로보어드바이저 테스트베드
제출자료 목록

- 자문일임 -

Robo Advisor
TEST BED CENTER

□ 제출자료 목록

자료 번호	자료명		문서형태	제출시기 (방법)	심사번호	비고
0	참여신청서		웹사이트 입력	참여신청시	-	
1	테스트베드 이용 약정서★		전자(화)문서	참여 신청 마감 전까지 (웹사이트 제출)	-	홈페이지에 업로드만 필요
2	법인등기사항전부증명서 사본 1부		전자(화)문서		P0-01-DE	(자문·일임업 미등록자 대상)
3	자문·일임업 등록 증빙서류		전자(화)문서		P0-01-DE	(자문·일임업 기등록자 대상) 금융투자업등록통보서 등
4	사업자등록증 사본 1부		전자(화)문서		-	
11	알고리즘 설명서★	① 알고리즘 설명	전자(화)문서		P1-01-DE P5-01-EE	적용기술, 특징, 운용목표, 주요전제, 위험도 및 위험도 측정에 관한 내용, 포트폴리오 구성 원칙 등 * 표 작성시 위험도 높은 상품이 상단에 위치하도록 작성
		② 리밸런싱 설명	전자(화)문서		P1-03-DE O1-01-EE O1-02-EE	발생원칙, 발생기준, 발생주기 등
		③ 투자자성향분석 설명 (별첨1)	전자(화)문서		P2-01-DE P2-02-DE P2-03-PE	투자자성향유형 분류기준, 유형별 특징, 투자성향별 자산구성 기준
		④ 적용기술 상세 (별첨2)	전자(화)문서		P1-01-DE	적용기술 분류 및 주요 내용 시장, 자산 등의 분석에 필요한 데이터 설명
12	투자유니버스 자료★		전자(화)문서		P1-01-DE P3-01-PE O1-01-EE O1-02-EE	알고리즘명, 자산군구분, 종목코드, 종목명 등 * 위험도 높은 자산군 순으로 작성

자료 번호	자료명		문서형태	제출시기 (방법)	심사번호	비고
13	법규준수 설명 자료★		전자(화)문서		O3-01-DE	자본시장법상 불건전 영업행위 금지조항에 저촉되지 않도록 설계되어 있음을 설명 퇴직급여 전용 알고리즘인 경우 근로자퇴직급여보장법 등에 따라 설계되어 있음을 설명
14	백테스팅 결과분석 자료★		전자(화)문서		P1-02-DE	포트폴리오 유형별로 과거 1년 이상 동안의 모의실험 결과 제출 **(RA테스트베드 미참여 유형 포함)**
15	단계별 증빙화면★	① 투자자 프로파일링	캡쳐화면		P0-02-DE	상세화면 첨부
		② 자산배분	캡쳐화면		P0-02-DE	상세화면 첨부
		③ 포트폴리오 셀렉션	캡쳐화면		P0-02-DE	상세화면 첨부
		④ 주문집행(자동)	캡쳐화면		P0-02-DE	상세화면 첨부(선택)
		⑤ 포트폴리오 리밸런싱	캡쳐화면		P0-02-DE	상세화면 첨부
16	자가평가서 점검 결과★		전자(화)문서		-	자체 점검결과 작성 제출
16-2	시스템심사 상세 체크리스트★		전자(화)문서		-	**운용심사 단독 신청 시 제출 제외**
17	주식 종목정보 변경시 처리방법★		전자(화)문서			권리락 등 발생시 처리방법이며 투자유니버스에 '주식'종목 포함된 경우에만 제출
5	계좌개설증명가능한 문서 (계좌개설확인서, 증권통장사본, 계좌별 잔고증명서 등) 9부		전자(화)문서	운용심사 1주일 전까지 (웹사이트 제출)	-	계좌별 각 1부씩. 총 9부
20	포트폴리오 운용개시 현황★		전자(화)문서	포트폴리오 운용 중 (웹사이트 제출)	-	포트폴리오 운용개시 후 2영업일 內 제출
21	리밸런싱 발생내역★		전자(화)문서		O1-01-EE O1-03-EE	매일 리밸런싱 발생시 발생사실은 매일 등록하며 자료는 1주단위로 제출 가능 * 위험도 높은 자산군 순으로 작성

자료 번호	자료명	문서형태	제출시기 (방법)	심사번호	비고
22	시스템운영매뉴얼	전자(화)문서	시스템심사 신청시 (웹사이트 제출)	S0-01-SE ~ S0-06-SE S1-01-SE ~ S1-05-SE	매뉴얼 이력관리 및 현행화, 시스템 구성도, 시스템 구동·조작방법, RA 운영순서, 변경관리, 유지보수, 접근통제 등 포함 * 컨소시움으로 참여시 관계사(금융사-기술업체) 모두 각각 자료 제출
23	비상조치매뉴얼	전자(화)문서		S0-07-SE S1-02-SE	장애유형별 대응 시나리오 및 예상 복구시간 등 포함 * 컨소시움으로 참여시 관계사(금융사-기술업체) 모두 각각 자료 제출
24	형상관리절차서	전자(화)문서		S0-08-SE S1-06-SE	형상관리 정책, 형상관리 대상, 주요 형상관리 체계, 프로그램 변경 내역 관리 등 포함 * 컨소시움으로 참여시 관계사(금융사-기술업체) 모두 각각 자료 제출
25	보안대책명세서	전자(화)문서		S2-01-DE 등	
-	장애상황기록부	참여사 관리대장	시스템심사 현장실사시	S0-03-SE	
-	유지보수 관리대장			S0-06-SE S1-04-SE	
-	보호구역 출입자명부			S2-03-SE	
-	전문인력 증빙서류			P4-01-PE S1-01-SE	자격요건 확인 및 서류상의 인력이 실제로 전자적 투자조언장치를 전담하여 운영하고 있는가를 확인
30	사후심사 자가평가서	전자(화)문서	사후 운용 (웹사이트 제출)		3, 6, 9, 12월 첫째주 제출
31	사후리밸런싱 발생내역				단, 리밸런싱 1개월 미만은 1개월 단위 제출
32	재심사대상여부 자가점검 결과서				3, 6, 9, 12월 첫째주 제출

* 별표(★) 자료는 별도양식 참조(RA공표시스템 웹사이트 '공지사항'에 RA테스트베드 진행안내)

□ **제출파일명 생성규칙 : [알고리즘명]자료번호.(자문일임)자료명_회사명_작성일자**

ex) [코스콤로보1]11.알고리즘설명서_코스콤_20250526.hwp

[코스콤로보1]11.알고리즘설명서(별첨1)_코스콤_20250526.hwp

[코스콤로보1]21.리밸런싱발생내역_코스콤_20250526.hwp

※ '제출파일명 생성규칙'을 반드시 준수할 것. 미준수시 제출파일 반려함.

□ **제출방법 : (웹사이트) '알고리즘 참여신청' 후 '심사진행현황'메뉴 → '파일첨부관리' 이용**

○ 기 제출자료 유형 등록시 기존 게시물을 수정으로 들어가서 최종파일만 등록

ex) [코스콤로보1]11.알고리즘설명서_코스콤_20250502.hwp 파일 등록 후

[코스콤로보1]11.알고리즘설명서_코스콤_20250526.hwp 으로 변경시 최종파일만 남김

○ 파일크기 10MB 초과 시 분할 압축하여 첨부

□ **유의사항**

○ 개인정보, IP 등 시스템 보안사항은 마스킹 처리 후 제출

○ 법규준수 설명자료는 알고리즘 유형 및 참여사에 따라 제출 여부가 상이함

- 일반 알고리즘 : [알고리즘명]13.법규준수설명자료_회사명_yyyymmdd.hwp (RA기술업체 제외) 제출
- 퇴직연금 알고리즘 : [알고리즘명]13.**(퇴직연금)**법규준수설명자료_회사명_yyyymmdd.hwp (전체)
  및 [알고리즘명]13.법규준수설명자료_회사명_yyyymmdd.hwp (RA기술업체 제외) 제출