

자산배분에 관한 기준

제 정 : 2007. 8.17

제 1 조(목적) 이 기준은 간접투자자산을 운용함에 있어 펀드별로 미리 정해진 자산배분계획에 따라 매매결과를 공정하게 배분하여 간접투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

제 2 조(적용범위 및 대상자산) 이 기준은 회사내 운용담당자 등 간접투자재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 일체의 직원에게 적용하며, 대상자산은 간접투자자산운용업법(이하 “업법”이라 한다.) 제 90 조 제 1 항의 단서규정에 의한 투자증권, 장내파생상품, 단기대출, 간접투자증권, 외환선도환거래에 한한다.

제 3 조(선량한 관리자로서의 책임 등) 회사는 선량한 관리자의 주의를 다하여 펀드별로 관리하여야 하며, 간접투자자의 이익을 보호하여야 한다.

제 4 조(용어의 정의) 이 기준에서 사용하는 용어에 관한 정의는 다음 각호와 같다.

1. “사전자산배분”이라 함은 펀드별로 미리 정하여진 자산배분계획에 따라 매매결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.
2. “펀드”라 함은 회사가 운용하는 회사형 또는 계약형 간접투자기구와 일임자문 포트폴리오를 말한다.
3. “운용담당자”라 함은 펀드를 운용하는 직원을 말한다.
4. “매매담당자”라 함은 운용담당자로부터 매매주문을 접수하여 직접 자산의 취득, 매각 등을 실행하는 직원을 말한다.

제 5 조 (자산배분 원칙) ① 펀드별 자산배분은 특정수익자 또는 특정 펀드에 유리하거나 불리하지 아니하여야 한다.

② 펀드별로 취득, 매각한 자산은 균등한 가격으로 배분되어야 한다. 단, 균등한 가격은 다수의 펀드에 대해서 동시에 주문하는 경우에 한한다.

③ 동일한 종목에 대한 펀드별 배분은 지정가격이 아닌 경우에는 주문접수 순으로 배분한다. 이때, 주문시각이 다른 동일종목에 대한 각각의 주문은 별개의 주문으로 본다.

④ 취득, 매각한 자산의 수량이 매매주문 수량에 미달하는 경우에는 미리 정한 펀드별 배분비율에 따라 자산을 배분하여야 한다.

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

1. 법규 등(약관, 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 부서장 및 준법감시인에게 승인을 받은 경우

제 6 조 (사전자산배분에 관한 기준의 공시) 회사는 자산배분에 관한 기준을 인터넷 홈페이지를 통하여 공시하여야 한다.

제 7 조 (자산배분내역에 관한 장부 및 서류) ① 자산의 취득, 매각 등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 자산에 대하여 펀드별로 주문금액 또는 수량, 가격 등을 기재한 매매주문서와 펀드별 배분계획을 기재한 자산 배분내역서를 작성하여야 한다.

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

③ 자산배분내역서를 정정하는 경우에는 제 5 조 제 5 항에 해당되는 경우에 한하여 가능하며 전산으로 기록 유지하여야 한다.

제 8 조 (매매주문서의 작성) ① 운용담당자는 펀드별로 종목, 주문금액 또는 수량, 가격, 주문시각 등을 기재한 매매주문서를 전산상으로 작성하여야 한다.

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

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

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

제 9 조 (매매주문의 실행) 매매담당자는 사전에 작성된 매매주문서를 기초로 하여 주문을 실행하여야 한다.

제 10 조 (자산배분내역서의 작성) ① 매매담당자는 매매주문서와 체결내역서를 기초로 하여 자산배분내역서를 전산상에 작성하여야 한다.

② 자산배분내역서에는 체결된 종목에 대하여 체결가격, 배분가격 등이 기재되어야 한다.

③ 펀드별로 매매주문서와 상이한 수량으로 배분될 시에는 그 사유를 기재하여야 한다.

제 11 조 (운용담당자와 매매담당자간 겸직금지) 제 2 조에 정하는 자산에 대해 운용을 담당하는 직원과 직접 자산의 취득, 매각 등의 실행하는 직원을 분리하여야 한다. 다만, 간접투자자산운용업감독규정 제 71 조에서 정하는 투자신탁별 개별계좌 거래의 경우에는 그러하지 아니한다.

부 칙 (제 정)

제 1 조 (시행일) 이 규정은 2007년 8월 17일부터 시행한다.