんするため、財産上の利益を提供する行為等

架空取引を捏造して顧客に財産上の利益を提供する行為

株式会社パンタ・レイ証券(以下「当社」という。)FX事業部員は、その業務に関し、平成19年8月にロスカットされたことなどにより生じた外国為替証拠金取引に係る顧客の損失及び逸失利益について、顧客より財産上の利益を提供するよう要求を受け、独断でこれに応ずる旨を約束し、同19年9月5日、同月10日及び同年10月9日の3日間、計6回にわたり、管理端末に架空の新規・決済注文を入力することで決済益を出す方法、又は約定データの単価を変更して決済損を少なくする方法により、計12,580千円の財産上の利益を提供した。

システム障害により損失を受けた顧客に対し、損失を補てんするため財産上の利益を提供しながら、その届出を行わない行為等

当社は、(イ)平成19年7月13日から同年8月9日までの間に発生した8回の外国為替証拠金取引に係るシステム障害発生時において、損失を受けた顧客10名に対し、同年7月13日から同年9月4日にかけて、計7,888千円の損失補てんを行いながら、これらについて、近畿財務局長に届出を行っていなかった。また、(ロ)同年7月20日及び同年8月9日に発生した2回のシステム障害発生時においては、損失を受けた顧客3名に対し、同年8月6日及び同年9月4日、損失額を超える計47千円の財産上の利益を提供していた。

当社及び当社の使用人が行った上記の行為のうち、については、金融商品取引法第39条第1項第3号に規定する「有価証券売買取引等につき、当該有価証券等について生じた顧客の損失の全部若しくは一部を補てんし、又はこれらについて生じた顧客の利益に追加するため、当該顧客に対し、財産上の利益を提供する行為」(ただし、平成19年9月29日以前の行為については、廃止前の金融先物取引法(以下「金融先物取引法」という。)第76条第9号に基づく廃止前の金融先物取引法施行規則(以下「金融先物取引法施行規則」という。)第25条第3号に規定する「金融先物取引について生じた顧客の損失の全部若しくは一部を補てんし、又はこれらについて生じた顧客の利益に追加するため当該顧客に対し財産上の利益を提供すること」)に該当する。

また、のうち、(イ)については金融先物取引法施行規則第29条の2第2項の規定による届出を行っていないことから金融先物取引法第83条に違反し、(ロ)については同法第76条第9号に基づく金融先物取引法施行規則第25条第3号に規定する「金融先物

取引について生じた顧客の利益に追加するため当該顧客に対し財産上の利益を提供すること」に該当すると認められる。

(2) 電子情報処理組織の管理が十分でないと認められる状況

当社は、平成19年6月から同年9月までの間に、外国為替証拠金取引に係るシステムにおいて、少なくとも18件のシステム障害を発生させており、これらのシステム障害においては、顧客の取引に損失を与えたものも多数含まれている。しかしながら、当社においては、システム障害発生時における対応手順が確立されておらず、顧客の損失の発生状況すら把握せず、担当者が場当たりの対応に終始し、組織的な対応が行われていない。

また、当社においては、システムリスク管理を一部の使用人に任せきりとし、全社的なシステムリスク管理態勢が確立されていないことから、上記(1)のとおり、FX事業部員が、顧客からの要求に応じ、単独で、管理端末より架空取引を入力して財産上の利益を提供していたことを看過している。

以上のように、当社におけるシステムリスク管理態勢については、極めて杜撰である状況が認められた。

当社の上記の業務の運営の状況は、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14号に規定する「金融商品取引業等に係る電子情報処理組織の管理が十分でないと認められる状況」に該当すると認められる。

2. 以上のことから、本日、株式会社パンタ・レイ証券に対し、金融商品取引法第51条及び第52条第1項の規定に基づき、以下の行政処分を行いました。

業務停止命令

平成20年9月29日から同年10月1日までの間、全ての店頭デリバティブ取引業務(ただし、顧客取引の結了のための取引等を除く。)の停止。

業務改善命令

今般の法令違反行為の責任の所在を明確化すること。

法令遵守に関する経営管理態勢の改善を図ること。

内部管理態勢の充実・強化を図るとともに、法令違反の根絶に向けた再発防止策を策定し、役職員への周知徹底を図ること。

システム障害の発生原因を十分認識・検討し、監査の実施及びシステム障害発生時の速やかな報告態勢の確立等、実効性のあるシステムリスク管理態勢の整備を図り、確実に実行すること。

上記の から について、その対応状況を平成20年10月24日までに近畿財務局へ書面で報告することとし、 から については、その実施状況を、当分の間3か月ごとに近畿財務局へ書面で報告すること。

連絡・問い合わせ先 近畿財務局 理財部証券監督課 06 - 6949 - 6367(ダイヤルイン)
