・　行政処分の内容
①　業務停止命令
全ての店頭デリバティブ取引業務の停止１週間
②　業務改善命令（イ　今般の法令違反行為の責任の所在を明確化すること、ロ　システム障害の発生原因を十分認識・検討し、対応方針を策定すること、その上で、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、ハ　システム活用ガイドの「成行注文は、今の為替レートで素早く約定する」という記載が、カバー取引が成立した後に注文を約定させていた顧客にとって、誤解を招く表示であった旨を公表すること、ニ　業務運営の各局面において、顧客間の公平を損なう取扱いが行われていないか、また、説明内容と実態に乖離が生じていないかを検証し、必要に応じて改善を図ること、ホ　役職員の法令遵守意識を高めるよう、必要な研修等を実施すること）

㈱　上記処分の内容は、この法令違反とともに勧告の対象とした⑸の「顧客に対し特別の利益を提供する行為等」及び⑹の「顧客に対する注文方法の提示において誤解を生ぜしめるべき表示をする行為」に係る処分を含む。

⑸　顧客に対し特別の利益を提供する行為等〔金商法第38条第６号に基づく金商業等府令第117条第１項第３号該当。金商法第39条第３項に基づく金商業等府令第119条第３項違反〕

①　顧客に対し特別の利益を提供する行為

株式会社ＭＪは、平成20年４月29日に発生したシステム障害により損失を受けた顧客199名に対し、損失補てんを行っているが、うち１名の顧客より、当該損失補てん処理のほか、新規注文分を建てるために必要な証拠金を当社が負担するよう要求を受け、当社は、当該顧客に対し、本来の補てん金額に加えて不当な利益の提供と知りながら、合計約35万円の特別の利益を提供した。

②　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、その報告を行わない行為

当社は、平成20年３月６日、４月29日及び８月５日に発生したシステム障害により損失が生じた顧客のうち120名の顧客に対し、損失の補てんとして合計約512万円を支払っていながら、これらについて、東海財務局長に報告を行っていなかった。

・　勧告対象
当社

㈱　勧告年月日、行政処分の内容については、⑷の「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」を参照。

⑹　顧客に対する注文方法の提示において誤解を生ぜしめるべき表示をする行為〔金商法第38条第６号に基づく金商業等府令第117条第１項第２号該当〕

○　株式会社ＭＪは、インターネット取引による外国為替証拠金取引において、顧客から注文を受けた場合、①　顧客取引を約定させた後、カバー取引先に発注する方法と、②　受注レートでカバー取引を執行し、当該カバー取引が成立した後に顧客注文を約定させる方法の、２通りの約定経路を設けている。また、当社は、上記①の方法を原則としており、当社が指定した特定の顧客につき、上記②の方法を採用している。

このような状況下、平成20年５月30日から12月１日までの間に②に指定された顧客51名の成行注文は、①の顧客の成行注文が速やかに約定する中、５万8,329件の注文のうち少なくとも２万5,466件の注文が不成立となっているほか、少なくとも30件の約定が①の顧客の約定に比して５秒以上遅延し、うち５件についてはロスカット注文が遅延したことにより損失が拡大するなど、両顧客の間では著しい差異が生じている。

この点、当社の顧客が取引において使用するトレードシステムの活用ガイドでは、「成行注文は、今の為替レートで素早く約定する」と説明されているが、②に指定された顧客の注文は、当該説明とは異なり、カバー取引が成立した後でなければ約定しない。

なお、当社は、顧客から注文が不成立になったことに関する苦情を多数受けているが、「当社の提示レートが変動したことにより注文が不成立となった」旨の説明を一律的に行うのみで、②に指定された顧客に対して適切な説明を行っていない。

・　勧告対象
当社

㈱　勧告年月日、行政処分の内容については、⑷の「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」を参照。

⑺　報告徴取命令に対する対応の不備〔金商法第52条第１項第６号該当。金商法第56条の２違反〕

○　ビー・エヌ・ピー・パリバ・セキュリティーズ（ジャパン）リミテッド東京支店は、平成20年11月28日付で金融庁長官から、「不適切な業務運営を看過するなど、経営管理態勢・内部管理態勢に重大な欠陥があると認められる状況」に該当するとして、行政処分（以下この⑺において「本件行政処分」という。）を受けている。本件行政処分においては、当支店が「契約の履行過程の一部として、機械的に当該顧客の発行する株式の取引を行った」ことが、金商法第38条第６号に基づく金商業等府令第117条第１項第16号に規定する「法人関係情報に基づいて、自己の計算において当該法人関係情報に係る有価証券の売買その他の取引等をする行為」に該当すると認定されている。こうした事実認定は、金商法第56条の２に基づく金融庁長官の報告徴取命令を受けて、本件行政処分に先立ち当支店が提出した報告書の記載内容が、重要な要素となっている。

しかしながら、今回検査において、当該報告書に関する検証を行ったところ、①　当該報告書の記載内容に不足及び事実に反する記載があること、②　当支店は、調査・検証が不十分なまま当該報告書を作成し、これを提出していたことが認められた。また、③　本件行政処分において、「法人関係情報に基づいて、自己の計算において当該法人関係情報に係る有価証券の売買その他の取引等をする行為」に該当すると認定された取引のうちには、「契約の履行過程の一部として、機械的に当該顧客の発行する株式の取引を行った」ものとは認められない取引が認められた。

・　勧告年月日
平成21年10月16日

・　勧告対象
当社

・　行政処分の内容
①　業務停止命令
当支店株式派生商品統括本部が行う全業務の停止１週間
②　業務改善命令（イ　今回の法令違反行為に係る役職員の責任の所在の明確化を図ること、ロ　全役職員に対し、研修等を通じて、法令遵守意識の徹底を図ること、特に、株式派生商品統括本部の役職員に対して、金商法等が定める有価証券取引における禁止行為について、周知徹底を図ること、ハ　内部調査・監査の適切な機能発揮に向けて、手続の整備や体制の充実・強化など、必要な方策を実施すること、ニ　売買審査体制の抜本的な見直しを図ること、ホ　経営管理態勢・内部管理態勢を抜本的に強化するため、平成20年11月28日の業務改善命令を受けて実施中の改善策について必要な見直しを行い、適切に実施すること）

㈱　上記処分の内容は、この法令違反とともに勧告の対象とした⑻の「特定の上場金融商品の相場を固定させる目的をもって、買付けの申込み等を行う行為」に係る処分を含む。