

# 사전 자산배분기준

시그니처자산운용(주)

**제1조(목적)** 이 기준은 투자신탁의 집합투자업자(이하 “집합투자업자”라 한다)로서 회사가 투자대상자산을 직접 취득함으로써 발생할 수 있는 불공정행위 등을 사전에 예방하기 위해 필요한 기준과 절차를 정함으로써 투자자 보호에 기여함을 목적으로 한다.

**제2조(적용범위 및 투자대상자산)** ① 이 기준은 회사내 운용담당자 등 집합투자재산운용과 관련하여 직접 또는 간접적으로 관여하는 모든 임직원에게 적용한다.

② 이 기준은 「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」 제80조제1항의 단서 및 법 시행령 제79조제2항에 따라 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 방법으로 투자대상자산을 회사의 명의로 직접 취득·처분 등을 하는 경우에 적용한다.

1. 증권시장이나 해외증권시장에 상장된 증권의 매매(증권시장에 기업공개를 위하여 발행한 공모주를 포함)
2. 장내파생상품의 매매
3. 법 제83조제4항에 따른 단기대출
4. 다음 각 목의 어느 하나에 해당하는 금융기관이 발행·할인·매매·중개·인수 또는 보증하는 어음의 매매

가. 은행

나. 「한국산업은행법」에 따른 한국산업은행

다. 「중소기업은행법」에 따른 중소기업은행

라. 「한국수출입은행법」에 따른 한국수출입은행

마. 투자매매업자 또는 투자중개업자

바. 증권금융회사

사. 종합금융회사

아. 「상호저축은행법」에 따른 상호저축은행

5. 양도성 예금증서의 매매

6. 「외국환거래법」에 따른 대외지급수단의 매매거래
7. 투자위험을 회피하기 위한 장외파생상품의 매매 또는 금리나 채권가격을 기초자산으로 하는 스왑거래를 함에 있어 거래상대방과 기본계약을 체결하고 그에 따라 계속적으로 계약을 체결하는 경우
8. 그 밖에 불가피한 경우로서 금융위원회가 정하여 고시하는 경우

**제3조(선량한 관리자로서 책임)** 회사는 재산을 운용함에 있어 투자자에 대하여 선량한 관리자의주의로써 집합투자재산을 운용하여야 한다.

**제4조(용어정의)** 이 기준에서 사용하고 있는 용어의 정의는 다음 각 호와 같다. 다만, 이 기준에서 정의하지 아니한 용어는 법, 시행령, 시행규칙 및 금융투자업규정 등 관련 법령에서 정하는 바에 따른다.

1. “사전자산배분”이라 함은 법 제80조제1항 단서에 따라 회사가 집합투자업자로서 회사의명의로 직접 투자대상자산을 취득·처분하는 경우 투자신탁재산별로 미리 정하여진자산배분명세에 따라 취득·처분 등의 결과를 공정하게 배분하도록 하는 것을 말한다.
2. “운용담당자”라 함은 제2조제5항에 따라 집합투자재산의 운용을 담당하는 임직원을 말한다.
3. “매매담당자”라 함은 제2조제6항에 따라 투자대상자산의 취득·처분의 실행을 담당하는 임직원을 말한다.
4. “정보통신수단”이라 함은 전화, 전자우편, 메신저 및 이와 유사한 수단으로 회사의 정보통신망을 통하여 정보 및 문서를 송·수신하는 장치 및 컴퓨터 프로그램을 말한다.
5. “당일 발행자산”이라 함은 당일 거래시간 중에 사전예고 없이 발행여부 및 발행조건이 결정되는 채무증권, 양도성 예금증서 등을 말한다.

6. “종목코드주문” 이라 함은 운용담당자가 구체적인 종목코드를 사전자산배분 시스템에 입력하는 주문방식을 말한다.

7. “텍스트주문” 이라 함은 운용담당자가 거래대상과 조건 등을 특정하기 곤란한 경우 이를 포괄적으로 지정하는 주문방식을 말한다.

**제5조(자산배분 원칙)** ① 회사는 자산의 취득·매각 등의 업무를 수행하는 경우에는 펀드별로 미리 정하여진 자산배분명세서에 따라 매매결과를 공정하게 배분하여야 한다.

② 펀드별 자산배분은 특정투자자 또는 특정 펀드에 유리하거나 불리하지 않도록 하여야 한다.

③ 하나 또는 다수의 펀드에서 다른 시간에 매매주문을 하여 취득·처분한 자산은 주문 접수시간 순서대로 운용담당자가 사전에 정한 펀드에 배분하여야 한다.

④ 다수의 펀드에서 동일한 자산에 대하여 동일한 시간에 동일한 주문번호로 매매주문을 하여 취득·처분한 자산은 그 다수의 펀드에 균등한 가격으로 배분하여야 한다.

⑤ 실제 취득·처분한 자산의 수량이 매매주문 수량에 미달하는 경우에는 운용담당자가 미리 정한 펀드별 주문수량을 기초로 동일한 시간에 주문한 다수의 펀드 간에 수량을 안분하여 동일한 가격으로 배분하여야 한다. 다만 운용담당자가 펀드별 배분 우선순위 또는 비율을 미리 정한 경우에는 그 우선순위 또는 비율에 따라 자산을 배분하여야 한다.

⑥ 이 조의 규정에도 불구하고 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 경우에는 운용담당자는 사전자산배분 정정승인서를 작성하여 관련 운용담당자의 동의와 운용부서장 및 준법감시인의 사전 승인을 받아 매매주문서와 상이한 수량으로 매매결과를 배분할 수 있으며 이 경우에는 그 사유를 기록하고 이를 증빙할 수 있는 자료를 첨부하여야 한다.

1. 법규, 집합투자규약, 운용지침, 운용계획서, 마케팅자료 등 회사가 준수하여야 할 모든 운용제한사항의 위반방지를 위한 수량 정정 또는 펀드 정정

2. 매매체결 후 예상치 못한 중대한 설정액 증감으로 인한 수량 정정 또는 펀드

정정

3. 상기 1,2호 이외 결제자금 부족, 환매자금 부족 등 불가피한 사유로 인하여  
수량 정정 또는 펀드 정정이 불가피한 경우

**제6조(사전자산배분규정의 개정 및 공시)** ① 회사는 사전자산배분규정을 정하는 경우에는  
집합투자재산평가위원회의 의결을 거쳐야 한다. 다만, 법령 및 내규의 개정에 따른  
용어변경, 자구수정 등과 같이 실질적인 내용 변경이 없는 경우에는 준법감시인이 이를  
승인할 수 있다.

② 회사는 사전자산배분규정을 회사의 인터넷 홈페이지를 통해 공시하여야 한다.

**제7조(자산배분내역에 관한 장부 및 서류)** ① 운용담당자는 투자대상자산의 취득·처분  
등의 업무를 수행하기 전에 매매하고자 하는 투자대상자산에 대하여 투자신탁별로 종목,  
주문금액, 가격, 수량 등을 기재한 주문서와 투자신탁별로 배분내용을 기재한 자산배분  
명세서를 작성하여야 한다.

② 매매담당자는 주문서와 자산배분명세서를 전산 또는 문서로 기록·유지하여야 하며 준  
법감시인은 주문서와 자산배분명세서의 적정성과 이행내용을 확인하여야 한다.

③ 매매담당자는 각 투자대상자산의 사전자산배분에 관한 전산시스템을 이 기준의 내용  
에 부합하도록 적정하게 유지하여야 하며 그 시스템을 수정하고자 하는 경우에는 준법감  
시인의 확인을 받아 수정하여야 한다.

**제8조(주문서의 작성)** ① 운용담당자는 주문서상의 가격은 해당 자산의 단가 혹은 수익  
률 등으로 표시하거나 지정가격, 시장가격뿐만 아니라 범위를 정하여 매매담당자에게 가  
격을 일임하거나 범위를 정하지 않고 매매담당자에게 일임하여 주문할 수 있다. 이 때  
운용담당자가 별도의 가격을 기재하지 않은 경우에는 범위를 정하지 않고 매매담당자에

게 일임하여 주문한 것으로 본다.

② 운용담당자는 제1항의 주문과 관련하여 투자대상자산의 특성 등을 고려하여 집합투자업자별로 적합한 주문방식(종목코드주문, 텍스트주문, 텍스트주문과 종목코드주문의 병행 등)을 적용하여 주문할 수 있다.

③ 운용담당자는 자산의 취득·처분 등의 주문이 체결되기 전에는 제1항의 주문서를 취소하고 새로이 작성하는 방법으로 주문을 정정할 수 있다.

**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 집합투자업자는 투자신탁별로 콜, RP에 대한 운용가능 자금을 합산하여 통합운용 및 거래할 수 있다.

③ 집합투자업자는 제2항의 운용결과를 투자신탁재산별로 운용가능 자금을 기준으로 안분 배분을 원칙으로 하되, 설정 1개월 내 투자신탁, 해지 예정인 투자신탁 또는 단기금융 상품을 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 제8조 제2항에도 불구하고 투자중개업자 등과 직접 정보통신수단을 통하여 예외적으로 주문을 체결할 수 있다.

② 운용담당자는 제1항에 따라 당일 발행자산에 대한 주문체결이 확정되는 경우 정보통신단을 이용하여 투자신탁별 코드 및 배분수량 등 최소한의 내용을 기재한 주문내역을 매매당자에게 즉시 통보한다.

③ 운용담당자는 주문체결 확정시점으로부터 15분 이내에 투자신탁별 주문내역을 자산배

분시스템에 입력한다.

**제11조(매매우선 순위 및 체결내역 배분 원칙에 대한 예외)** ① 매매 우선순위 및 체결 내역 배분 기준은 심각한 증시불안요인 또는 특정종목의 유동성 부족 등으로 매매가 어려운 경우(상/하한가, 매매정지 등) 매매담당자가 담당 본부장의 승인을 득하고 위험관리부서에 통보한 후 매매 요청 건을 취합하여 매매한 후 종목별 매매평균가로 균등 배분할 수 있다.

**제12조(운용담당자와 매매담당자간 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 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. 펀드별로 계좌를 개설하고 계좌별로 이루어지는 매매거래의 경우
3. 거래소의 증권시장업무규정에서 정하는 프로그램매매에 해당하는 거래의 경우
4. 장내파생상품의 경우

## 부 칙

제1조(시행일) 이 기준은 전문사모집합투자업 등록일부터 시행한다.