
로보어드바이저 테스트베드 제출자료 목록

- 개인심사 -

□ 제출자료 목록

| 자료 번호 | 자료명 | | 문서형태 | 제출시기 (방법) | 심사번호 | 비고 |
|----------|---------------|--------------|---------|-------------------------------------|--|--|
| 0 | 참여신청서 | | 웹사이트 입력 | 참여신청서 | - | |
| 1 | 테스트베드 이용 약정서★ | | 전자(화)문서 | 참여 신청 마감 전 까지 (웹사이트 제출) | - | |
| 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 |
| | | ② 리밸런싱 설명 | 전자(화)문서 | | P1-03-DE O1-01-EE O1-02-EE | 발생원칙, 발생기준, 발생주기 등 |
| 12 | 투자유니버스 자료★ | | 전자(화)문서 | | P1-01-DE P3-01-PE O1-01-EE O1-02-EE | 알고리즘명, 자산군구분, 종목코드, 종목명 등 |
| 14 | 백테스팅 결과분석 자료★ | | 전자(화)문서 | | P1-02-DE | 과거 1년 이상 동안의 모의실험 결과 포함 |
| 15 | 단계별 증빙화면★ | ① 투자자 프로파일링 | 캡처화면 | | P0-02-DE | 상세화면 첨부(선택) |
| | | ② 자산배분 | 캡처화면 | | P0-02-DE | 상세화면 첨부 |
| | | ③ 포트폴리오 선택 | 캡처화면 | | P0-02-DE | 상세화면 첨부 |
| | | ④ 주문집행(자동) | 캡처화면 | | P0-02-DE | 상세화면 첨부(선택) |
| | | ⑤ 포트폴리오 리밸런싱 | 캡처화면 | | P0-02-DE | 상세화면 첨부 |
| 16 | 자가평가서 점검 결과★ | | 전자(화)문서 | | - | 자체 점검결과 작성 제출 |

| 자료 번호 | 자료명 | 문서형태 | 제출시기 (방법) | 심사번호 | 비고 |
|----------|--|---------|------------------------------------|----------------------|--|
| 5 | 계좌개설증명가능한 문서 (계좌개설확인서, 증권통장사본, 계좌별 잔고증명서 등) 3부 | 전자(화)문서 | 운용심사 1주일 전까지 (웹사이트 제출) | - | 계좌별 각 1부씩. 총 3부 (pdf 또는 그림파일형식으로 제출) |
| 20 | 포트폴리오 운용개시 현황★ | 전자(화)문서 | 포트폴리오 운용 중 (웹사이트 제출) | - | 포트폴리오 운용개시 후 2영업일 內 제출 20번과 21번은 같은 문서이나 제출 시기 에 따라 분리하였음. |
| 21 | 리밸런싱 발생내역★ | 전자(화)문서 | | O1-01-EE O1-03-EE | 매일 리밸런싱 발생시 발생사실은 매일 등록하며 자료는 1주단위로 제출 가능 |

* 별표(★) 자료는 별도양식 참조(웹사이트 ‘공지사항’ 게시)

□ 제출파일명 생성규칙 : [알고리즘명]자료번호.(개인)자료명_작성일자

ex) [부자아빠로보1]11.(개인)알고리즘설명서_20190608.hwp

[부자아빠로보1]11.(개인)알고리즘설명서_1_알고리즘설명_20190608.hwp

※ ‘제출파일명 생성규칙’을 반드시 준수할 것. 미준수시 제출파일 반려함.

□ 제출방법 : (웹사이트) ‘알고리즘 참여신청’ 후 ‘심사진행현황’메뉴 → ‘파일첨부관리’ 이용

* 기 제출파일 변경 등록 시 기존파일 삭제 후 변경파일 첨부

* 파일크기 10MB 초과 시 분할 압축하여 첨부