

蘇黎世/巴塞爾, 2011年9月18日

新聞稿

瑞銀集團提供關於未授權交易更詳細之資訊

蘇黎世/巴塞爾, 2011年9月18日 — 2011年9月15日瑞銀集團宣布發現其投資銀行部有未經授權之交易。該交易係由一位駐倫敦環球合成股票業務(Global Synthetic Equity business)的交易員所進行。涉嫌的交易員已被英國當局指控濫用職權欺詐。

在公布更多細節之前, 我們需要確定我們瞭解未授權交易之帳上部位, 以及損失的金額。

目前此未授權交易造成的風險已經解除, 而且該股票業務部門已於規定的風險限額內正常運作。這個事件造成 23 億美元損失。如前次之聲明, 客戶的部位並未受到影響。

本事件中的損失, 是由最近三個月針對標準普爾 500 指數、德國 DAX 指數和 EuroStoxx 指數期貨的非經授權的投機交易所造成, 作為適當避險投資組合的一部分, 這些交易產生的部位是大型全球股票交易商的常規交易的範圍, 然而, 因涉嫌的交易員在我們的系統中執行虛構的遠期交割的指數股票型基金交易沖銷了這些部位而扭曲了真正的曝險規模。這些虛構交易掩蓋了指數期貨交易已逾越瑞銀集團風險限額的事實。

在瑞銀集團控管部門審查該交易員的部位並詢問其本人後, 該交易員在 2011 年 9 月 14 日透露他的未授權交易。

瑞銀集團董事會已成立一個特別委員會來進行未授權交易及其相關內控制度的獨立調查。該委員會將由資深獨立董事 David Sidwell 擔任主席, 並會向董事會報告。該委員會的其他成員包括 Ann Godbehere 女士及任志剛先生。

瑞銀集團

媒體聯絡

瑞士: +41-44-234-85 00

英國: +44-207-567 47 14



新聞稿
2011年9月18日
第二頁

美洲: +1-212-882 58 57
亞太地區: +852-297-1 82 00
www.ubs.com