

平成 24 年 5 月 29 日

あすかアセットマネジメント株式会社

証券取引等監視委員会による課徴金納付命令の勧告について

本日、証券取引等監視委員会から、弊社の従業員であるインベストメント・マネージャー1 名が弊社の運用するファンド（Asuka Opportunities Master Trust）の計算において平成 22 年 8 月に行った株式 1 銘柄の売買につき、金融商品取引法違反（インサイダー取引規制違反）の事実が認められたとして、内閣総理大臣及び金融庁長官に対し、弊社に課徴金納付命令を発出するよう勧告を行った旨の公表がありましたので、お知らせいたします。

今般の事態につきまして、お取引をいただいているお客さまをはじめとする関係者の皆様に、多大なるご心配とご迷惑をおかけしますことを、深くお詫び申し上げます。勧告を受けた事実関係及び今後の対応策等につきましては、下記の通りです。

弊社は、投資運用業、投資助言業、及び第二種金融商品取引業を行う金融商品取引業者として、今般勧告を受けましたこと及び勧告内容を重大かつ厳粛に受け止め、これらの対応策の厳正な遂行による内部管理態勢の充実強化に全力で取り組み、このような事態の再発防止とお客さまをはじめとする関係者の皆様からの信頼回復に誠心誠意努めてまいります。

記

1. 勧告を受けた事実関係

当社が受けた勧告は以下のとおりです。

(1) 勧告の内容

証券取引等監視委員会は、日本板硝子株式会社の株券に係る内部者取引について検査した結果、(2)のとおり法令違反の事実が認められたので、本日、内閣総理大臣及び金融庁長官に対して、金融庁設置法第 20 条第 1 項の規定に基づき、課徴金納付命令を発出するよう勧告を行いました。

(2) 事実関係

弊社は、その締結した投資一任契約に基づき、当該契約の相手方がその資産を管理するファンドの資産の運用を行っていたところ、当該運用を行っていた弊社

社員が、日本板硝子株式会社と株式引受契約の締結に向けた交渉を行っていた証券会社の社員甲から、同証券会社の他の社員乙らが交渉に関して知り、甲がその職務に関して知った、日本板硝子株式会社の業務執行を決定する機関が株式の募集を行うことについての決定をした事実の伝達を受け、この事実が公表されるより以前の平成 22 年 8 月 5 日から同月 23 日までの間、上記ファンドの計算において、日本板硝子株式会社株式合計 215 万株を総額 4 億 6537 万 9995 円で売り付けました。

以上の売付け行為がインサイダー取引と認定されました。

(3) 課徴金の額

弊社に対して、金 13 万円の課徴金納付命令の勧告が発出されました。

2. 原因と今後の対応策

弊社は、平成 22 年当時も、インサイダー取引の未然防止を図るために、「内部者取引の管理等に関する規則」を定めて、役職員による関係法令等の遵守、法人関係重要情報の管理及び法人関係重要情報を利用した業務遂行の禁止等の徹底に努めて参りましたが、その浸透が十分でなく、今般ご指摘を受けたインベストメント・マネージャー1 名が認識を欠き、不適切な行為に及ぶに至りました。

今回の勧告への対応として、全ての役職員の法令遵守意識の強化を初めとしたコンプライアンス体制の機能強化や法人関係重要情報のモニタリング強化を含め、再発防止策を策定し、その実効性の徹底を図ることにより、弊社の内部管理態勢を大幅に充実強化することといたします。(別紙の再発防止策を参照)

併せまして、今般の事態に係る経営の責任の明確化を図る観点から、社内規程に基づき、関係する役職員について、報酬の減額を含めて厳正な社内処分を実施いたします。

以 上

再発防止策について

弊社では、以下の通り、再発防止を図るための対応策を講じることといたします。

1 組織体制の強化・見直し

- (1) コンプライアンス体制の機能強化、全部門へのコンプライアンス担当者の配置
- (2) リスク・マネジメント部の牽制機能強化

2 法人関係重要情報管理態勢の強化

- (1) 法人関係重要情報のモニタリング強化
- (2) 「法人関係重要情報管理遵守状況チェックリスト(仮称)」の新規作成
- (3) 法人関係重要情報管理について全役職員からの誓約書の提出
- (4) 証券会社営業担当者との接触の事前届出
- (5) 法人関係重要情報管理に関する研修の強化
- (6) ルール違反に対する厳正な社内処分の実施

3 外部有識者による内部管理態勢に関するアドバイス

以 上