
【JPX Weekly News】

日本取引所グループメールマガジン vol. 123 (2019/07/01)

<<< 今週の目次 >>>

- 【1】注目のニュース
- 【2】新着セミナー・イベントのご案内
- 【3】株式市場
- 【4】先物・オプション市場
- 【5】日本取引所グループの IR 情報
- 【6】その他

※本号では、証券取引等監視委員会からの寄稿を掲載しています。

=====
※ 以下については、証券取引等監視委員会のウェブサイト掲載にあたり、上記目次【6】その他 ◆証券取引等監視委員会からの寄稿 No. 216 を抜粋しております。
=====

【6】その他

◆証券取引等監視委員会からの寄稿 No. 216

シティグループ証券株式会社に対する検査結果に基づく勧告について

証券取引等監視委員会（以下「証券監視委」といいます。）は、平成 31 年 4 月 19 日、金融庁に対して、シティグループ証券株式会社（以下「当社」といいます。）に行政処分を行うよう勧告いたしました。

https://www.fsa.go.jp/sesc/news/c_2019/2019/20190419-1.htm

【事案の概要】

当社の売買管理態勢等について検証した結果、以下の問題が認められました。

(1) 取引システムに係る不備

市場デリバティブ取引の一部(手動での一括取消注文、アルゴリズム取引における分割注文)について、プログラム上の不備により、取引データが売買審査システムへ送信されておらず、

売買審査の対象となっておりませんでした。

(2) 売買審査システムに係る不備

見せ玉形態の取引に係る抽出閾値（発注から取消しまでの時間）について、何ら検討が行われないまま短い時間に設定変更しており、不適切に売買審査の対象を絞り込んでいました。また、設定上の不備により、休日前日の夜間取引が売買審査の対象となっておりませんでした。

(3) 売買管理態勢等に係る不備

売買審査において、不公正取引の疑いがあるとしてアラートが集中して発生しているトレーダーがいるにもかかわらず、当該トレーダーに対する取引意図の確認や取引内容の分析など、深度ある対応が行われておりませんでした。

上記のような売買管理態勢の下、当社においては、平成 31 年 3 月 26 日に証券監視委が課徴金納付命令勧告を行ったシティグループ・グローバル・マーケット・リミテッドによる相場操縦取引を受託・執行し、当該不公正取引を看過している状況が認められています。

https://www.fsa.go.jp/sesc/news/c_2019/2019/20190326-1.htm

このように、投資者保護上問題のある行為に対しては、今後も厳正に対処していきます。

なお、当社に対しては、令和元年 6 月 7 日に、金融庁から業務改善命令の行政処分が行われています。

<https://www.fsa.go.jp/news/30/shouken/20190607-2.html>

■証券取引等監視委員会ウェブサイト

<https://www.fsa.go.jp/sesc/index.htm>

■証券取引等監視委員会 Twitter

https://twitter.com/SESC_JAPAN

■市場へのメッセージ

<https://www.fsa.go.jp/sesc/message/index.htm>