

投資信託財産における一括発注について

1. 基本的な考え方

当社は、公正性を確保し、かつ、より効率的な売買執行に資するため、当社が運用を行う投資信託財産について、売買条件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。また、当社では、投資信託財産と投資一任契約に係る運用財産を一括して発注することがあります。一括発注を行なった取引については、平均単価により約定および決済することがあります。

2. 対象有価証券および対象取引

投資信託財産の一括発注の対象となる有価証券は、取引所金融商品市場または店頭売買金融商品市場に上場または登録されている株式とします。また、対象取引は現物取引とします。

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、以下の方法により、約定結果を各運用財産に配分します。

- ① 運用財産ごとに「総約定数量」×「その運用財産の注文数量」÷「総注文数量」を計算し、売買単位未満を切り捨てた数量の有価証券を各運用財産に配分する。
- ② 残余数量がある場合には、「擬似乱数生成アルゴリズム」を使用し当該一括発注を行った運用財産にランダムに最低売買単位ずつ配分する。

4. 最良執行の基本方針

市場の状況、価格、取引に係る手数料等を総合的に勘案し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、社内規程を整備し関係各署に周知徹底を図るとともに、コンプライアンスがその実施状況を事後検証します。