一括発注の基本方針

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

■ 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または投資一任契約財産（以下、「ファンド」といいます。）に係る運用において、同一の売買条件の注文の発注に際しては、ファンド間の公平性を図るため及び最良執行を目的として一括発注を行う場合があります。一括発注を行なった取引については、適用する約定単価は平均単価とします。

■ 対象有価証券および対象取引

一括発注の対象は、国内において上場されている株式とします。また、対象取引は現物取引に加え、信用取引およびデリバティブ取引を含める場合があります。

■ 約定結果の配分方法

一括発注した結果、発注数量の一部のみが出来た場合は、原則として以下の配分方法に従うものとします。

（1）約定数量 の配分

各口座への配分は以下の手順により決定します。

① 出来数量の比例配分

各口座の注文数量 × （総約定数量 ／ 総発注数量）・・・売買単位未満切捨て

② 残余数量の配分

上記① の比例配分の結果、生じた残余数量は各口座における総注文数量に対する注文割合が高い順に最低売買単位ずつ配分します。

（2）約定金額の配分

各口座の約定代金は、上記（1）によって配分された数量に平均単価を乗じて得られた金額とします。

■ 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うえで最良執行を図り、必要に応じて分割発注することがあります。

■ 社内管理体制

社内規程を整備し、管理部門が一括発注に係る業務執行状況を検証します。