

TCK

SEOUL | LONDON

사전자산배분기준

토포앤코코리아자산운용 주식회사

Topor & Co. Korea

사전자산배분기준

제1장 총 칙

제1조(목적) 이 기준은 토포앤코코리아자산운용(이하 "회사")이 집합투자재산을 운용함에 있어 관련법규에 따라 직접 투자대상자산의 취득·처분 등의 업무를 수행하는 경우 집합투자재산별로 미리 정해진 자산배분명세에 따라 취득·처분 등의 결과를 공정하게 배분함으로써 투자자의 이익을 보호함을 목적으로 한다.

제2조(적용범위 및 투자대상 자산) ① 이 기준은 회사 내 운용담당자 등 집합투자재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 일체의 직원에게 적용한다.

② 이 기준은 모든 집합투자기구에 대하여 적용한다.

③ 이 기준은 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 "법"이라 한다) 제80조 제1항의 단서 및 법 시행령(이하 "영"이라 한다) 제79조 제2항에 따른 투자대상자산을 자신의 명의로 직접 취득·처분 등을 하는 경우의 사전자산배분 관련 업무에 대하여 적용한다.

④ 이 기준은 영 제99조 제2항 제4호에 따라 투자일임자산을 사전자산배분하는 경우에 준용한다.

제3조(선량한 관리자로서 책임 등) 회사는 투자자에 대하여 선량한 관리자의 주의로써 집합투자재산을 운용하여야 하여 투자자의 이익을 보호하기 위하여 해당업무를 충실하게 수행하여야 한다.

제4조(용어의 정의) 이 기준에서 사용하는 용어에 관한 정의는 다음 각 호와 같으며, 이 기준에서 정하지 아닌 한 경우에는 관련법규에서 정하는 바에 따른다.

1. "펀드"라 함은 법 제9조 제18항에서 규정하는 집합투자기구를 말한다.
2. "사전자산배분"이라 함은 법 제80조에서 규정한 펀드별로 미리 정하여진 자산배분명세에 따라 취득·처분 등의 결과를 공정하게 배분하는 것을 말한다.
3. "운용담당자"라 함은 실제 펀드를 운용하는 직원을 말한다.
4. "매매담당자(Trader)"라 함은 운용담당자로부터 취득·처분 등의 주문을 접수하여 직접 자산의 취득·처분 등을 실행하는 직원을 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.

제5조(자산배분 원칙) ① 펀드별 자산배분은 특정 수익자 또는 특정 펀드에 유리하거나 불리하지 아니하여야 한다.

② 펀드별로 취득, 처분한 자산을 균등한 가격으로 배분하여야 한다. 단, 균등한 가격은 다수의 펀드에 대해서 동시에 주문하는 경우에 한한다.

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

④ 취득, 처분한 자산의 수량이 취득·처분 등의 주문 수량에 미달하는 경우에는 미리 정한 펀드별 배분비율에 따라 자산을 배분하여야 한다. 다만 운용담당자가 펀드별 배분우선순위 또는 비율을 미리 정한 경우에는 그 우선순위 또는 비율에 따라 자산을 배분할 수 있다.

⑤ 이 조의 규정에도 불구하고 시스템 오류, 운용담당자의 주문 오류 등 불가피한 사유가 있는 경우 취득·처분 등의 주문 체결 이후에도 취득·처분 등의 주문 또는 배분내용을 정정할 수 있으며, 이 경우에도 전산으로 자산배분명세서를 기록·유지하여야 한다.

⑥ 제4항 단서 및 제5항에 의거 주문 또는 배분 내용을 정정하는 경우 이를 입증할 수 있는 근거자료를 첨부하여 준법감시인의 사전 승인을 받아야 한다.

제6조(자산배분명세에 관한 장부 및 서류) ① 운용담당자는 자산의 취득, 처분 등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 자산에 대하여 펀드별로 종목, 주문금액, 가격, 수량 등을 기재한 취득·처분 등의 주문서와 펀드별 배분내역을 기재한 자산배분명세서를 전산시스템에 작성하여야 한다.

② 취득·처분 등의 주문서 및 자산배분명세서는 전산으로 기록 유지되어야 하며 준법감시인이 이행내역을 확인하여야 한다.

③ 제1항에도 불구하고, 전산시스템의 작동 불능, 오류 등이 있는 경우에는 운용담당자는 준법감시인의 승인을 받아서 서면(전자우편을 포함한다)으로 주문내역을 작성할 수 있으며 전산시스템이 정상화되는 즉시 그 주문내역을 전산시스템에 입력하여야 한다.

④ 회사는 각 투자대상자산의 사전자산배분에 관한 전산시스템을 금융투자협회가 정한 관련 가이드라인의 내용에 부합하도록 적정하게 유지하여야 하며 그 시스템을 수정하고자 하는 경우에

는 준법감시인의 확인을 받아 수정하여야 한다.

제7조 (취득·처분 등의 주문서의 작성) ① 운용담당자는 취득·처분 등의 주문서상의 가격주문은 해당자산의 단가 혹은 수익률 등으로 표시하거나, 지정가격, 시장가격뿐만이 아니라 범위를 정하여 매매담당자에게 취득·처분 등의 가격을 일임하거나 범위 없이 매매담당자에게 일임하여 주문할 수 있다. 이때 별도의 가격을 기재하지 않은 경우는 범위 없이 매매담당자에게 일임하여 주문한 것으로 본다.

② 제6조 제1항 및 이조 제2항에도 불구하고 주문시 펀드별로 주문계좌를 지정하여 다수종목에 대한 취득·처분 등의 주문서를 작성하는 경우에는 종목, 수량만을 작성하고, 매매금액 및 가격 등을 기재하지 않을 수 있다.

③ 운용담당자는 제1항의 주문과 관련하여 투자대상자산의 특성 등을 고려하여 펀드별로 적합한 주문방식(종목코드주문, 텍스트주문, 텍스트주문과 종목코드주문의 병행 등)을 적용하여 주문할 수 있다.

④ 운용담당자는 자산의 취득·처분 등의 주문이 체결되기 전에 제3항의 주문서를 취소하고 새로이 작성하는 방법으로 주문을 정정할 수 있다.

제8조(콜론 및 환매조건부매매의 특례) ① 운용담당자는 펀드별로 콜 및 RP시장의 특성, 각 펀드의 운용전략 및 운용제한 등을 감안하여 콜 또는 RP거래를 할지 여부를 설정일, 거래하고자 하는 날 등 사전에 결정하여야 한다.

② 운용담당자 또는 매매담당자는 펀드별로 콜, RP에 대한 운용가능 자금을 합산하여 통합운용 및 거래할 수 있다.

③ 매매담당자는 제2항의 운용결과를 펀드별로 운용가능 자금을 기준으로 안분 배분을 원칙으로 하되, 설정 1개월 내 펀드, 해지 예정인 펀드 또는 MMF 등 유동성 확보가 필요한 경우에는 우선적으로 또는 추가로 배분할 수 있다.

제8조의2(당일 발행자산의 특례) ① 당일 발행자산의 특성을 감안하여, 운용담당자는 제12조 제2항에도 불구하고 투자중개업자 등과 직접 정보통신수단을 통하여 예외적으로 주문을 체결할 수 있다.

② 운용담당자는 제1항에 따라 당일 발행자산에 대한 주문체결이 확정되는 경우 정보통신수단을 이용하여 펀드별 코드 및 배분수량 등 최소한의 내용을 기재한 주문내역을 매매담당자에게 즉시 통보한다.

③ 운용담당자는 주문체결 확정시점으로부터 15분 이내에 투자신탁별 주문내역을 자산배분시스템에 입력한다. 다만, 시장상황 급변동 등으로 인해 불가피하게 입력이 곤란한 경우에는 이를

준법감시인에게 즉시 보고하고 이해상충 등이 발생하지 않도록 필요한 조치를 취하여야 한다.

제9조(취득·처분 등 주문의 집행) ① 매매담당자는 운용담당자가 사전에 작성한 취득·처분 등의 주문서를 기초로 하여 주문을 집행하여야 한다.

② 매매담당자는 취득·처분 등의 주문에 대한 체결 및 미체결 내역은 그 기록을 유지하여야 한다.

제10조(자산배분명세서의 작성) ① 매매담당자는 취득·처분 등의 주문서와 체결내역서를 기초로 하여 자산배분명세서를 전산상에 작성하여야 한다.

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

제11조(운용과 매매의 분리) ① 회사는 공정한 자산배분 등 투자자의 보호를 위하여 집합투자재산의 운용담당자와 매매담당자를 구분하여야 한다.

② 제1항에도 불구하고 동법 시행규칙 제10조 제4항 단서에서 정한 다음 각 호의 어느 하나에 해당되는 경우에는 관련 법규에 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. 한국거래소의 증권시장업무규정에서 정하는 프로그램매매에 해당하는 거래의 경우
4. 장내파생상품 거래의 경우

제12조(운용담당자의 업무) ① 운용담당자는 정보통신수단을 이용하여 투자매매업자 또는 투자중개업자(이하 "투자중개업자 등"이라 한다)로부터 투자대상자산 관련 정보(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 해당 투자중개업자 등과 협의 과정을 거치는 경우는 제외한다)하거나 가격을 결정하는 행위

제13조(준법감시인의 감시) 준법감시부서는 사전자산배분 관련 업무처리 실태에 대해 정기적으로 점검하여야 한다.

제14조(세부사항) 이 기준 시행에 필요한 양식, 서식 등 세부사항은 준법감시인이 별도로 정하여 시행할 수 있다.

부 칙

제1조(시행일) 이 기준은 2021년 9월 15일부터 시행한다.