

사전자산배분기준

제정: 2018. 10. 15.

제1조 (목적)

이 기준은 주식회사 스카이워크자산운용(이하 “회사”라 한다)이 투자신탁의 자산을 운용함에 있어 투자신탁재산별로 미리 정해진 자산배분내역에 따라 매매결과를 공정하게 배분함으로써 집합투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

제2조 (적용범위)

- ① 이 기준은 회사내 운용담당자 등 집합투자재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 일체의 직원에게 적용한다.
- ② 이 기준은 ‘자본시장과 금융투자업에 관한 법률’(이하 “법”이라 한다) 제80조 제1항 단서 및 법 시행령 제79조 제2항에 따라 투자대상자산을 회사의 명의로 직접 취득·처분 등을 하는 경우의 사전자산배분 관련 업무에 대하여 적용한다.

제3조 (선량한 관리자로서 책임 등)

회사는 선량한 관리자의 주의로서 집합투자재산별로 관리하여야 하며 집합투자자의 이익을 보호하여야 한다.

제4조 (용어의 정의)

이 기준에서 사용하는 용어에 관한 정의는 다음 각 호와 같다.

1. “사전자산배분”이라 함은 법 제80조 제1항 단서에 따라 투자신탁의 집합투자업자가 자신의 명의로 직접 투자대상자산을 취득·처분하는 경우에 투자신탁재산별로 미리 정하여진 자산배분명세서에 따라 취득·처분 등의 결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.
2. “투자신탁”이라 함은 법 제9조 제18항 제1호에서 규정한 집합투자기구를 말한다.
3. “운용담당자”라 함은 투자신탁재산의 운용을 담당하는 자를 말한다.
4. “매매담당자”라 함은 운용담당자로부터 매매주문을 접수하여 자산의 취득·처분의 실행을 담당하는 자를 말한다.
5. “정보통신수단”이라 함은 전화, 전자우편, 메신저 및 이와 유사한 수단으로 회사의 정보통신망을 통하여 정보 및 문서를 송·수신하는 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.

제2장 자산배분

제5조 (자산배분 원칙)

- ① 투자신탁별 자산배분은 특정 수익자 또는 특정 투자신탁에 유리하거나 불리하지 아니하여야 한다.
- ② 하나 또는 다수의 투자신탁에서 다른 시간에 매매주문을 하여 취득·처분한 자산은 주문접수시간 순서대로 운용담당자가 사전에 정한 투자신탁에 배분하여야 한다.
- ③ 다수의 투자신탁에서 동일한 자산에 대하여 동일한 시간에 동일한 주문번호로 매매주문을 하여 취득·처분한 자산은 그 다수의 투자신탁에 균등한 가격으로 배분하여야 한다.
- ④ 실제 취득·처분한 자산의 수량이 매매주문 수량에 미달하는 경우에는 운용담당자가 미리 정한 투자신탁별 주문수량을 기초로 동일한 시간에 동일한 주문번호로 주문한 다수의 투자신탁간의 수량을 안분하여 동일한 가격으로 배분하여야 한다. 다만, 운용담당자가 투자신탁별 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 (별첨 1)의 '사전자산 배분 정정신청서'를 작성하여 운용본부장과 준법감시인의 사전승인을 받아 매매주문서와 상이한 수량으로 매매결과를 배분할 수 있으며, 이 경우에는 그 사유를 기록하고 이를 증빙할 수 있는 자료를 첨부하여야 한다.
 1. 법규, 규약, 운용지침, 운용계획서, 마케팅자료 등 회사가 준수하여야 하는 모든 운용제한사항의 위반방지를 위한 수량 정정 또는 투자신탁 정정
 2. 매매체결후 예상치 못한 중대한 설정고 증감으로 인한 수량 정정 또는 투자신탁 정정
 3. 결제자금 부족, 한매자금 부족 등 이 항의 사유와 유사하거나 관련된 것으로 수량 정정 또는 투자신탁 정정이 불가피한 경우

제6조 (자산배분기준의 의결)

회사는 사전자산배분기준을 정하는 경우에는 집합투자재산 평가위원회의 의결을 거쳐야 한다.

제7조 (자산배분기준의 공시)

회사는 자산배분기준을 인터넷 홈페이지를 이용하여 공시하여야 한다.

제3장 자산배분내역에 관한 장부 및 서류

제8조 (자산배분내역에 관한 장부 및 서류)

- ① 운용담당자는 자산의 취득·매각 등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 투자대상자산에 대하여 투자신탁별로 주문금액 또는 수량, 가격 등을 기재한 매매주문서와 투자신탁별 배분내역을 기재한 자산배분명세서를 작성하여야 한다.
- ② 매매주문서 및 자산배분명세서는 전산으로 기록·유지되어야 하며 해당 운용본부장 및 준법감시인이 이행내역을 확인하여야 한다.

제4장 매매주문서의 작성 및 매매주문의 집행

제9조 (매매주문서의 작성)

- ① 운용담당자는 투자신탁별로 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 서면으로 작성할 수 있으며 전산시스템이 정상화되는 즉시 주문내역을 전산시스템에 입력하여야 한다.
- ② 운용담당자는 매매주문서상의 종목은 특정종목, 금융투자협회 채권종류별, 신용등급별 종목 등으로 지정할 수 있다.
- ③ 운용담당자는 매매주문서상의 가격주문은 해당자산의 단가 혹은 수익률 등으로 표시되거나 지정 가격, 시장가격 또는 범위를 정하여 매매담당자에게 매매가격을 일임하거나 범위를 정하지 않고 매매담당자에게 일임하여 주문할 수 있다. 이때 별도의 가격을 기재하지 않은 경우는 범위 없이 매매담당자에게 일임하여 주문한 것으로 본다.
- ④ 제1항 및 제3항에도 불구하고 주문시 투자신탁별로 주문계좌를 지정하여 다수종목에 대한 매매주문서를 작성하는 경우에는 종목, 수량만을 작성하고, 매매금액 및 가격 등을 작성하지 않을 수 있다.
- ⑤ 운용담당자는 제3항의 주문과 관련하여 투자대상자산의 특성 등을 고려하여 집합투자업별로 적합한 주문방식(종목코드주문, 텍스트주문, 텍스트주문과 종목코드주문의 병행 등)을 적용하여 주문할 수 있다.
- ⑥ 운용담당자는 자산의 취득·처분 등의 주문이 체결되기 전에는 매매주문서를 취소하고 새로이 작성하는 방법으로 주문을 정정할 수 있다.
- ⑦ 운용담당자는 정보통신수단 등을 이용하여 투자매매업자 또는 투자중개업자(이하 “투자중개업자 등”이라 한다)로부터 투자대상자산 관련 정보(명칭, 가격, 수량, 시장동향 등)의 수신 및 단순문의를 할 수 있다.
- ⑧ 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 해당 투자중개업자 또는 다른 투자중개업자 등과 협의 과정을 거치는 경우는 제외한다)하거나 가격을 결정하는 행위

제9조의 2 (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 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.

제10조 (매매주문의 집행)

① 매매담당자는 사전에 작성된 매매주문서를 기초로 하여 주문을 집행하여야 한다.

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

제5장 자산배분 및 자산배분명세서 작성

제11조 (자산배분명세서 작성)

① 매매담당자는 매매주문서와 체결내역서를 기초로 하여 자산배분명세서를 전산상에 작성하여야 한다.

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

제6장 운용과 매매의 분리

제12조 (운용담당자와 매매담당자의 겸직 금지)

① 회사는 공정한 자산배분 등 투자자의 보호를 위하여 집합투자재산의 운용담당자와 매매담당자를 구분하여야 한다.

② 제1항에도 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

제7장 기타

제13조 (준법감시부서의 점검)

준법감시담당 부서는 자산배분관련 업무처리실태에 대해 정기적으로 점검하여야 한다.

부 칙

제 1 조 (시행일)

이 기준은 금융위원회의 전문사모 집합투자업 등록일부터 효력이 있다.

(별첨 1)

자산배분 정정 신고서

일 자	
운용담당자	
운용본부장	
매매담당자	
준법감시인	
사 유	

□ 배분정정내역

투자신탁명	종목명	변경 전	변경 후	비고

※ 상세내역 첨부 가능