YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

7월 2주차 실적시즌 포트폴리오

신현용 Quant/ETF Analyst
02 3770 3634
hyunyong.shin@yuantakorea.com

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 포트폴리오 리밸런싱

Quant 7월호 – 체리 피킹(Cherry Picking) 리밸런싱

Ⅱ 수급

업종별

종목별

Ⅲ 컨센서스&수익률

업종별

종목별

Ⅳ 팩터 Status

성장 / 가치

주가 – 모멘텀 / 낙폭과대

수급 – 개인 / 기관 / 외국인

기타 – 리비전 / 배당 / 퀄리티

신현용

Quant/ETF Analyst

02 3770 3634

hyunyong.shin@yuantakorea.com

Quant Playbook 7월호 – 체리 피킹(Cherry Picking)

1) 과열로 인한 단기적 상승세 둔화 국면이 나타날 가능성이 높음. 해당 국면 대형주가 높은 Hit Ratio를 기록하고 있으며 FQ1 영업이익 리비전 상위 등 단기 이익 기대감 변화에 민감하게 반응하는 팩터가 KOSPI 대비 높은 성과를 기록

2) 이익 성장 둔화가 우려되는 2분기 실적시즌 동안 이익 추정치 변화에 시장은 더욱 민감하게 반응할 것이며, 대형주를 중심으로 이익 성장이 기대되는 소수 종목을 체리 피킹해야 한다는 판단

3) 대형주 중 '25년 2분기 영업이익 및 순이익 추정치 상향 조정 상위 30% 종목을 스크리닝

[7월 2주차] 대형주 중 '25년 2분기 영업이익 및 순이익 조정 상위 30% 종목

편입일	종목코드	종목명	시가총액 (억원)	'25년 2분기 영업이익 추정치		'25년 2분기 순이익 추정치		편입일 이후 누적 수익률(%)
				7/9일 기준(억원)	조정율(%)	7/9일 기준(억원)	조정율(%)	
7/1	A006800	미래에셋증권	126,040	3,751	26.9	2,797	21.8	4.2
7/1	A011200	HMM	253,697	3,712	21.3	3,464	4.9	9.5
7/4	A071050	한국금융지주	84,592	4,148	13.7	3,485	19.6	11.5
7/1	A005940	NH투자증권	70,813	2,760	11.3	2,040	11.8	11.2
7/1	A251270	넷마블	53,463	667	10.0	591	11.1	0.0
신규 편입	A042700	한미반도체	90,165	986	9.7	789	4.0	-
신규 편입	A005830	DB손해보험	94,447	6,153	6.4	4,592	5.1	-
신규 편입	A016360	삼성증권	67,600	3,202	6.1	2,381	3.3	-
7/1	A012450	한화에어로스페이스	402,018	7,182	5.6	3,593	4.1	0.9
7/1	A086790	하나금융지주	267,925	14,290	4.3	10,911	5.7	7.3
7/1	A138930	BNK금융지주	45,975	3,049	3.9	2,445	7.2	19.5
7/1	A010620	HD현대미포	74,093	795	3.7	599	3.0	-12.1
7/1	A128940	한미약품	36,063	578	3.1	386	2.4	0.1
7/4	A105560	KB금융	451,651	22,219	3.1	16,266	3.4	0.3
7/4	A207940	삼성바이오로직스	724,551	4,303	2.5	3,524	4.8	3.6
7/1	A055550	신한지주	346,098	19,647	1.7	14,389	2.7	13.4
						누적 수익률(%)	포트폴리오	4.5
							KOSPI	3.6

편출 종목

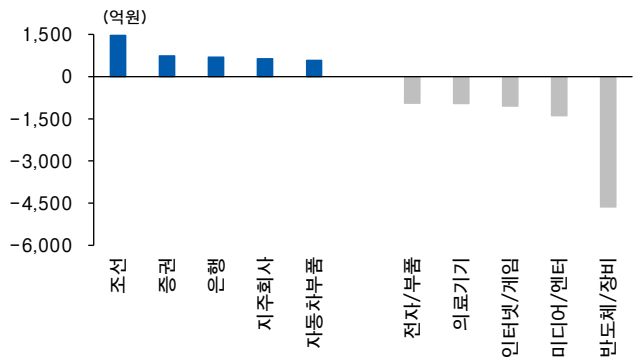
종목코드	종목명	시가총액 (억원)	'25년 2분기 영업이익 추정치			'25년 2분기 순이익 추정치			편입일	누적수익률 (%)
			5/31일 기준 (억원)	7/9일 기준 (억원)	조정율(%)	5/31일 기준 (억원)	7/9일 기준 (억원)	조정율(%)		
A329180	HD현대중공업	350,654	4,467	4,541	1.6	2,765	3,086	11.6	7/1	-6.4

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/9일 기준

주간 수급 Comment

- 이번주 은행 업종은 기관 순매수 상위에 스크리닝된 반면, 외국인 순매수 하위에 스크리닝
- 반도체/장비 업종은 기관, 외국인 순매수 하위에 동시에 스크리닝. 기관 및 외국인 합 순매수 상위는 지주회사, 제약/바이오, 조선 등

기관 주간 순매수 상/하위 업종

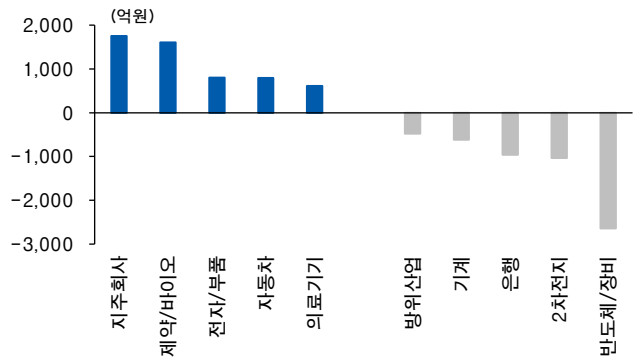


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	1,469	-492	-9,379	
2	증권	744	2,606	6,838	
3	은행	694	1,457	9,142	
4	지주회사	639	-735	4,778	
5	자동차부품	578	568	-230	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-4,635	-10,477	-2,937	
2	미디어/엔터	-1,394	-3,149	-936	
3	인터넷/게임	-1,047	2,006	1,880	
4	의료기기	-953	264	-186	
5	전자/부품	-943	-1,473	-2,614	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

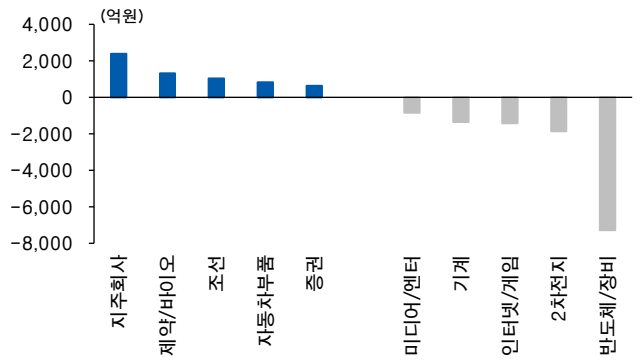


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	지주회사	1,752	2,747	1,931	
2	제약/바이오	1,610	2,409	-5,362	
3	전자/부품	804	1,489	1,799	
4	자동차	793	1,966	-2,035	
5	의료기기	614	-638	-26	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-2,643	4,139	6,360	
2	2차전지	-1,035	-589	-4,556	
3	은행	-961	391	4,392	
4	기계	-619	-10,535	5,462	
5	방위산업	-479	-2,385	994	

기관+외국인 주간 순매수 상/하위 업종



기관+외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	지주회사	2,391	2,012	6,709	
2	제약/바이오	1,317	962	-7,295	
3	조선	1,038	69	7,505	
4	자동차부품	821	1,806	807	
5	증권	638	100	2,826	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-7,277	-6,338	3,423	
2	2차전지	-1,861	-1,373	-7,911	
3	인터넷/게임	-1,420	-11,922	-9,888	
4	기계	-1,351	-18,519	-2,929	
5	미디어/엔터	-836	-37	5,970	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/10일 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A103140	풍산	비철금속	37,412	284	0.81
A010140	삼성중공업	조선	157,344	958	0.63
A145720	덴티움	의료기기	7,958	45	0.61
A079550	LIG넥스원	방위산업	130,020	569	0.47
A034230	파라다이스	호텔/레저	16,786	69	0.43
A353200	대덕전자	전자/부품	8,851	32	0.37
A005830	DB손해보험	손해보험	96,784	337	0.36
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	13,831	48	0.35
A030000	제일기획	미디어/엔터	24,964	85	0.35
A004020	현대제철	철강	44,104	156	0.34

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A007660	이수페타시스	전자/부품	42,284	623	1.49
A214450	파마리서치	의료기기	58,286	574	0.98
A006650	대한유화	화학	6,370	62	0.97
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	13,831	117	0.85
A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	16,299	105	0.66
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	7,871	52	0.65
A128940	한미약품	제약/바이오	36,639	237	0.65
A034230	파라다이스	호텔/레저	16,786	99	0.61
A139480	이마트	소매/유통	27,154	150	0.56
A010140	삼성중공업	조선	157,344	832	0.55

기관 + 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A007660	이수페타시스	전자/부품	42,284	515	1.2
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	13,831	165	1.2
A010140	삼성중공업	조선	157,344	1,790	1.2
A145720	덴티움	의료기기	7,958	78	1.0
A034230	파라다이스	호텔/레저	16,786	168	1.0
A139480	이마트	소매/유통	27,154	196	0.7
A006650	대한유화	화학	6,370	45	0.7
A009240	한샘	건자재	11,685	74	0.7
A294870	HDC현대산업개발	건설	15,752	91	0.6
A103140	풍산	비철금속	37,412	186	0.5

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A064350	현대로템	기계	211,627	742.0	-4,681	-3,728
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	2,162,167	1,237.1	-2,181	19,592
A012450	한화에어로스페이스	방위산업	403,437	208.4	-2,695	-973
A011200	HMM	해운	253,185	71.5	-1,769	-1,173
A003490	대한항공	항공	90,030	457.0	-780	-1,481
A035720	카카오	인터넷/게임	268,594	176.9	-933	3,130
A000880	한화	지주회사	70,086	261.3	-626	-652
A323410	카카오뱅크	은행	152,637	28.1	-685	-59
A016360	삼성증권	증권	69,475	109.0	-336	126
A204320	HL만도	자동차부품	16,599	65.9	-320	-707

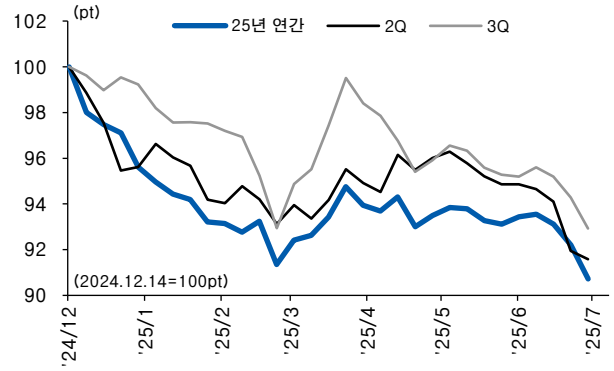
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/10일 기준

업종별 | 종목별

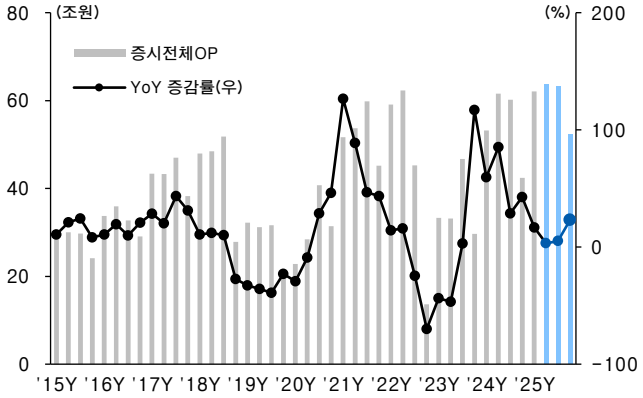
주간 컨센서스 Comment

- 2분기 실적시즌 이후 25년 연간, 2분기, 3분기 영업이익 추정치는 둔화세 지속. 지난 7/8일 삼성전자는 추정치를 크게 하회하는 잠정실적을 발표
- 이번주 기준 증권 업종이 연간(+10.5%) 및 2분기(+17.3%) 영업이익 추정치 상향 조정 상위에 동시에 스크리닝

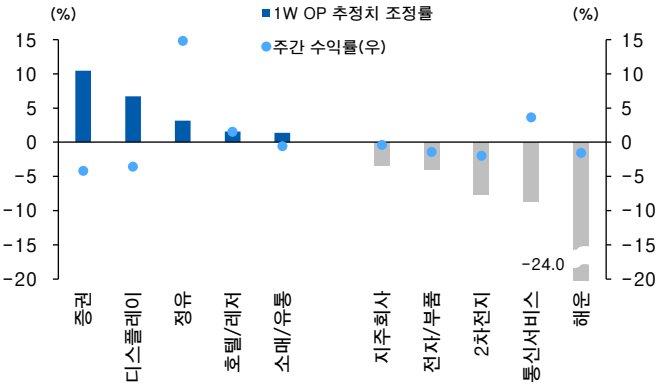
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

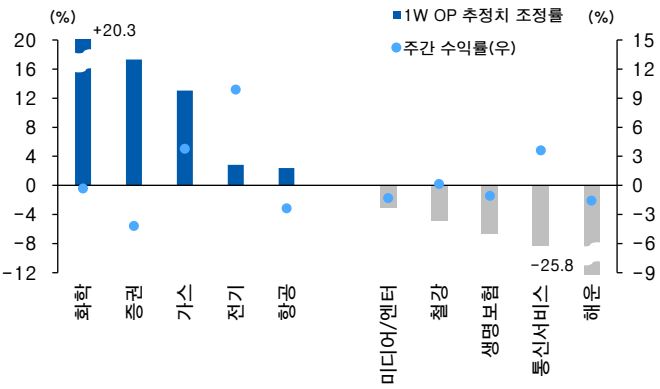


연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	증권	68,977	10.5	-4.2	
2	디스플레이	9,226	6.7	-3.6	
3	정유	5,443	3.2	14.8	
4	호텔/레저	7,771	1.6	1.5	
5	소매/유통	25,546	1.4	-0.6	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	해운	20,285	-24.0	-1.6	
2	통신서비스	50,291	-8.6	3.6	
3	2차전지	8,044	-7.7	-2.0	
4	전자/부품	45,342	-4.0	-1.4	
5	지주회사	233,118	-3.4	-0.4	

2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

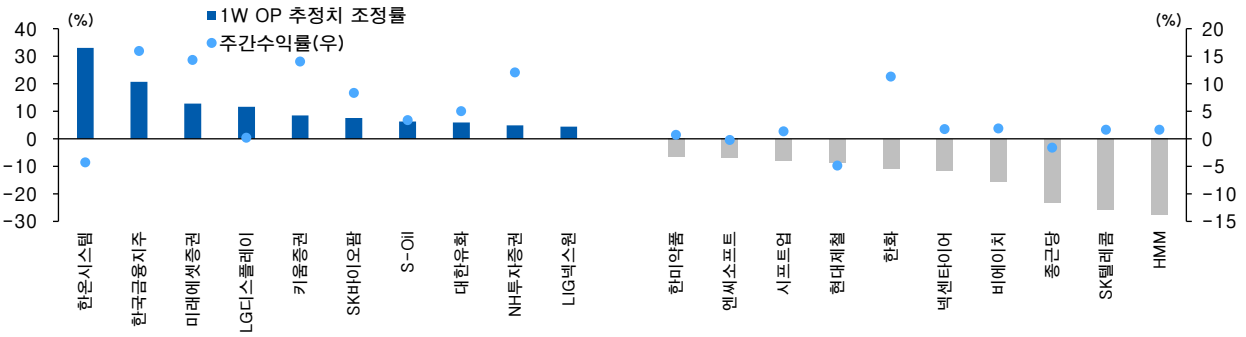
(단위:억원,%)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	화학	5,221	20.3	-0.3	
2	증권	18,908	17.3	-4.2	
3	가스	4,931	13.1	3.8	
4	전기	23,114	2.8	9.9	
5	항공	3,973	2.4	-2.4	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	해운	4,805	-25.8	-1.6	
2	통신서비스	15,418	-8.3	3.6	
3	생명보험	9,895	-6.7	-1.1	
4	철강	7,990	-4.9	0.1	
5	미디어/엔터	3,611	-3.1	-1.3	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/9일 기준

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

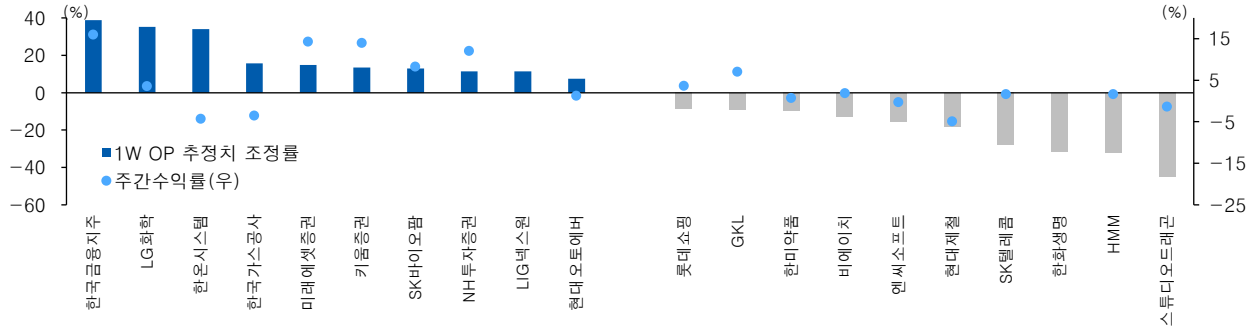


연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A018880	한온시스템	자동차부품	998	33.1	4.1	1	A128940	한미약품	제약/바이오	2,438	-6.6	-0.5
2	A071050	한국금융지주	증권	17,747	20.8	-2.5	2	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	503	-6.9	7.1
3	A006800	미래에셋증권	증권	13,940	12.8	-2.5	3	A462870	시프트업	인터넷/게임	2,003	-7.7	-6.9
4	A034220	LG디스플레이	디스플레이	5,530	11.7	-1.9	4	A004020	현대제철	철강	3,903	-8.5	-0.6
5	A039490	키움증권	증권	13,276	8.5	-4.9	5	A000880	한화	지주회사	38,473	-10.8	6.6
6	A326030	SK바이오팜	제약/바이오	1,600	7.6	0.1	6	A002350	넥센타이어	자동차부품	1,599	-11.5	-2.0
7	A010950	S-Oil	정유	2,823	6.3	6.9	7	A090460	비에이치	전자/부품	538	-15.4	-0.5
8	A006650	대한유화	화학	142	6.0	2.8	8	A185750	종근당	제약/바이오	622	-23.0	4.1
9	A005940	NH투자증권	증권	11,362	4.9	-1.5	9	A017670	SK텔레콤	통신서비스	14,126	-25.6	2.1
10	A079550	LIG넥스원	방위산업	3,913	4.4	-0.2	10	A011200	HMM	해운	16,805	-27.6	1.1

2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



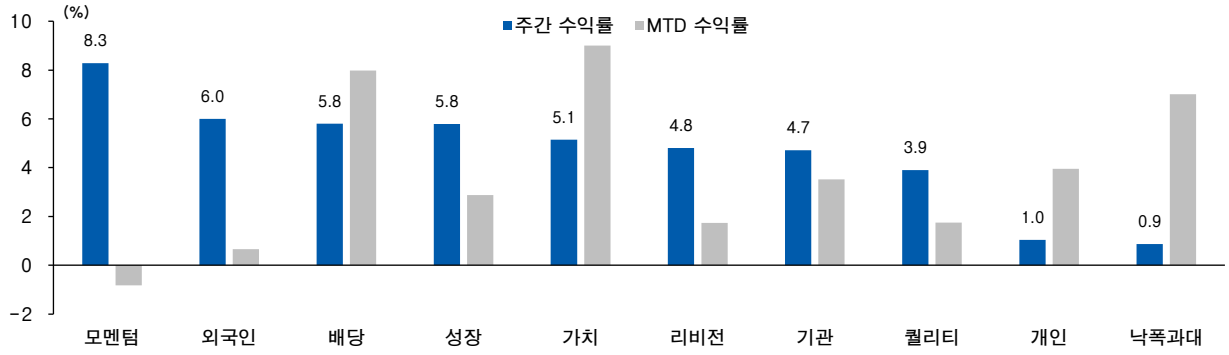
2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A071050	한국금융지주	증권	4,967	38.8	-2.5	1	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	8	-45.0	-4.7
2	A051910	LG화학	화학	3,934	35.2	11.1	2	A011200	HMM	해운	3,575	-31.8	1.1
3	A018880	한온시스템	자동차부품	209	34.0	4.1	3	A088350	한화생명	생명보험	1,580	-31.3	0.5
4	A036460	한국가스공사	가스	4,210	15.7	1.3	4	A017670	SK텔레콤	통신서비스	3,749	-28.0	2.1
5	A006800	미래에셋증권	증권	3,863	14.8	-2.5	5	A004020	현대제철	철강	857	-18.2	-0.6
6	A039490	키움증권	증권	3,617	13.5	-4.9	6	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	41	-15.4	7.1
7	A326030	SK바이오팜	제약/바이오	366	12.9	0.1	7	A090460	비에이치	전자/부품	144	-12.6	-0.5
8	A005940	NH투자증권	증권	3,220	11.4	-1.5	8	A128940	한미약품	제약/바이오	581	-9.9	-0.5
9	A079550	LIG넥스원	방위산업	884	11.4	-0.2	9	A114090	GKL	호텔/레저	154	-9.1	4.0
10	A307950	현대오토에버	SW/SI	702	7.5	-8.3	10	A023530	롯데쇼핑	소매/유통	649	-8.6	1.8

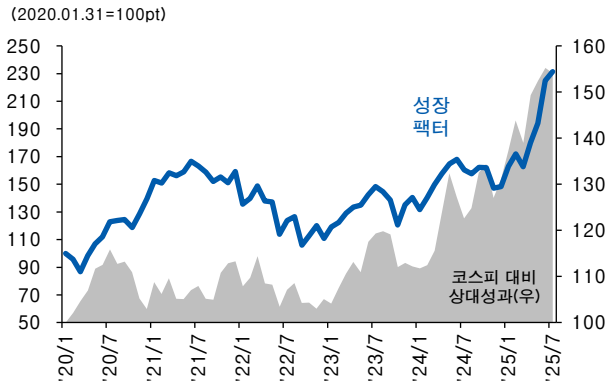
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/9일 기준

주간/MTD 팩터 수익률



성장 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.2	0.8



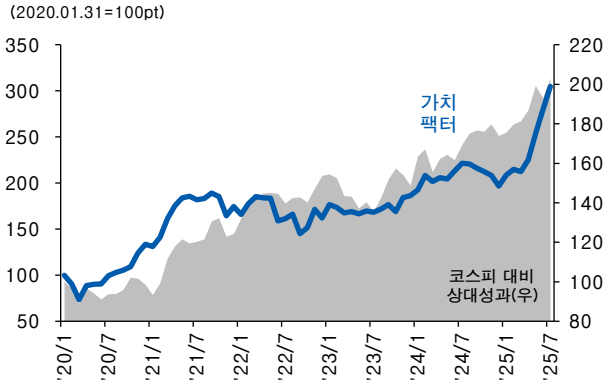
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A068270	셀트리온	9.0	8.9	8.8	26.7	0.4
A064350	현대로템	8.3	8.9	8.9	26.1	7.3
A352820	하이브	8.3	7.4	9.7	25.5	-0.3
A267260	HD현대일렉트릭	8.6	7.5	8.0	24.0	6.4
A298040	효성중공업	7.1	8.0	8.6	23.7	9.5
A145020	휴젤	8.4	7.1	7.6	23.1	-2.5
A278470	에이피알	9.7	9.0	4.1	22.8	16.1
A012450	한화에어로스페이스	9.9	8.6	4.0	22.6	9.2
A010120	LS ELECTRIC	7.5	7.0	7.9	22.4	6.0
A207940	삼성바이오로직스	8.4	5.9	6.9	21.1	4.2

가치 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
62.7	1.0



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

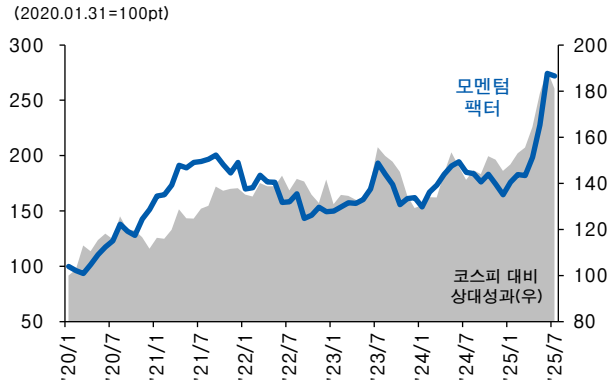
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.6	29.5	-1.9
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	27.1
A088350	한화생명	9.8	9.8	9.9	29.4	29.0
A036460	한국가스공사	9.7	9.5	9.8	29.1	-3.2
A001450	현대해상	9.9	8.5	9.8	28.1	2.8
A001120	LX인터내셔널	9.3	8.9	9.9	28.1	4.1
A139480	이마트	8.1	9.8	9.9	27.8	8.3
A002350	넥센타이어	9.5	9.6	8.6	27.7	1.8
A023530	롯데쇼핑	8.3	10.0	9.2	27.5	3.7
A139130	iM금융지주	8.7	9.5	9.1	27.2	13.1

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 7/10일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

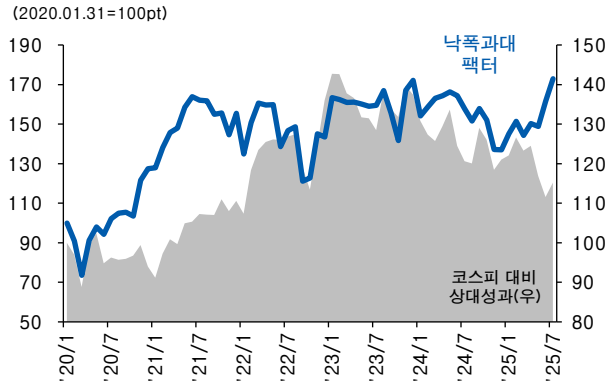
모멘텀 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
50.7	1.0



낙폭과대 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
47.8	0.3



모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A034020	두산에너빌리티	9.9	10.0	9.9	9.8	39.6	5.4
A006800	미래에셋증권	9.3	9.8	9.7	9.7	38.4	13.8
A064350	현대로템	9.1	9.4	10.0	10.0	38.4	7.3
A103140	풍산	10.0	9.6	9.6	9.2	38.3	15.6
A298040	효성중공업	9.7	9.5	9.4	9.5	38.1	9.5
A032350	롯데관광개발	9.7	9.7	9.5	8.9	37.8	2.9
A000880	한화	8.0	9.9	9.9	9.9	37.6	11.0
A278470	에이피알	9.0	9.6	9.8	9.0	37.3	16.1
A272210	한화시스템	8.4	9.2	9.6	9.7	36.8	8.1
A079550	LIG넥스원	8.2	9.7	9.5	9.5	36.8	19.2

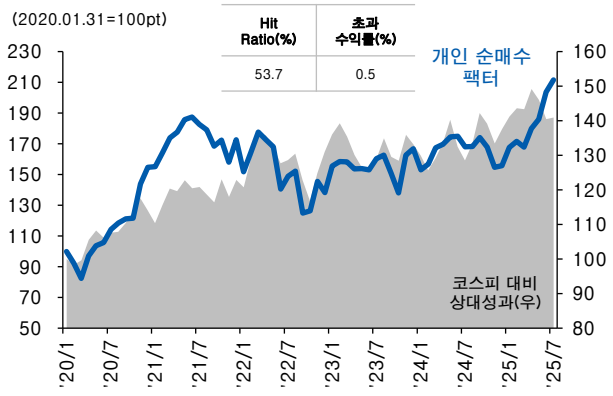
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A066970	엘앤에프	10.0	10.0	10.0	9.9	39.8	-2.4
A105630	한세실업	9.5	9.1	9.7	9.6	37.8	1.9
A009420	한올바이오파마	9.6	9.6	9.9	7.9	36.9	5.9
A090460	비에이치	8.0	9.5	9.8	9.7	36.9	1.9
A005070	코스모신소재	7.2	9.8	9.9	10.0	36.7	-5.7
A204320	HL만도	8.9	9.8	9.5	8.4	36.6	4.1
A006400	삼성SDI	7.5	9.3	9.7	9.8	36.3	-6.1
A011170	롯데케미칼	8.7	9.5	8.2	9.6	36.0	-1.9
A020150	롯데에너지머티	8.3	9.0	8.7	9.9	35.8	0.1
A018880	한온시스템	7.4	9.7	9.6	8.9	35.5	-4.3

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 7/10일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

개인 순매수 팩터 성과 추이

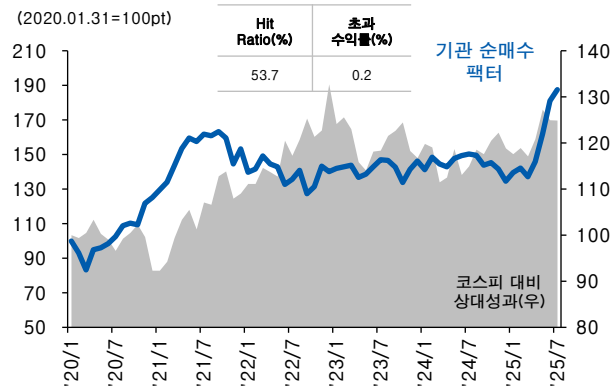


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A090460	비에이치	9.9	9.9	10.0	10.0	39.7	1.9
A105630	한세실업	9.7	9.7	9.8	9.9	39.0	1.9
A005070	코스모신소재	9.8	9.4	9.9	9.8	38.8	-5.7
A066970	엘앤에프	9.5	9.5	9.9	9.8	38.5	-2.4
A006400	삼성SDI	9.1	9.6	9.8	9.9	38.4	-6.1
A011070	LG이노텍	9.3	9.4	9.6	9.5	37.8	3.8
A181710	NHN	10.0	9.6	8.9	8.5	36.9	4.0
A097950	CJ제일제당	7.4	9.8	9.7	9.7	36.5	-1.3
A204320	HL만도	9.9	9.9	9.7	7.1	36.5	4.1
A004370	농심	9.7	9.2	8.7	8.7	36.2	1.1

기관 순매수 팩터 성과 추이

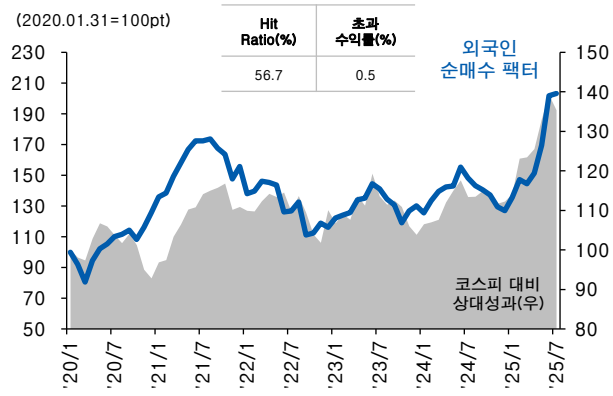


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A122870	와이지엔터	9.3	9.7	9.8	9.9	38.7	2.9
A001430	세아베스틸지주	9.9	9.8	9.3	9.7	38.6	1.9
A032350	롯데관광개발	9.5	9.9	9.7	9.4	38.4	2.9
A071050	한국금융지주	9.1	9.5	9.5	9.6	37.6	15.1
A004170	신세계	8.0	9.9	9.8	9.8	37.5	0.1
A039130	하나투어	9.9	9.4	8.8	8.9	36.9	4.6
A042670	HD현대인프라	9.2	8.9	9.4	9.2	36.6	4.1
A375500	DL이앤씨	8.7	9.6	8.5	9.0	35.8	-0.9
A282330	BGF리테일	8.3	8.5	9.0	9.3	35.1	2.2
A006800	미래에셋증권	9.2	8.8	8.4	8.1	34.4	13.8

외국인 순매수 팩터 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

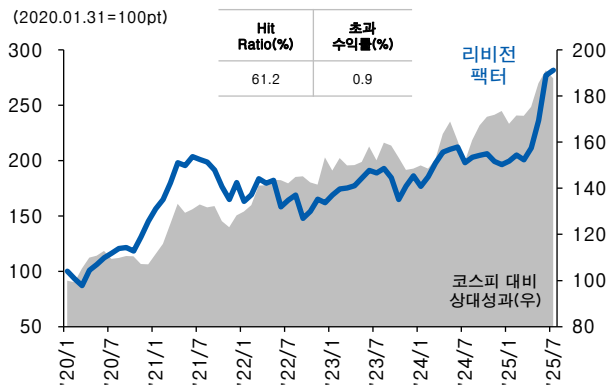
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A041510	에스엠	9.6	10.0	10.0	10.0	39.5	2.6
A161890	한국콜마	9.7	9.8	9.6	9.9	38.9	13.5
A139480	이마트	9.9	9.7	9.7	9.5	38.7	8.3
A278470	에이피알	9.1	9.8	9.9	9.9	38.7	16.1
A032350	롯데관광개발	9.9	9.7	9.0	9.1	37.7	2.9
A114090	GKL	9.4	9.6	9.6	9.7	38.1	6.9
A010620	HD현대미포	9.8	9.9	9.4	8.8	37.8	7.7
A078340	컴투스	9.2	9.3	9.8	9.6	37.9	3.0
A052690	한전기술	9.7	9.2	9.1	9.1	36.9	2.5
A003230	삼양식품	8.7	9.6	9.8	9.6	37.6	17.0

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 7/10일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

리비전 팩터 성과 추이

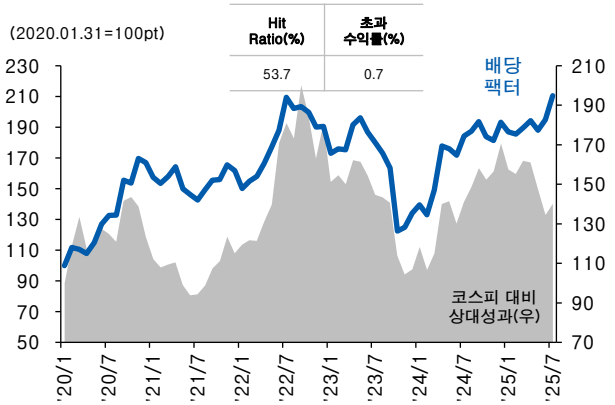


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.7	9.9	9.4	29.0	1.7
A251270	넷마블	8.5	9.6	9.7	27.7	1.0
A278470	에이피알	9.3	8.9	8.3	26.5	16.1
A103140	풍산	8.2	9.0	8.5	25.6	15.6
A058470	리노공업	9.0	8.7	7.9	25.6	-0.5
A257720	실리콘투	8.4	9.3	7.6	25.3	9.3
A014680	한솔케미칼	8.6	7.9	8.3	24.8	3.1
A008770	호텔신라	8.5	6.6	9.7	24.8	-1.9
A214450	파마리서치	8.5	7.9	8.0	24.4	14.2
A353200	대덕전자	8.4	9.0	6.8	24.2	0.4

배당 팩터 성과 추이

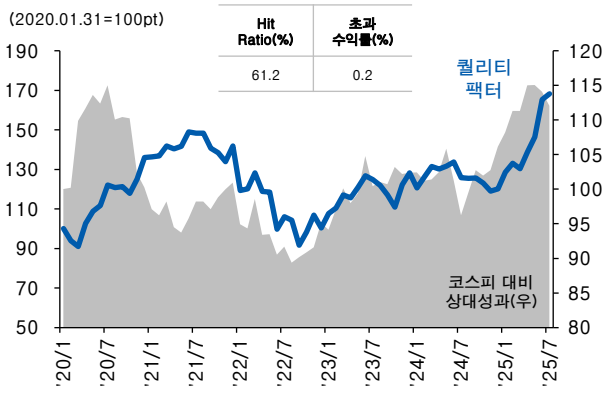


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A017670	SK텔레콤	8.9	9.7	9.4	9.9	37.8	1.7
A030000	제일기획	8.8	9.5	9.1	9.8	37.2	5.8
A005940	NH투자증권	8.0	9.4	9.9	9.3	36.7	11.6
A030200	KT	9.7	8.9	9.0	8.7	36.3	-2.6
A001120	LX인터내셔널	7.6	9.5	9.3	9.9	36.3	4.1
A024110	기업은행	6.5	9.9	9.9	9.8	36.1	6.8
A032640	LG유플러스	9.2	9.2	8.8	8.8	36.0	2.1
A001430	세아베스틸지주	9.9	8.6	8.9	8.2	35.5	1.9
A078930	GS	7.9	9.3	9.2	9.5	35.9	8.7
A033780	KT&G	8.2	9.1	9.3	8.8	35.4	4.7

퀄리티 팩터 성과 추이



자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티스 코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	4.0	9.9	9.7	9.3	32.9	-4.3
A058470	리노공업	4.8	9.7	9.6	8.8	32.9	-0.5
A145020	휴젤	4.8	9.6	9.4	8.5	32.4	-2.5
A259960	크래프톤	4.6	9.7	9.8	8.2	32.4	-1.8
A042700	한미반도체	3.8	9.8	9.4	9.4	32.3	3.4
A214150	클래시스	3.7	9.8	9.6	9.2	32.3	-1.6
A192080	더블유게임즈	4.9	9.5	9.3	7.5	31.2	7.0
A000660	SK하이닉스	2.3	9.5	9.5	9.6	31.0	9.6
A214450	파마리서치	2.7	9.5	9.2	8.8	30.2	14.2
A140860	파크시스템스	2.6	9.1	9.1	9.3	30.1	5.8

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 7/10일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

- 이 자료에 게재된 내용들은 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인함. (작성자:신현용)
- 당사는 동 자료를 전문투자자 및 제 3 자에게 사전 제공한 사실이 없습니다.

본 자료는 투자자의 투자를 권유할 목적으로 작성된 것이 아니라, 투자자의 투자판단에 참고가 되는 정보제공을 목적으로 작성된 참고자료입니다. 본 자료는 금융투자분석사가 신뢰할만 하다고 판단되는 자료와 정보에 의거하여 만들어진 것이지만, 당사와 금융투자분석사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없습니다. 따라서, 본 자료를 참고한 투자자의 투자의사결정은 전적으로 투자자 자신의 판단과 책임하에 이루어져야 하며, 당사는 본 자료의 내용에 의거하여 행해진 일체의 투자행위 결과에 대하여 어떠한 책임도 지지 않습니다. 또한, 본 자료는 당사 투자자에게만 제공되는 자료로 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제 전송 인용 배포하는 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)