

平成 17 年 12 月 27 日

各 位

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

弊社に対する業務改善命令について

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて弊社は、投資顧問業務および投資信託業務において下記事項に関し、本日金融庁より業務改善命令を拝受いたしました。

受益者ならびに関係者の皆様には、多大なご心配とご迷惑をおかけしておりますことを深くお詫び申し上げます。弊社では今回の業務改善命令を厳粛に受け止め、今後、法令等遵守体制および内部管理体制の一層の強化に努める所存でございます。何卒、皆様の変わらぬご支援ご鞭撻のほど、お願い申し上げます。

なお、本処分は弊社の投資顧問業務および投資信託業務の日常の業務に影響を及ぼすものではなく、投資信託の運用ならびに設定解約の受付など全ての業務を平常通り行いますことを申し添えさせていただきます。

記

1. 業務改善命令を受けた事由の概要

(1) 平成 14 年 6 月から平成 15 年 6 月にかけて、投資一任契約に基づく資産の運用において誤って発注した株式を同様の投資方針を持つ他の投資一任契約の口座に付替えた事例が、有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律（投資顧問業法）に違反すると認められました。

(2) 平成 16 年 6 月において、公募投資信託と私募投資信託の双方のファンドで TOPIX 先物取引に係る限月延長の実施が必要となっていたことから、取引執行コストの軽減を図る目的で、それぞれのファンド間で先物買建てと先物売建てのロールオーバー取引における売り買いを対当させた事例が、投資信託及び投資法人に関する法律（投信法）に違反すると認められました。

(3) 平成 16 年 4 月から同年 5 月にかけて公募投資信託の設定を行った際、投資顧問業務における個人富裕層顧客に対する投資助言業務において、同様の運用方針を持つ従来の私募投資信託の投資家に対する当該公募投資信託への乗り換えに関する説明等を、有価証券届出書の提出前に行った事例がありました。これらは募集行為に該当するものとして証券取引法に違反すると認められました。

2. 業務改善命令の概要

(1) 投資顧問業および投資一任契約に係る業務、投資信託委託業に関する法令等遵守体制および内部管理体制を強化するための措置を採ることが命じられました。

(2) 上記 (1) に関する業務改善計画を提出し、直ちに実行することが命じられました。

以上