

사후운용 단계 현장심사 안내

RA테스트베드 사무국

I. 사후운용심사 점검사항

1. 운용심사 및 시스템심사 관련하여 현장방문 심사에서 점검했던 내용을 실제 운용환경에서 연속적으로 운용되고 있는지 확인
2. (사후운용)자가평가서 점검 결과 항목 중심으로 확인

II. 알고리즘 최종 버전에 대한 설명

- 운용심사 현장심사에 사용했던 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 기존에 점검했던 내용과 동일성 여부를 확인

III. 사후운용 현장 점검

1. (사후운용)자가평가서 점검 결과 항목 중심으로 확인
2. 모델포트폴리오 구성 종목의 기제출 투자유니버스 목록에 포함 여부 확인
3. 각 메뉴얼의 개정이력이 관리되고 있는지 확인
4. 현장에서 확인하는 서류 : 장애상황기록부, 유지보수관리대장, 전문인력 증빙서류