경영유의사항 · 개선사항 공개

1. 금융회사명 : 신한금융투자㈜

2. 제재조치일 : 2017. 1. 26.

3. 제재조치내용

제재대상	제재내용
기 관	개선사항 : 2건

4. 제재대상사실

가. 개선사항

(1) ARS 운용 관련 내부통제 및 리스크 관리 강화 필요

○ ARS(Absolute Return Swap) 운용과 관련하여 롱숏전략을 추구함에 있어 대차거래에 대한 적정성 검토 절차가 미흡하고, 과도한 분할매수 주문으로 계좌간에 이상매매가 다수 적출되고 있으며, 빈번한 주식매매로 매매회전율이 높아 향후 고객과의 분쟁을 야기할 우려가 있으므로

ARS 매매 관련 시스템을 개선하고 유관부서를 통한 모니터링 등 내부통제를 강화하고 ARS 운용에 따른 리스크 관리를 강화할 필요가 있음

(2) ELS 헤지운용시 상관관계를 고려한 델타한도 관리 필요

○ 자체 헤지중인 ELS의 헤지를 하면서 기초자산별(국내 및 해외지수)로 델타한도를 관리하지 않고 모든 기초자산을 통합관리하고 있으므로 기초자산별 상관관계 등을 고려하여 델타한도를 관리할 필요가 있음