

사전자산배분기준

제정 2019.01.01. 개정2019. 03. 28.

제 1 조 (목적) 이 기준은 회사가 집합투자재산을 운용함에 있어 관련법규에 따라 직접 투자대상자산의 취득·처분 등의 업무를 수행하는 경우 집합투자재산별로 미리 정하여진 자산배분명세에 따라 취득·처분 등의 결과를 공정하게 배분함으로써 집합투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

제 2 조 (적용범위) ① 이 기준은 회사 내 운용담당자 등 집합투자재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 모든 임직원에게 적용한다.

② 이 기준은 「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」(이하 “법”이라 한다) 제 80 조제 1 항의 단서 및 법 시행령 제 79 조제 2 항에 따라 신탁계약서에 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 방법을 정하여 투자대상자산을 운용하는 경우 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. 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 스왑거래를 함에 있어 거래상대방과 기본계약을 체결하고 그에 따라 계속적으로 계약을 체결하는 경우

제 3 조 (선량한 관리자로서 책임 등) 회사는 선량한 관리자의 주의로써 집합투자재산을 운용하여야 한다.

제 4 조 (용어의 정의) 이 기준에서 사용하는 용어의 정의는 다음 각 호와 같으며, 이 기준에서 정하지 아니한 경우에는 관련법규 및 금융투자협회 규정 등에서 정하는 바에 따른다.

1. “펀드”라 함은 법 제 9 조 제 18 항에서 규정하는 집합투자기구를 말한다.
2. “사전자산배분”이라 함은 법 제 80 조에서 규정한 바에 따라 펀드별로 미리 정하여진 자산배분명세에 따라 취득·처분 등의 결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.
3. “운용담당자”라 함은 펀드를 실제 운용하는 직원을 말한다.
4. “매매담당자”라 함은 운용담당자로부터 매매주문을 접수하여 직접 자산의 취득·처분 등을 실행하는 직원을 말한다.
5. “정보통신수단”이라 함은 전화, 전자우편, 메신저 및 이와 유사한 수단으로 회사의 정보통신망을 통하여 정보 및 문서를 송수신하는 장치 및 컴퓨터 프로그램을 말한다.
6. “당일 발행자산”이라 함은 당일 거래시간 중에 사전예고 없이 발행여부 및 발행조건이 결정되는 채무증권, 양도성 예금증서 등을 말한다.
7. “종목코드주문”이라 함은 운용담당자가 구체적인 종목코드를 사전자산배분시스템에 입력하는 주문방식을 말한다.
8. “텍스트주문”이라 함은 운용담당자가 거래대상과 조건 등을 특정하기 곤란한 경우 이를 포괄적으로 지정하는 주문방식을 말한다.

제 5 조 (자산배분 원칙) ① 펀드별 자산배분은 특정 수익자 또는 특정 펀드에 유리하거나 불리하지 않도록 접수 우선 원칙 등에 따라 투자대상자산을 취득·처분하고, 취득·처분 등을 한 투자대상자산은 미리 정한 자산배분명세서에 따라 펀드별로 공정하게 안분 배분하여야 한다.

② 다수의 펀드에서 동일한 자산에 대하여 동일한 시간에 동일한 주문번호로 매매주문을 하여 취득·처분한 자산은 그 다수의 펀드에 균등한 가격으로 배분하여야 한다.

③ 실제 취득·처분한 자산의 수량이 매매주문 수량에 미달하는 경우에는 운용담당자가 미리 정한 펀드별 주문수량을 기초로 동일한 시간에 주문한 다수의 펀드 간에 수량을 안분하여 동일한 가격으로 배분하여야 한다. 이 경우 배분 후 발생하는 단수에 대하여는 설정금액이 가장 큰 펀드에 배정한다.

④ 제 3 항에도 불구하고 운용담당자가 펀드별 배분 우선순위 또는 비율을 미리 정한 경우에는 그 우선순위 또는 비율에 따라 자산을 배분하여야 한다.

⑤ 이 조의 규정에도 불구하고 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 경우에는 운용담당자는 사전자산배분 정정승인서(별지서식 1 호)를 작성하여 운용담당부서장과 준법감시인의 사전승인을 받아 매매주문서와 상이한 수량으로 매매결과를 배분할 수 있으며, 이 경우에는 그 사유를 기록하고 이를 증빙할 수 있는 자료를 첨부하여야 한다.

1. 법규, 신탁계약서, 운용지침, 운용계획서, 마케팅자료 등 회사가 준수하여야 하는 모든 운용제한사항의 위반 방지를 위한 수량 정정 또는 펀드 정정
2. 매매체결 후 예상치 못한 중대한 설정고 증감으로 인한 수량 정정 또는 펀드 정정
3. 결제자금 부족, 환매자금 부족 등 이 항의 사유와 유사하거나 관련된 것으로서 수량 정정 또는 펀드 정정이 불가피한 경우

제 6 조 (자산배분내역에 관한 장부 및 서류) ① 운용담당자는 투자대상자산의 취득·처분 등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 투자대상자산에 대하여 펀드별로 주문금액, 가격, 수량 등을 기재한 매매주문서와 펀드별 배분내용을 기재한 자산배분명세서를 작성하여야 한다.

② 매매담당부서장은 매매주문서와 자산배분명세서를 전산으로 기록·유지하여야 하며 준법감시인은 매매주문서와 자산배분명세서의 적정성과 이행내용을 확인하여야 한다.

③ 운용담당자는 자산의 취득·처분 등의 주문이 체결되기 전에는 제 1 항의 매매주문서를 취소하고 새로이 작성하는 방법으로 주문을 정정할 수 있다.

④ 운용담당자는 제 5 조 제 4 항에 해당되는 경우에 한해서 체결된 자산배분명세서를 정정할 수 있으며 이 경우에도 전산으로 자산배분명세서를 기록·유지하여야 한다.

⑤ 회사는 각 투자대상 자산의 사전자산 배분에 관한 전산시스템을 이 기준에 부합하도록 적정하게 유지하여야 하며, 그 시스템을 수정하고자 하는 경우 준법감시인의 승인을 받아야 한다.

제 7 조 (매매주문서의 작성) ① 운용담당자는 펀드별로 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 서면(전자우편 포함)으로 작성할 수 있으며 전산시스템이 정상화되는 즉시 주문내역을 전산시스템에 입력하여야 한다.

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

③ 운용담당자는 매매주문서상의 가격은 해당 자산의 단가 혹은 수익률 등으로 표시하거나 지정가격, 시장가격 또는 범위를 정하여 매매담당자에게 매매가격을 일임하거나 범위를 정하지 않고 매매담당자에게 일임하여 주문할 수 있다. 이 때 운용담당자가 별도의 가격을 기재하지 않은 경우에는 범위를 정하지 않고 매매담당자에게 일임하여 주문한 것으로 본다.

④ 제 1 항 및 제 3 항에도 불구하고 주문시 펀드별로 주문계좌를 지정하여 다수 종목에 대한 매매주문서를 작성하는 경우에는 종목, 수량만을 기재하고, 매매금액 및 가격 등을 기재하지 않을 수 있다.

⑤ 운용담당자는 제 1 항의 주문과 관련하여 투자대상자산의 특성을 고려하여 적합한 주문방식(종목코드 주문, 텍스트 주문, 텍스트 주문과 종목코드 주문의 병행 등)을 적용하여 주문할 수 있다.

제 7 조의 2(콜론 및 환매조건부매매의 특례) ① 운용담당자는 투자신탁별로 콜 및 RP 시장의 특성, 각 투자신탁의 운용전략 및 운용제한 등을 감안하여 콜 또는 RP 거래를 할지 여부를 설정일, 거래하고자 하는 날 등 사전에 결정하여야 한다.

② 운용담당자는 투자신탁별로 콜, RP 에 대한 운용가능 자금을 합산하여 통합운용 및 거래할 수 있다.

③ 운용담당자는 제 2 항의 운용결과를 투자신탁재산별로 운용가능 자금을 기준으로 안분 배분을 원칙으로 하되, 설정 1 개월 내 투자신탁, 해지 예정인 투자신탁 또는

단기금융상품을 주된 투자대상자산으로 하는 투자신탁 등 유동성 확보가 필요한 경우에는 우선적으로 또는 추가로 배분할 수 있다.

제 7 조의 3(당일 발행자산의 특례) ① 당일 발행자산의 특성을 감안하여, 운용담당자는 제 12 조제 2 항에도 불구하고 투자중개업자 등과 직접 정보통신수단을 통하여 예외적으로 주문을 체결할 수 있다.

② 운용담당자는 제 1 항에 따라 당일 발행자산에 대한 주문체결이 확정되는 경우 정보통신수단을 이용하여 투자신탁별 코드 및 배분수량 등 최소한의 내용을 기재한 주문내역을 매매담당자에게 즉시 통보한다.

③ 운용담당자는 주문체결 확정시점으로부터 15 분 이내에 투자신탁별 주문내역을 자산배분시스템에 입력한다.

제 8 조 (매매주문의 집행) ① 매매담당자는 운용담당자가 사전에 작성한 매매주문서를 기초로 하여 주문을 집행하여야 한다.

② 매매담당자는 매매주문에 대한 체결 및 미체결 내역은 그 기록을 유지하여야 한다.

제 9 조 (자산배분명세서의 작성) ① 매매담당자는 매매주문서와 체결내역서를 기초로 하여 자산배분명세서를 전산상에 작성하여야 한다.

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

제 10 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

제 11 조 (기준의 제·개정) 이 기준을 개정하는 경우에는 집합투자재산평가위원회의 의결을 거쳐야 한다. 단, 법령 및 내규의 개정에 따른 용어변경, 자구수정 등과 같이 실질적인 내용의 변경이 없는 경우 준법감시인이 이를 승인할 수 있다.

제 12 조 (공시) 이 기준을 제정하거나 개정하는 경우에는 회사의 인터넷 홈페이지 등을 이용하여 공시하여야 한다.

제 1 조 (시행일) 이 기준은 전문사모집합투자업 등록일부터 시행한다.

부 칙 (2019. 3. 28.)

제 1 조 (시행일) 이 기준은 2019년 3월 28일부터 시행한다.

[별지서식 1호]

자산배분 정정신고서

일 자	
운용담당자	
운용부서장	
매매담당자	
준법감시인	
사유	

○ 배분정정내역

종목명:

변경 전			변경 후		
펀드명	주수	단가	펀드명	주수	단가

*첨부: 상세내역