

投資信託財産に係る一括発注の取り扱いについて

1. 基本的な考え方

当社では、取引の公正性の確保および最良執行を目的として、複数の運用財産について、売買条件(対象有価証券等(有価証券、有価証券に関する信用取引及びデリバティブ取引をいいます。以下「有価証券等」といいます。))の種類および銘柄、売付又は買付の別、取引種類並びに執行価格又は価格帯)が同一である売買注文を一括して発注する場合があります。

一括発注に適用する約定単価は平均単価によるものとします。平均単価は、総約定金額を総約定数量で除して計算する方法とします。

投資信託財産のための有価証券等の売買注文、投資一任契約に係る顧客資産のための有価証券等の売買注文、および関係外国運用業者のための有価証券等の売買注文を束ねて一括発注することがあります。

2. 対象有価証券等及び対象取引

投資信託財産の一括発注の対象となる有価証券等は、取引所金融商品市場、外国金融商品市場又は店頭売買金融商品市場に上場又は登録されている有価証券等とします。また、当社自己取引に係る注文との一括発注は行いません。

3. 約定結果の配分方法

一括発注を行う場合には、運用財産間の公正性を確保する観点から、予め定めた配分基準により、各運用財産への約定配分を行います。

一括発注に係る約定結果の配分は取引単位で行うものとし、配分に当たっては、各運用部の部内手順書に定める配分方法により行うものとします。

4. 最良執行の基本方針

市場の状況や価格等を総合的に勘案した上で、最良執行を図り、必要に応じて、一括発注について分割して発注することがあります。

5. 社内管理体制

一括発注および平均単価による取引の適正な履行状況を確保するため、社内規程を整備し、コンプライアンス部は当該業務執行状況の検証を行います。