平成 24 年 3 月 21 日

各位

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社
（コード番号 :8309 東大名）
中央三井アセット信託銀行株式会社

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、「中央三井アセット信託銀行株式会社が運用するファンドにおける平成 22 年 7 月の株式売買につき、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、内閣総理大臣および金融庁長官に対し、中央三井アセット信託銀行株式会社（以下、「中央三井アセット信託銀行」）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。

＜中央三井アセット信託銀行の概要＞

名称	:中央三井アセット信託銀行株式会社
所在地	:東京都港区芝 3 丁目 23 番 1 号
代表者の役職・氏名	:取締役社長 住田 謙
事業内容	:年金信託業務・証券信託業務 他
資本金	:110 億円

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、及び本年 4 月に中央三井アセット信託銀行が中央三井信託銀行株式会社・住友信託銀行株式会社（以下、「住友信託銀行」）と統合して発足する予定の三井住友信託銀行株式会社（以下、「新信託銀行」）の対応策等については、下記のとおりです。

これらの対応策の厳正な遂行による管理態勢の強化に全力で取り組み、皆様からの信頼回復に努めて参ります。

記

1．勧告を受けた事実

（1） 勧告対象取引

中央三井アセット信託銀行が投資一任契約に基づき運用する海外投資家向けファンド（以下、「当該ファンド」）の運用において、同社の職員である運用担当者（以下、「当該運用担当者」）が行った平成 22 年 7 月 1 日及び平成 22 年 7 月 7 日における国際石油開発帝石株式会社（以下、「INPEX」）株式 90 株（43,630 千円）の売付け及び同株式 120 株（57,610 千円）の借株による空売りが、インサイダー取引と認定されました。

（2） 課徴金の額

当該ファンドの運用者である中央三井アセット信託銀行に対して、金 5 万円の課徴金納付命令の勧告が発出されました。

(3) 当該ファンドの概要

名称	Mitsui Trust Japan Long Short Fund(外国籍投信)
設定日	平成 18 年 2 月
運用スタイル	日本株ロング・ショート(リサーチ型)(注)
運用者	中央三井アセット信託銀行(投資一任業者)
残高	27 億円(平成 24 年 2 月末)

(注)個別株式の分析を基礎とした運用判断に基づき、売り持ちと買い持ちを組み合わせて安定的な収益獲得を目指すもの

(4) 取引経緯

平成 22 年 6 月 30 日　当該運用担当者は、証券会社の営業担当者から INPEX における公募増資の可能性を示唆する情報を入手したにも拘わらず、これを上席に報告することを怠りました。その結果として当該情報はインサイダー情報として管理されませんでした。

平成 22 年 7 月 1 日　当該運用担当者は、当該ファンドにて保有する INPEX 株の90株(43,630 千円)の売却及び60株(29,082 千円)の借株による空売りを実行しました。

平成 22 年 7 月 7 日　当該運用担当者は、当該ファンドにて INPEX 株の60株(28,528 千円)の借株による空売りを実行しました。

中央三井アセット信託銀行では、運用担当者がインサイダー情報に接した場合、その情報が公表されるまで関連する有価証券の売買を停止する旨を規定しており、上記の情報管理不徹底と株式売却はこの社内規定に抵触するものでありました。

2. 原因と今後の対応策

中央三井アセット信託銀行では、平成 22 年当時も法令等遵守を所管するコンプライアンス統括部を中心に、役職員の法令等遵守徹底を図っておりましたが、その徹底が不十分であったため、かかる事態の発生を招きました。

その後、平成 23 年 4 月 1 日の住友信託銀行との経営統合以降、法令等遵守態勢の強化を順次進めて参りました。本年 4 月 1 日に発足する新信託銀行におきましては、コンプライアンス関連体制のさらなる強化等を図ることとし、それらに加えて今回の勧告への対応として、ファンドマネージャー等運用担当者の証券会社営業担当者との接触の原則全面禁止を含む再発防止策を図ることにより、法令等遵守態勢を大幅に強化することとしております。(別紙ご参照)

三井住友トラスト・ホールディングスにおきましては、すでに社外有識者を含む特別調査委員会を設置し、改めて本件事案の全貌を調査すると共に、新信託銀行が進める改善策の評価・検証を行う態勢を整えております。新信託銀行におきましては、特別調査委員会の調査結果・意見を踏まえて、経営としての責任の明確化と関係者の厳正な人事処分を行うと共に、法令等遵守態勢の継続的な高度化に努めて参る所存でございます。

以上

【本件に関するお問い合わせ先】
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社　広報室　TEL　03-6256-6302
中央三井アセット信託銀行株式会社　広報室　TEL　03-5232-8827

別紙

新信託銀行における再発防止策について

新信託銀行では、以下の通り、住友信託銀行の管理態勢・管理規定をベースに、これをさらに高度化した追加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） 運用ミドル部署の牽制機能強化

新信託銀行では、取引モニタリングなどの運用ミドル機能を担う部署として「受託監理部」を設置しますが、受託監理部は運用部門から独立させ、全社のコンプライアンス管理に責任を持つコンプライアンス統括部担当役員の直轄とします。これにより、新信託銀行の運用部門のコンプライアンスについては、受託監理部とコンプライアンス統括部が重層的に管理する体制となり、大幅な拡充となります。

併せて、新信託銀行では、全社的にも運用部門をはじめとする各事業部門にコンプライアンス統括部の担当者を配置し、コンプライアンス統括部の直接的関与を強化します。

（2） インサイダー取引防止に特化した内部監査の実施

社長直轄の内部監査部による、運用部門におけるインサイダー取引防止に特化した監査を継続的に実施します。

なお、上記に加え、平成 24 年 4 月 1 日の三井住友信託銀行の役員体制等は既に発表済みですが、運用部門の管理体制をより強化するために、必要な見直しを行うこととしております。

2．業務運営の厳格化

（1） 証券会社営業担当者との接触禁止

運用担当者の証券会社営業担当者との接触を原則全面禁止とします。部長が業務上やむを得ないと判断した場合に限り、社内限定で複数での接触を可としますが、記録を受託監理部にも回付しチェックを行う運営とします。

（2） 外部から入手した情報の取扱ルール厳格化

インサイダー情報管理の要否判断については、コンプライアンス担当者またはコンプライアンス統括部等への相談を必須とする現行の住友信託銀行のルールを適用します。さらに、運用担当者の接する情報に関して、その内容や相手先に応じた詳細な管理ルールを明確に定め、情報管理の徹底を図ります。

（3） 短期売買、高出来高銘柄売買等の異例取引の全件チェック

現行の住友信託銀行の態勢をさらに強化し、運用部門から独立した受託監理部による全取引の検証態勢を構築します。

（4） 運用担当者の対外通話の全件記録と検証態勢強化

現行の住友信託銀行の管理態勢に沿って、運用担当者のすべての通話を記録し、運用部門から独立した受託監理部が検証する態勢を構築します。

（5） 個別株自己売買の禁止

個人の個別株売買については、従来より厳しく制限しておりますが、現行の住友信託銀行の管理態勢を踏襲し、運用部門については全面禁止とします。

（6） コンプライアンス研修等の強化

運用部門におけるコンプライアンス研修を、インサイダー取引防止を中心に四半期毎に行うなど質・量両面において強化するとともに、上記ルール等の誓約書を運用部門の職員全員から徴求し、徹底を図ります。

以上