② 業務改善命令
イ 顧客取引を速やかに結了し、かつ、顧客預託を受けた保証金等を遅滞なく返還すること。
ロ 会社財産を不当に費消しないこと。
ハ 今回の行政処分の内容について、顧客に対し、十分に説明すること。
ニ 上記イからハについて、その対応・実施状況を平成23年10月28日までに書面で報告すること。

⑶ 金融商品取引業者の使用人が職務上の地位を利用した有価証券の取引をする行為等〔金商法第38条第７号に基づく金商業等府令第117条第１項第２号及び第12号該当〕

○ セントラル短資証券株式会社の使用人は、当社が当社の顧客であるＡ社から平成22年６月15日に買い付けたＢ社発行の社債（以下「Ｂ社債」という。額面600百万円）に関する、職務上知ったＡ社の注文の動向を含む取引情報に基づき、自己の職務上の地位を利用して、Ｃ証券会社に開設していた当該使用人の配偶者名義の口座を利用して、同日、当該使用人は自己の計算によりＢ社債（額面600百万円）を買い付けた。

また、当該使用人は、平成22年６月15日、自己の計算によりＢ社債を買い付けるまでの過程において、当社の業務としてＡ社からＢ社債を買い付けるに際し、取引相手であるＡ社に対して、実際には顧客の取引意向に基づくものではないにもかかわらず、顧客の取引意向に基づくものとして売り気配を伝えた。

・勧告年月日
平成23年11月25日
・勧告対象
外務員１名
・外務員処分の内容
未定

⑷ ユーロ円ＴＩＢＯＲ等に係る不適切な行為〔金商法第52条第１項第９号該当〕

○ ＵＢＳセキュリティーズ・ジャパン・リミテッド債券本部金利商品部円レーツトレーダー（当時。以下「Ａ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ユービーエス・エイ・ジー東京支店の職員（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、Ａ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。

Ａ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、Ａ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、Ａ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、当社の内部管理態勢には重大な不備が認められた。

・勧告年月日
平成23年12月９日
・勧告対象
当社
・行政処分の内容
① 業務停止命令
平成24年１月10日から同年１月16日までの間、ＴＩＢＯＲ及びＬＩＢＯＲ関連のデリバティブ取引（既往の契約の履行に伴う取引等を除く。）の停止。
② 業務改善命令
イ 上記法令違反に係る責任の所在の明確化
ロ 役職員の法令遵守の徹底
ハ 経営管理・業務運営態勢の充実・強化を含む再発防止策の策定
ニ 上記イ～ハについて、その実施状況を平成24年１月16日まで、さらにロ、ハについては同日後の進捗状況を同年３月30日まで及びその後３月毎に、また必要に応じて随時に、書面で報告すること。

⑸ 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〕

○ シティグループ証券株式会社は、当社役職員のＴＩＢＯＲ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。

今回検査において、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。

⑹ ユーロ円ＴＩＢＯＲ等に係る不適切な行為〔金商法第52条第１項第９号該当〕

○ シティグループ証券株式会社常務執行役員金利商品本部長（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（当時。以下「Ｂトレーダー」という。）は、当社に入社した平成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当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、当社としても適切な対応を行っていないなど、当社の内部管理態勢には重大な問題が認められた。

⑺ 上級管理職による外務員登録外の外務行為〔金商法第64条第２項違反〕

○ シティグループ証券株式会社常務執行役員金利商品本部長（当時。以下「Ａ本部長」という。）は、平成21年11月12日から市場デリバティブ取引を行っていた。

しかしながら、当社は、Ａ本部長について、平成22年６月16日に至るまで、市場デリバティブ取引を行うために必要な一種外務員登録を日本証券業協会に対し行っていなかった。