

平成 23 年 2 月 17 日

楽天証券株式会社に対する処分について

当取引所は、楽天証券株式会社に対して、取引参加者規程第 34 条第 1 項第 8 号の規定に基づき処分（戒告）を行いましたので、お知らせいたします。

また、取引参加者規程第 19 条の規定に基づき、業務改善報告書（①今般の法令・諸規則違反が発生した原因を踏まえ、今後、システムの導入・変更や、社内における制度・運用の導入・変更に際し、法令・諸規則に準拠しない状況が発生することを防止するため、社内管理態勢の再構築に向けた強化策を策定し、これを確実に実施すること、②研修等を通じて、全役職員に対し、信用取引に係る法令・諸規則の正確な理解と遵守の徹底を図ること、③今般の処分を踏まえ、責任の所在の明確化を図ることを含む。）の提出を請求しました。

違反行為の概要

○ 信用取引委託保証金の引出制限違反及び保証金計算方法の誤り

同社における信用取引委託保証金（以下「保証金」という。）の管理状況に関し、以下のとおり保証金の引出制限違反及び保証金計算方法の誤りが認められた。

- ① 立替金及び立替金となると見込まれる額に充当するため、リスク統括部の承認に基づき、証券管理部の担当者が現金保証金を人為的に引き出したことによる引出制限違反
- ② 現金取引による株式の買付を買付余力の範囲内で行ったものの、当該余力がその後減少したことにより、決済時に買付代金が不足した場合に、当該不足額に充当するため、保証金率の水準如何にかかわらず、現金保証金を引き出すというプログラムが設定されていたことに起因して、システムで自動的に行われた引出制限違反
- ③ 売却した代用有価証券の決済のために、当該代用有価証券を引き出したものの、当該代用有価証券の決済日前日の終値を用いた評価額と同額以上又は保証金率 30%を満たすことになる額を、預り金勘定から保証金勘定へ振り替えなかったことによる引出制限違反
- ④ 現引き・現渡し（以下「現引き等」という。）が行われた際、当該現引き等の申込日

翌日から当該建玉額等を控除していること及び反対売買による決済益金が発生した際に当該建玉に係る諸経費を当該益金で相殺していることによる保証金率及び維持率計算に係る不備

上記のうち、①～③（引出制限違反）については「金融商品取引法第 161 条の 2 に規定する取引及びその保証金に関する内閣府令」第 7 条第 1 項及び当取引所受託契約準則第 44 条第 1 項に、④（保証金率及び維持率計算に係る不備）については同府令第 8 条及び同規則第 45 条に、それぞれ違反すると認められる。

お問合せ先

株式会社 東京証券取引所 企画マーケティング部 取引参加者室

電話：03-3666-0141（代）