

# 사전자산배분기준

제 정 2009. 7. .

## 제1조 (목적)

이 기준은 회사가 집합투자재산을 운용함에 있어 관련법규에 따라 직접투자대상자산의 취득, 처분 등의 업무를 수행하는 경우 집합투자재산별로 미리 정하여진 자산배분명세에 따라 취득, 처분 등의 결과를 공정하게 배분함으로써 집합투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

## 제2조 (용어의 정의)

① 이 기준에서 사용하는 용어의 정의는 다음 각 호와 같으며. 이 기준에서 정하지 아니한 경우에는 관련법규에서 정하는 바에 따른다.

1. “펀드”라 함은 자본시장과금융투자업에관한 법률(이하 “자본시장법”이라 한다.) 제 9 조 제 18 항에서 규정하는 집합투자기구를 말하며, 간접투자자산운용업법에 따라 설정된 투자신탁, 투자회사 및 투자전문회사를 포함한다.
2. “사전자산배분”이라 함은 자본시장법 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.

## 제3조 (적용범위)

이 기준은 자본시장법 제 80 조 제 1 항 단서 및 동법 시행령 제 79 조 제 2 항에 따라 회사가 투자신탁재산의 효율적인 운용을 위하여 불가피하게 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 방법으로 신탁계약서에 정하여진 투자대상자산을 회사의 명의로 직접 취득, 처분 등을 실행하는 경우에 적용한다.

1. 증권시장이나 해외 증권시장에 상장된 증권의 매매
2. 장내파생상품의 매매
3. 자본시장법 제 83 조 제 4 항에 따라 다음 각목의 금융기관에게 30 일 이내로 하는 단기대출
  - 가. 은행
  - 나. 한국산업은행
  - 다. 중소기업은행
  - 라. 한국수출입은행
  - 마. 투자매매업자 또는 투자중개업자
  - 바. 증권금융회사
  - 사. 종합금융회사
  - 아. 상호저축은행
  - 자. 보험회사
  - 차. 위 각목에 준하는 외국금융기관
4. 제 3 호 가목 내지 아목에 해당하는 금융기관이 발행, 할인, 매매, 중개, 인수 또는 보증하는 어음의 매매
5. 양도성 예금증서의 매매
6. 「외국환거래법」에 따른 대외지급수단의 매매거래

7. 투자위험을 회피하기 위한 장외파생상품의 매매 또는 금리/채권가격을 기초자산으로 하는 스왑거래를 함에 있어 거래상대방과 기본계약을 체결하고 그에 따라 계속적으로 하는 계약의 체결

#### 제4조 (자산배분원칙)

- ① 회사는 수익자의 이익을 최우선시해야 하며, 모든 수익자가 공정하고 공평하게 대우받을 수 있도록 하여야 한다.
- ② 펀드별 자산배분은 특정 수익자 또는 특정 펀드에 유리하거나 불리하지 아니하여야 한다.

#### 제5조 (자산배분방법)

- ① 매매담당자는 최선의 매매거래를 위하여 비슷한 시간대에 접수된 같은 증권의 매매주문을 취합하여 처리하여야 한다.
- ② 하나 또는 다수의 펀드에서 다른 시간에 매매주문을 하여 취득, 처분한 자산은 주문접수시간 순서대로 운용담당자가 사전에 정한 펀드에 배분하여야 한다.
- ③ 다수의 펀드에서 동일한 자산에 대하여 동일한 시간에 동일한 주문번호로 매매주문을 하여 취득, 처분한 경우 체결가격과 수수료는 펀드별로 가중평균값을 동일하게 적용하여야 한다.
- ④ 거래의 부분체결 등 제한적인 투자기회의 배분에 있어서 각각의 펀드에 사전에 준비된 매매지시와 실제 체결된 수량을 비교하여 안분비례의 원칙에 따라 배분하여야 한다.
- ⑤ 기업공개 또는 신주발행의 경우, 운용담당자는 투자 가능한 모든 펀드를 대상으로 하여야 하며, 청약일 전일 기준으로 펀드 순자산에 주식투자가능비율을 곱한 금액에 따라 안분비례하여 배분하여야 한다. 단, 운용담당자의 판단에 따라 특정 펀드를 제외하거나 그 배분수량을 조정하고자 하는 경우 그 사유를 매매주문서에 기재하고 준법감시인의 사전승인을 받아야 한다.

⑥ 이 조의 규정에도 불구하고 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 경우에는 운용담당자는 별첨 1 의 사전자산배분 정정신청서를 작성하여 운용부서장과 준법감시인의 사전승인을 받아 사전배분명세서와 상이한 수량으로 매매결과를 배분할 수 있으며, 이 경우에는 그 사유를 기록하고 이를 증빙할 수 있는 자료를 첨부하여야 한다.

1. 법규, 약관, 운용지침, 운용계획서, 마케팅자료 등 회사가 준수하여야 하는 모든 운용제한사항의 위반방지를 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

#### 제6조 (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 배분결과를 기재한 자산배분명세서를 작성하여야 한다.

② 회사는 매매주문서와 자산배분명세서를 전산으로 작성, 기록, 유지하여야 한다. 단, 매매주문시스템을 이용할 수 없는 경우, 또는 매매주문시스템의 일시적 작동 불능, 오류 등으로 인하여 매매주문시스템에 입력이 불가능한 경우에는 운용부는 매매주문서와 자산배분명세서를 각각 서면으로 작성하여 매매담당자, 담당운용역, 운용부서장의 서명을 받아 원본을 신탁계리를 담당하는 부서에 제출하고, 사본 1 부를 준법감시부에 제출한다. 운용부는 사본 1 부를 별도로 자체 보관한다.

③ 준법감시인은 매매주문서와 자산배분명세서의 적정성과 이행내용을 확인하여야 한다.

④ 회사는 각 투자대상자산을 위한 매매주문시스템을 적정하게 유지하여야 하며, 그 시스템 내에 자동배분방식이 있는 경우 이를 수정하고자 하는 경우에는 준법감시인의 사전승인을 받아야 한다.

⑤ 운용담당자는 자산의 취득, 처분 등의 주문이 체결되기 전에는 제 1 항의 매매주문서를 취소하고 새로이 작성하는 방법으로 주문을 정정할 수 있다.

⑥ 운용담당자는 제 5 조 제 6 항에서 정하는 바에 따라 매매체결 후 자산배분명세서를 정정할 수 있으며, 이 경우에도 자산배분명세서를 기록, 유지하여야 한다.

#### 제7조 (매매주문서의 작성)

① 운용담당자는 펀드별로 종목, 주문금액 또는 수량, 가격, 주문시간, 주문번호 등을 기재한 매매주문서를 작성하여야 한다. 단, 매매주문시스템의 작동 불능, 오류 등으로 인하여 시스템에 입력이 불가능한 경우, 매매주문서를 서면으로 작성하여 매매담당자, 운용부서장의 사인을 받아 준법감시부 및 재무기획팀에 제출하여야 한다.

② 운용담당자는 매매주문서상에 지정가격, 시장가격 또는 범위 등을 정하여 매매담당자에게 주문하거나, 범위를 정하지 않고 매매담당자에게 일임하여 주문할 수 있다. 이 때 운용담당자가 별도의 가격을 기재하지 않은 경우에는 범위를 정하지 않고 매매담당자에게 일임하여 주문한 것으로 본다.

#### 제8조 (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.

### 제9조 (자산배분명세서의 작성)

- ① 매매담당자는 매매주문서의 체결내역서를 기초로 하여 자산배분명세서를 작성하여야 한다.
- ② 자산배분명세서는 체결된 종목에 대하여 체결가격 등을 기재하여야 한다.

### 제10조 (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 해당하는 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

### 제11조 (기준의 개정 및 공시)

본 기준의 개정절차는 사규관리규정에 따르기로 하며 회사는 이 기준을 제정하거나 개정하는 경우에는 회사의 인터넷 홈페이지를 이용하여 공시하여야 한다.

부 칙

제 1 조(시행일)

이 기준은 2009년 7월 일부터 시행한다.

<별첨 1>

사전자산배분 정정신청서

일 자:

소 속:

직 위:

성 명:

정정사유(증빙자료 첨부)

대상종목

배분정정내역

펀드명	배분전 수량 or 액면	배분후 수량 or 액면

위와 같이 사전자산배분 내역의 정정을 신청합니다.

운용역	운용부서장
서명	서명
일자 및 시각:	일자 및 시각:

다음과 같이 승인 또는 기각합니다.

준법감시인	승인/기각
서명:	
일자 및 시각:	<input type="checkbox"/> 승인 <input type="checkbox"/> 기각