

2021년 8월 로보어드바이저 테스트베드 운영현황

2021. 9. 10, RA 테스트베드 사무국

① 기간별 수익률 Top 10 RA

3Y		(2018.9. ~ 2021.8.)			
순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	데이터앤애널리틱스 FASST KOREA [적극투자] 데이터앤애널리틱스	58.13	⑥	쿼터백 글로벌자산배분 해외상장ETF [적극투자] 쿼터백자산운용	44.10
②	W-Robo Fund Selection [적극투자] 에프앤가이드	53.11	⑦	디셈버 미국 주식 솔루션 [적극투자] 디셈버애크퍼니	43.73
③	W-Robo Fund Selection [위험중립] 에프앤가이드	51.38	⑧	W-Robo Fund Selection [안정추구] 에프앤가이드	42.33
④	W_Robo 글로벌자산배분 [적극투자] 에프앤가이드	49.38	⑨	W_Robo 글로벌자산배분 [안정추구] 에프앤가이드	41.18
⑤	키움 멀티에셋 [적극투자] 키움증권	45.56	⑩	파운트 블루웨일(펀드)1.0 [적극투자] 파운트투자자문	38.68

2Y		(2019.9. ~ 2021.8.)			
순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	관텍 가치투자 주식형 2호 [적극투자] 관텍투자자문	360.16	⑥	관텍 가치투자 주식형 2호 [안정추구] 관텍투자자문	65.94
②	관텍 가치투자 주식형 3호 [적극투자] 관텍투자자문	212.02	⑦	W-Robo Fund Selection [적극투자] 에프앤가이드	56.25
③	관텍 가치투자 주식형 2호 [위험중립] 관텍투자자문	127.52	⑧	웰스멘토밸류 [적극투자] 예스스탁	54.36
④	관텍 가치투자 주식형 1호 [적극투자] 관텍투자자문	104.47	⑨	데이터앤애널리틱스 FASST KOREA [적극투자] 데이터앤애널리틱스	51.96
⑤	관텍 가치투자 주식형 3호 [위험중립] 관텍투자자문	89.45	⑩	W-Robo Fund Selection [위험중립] 에프앤가이드	50.44

1Y		(2020.9. ~ 2021.8.)			
순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	관텍 가치투자 주식형 2호 [적극투자] 관텍투자자문	156.12	⑥	NH-관텍 국내주식형 현금여유기업 [적극투자] NH투자증권	67.65
②	관텍 가치투자 주식형 3호 [적극투자] 관텍투자자문	107.36	⑦	관텍 가치투자 주식형 2호 [위험중립] 관텍투자자문	67.27
③	관텍 국내주식형 대형1호 [적극투자] 관텍투자자문	89.87	⑧	웰스멘토밸류 [적극투자] 예스스탁	54.00
④	관텍 가치투자 주식형 1호 [적극투자] 관텍투자자문	75.58	⑨	관텍 국내주식형 대형2호 [적극투자] 관텍투자자문	53.72
⑤	스마트 베타 2호 [적극투자] shkim	73.49	⑩	관텍 가치투자 주식형 3호 [위험중립] 관텍투자자문	51.44

6M

(2021.3. ~ 2021.8.)

순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	관텍 가치투자 주식형 2호 [적극투자] 관텍투자자문	49.47	⑥	스마트 베타 2호 [위험중립] shkim	33.77
②	스마트 베타 2호 [적극투자] shkim	47.14	⑦	관텍 가치투자 주식형 1호 [적극투자] 관텍투자자문	31.58
③	관텍 가치투자 주식형 3호 [적극투자] 관텍투자자문	45.96	⑧	디셈버 미국 주식 솔루션 [적극투자] 디셈버앤컴퍼니	30.62
④	관텍 국내주식형 대형1호 [적극투자] 관텍투자자문	38.83	⑨	관텍 해외주식형 대형2호 [적극투자] 관텍투자자문	27.78
⑤	NH-관텍 국내주식형 현금여유기업 [적극투자] NH투자증권	33.87	⑩	스마트 베타 3호 [적극투자] shkim	26.06

3M

(2021.6. ~ 2021.8.)

순위	알고리즘	수익률	순위	알고리즘	수익률
①	관텍 가치투자 주식형 3호 [적극투자] 관텍투자자문	18.46	⑥	스마트 베타 1호 [적극투자] shkim	11.40
②	디셈버 미국 주식 솔루션 [적극투자] 디셈버앤컴퍼니	15.75	⑦	디셈버 미국 주식 솔루션 [위험중립] 디셈버앤컴퍼니	10.97
③	스마트 베타 2호 [적극투자] shkim	14.02	⑧	스마트 베타 2호 [위험중립] shkim	10.88
④	관텍 가치투자 주식형 2호 [적극투자] 관텍투자자문	12.45	⑨	관텍 해외주식형 대형2호 [적극투자] 관텍투자자문	10.79
⑤	하나금융 글로벌 자산배분 해외ETF 1호 [적극투자] 하나금융투자	12.05	⑩	데이터앤애널리틱스 FASST KOREA [적극투자] 데이터앤애널리틱스	10.27

② RA 운용실적 현황

□ 투자유형별 평균 수익률

- 8월 KOSPI200(벤치마크)은 전월 대비 -0.97% 소폭 하락함
- 시장이 보합수준의 조정을 거치는 동안 RA 알고리즘들의 투자유형별 8월 평균 수익률은 큰 차이가 없었음. 안정추구형의 8월 평균 수익률은 0.36%이고 적극투자형은 0.50%였음.
- KOSPI200의 1년간 수익률은 36.68%지만 6개월 수익률은 2.41%로 최근 장세가 횡보장임을 알 수 있음
- RA 알고리즘들의 1년 수익률은 벤치마크보다 낮지만 6개월 이하 기간 수익률은 벤치마크를 상회하고 있으며 기간별 수익률간의 차이는 벤치마크보다 안정적임

투자유형	직전1개월	1개월	3개월	6개월	1년
안정추구	0.54	0.36	2.09	5.21	7.92
위험중립	0.39	0.44	2.57	7.92	14.65
적극투자	0.17	0.50	3.17	13.21	27.03

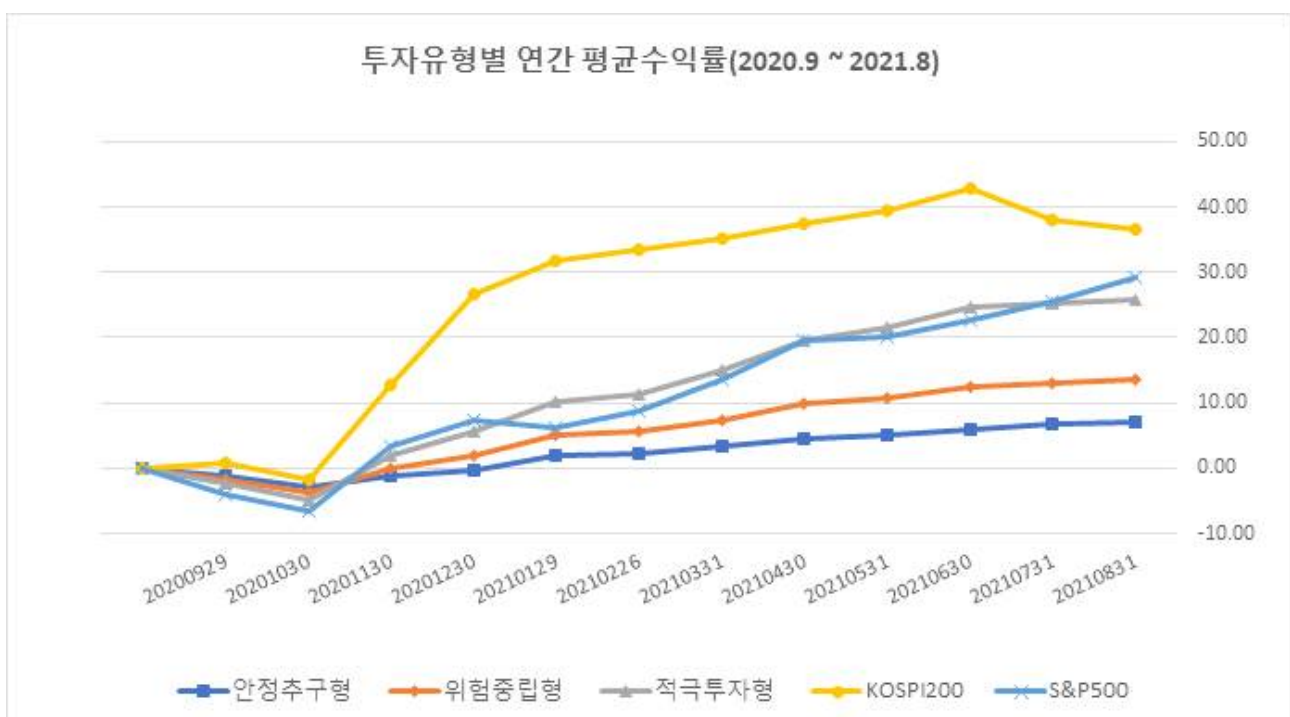
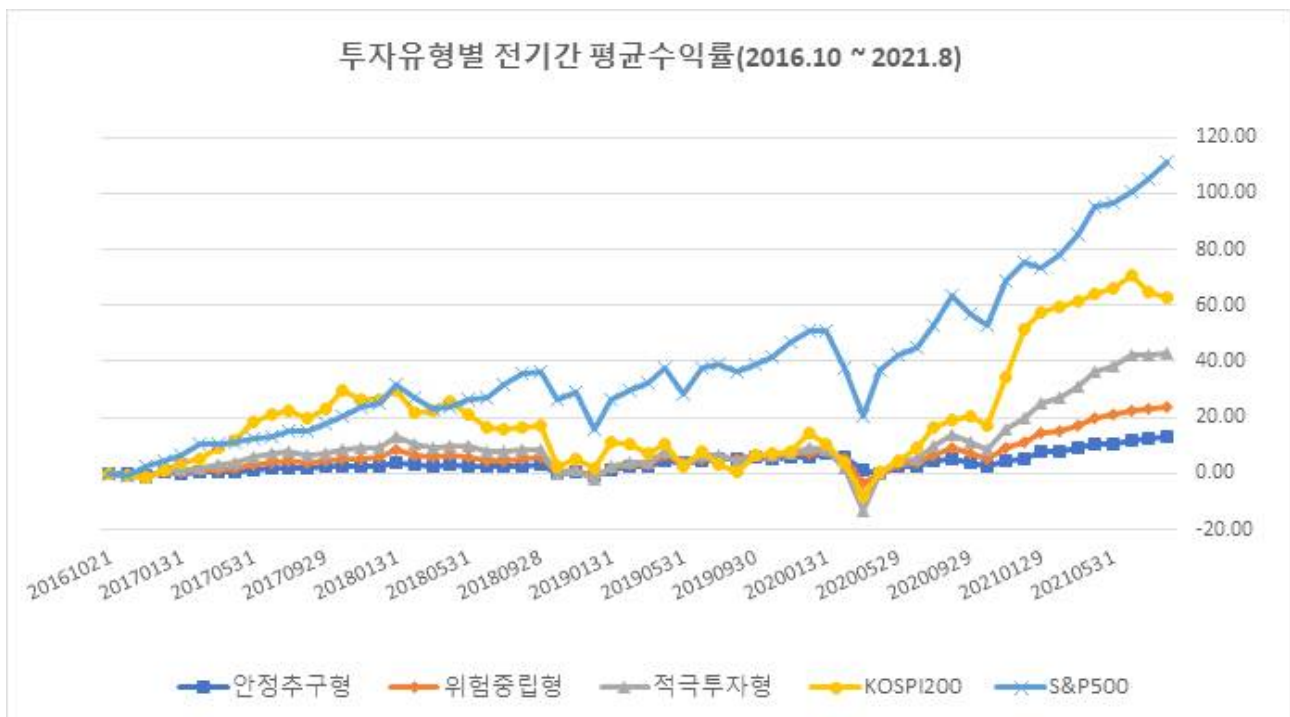
KOSPI200대비 상회하는 경우는 **적색**으로 표기, 하회하는 경우는 **청색**으로 표기

※시장 비교지표

구 분		직전1개월	1개월	3개월	6개월	1년
시장지표	KOSPI	-2.86	-0.10	-0.15	6.18	37.53
	KOSPI200	-3.40	-0.97	-1.90	2.41	36.68
	KOSDAQ	0.11	0.70	5.76	13.61	22.41

□ 투자유형별 누적수익률 추이

- KOSPI200은 지난달에 이어 연속 하락하였으나 S&P500은 여전히 상승을 이어갔으며 연간 수익률에서도 KOSPI200과 S&P500의 차이가 점점 줄어들고 있음
- 국내외 시장의 상승 기조가 유지되고 있어 적극투자형일수록 수익률이 높게 나오고 있음



□ 업종별 평균 수익률

- 업종별 8월 평균 수익률 순위는 7월과 같았으며 자산운용사가 0.63 ~ 1.37%로 가장 높았고 은행이 0.06% ~ 0.35%로 가장 저조했음
- 1년 평균 수익률은 자문일임사가 9.92 ~ 40.81%로 가장 높았으며 기술업체가 5.20 ~ 17.29%로 가장 저조했음

그룹	투자유형	직전1개월	1개월	3개월	6개월	1년
증권사	안정추구	0.55	0.36	1.93	3.95	6.73
	위험중립	0.35	0.46	2.27	5.60	12.09
	적극투자	0.05	0.47	2.39	8.39	20.15
자산운용	안정추구	1.30	0.63	3.01	4.79	6.78
	위험중립	1.54	1.18	4.38	8.77	14.92
	적극투자	1.98	1.37	5.26	12.97	23.26
자문일임	안정추구	0.71	0.43	2.57	7.03	9.92
	위험중립	0.52	0.49	3.18	10.93	18.88
	적극투자	0.27	0.74	4.71	20.45	40.81
은행	안정추구	-0.11	0.06	0.83	1.35	8.49
	위험중립	-0.41	0.20	0.91	1.40	11.95
	적극투자	-0.68	0.35	0.92	1.67	16.11
기술업체	안정추구	0.07	0.47	1.37	2.92	5.20
	위험중립	-0.02	0.48	1.49	4.34	9.59
	적극투자	-0.38	0.27	1.04	6.27	17.29

□ 자산구성별 평균 수익률

- KOSPI200이 조정애 들어간 반면 S&P500은 상승을 유지, 7월에 이어 8월에도 해외자산 투자 알고리즘이 국내자산 투자 알고리즘보다 성과가 높았음
- 1년 평균 수익률은 국내 주식포함 알고리즘이 13.52 ~ 48.93%로 가장 높았으며 해외 주식제외 알고리즘이 3.11 ~ 12.66%로 가장 저조했음. 특히 투자유형까지 고려했을 때 국내 주식포함 적극형만 48.93%로 벤치마크인 36.68%를 상회하였으며 다른 알고리즘들은 벤치마크를 넘지 못했음

자산		투자유형	직전1개월	1개월	3개월	6개월	1년
국 내	주식 포함	안정추구	-0.20	-0.36	1.03	7.50	13.52
		위험중립	-0.67	-0.75	1.31	12.35	24.65
		적극투자	-1.44	-1.43	2.16	23.35	48.93
	주식 제외	안정추구	0.17	0.46	1.35	2.77	7.10
		위험중립	0.02	0.73	1.89	4.11	11.35
		적극투자	-0.15	0.91	2.29	5.74	16.50
해 외	주식 포함	안정추구	1.92	0.86	4.66	8.49	6.48
		위험중립	1.84	1.12	4.72	12.09	13.93
		적극투자	1.85	2.12	5.52	21.43	34.59
	주식 제외	안정추구	1.44	0.87	3.77	4.83	3.11
		위험중립	1.72	1.10	4.75	6.62	8.23
		적극투자	1.94	1.29	5.28	8.38	12.66

③ 테스트베드 참여 현황

□ 알고리즘별 참여 현황

- 1~12차 테스트베드 완료
- 13~15차 테스트베드 진행 중

구 분		증권사	자산운용	자문일임	은행	기술업체	개인	합계
접수		47	14	43	11	58	31	204
심사	진행 중	3	2	9	0	9	6	29
	운용심사완료	1	4	4	2	20	6	37
	통과	42	6	23	8	5	0	84
합계		46	12	36	10	34	12	150
운용실적 공시		24	8	33	7	17	4	93

- 운용심사완료 : 포트폴리오 운용심사만 완료한 경우로 상용화를 위해서는 시스템심사가 추가로 필요한 알고리즘
- 통과 : 포트폴리오 운용심사 및 시스템심사 모두 완료한 경우로, 상용화가 가능한 알고리즘

□ 회사별 참여 현황(중복 참여 제외)

구 분	증권사	자산운용	자문일임	은행	기술업체	개인	합계
접수	14	10	15	6	37	15	97
운용심사완료 및 통과	11	7	7	6	19	3	53
운용실적 공시	9	5	8	4	12	2	40