

運用財産に係る一括発注について

1. 基本的な考え方

当社が運用の指図を行う複数の投資信託財産及び投資一任契約に係る顧客資産(以下「運用財産」といいます。)について、最良執行を目的として、売買条件(対象有価証券の種類及び銘柄、売付又は買付の別、取引種類ならびに執行価格又は価格帯をいいます。)が同一である売買注文であり、かつ当社社内規程に定める注文に該当する場合、その売買注文を一括して発注する場合があります(以下「一括発注」といいます。)。また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。

2. 対象有価証券

一括発注の対象となる有価証券は、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とします。

3. 約定結果の配分方法

一括発注において内出来となった場合(総約定数量が総注文数量を下回った場合)は、次式の通りに約定結果を各運用財産に配分します。さらに当該比例配分の結果、残余数量が発生した場合には、注文数量に応じて按分します。

運用財産の注文数量 $\times$ 総約定数量 $\div$ 総発注数量

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るものとし、その観点から一括発注を分割して発注する場合があります。

5. 社内管理体制

一括発注を実施するにあたっては、社内規程を整備し、管理部門が一括発注に係る業務執行体制を検証します。