

# 운영심사 단계 현장심사 안내

RA테스트베드 사무국

## I. 운용심사 및 시스템심사 진행 및 주요 점검사항

1. 사전심사과정 중 현장방문심사에서 점검했던 내용을 실제 운용환경에서 운용되고 있는지 최종점검
  - 1) 알고리즘의 운용가능 수준 확인
  - 2) 알고리즘과 시스템의 상용화 가능 수준 확인 : 시스템심사 대상 한정
2. 운용심사 : 자산운용 과정 및 결과 점검, 문서 및 알고리즘 보완사항 확인
3. 시스템심사 : RA 운용시 시스템의 안전성 및 보안성 점검

## II. 알고리즘 최종 버전에 대한 설명

- 알고리즘 설명서가 아닌 별도의 설명자료(ppt, 흐름도 등)를 통한 설명
  - 1. 알고리즘 설명
    - 1) 데이터 흐름 및 가공을 중심으로 알고리즘의 처리 프로세스 설명
    - 2) 알고리즘 처리 절차 설명 : 데이터 입수부터 MP산출, 리밸런싱 처리 과정 설명( \*\*상기 1)과 통합 가능)
      - 별도의 도표나 흐름도를 준비해서 설명
    - 3) 심사에 참고할 알고리즘의 특징 또는 고려사항 (생략 가능)
  - 2. 웹 또는 모바일을 통한 시연
    - 1) 투자자성향 파악에서 포트폴리오 제시, 리밸런싱까지의 전과정
    - 2) 주문집행 과정 및 결과 확인
    - 3) 운용화면 또는 상용화면 점검
      - \* 투자자성향분석, 자산배분, 포트폴리오 산출, 리밸런싱, 계좌관리
- ※ 최종 버전을 확인하고 사전심사시 점검했던 내용과 동일성 여부를 확인

## III. 운용심사 진행순서 및 준비사항

1. 제출문서 확인 : 제출문서 중 변경내용 확인
  - 1) 투자유니버스 등

※ 최종 버전을 확인하고 사전심사시 점검했던 내용과 동일성 여부를 확인
2. 리밸런싱 결과 확인 : 기제출된 리밸런싱 자료와 실제 운용현황과 대사

- 1) 투자자별, 포트폴리오 유형별 리밸런싱 결과 확인
- 2) 다계좌 운용여부 확인
3. 운용심사 점검항목 충족 여부 확인 : 자가평가점검결과서를 중심으로 확인
4. 추가 검토사항

#### IV. 시스템 운용 점검

- 제출된 문서(시스템운용 메뉴얼, 비상조치 메뉴얼, 형상관리절차서)대로 운용되는지 확인
1. 시스템 운용현황 설명 : 별도 설명 자료(그림, 흐름도, 구성도 등) 준비
    - 1) RA업무 흐름 설명 : 업무실행 순서에 따라서 진행
      - 예) "데이터 수신여부 확인 -> DB 입력 확인 -> 주문수량 계산 -> 주문"의 처리 순서대로
    - 2) 시스템 구성도 설명
      - RA업무를 수행하기 위한 시스템들의 H/W 및 N/W 구성 설명
      - \* RA업무수행을 위한 데이터 흐름을 포함하여 설명
      - 대외 시스템 연결이 있는 경우 포함하여 설명
    - 3) RA 시스템(H/W 중심) 작동 방법 설명(기동, 종료, 중단 및 재기동 등)
    - 4) RA 프로그램 작동 방법 설명
    - 5) 모니터링 체계 설명
    - 6) 시스템 접근통제와 유지보수 방안 설명
    - 7) 형상관리 체계 설명
  2. 제출/설명된 RA시스템 운용메뉴얼대로 운용을 할 수 있는지 시연
    - 시간 순서대로 메뉴얼에 의해 조작하는 과정 시연
  3. 현장에서 확인하는 서류 : 장애상황기록부, 유지보수관리대장, 전문인력 증빙서류
  4. 상기 1번에서 설명한 내용에 대한 실제 운용 확인
    - 2번 시연에서 확인된 내용은 생략 가능
  5. 상기 설명 자료에 대한 점검사항 질의 응답
    - 1) 주로 오류 등 장애시 조치 방법에 대한 내용 확인
    - 2) 1번에서 설명한 내용과 제출한 자료와의 일치 여부 확인
  6. 심사항목 충족여부 확인
    - 1) 자가평가점검결과서에 점검한 내용을 모두 충족하는지 점검