사전자산배분 기준

제정: 2017.06.30

제 1 장 총 칙

제 1 조(목적)

이 기준은 집합투자자산을 운용함에 있어 집합투자재산별로 미리 정해진 자산배분내역에 따라 매매결과를 공정하게 배분하여 집합투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

제 2 조(적용범위 및 투자대상자산)

① 이 기준은 회사내 운용담당자 등 집합투자재산 운용과 관련하여 직접 또는 간접으로 관여하는 일체의 직원에게 적용한다.

② 이 기준은 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 "법"이라 한다.) 제 80 조 제 1 항 단서 및 법 시행령 제 79 조 제 2 항에 따라 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 방법을 신탁계약서에 정하여 투자대상자산을 회사의 명의로 직접 취득·처분 등을 실행하는 경우에 적용한다.

1. 증권시장이나 해외 증권시장에 상장된 증권의 매매
2. 장내파생상품의 매매
3. 법 제 83 조제 4 항에 따른 단기대출
4. 다음 각 목의 어느 하나에 해당하는 금융기관이 발행 · 할인 · 매매 · 중개 · 인수 또는 보증하는 어음의 매매
   가. 은행
   나.「한국산업은행법」에 따른 한국산업은행
   다.「중소기업은행법」에 따른 중소기업은행
   라.「한국수출입은행법」에 따른 한국수출입은행
   마. 투자매매업자 또는 투자중개업자
   바. 증권금융회사
   사. 사. 종합금융회사
   아.「상호저축은행법」에 따른 상호저축은행
5. 양도성 예금증서의 매매

6. 「외국환거래법」에 따른 대외지급수단의 매매거래
7. 투자위험을 회피하기 위한 장외파생상품의 매매 또는 금융위원회가 정하여 고시하는 기준에 따른 법 제 5 조제 1 항제 3 호에 따른 계약의 체결
8. 금리 또는 채권가격을 기초자산으로 하는 스왑 거래를 함에 있어 거래상대방과 기본계약을 체결하고 그에 따라 계속적으로 계약을 체결하는 경우

제 3 조(선량한 관리자로서 책임 등)

회사는 선량한 관리자의 주의로써 집합투자재산별로 관리하여야 하며 집합투자자의 이익을 보호하여야 한다.

제 4 조(용어의 정의)

이 기준에서 사용하는 용어에 관한 정의는 다음 각호와 같다.

1. "사전자산배분"이라 함은 법 제 80 조에서 규정한 투자신탁재산별로 미리 정하여진 자산배분명세에 따라 취득・처분 등의 결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.
2. "투자신탁"이라 함은 법 제 9 조제 18 항에서 규정한 집합투자기구를 말한다.
3. "운용담당자"라 함은 집합투자재산의 운용을 담당하는 자를 말한다.
4. "매매담당자"라 함은 운용담당자로부터 매매주문을 접수하여 직접 자산의 취득, 매각 등을 실행하는 자를 말한다.

제 2 장 자산배분

제 5 조(자산배분 원칙)

① 투자신탁별 자산배분은 특정 수익자 또는 특정 투자신탁에 유리하거나 불리하지 아니하여야 한다.

② 주문지 주문처리는 매매담당자 접수시간 순서에 따른 매매를 원칙으로 한다.

③ 다수의 투자신탁에서 동일한 자산에 대하여 동일한 시간에 동일한 주문번호로 매매주문을 하여 취득, 처분한 자산은 그 다수의 투자신탁에 균등한 가격으로 배분하여야 한다.

④ 실제 취득, 처분한 자산의 수량이 매매주문 수량에 미달하는 경우에는 운용담당자가 미리 정한 동일한 시간에 동일한 주문번호로 주문한 다수의 펀드 간의 수량을 안분하여 동일한 가격으로 투자신탁에 배분하여야 한다.

⑤ 공모주 청약 및 대량매매의 경우는 당사 내부규정에 따라 사전배분을 시행한다.

⑥ 유동성이 부족한 종목의 매매는 시장 충격을 주지 않는 범위를 체크하고, 운용담당자와 협의 하에 일정 비율씩 매매 처리한다.

⑦ 투자신탁별로 매매주문서와 상이한 수량으로 배분될 시에는 다음 각호에 해당하는 경우에 한하고, 그 사유를 '별첨 1'의 사전배분 정정신청서를 작성하여 운용담당자와 준법감시인의 사전승인을 받고 그 기록을 유지하여야 한다.

1. 법규, 규약, 운용지침, 운용계획서, 마케팅자료 등 회사가 준수하여야 하는 모든 운용제한사항의 위반방지를 위한 수량 정정 또는 투자신탁 정정
2. 매매체결 후 예상치 못한 중대한 설정과 증감으로 인한 수량 정정 또는 투자신탁 정정
3. 상기 1, 2 호 이외 불가피한 사유로 인하여 수량 또는 투자신탁을 정정하는 경우

제 6 조(자산배분기준의 의결)

회사는 사전자산배분기준을 정하는 경우에는 집합투자재산 평가위원회의 의결을 거쳐야 한다.

제 7 조(자산배분기준의 공시)

회사는 자산배분기준을 인터넷 홈페이지를 이용하여 공시하여야 한다.

제 3 장 자산배분내역에 관한 장부 및 서류

제 8 조(자산배분내역에 관한 장부 및 서류)

① 자산의 취득, 매각 등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 투자대상자산에 대하여 투자신탁별로 주문금액 또는 수량, 가격 등을 기재한 매매주문서와 투자신탁별 배분내역을 기재한 자산배분명세서를 작성하여야 한다.

② 매매주문서 및 자산배분명세서는 전산으로 기록·유지되어야 하며 해당 운용담당자 및 준법감시인이 이행내역을 확인하여야 한다.

제 4 장 매매주문서의 작성 및 매매주문의 집행

제 9 조(매매주문서의 작성)

① 운용담당자는 투자신탁별로 종목, 주문금액 또는 수량, 가격, 주문시간, 주문번호 등을 기재한 매매주문서를 전산상에 작성하여야 한다. 다만, 전산 주문시스템의 작동 불능, 오류 등이 있는 경우에는 운용담당자는 준법감시인의 승인을 받아 서면으로 작성할 수 있으며 전산시스템이 정상화되는 즉시 주문내역을 전산시스템에 입력하여야 한다.

② 운용담당자는 매매주문서상의 종목은 특정종목, 금융투자협회 채권종류별, 신용등급별 종목 등으로 지정할 수 있다.

③ 운용담당자는 매매주문서상의 가격주문은 해당자산의 단가 혹은 수익률 등으로 표시되며, 지정가격, 시장가격 또는 범위를 정하여 매매담당자에게 매매가격을 일임하거나 범위 없이 매매담당자에게 일임하여 주문할 수 있다. 이때 별도의 가격을 기재하지 않은 경우는 범위 없이 매매담당자에게 일임하여 주문한 것으로 본다.

④ 제 1 항 및 제 3 항에도 불구하고 주문 시 투자신탁별로 주문계좌를 지정하여 다수종목에 대한 매매주문서를 작성하는 경우에는 종목, 수량만을 작성하고, 매매금액 및 가격 등을 작성하지 않을 수 있다.

제 10 조(매매주문의 집행)

매매담당자는 사전에 작성된 매매주문서를 기초로 하여 주문을 집행하여야 한다.

① 매매담당자는 매매주문에 대한 체결 및 미체결 내역 등 그 기록을 유지하여야 한다

제 5 장 자산배분 및 자산배분명세서 작성

제 11 조(자산배분명세서 작성)

① 매매담당자는 매매주문서와 체결내역서를 기초로 하여 자산배분명세서를 전산상에 작성하여야 한다.

② 자산배분명세서는 체결된 종목에 대하여 체결가격, 배분가격 등을 기재하여야 한다.

제 6 장 운용과 매매의 분리

제 12 조(운용담당자와 매매담당자의 겸직금지)

① 회사는 공정한 자산배분 등 투자자의 보호를 위하여 집합투자재산의 운용담당자와 매매담당자를 구분하여야 한다.

② 제 1 항에도 불구하고 다음 각 호의 어느 하나에 해당되는 경우에는 관련법규에 따라 운용담당자와 매매담당자를 겸직하게 할 수 있다.

1. 증권에 관하여 그 종류에 따라 다수 종목의 가격수준을 종합적으로 표시하는 지수의 변화에 연동하여 운용하는 것을 목표로 하는 집합투자기구의 집합투자재산을 취득·처분 등을 하는 경우
2. 투자신탁별로 계좌를 개설하고 계좌별로 이루어지는 매매거래의 경우
3. 거래소의 증권시장업무규정에서 정하는 프로그램매매에 해당하는 거래의 경우
4. 장내파생상품 거래의 경우

부 칙

제 1 조(시행일) 이 기준은 2017.06.30 일 부터 시행한다.

<별 첨 1>

자산배분 정정신고서

일자	
운용담당자	
운용본부장	
매매담당자	
준법감시인	
사유	

투자신탁명	종목명	변경 전	변경 후	비고

□ **배분정정내역**

□ **상세내역 첨부 가능**