

사전자산배분기준

라이크자산운용 주식회사

사전자산배분기준

제정 2022.09.05

제1장 총칙

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

제2조(적용범위 및 투자대상자산) ① 이 기준은 회사 내 운용담당자 등 신탁재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 일체의 직원에게 적용하며, 대상자산은 「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」(이하 “법”이라 한다) 제80조 제1항의 단서규정 및 법 시행령 제79조 제2항에 따라 신탁계약서에 정하여 투자대상자산을 회사의 명의로 직접 취득·처분 등을 실행하는 경우에 적용한다. 관련 법규가 개정되어 그 내용이 변경되는 경우에는 이 기준의 개정 절차 없이 관련 법규의 개정 내용에 따른다. 단, 집합투자기구의 자전거래의 경우는 이 기준을 적용하지 아니한다.

② 이 기준은 투자일임업을 겸영하는 경우 영 제99조제2항제4호에 따라 투자일임재산을 사전자산배분하는 경우에 준용한다. 다만 이 경우 제10조부터 제10조의 2까지의 규정 준용 여부는 투자일임업을 겸영하는 회사가 자율적으로 정한다.

제3조(선량한 관리자로서의 책임 등) 회사는 선량한 관리자의 주의로써 집합투자재산별로 관리하여야 하며 집합투자자의 이익을 보호하여야 한다.

제4조(용어의 정리) 이 기준에서 사용하는 용어에 관한 정의는 다음 각 호와 같다.

1. “사전자산배분”이라 함은 법제80조에서 규정한 투자신탁별로 미리 정하여진 자산배분내역에 따라 매매결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.
2. “펀드”라 함은 법제9조제18항에서 규정하는 집합투자기구를 말한다.
3. “운용담당자”라 함은 실제펀드를 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 회

사의 정보통신망을 통하여 정보 및 문서를 송·수신하는 장치 및 컴퓨터프로그램을 말한다.

6. “당일발행자산”이라 함은 당일 거래시간 중에 사전 예고 없이 발행여부 및 발행조건이 결정되는 채무증권, 양도성예금증서 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.

제2장 사전자산배분

제5조(자산배분 원칙) ① 회사는 특정 수익자 또는 특정 투자신탁에 유리하거나 불리하지 않도록 접수 우선원칙 등에 따라 투자대상자산을 취득·처분하고, 취득·처분 등을 한 투자대상자산은 미리 정한 자산배분명세서에 따라 투자신탁별로 공정하게 안분 배분하여야 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 자산은 그 다수의 펀드에 균등한 가격으로 배분하여야 한다.

④ 실제 취득, 처분한 자산의 수량이 매매주문수량에 미달하는 경우에는 운용담당자가 미리 정한 펀드별 주문수량을 기초로 동일한 시간에 주문한 다수의 펀드간에 수량을 안분하여 동일한 가격으로 배분하여야 한다. 다만 운용담당자가 펀드별 배분 우선순위 또는 비율을 미리 정한 경우에는 그 우선순위 또는 비율에 따라 자산을 배분할 수 있다. 이 경우 회사는 투자자간 이해상충이 발생하지 않도록 관리해야 한다.

⑤ 운용담당자는 제4항에 따라 배분하는 경우 준법감시인의 확인을 받아야 하며, 이를 입증할 수 있는 근거자료를 보관·유지하여야 한다.

⑥ 제1항 및 제5항에도 불구하고 펀드별 매매계좌를 분리하여 매매주문이 이루어지는 경우에는 사전배분이 이루어진 것으로 본다.

제6조(자산배분내역에 관한 장부 및 서류) ① 운용담당자는 투자대상자산의 취득, 처분 등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 투자대상자산에 대하여 펀드별로 종목, 주문금액, 가격, 수량 등을 기재한 매매주문서와 펀드별 배분내용을 기재한 자산배분명세

서를 전산시스템에 작성하여야 한다. 다만, 전산시스템의 작동불능, 오류 등이 있는 경우에는 운용담당자는 준법감시인의 승인을 받아 서면(전자우편을 포함한다)으로 주문내역을 작성할 수 있으며 전산시스템이 정상화되는 즉시 그 주문내역을 전산시스템에 입력하여야 한다.

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

③ 매매담당부서장은 각 운용자산의 사전자산배분에 관한 전산시스템을 이 기준의 내용에 부합하도록 적정하게 유지하여야 하며 그 시스템을 수정하고자 하는 경우에는 준법감시인의 사전 승인을 받아 수정하여야 한다.

④ 제1항 및 제3항에도 불구하고 펀드별로 매매계좌를 분리하여 매매주문이 이루어지는 경우에는 자산배분명세서를 작성·기록·유지하지 않을 수 있다.

제3장 매매주문서의 작성 및 매매주문의 집행

제7조(매매주문서의 작성) ① 운용담당자는 펀드별로 종목, 주문금액 또는 수량, 가격, 주문시간 등을 기재한 매매주문서를 전산상에 작성하여야 한다.

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

③ 매매주문서상의 가격주문은 해당 자산의 단가 혹은 수익률 등으로 표시되며, 지정가격, 시장가격뿐만 아니라 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 운용담당자는 제3항의 주문과 관련하여 투자대상 자산의 특성 등을 고려하여 회사에 적합한 주문방식(종목코드주문, 텍스트주문, 텍스트주문과 종목코드주문의 병행 등)을 적용하여 주문할 수 있다.

⑤ 운용담당자는 자산의 취득·처분 등의 주문이 체결되기 전에는 제1항 및 제3항의 주문서를 취소하고 새로이 작성하는 방법으로 주문을 정정할 수 있다.

⑥ 제1항 및 제5항에도 불구하고 펀드별로 매매계좌를 분리하여 매매주문이 이루어지는 경우에는 매매주문서를 작성하지 않을 수 있다.

제8조(사전자산배분의 정정) ① 회사는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행규칙 제9조 제1항에 따라 시스템 오류, 운용담당자의 주문 오류 등 불가피한 사유가 있는 경

우 취득·처분 등의 주문체결 이후에도 취득·처분 등의 주문 또는 배분 내용을 정정할 수 있으며 이 경우에도 전산으로 자산배분명세서를 기록·유지하여야 한다.

② 운용담당자는 제1항에 따라 주문 또는 배분 내용을 정정하는 경우 준법감시인의 사전 승인을 받아야 하며, 이를 입증할 수 있는 근거자료를 보관·유지하여야 한다.

제9조(콜론 및 환매조건부매매의 특례) ① 운용담당자는 투자신탁별로 콜 및 RP시장의 특성, 각 투자신탁의 운용전략 및 운용제한 등을 감안하여 콜 또는 RP거래를 할지 여부를 설정일, 거래하고자 하는 날 등 사전에 결정하여야 한다.

② 회사는 투자신탁별로 콜, RP에 대한 운용가능 자금을 합산하여 통합운용 및 거래할 수 있다.

③ 회사는 제2항의 운용결과를 투자신탁 재산별로 운용가능 자금을 기준으로 안분배분을 원칙으로 하되, 설정 1개월 내 투자신탁, 해지 예정인 투자신탁 또는 단기금융상품을 주된 투자대상자산으로 하는 투자신탁 등 유동성 확보가 필요한 경우에는 우선적으로 또는 추가로 배분할 수 있다.

제10조(당일 발행자산의 특례) ① 당일 발행자산의 특성을 감안하여, 운용담당자는 제14조제2항에도 불구하고 투자중개업자 등과 직접 정보통신수단을 통하여 예외적으로 주문을 체결할 수 있다.

② 운용담당자는 제1항에 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 15분 이내에 투자신탁별 주문내역을 자산배분시스템에 입력한다.

제11조(매매주문의 집행) ① 매매담당자는 운용담당자가 사전에 작성한 주문서를 기초로 하여 주문을 집행하여야 한다.

② 매매담당자는 매매주문에 대한 체결 및 미체결내역의 기록을 유지하여야 한다.

제4장 자산배분 및 자산배분내역서 작성

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

- ② 자산배분내역서는 체결된 종목에 대하여 체결가격, 배분가격 등을 기재하여야 한다.
- ③ 펀드별로 매매주문서와 상이한 수량으로 배분될 시에는 그 사유를 기재하여야 한다.
- ④ 제1항 및 제3항에도 불구하고 펀드별로 매매계좌를 분리하여 매매가 이루어지는 경우에는 자산배분내역서를 작성하지 않을 수 있다.

제5장 운용과 매매의 분리

제13조(운용담당자와 매매담당자간 겸직금지) ① 제2조에 정하는 자산에 대해 운용을 담당하는 직원과 직접 자산의 취득, 처분등을 실행하는 직원이 구분되도록 하여야 한다. 다만, 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행규칙 제10조제4항 단서에 따라 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 경우에는 관련법규에 따라 운용담당자와 매매 담당자를 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. 장내과생상품 거래의 경우

② 제1항에 따른 운용담당자와 매매담당자의 업무구분은 별도팀 운영 등 조직분리를 원칙으로 한다. 다만, 회사는 인력구조 등을 고려하여 불가피한 경우 운용과 매매의 조직분리가 아닌 담당자 개인별 전담업무를 분리하는 방식으로 운영할 수 있다.

③ 회사는 제2항 단서에 따라 전담업무 분리방식으로 운영하는 경우 운용담당자 또는 매매담당자 부재 시 업무대리자를 지정할 수 있으며, 이 경우 업무대리자는 지정기간 동안 본인의 본래업무를 일시적으로 중단하고 회사는 업무대리자와 대리하는 업무에 대한 기록을 유지하여야 한다.

제14조(운용담당자의 업무) ① 운용담당자는 정보통신수단을 이용하여 투자매매업자 또는 투자중개업자(이하 “투자중개업자 등”이라 한다)로부터 투자대상자산 관련정보(명칭, 가격, 수량, 시장동향 등)의 수신 및 단순 문의를 할 수 있다.

② 운용담당자는 투자대상자산의 취득·처분 등과 관련하여 투자중개업자 등과 다음 각 호의 어느 하나의 행위를 하여서는 아니 된다.

1. 투자중개업자 등을 결정하는 행위
2. 투자중개업자 등에게 매매의사를 암시하는 행위
3. 투자중개업자 등과 종목에 대한 수량·가격을 협의(운용담당자의 협의결과에 근거하여 매매담당자가 해당투자중개업자 또는 다른 투자중개업자 등과 협의과정을 거치는 경우는 제외한다)하거나 가격을 결정하는 행위

제15조(준법감시부서의 감시) 준법감시부서는 사전자산배분 관련 업무처리실태에 대해 정기적으로 점검하여야 한다.

제16조(공시) 회사는 이 기준을 제정하거나 개정하는 경우에는 회사의 인터넷홈페이지를 이용하여 공시하여야 한다.

부 칙

제1조(시행일) 이 기준은 2022년 9월 5일부터 시행한다.