

사전자산배분기준

제 정 2008.06.24

개 정 2009.02.04

개 정 2014.02.24

제 1 장 총 칙

제1조(목적) 이 기준은 집합투자재산을 운용함에 있어 집합투자기구재산별로 미리 정해진 자산배분내역에 따라 매매결과를 공정하게 배분하여 집합투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

제2조(적용범위 및 투자대상 자산) ① 이 기준은 회사 내 운용담당자 등 집합투자기구 재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 모든 임직원에게 적용하며, 대상 자산은 「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」(이하 “법”이라 한다.) 제80조 제1항 및 법 시행령 제79조 제2항의 단서규정에 따른 증권, 장내파생상품, 단기대출, 어음, 양도성예금증서 등에 한한다.

② 이 기준은 「증권투자신탁업법」, 「간접투자자산운용업법」에 의해 설정된 펀드를 포함하여 모든 펀드(자본시장과 금융투자업에 관한 법률상 집합투자기구, 간접투자자산운용업법상 간접투자기구, 증권투자신탁업법상 투자신탁)에 대하여 적용한다.

제3조(선량한 관리자로서 책임 등) 회사는 선량한 관리자의 주의로써 집합투자기구재산별로 관리하여야 하여 집합투자자의 이익을 보호하여야 한다.

제4조(용어의 정의) 이 기준에서 사용하는 용어에 관한 정의는 다음 각호와 같으며, 이 기준에서 정하지 아니한 경우에는 관련법규에서 정하는 바에 따른다.

1. “사전자산배분”이라 함은 법 제80조에서 규정한 집합투자기구별로 미리 정해진 자산배분내역에 따라 매매결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.

2. “펀드”라 함은 법 제9조 제18항에서 규정하는 집합투자기구를 말한다.
3. “운용담당자”라 함은 펀드를 운영하는 임직원을 말한다.
4. “매매담당자”라 함은 운용담당자로부터 매매주문을 접수하여 직접 자산의 취득·매각 등을 실행하는 직원을 말한다.

제5조(기준변경) 본 기준을 제정 또는 개정하고자 하는 경우에는 집합투자재산평가위원회 심의·의결을 필요로 한다.

제6조(주관부서) 본 기준과 관련된 업무의 주관부서는 컴플라이언스부서로 한다.

제 2 장 사전자산배분

제7조(자산배분 원칙) ① 펀드별 자산배분은 특정수익자 또는 특정 펀드에 유리하거나 불리하지 아니하여야 한다.

② 펀드별로 매매한 자산을 균등한 가격으로 배분하여야 한다. 다만, 균등한 가격은 다수의 펀드에 대해서 동시에 주문하는 경우에 한한다.

③ 동일한 종목에 대한 펀드별 배분은 지정가격이 아닌 경우에는 주문접수순으로 배분한다. 이때, 주문시간이 다른 동일한 종목에 대한 각각의 주문은 별개의 주문으로 본다.

④ 매매 거래된 자산은 주문수량에 따라 일정비율로 배분함을 원칙으로 한다. 매매한 자산의 수량이 매매주문 수량에 미달하는 경우에는 미리 정한 펀드별 배분 비율에 따라 자산을 배분하여야 한다. 체결배분후 잔여금액 및 단주는 자산규모가 가장 큰 펀드에 배분함을 원칙으로 한다.

⑤ 펀드별로 매매주문서와 상이한 수량으로 배분될 시에는 다음 각호에 해당하는 경우에 한하고, 그 사유를 기록하여야 한다.

1. 법규 등(투자규약, 운용계획서 포함) 위반 및 위반 방지를 위한 수량 정정 또는 펀드 정정
2. 매매체결 후 예상치 못한 중대한 설정고 증감으로 인한 수량 정정 또는 펀드 정정

3. 위 사유 외의 불가피한 사유로 사전에 준법감시인에게 승인을 받은 경우

⑥ 운용담당자 및 매매담당자는 제5항 제1호 및 제2호에 따라 매매주문서와 상이한 수량으로 배분해야 할 경우 관련법령을 위반하지 않도록 사전에 준법감시인과 협의하여야 한다.

제8조(사전자산배분에 관한 기준의 공시) 회사는 자산배분에 관한 기준을 인터넷 홈페이지를 이용하여 공시한다.

제 3 장 사전자산배분내역에 관한 장부 및 서류

제9조(자산배분내역에 관한 장부 및 서류) ① 자산의 매매업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 자산에 대하여 펀드별로 주문금액 또는 수량, 가격 등을 기재한 취득·처분 등의 주문서(이하 “매매주문서”)와 펀드별 배분내역을 기재한 자산배분내역서를 작성하여야 한다.

② 매매주문서 및 자산배분내역서는 전산으로 기록 유지되어야 하며, 각 운용담당자 및 준법감시인이 이행내역을 확인하여야 한다.

③ 자산배분내역서를 정정하는 경우에는 제7조 제5항에 해당되는 경우에 한해서 가능하며 전산으로 기록 유지하여야 한다.

제 4 장 매매주문서의 작성 및 매매주문의 집행

제10조(매매주문서의 작성) ① 운용담당자는 펀드별로 종목, 주문금액 또는 수량, 가격, 주문시간 등을 기재한 매매주문서를 전산상에 작성하여야 한다. 다만, 전산주문시스템의 작동불능, 오류 등이 있는 경우 운용담당자는 준법감시인의 승인을 받아 서면 또는 구두로 작성할 수 있으며, 전산시스템이 정상화되는 즉시 주문내역을 전산시스템에 입력하여야 한다.

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

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

④ 제1항 및 제3항에도 불구하고 주문시 펀드별로 주문계좌를 지정하여 다수종목에 대한 매매주문서를 작성하는 프로그램 거래의 경우에는 종목, 수량만을 작성하고, 매매금액 및 가격 등을 작성하지 않을 수 있다.

제11조(매매주문의 집행) 매매담당자는 사전에 작성된 매매주문서를 기초로 하여 주문을 집행하여야 한다.

제 5 장 자산배분 및 자산배분내역서 작성

제12조(자산배분내역서의 작성) ① 매매담당자는 매매주문서와 체결내역서를 기초로 하여 자산배분내역서를 전산상에 작성하여야 한다.

② 자산배분내역서는 체결된 종목에 대하여 체결가격, 배분가격등이 기재하여야 한다.

제 6 장 운용과 매매의 분리

제13조(대상자산) 회사는 제2조에 정하는 자산에 대해 운용을 담당하는 임직원과 직접 자산의 매매업무를 실행하는 직원이 구분되도록 하여야 한다. 다만, 「금융투자업규정」 제4-55조 등에서 정하는 겸직금지 예외의 경우에는 그러하지 아니한다.

부 칙(2008년6월24일)

제1조 (시행일) 이 기준은 2008년 6월 24일부터 시행한다.

부 칙(2009년2월4일)

제1조 (시행일) 이 기준은 2009년 2월 4일부터 시행한다.

부 칙(2014년2월24일)

제1조 (시행일) 이 기준은 2014년 2월 24일부터 시행한다.