

一括発注に関する基本方針について

大和アセットマネジメント株式会社

2024年10月1日

1. 基本的な考え方

当社が運用を行う複数の信託財産について、売買条件（対象有価証券の種類および銘柄、売り・買いの別、取引種類ならびに執行価格または価格帯をいいます。）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、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場合があります。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を行います。

2. 対象有価証券および対象取引

一括発注の対象は国内株式および不動産投信（いわゆるREIT）等の有価証券の現物取引とします。なお、当社が運用に関する権限を他の運用会社に委託している信託財産については、当該運用委託先において、取引所金融商品市場、外国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有価証券等を一括発注の対象としている場合があります。

3. 約定結果の配分方法

一括発注において一部出来となった場合（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、約定結果を各信託財産に配分します。

- ① 信託財産ごとに「総約定数量」×「その信託財産の注文数量」÷「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信託財産に配分します。
- ② 算出される配分数量の合計と総約定数量の差については、社内規則に従い配分を行います。

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、社内規則を整備し、コンプライアンス部門等の管理部門が一括発注に係る業務執行体制を検証します。

以上