경영유의사항 등 공시

1. 금융기관명 : 삼성증권㈜

2. 제재조치일 : 2017. 2. 3.

3. 제재조치내용

제재대상	제재내용
기 관	개선사항 : 1건

4. 제재대상사실

가. 개선사항

(1) 파생결합증권 한도초과 관련 규정 및 업무절차 개선

□ 국내지수와는 운용시간대가 다른 해외지수형 ELS도 국내지수와 동일한 기간 내에 한도초과 사실을 보고토록 하고 있어 일부 지연보고가 발생한 사실이 있고, 리스크관리팀에서 자체적으로 산출한 민감도지표와 헤지운용부서의 민감도지표를 수기로 비교하여 한도초과 여부를 판단하고 있어 적시에 대응이 이루어지지 않을 가능성이 있으므로 관련 규정을 개선하고 한도초과 인지부터 대응방안 마련에 이르기까지 체계적으로 관리되도록 시스템을 개선할 필요가 있음