YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

8월 4주차 첨단산업 국민펀드 리밸런싱

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

유안타증권 Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 포트폴리오 리밸런싱

첨단산업 국민펀드 포트폴리오 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

첨단산업 국민펀드: ABCDEF 포트폴리오 (참고 자료: 5천P 가는 길: 국민펀드 ABCDEF + G)

1) 대선 당시 이재명 대통령은 AI 등 첨단전략산업 지원을 위한 100조원 "첨단산업 국민펀드" 조성을 강조. AI 기술은 특정 산업에 국한되지 않고 다양한 산업에 포진해 있다는 점에서 산업을 특정하기 위해 경기 부양책 중 하나인 "ABCDEF 첨단기업 육성" 정책을 참고. 각 산업(AI(A), 바이오(B), 컨텐츠(C), 방위산업(D), 에너지(E), 제조업(F))에 속하는 대표 종목 90개로 구성된 ABCDEF 지수를 구성

2) BBIG의 전례를 참고, 산업 모멘텀 위축 국면 리비전 스코어(연간 및 분기 영업이익 추정치 스코어) 상위 종목의 모멘텀은 장기화되는 것으로 확인

3) "ABCDEF 액티브 전략"으로 지수에 편입된 90개 종목 중 리비전 스코어 상위 20% 종목을 스크리닝

[8월 4주차] ABCDEF 지수에 속한 90개 종목 중 '25년 3분기 및 '25년 연간 영업이익 추정치 조정 상위 20% 스크리닝

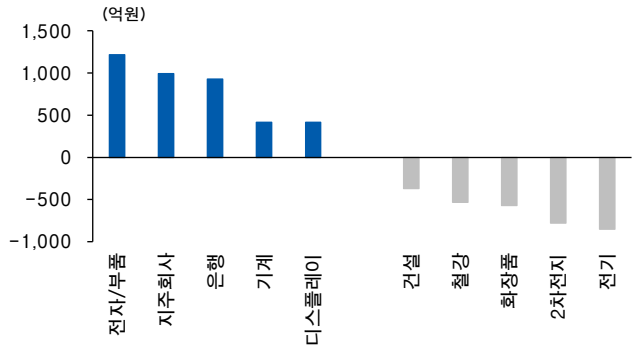
산업	종목코드	종목명	시가총액 (억원)	'25년 3분기 영업이익 추정치			'25년 연간 영업이익 추정치		
				7/31일 기준 (억원)	8/27일 기준 (억원)	조정율 (%)	7/31일 기준 (억원)	8/27일 기준 (억원)	조정율 (%)
A	A039030	이오테크닉스	26,179	183	203	10.9	655	748	14.1
	A000990	DB하이텍	20,490	702	768	9.5	2,664	2,782	4.4
	A240810	원익IPS	20,223	305	313	2.6	753	896	19.0
C	A035720	카카오	283,402	1,434	1,620	13.0	5,387	6,381	18.5
	A251270	넷마블	53,119	713	815	14.3	3,018	3,391	12.4
	A041510	에스엠	32,968	450	492	9.4	1,626	1,710	5.1
	A122870	와이지엔터테인먼트	19,345	271	291	7.5	677	749	10.6
D	A012450	한화에어로스페이스	467,680	8,060	8,958	11.1	31,755	35,261	11.0
	A064350	현대로템	198,639	2,482	2,563	3.3	9,674	10,069	4.1
E	A247540	에코프로비엠	127,533	169	450	166.5	486	1,056	117.5
	A062040	산일전기	35,195	453	474	4.6	1,734	1,789	3.1
F	A012510	더존비즈온	23,456	237	245	3.6	1,013	1,032	1.9

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -5,392억원 순매도, 기관은 약 +381억원 순매수
- 외국인은 최근 2주간 약 -1.7조원 수준의 순매도를 기록하며 월 초 이후 누적 유입액(+1.9조원)의 상당부분을 재차 순매도. 8월 한달간 외국인의 주간 유입세가 지속된 업종은 전자/부품, 자동차부품, 철강 등

기관 주간 순매수 상/하위 업종

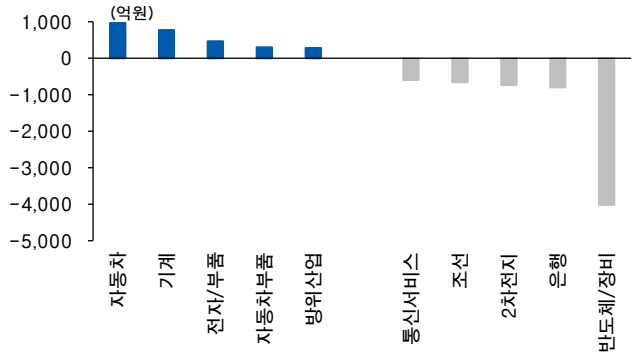


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	1,217	2,450	37	
2	지주회사	991	-1,743	-3,697	
3	은행	927	2,965	4,712	
4	기계	416	959	-6,907	
5	디스플레이	416	247	-39	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전기	-853	485	2,525	
2	2차전지	-779	3,467	9,546	
3	화장품	-573	-1,783	-8,260	
4	철강	-532	-1,550	2,740	
5	건설	-371	-777	-3,530	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

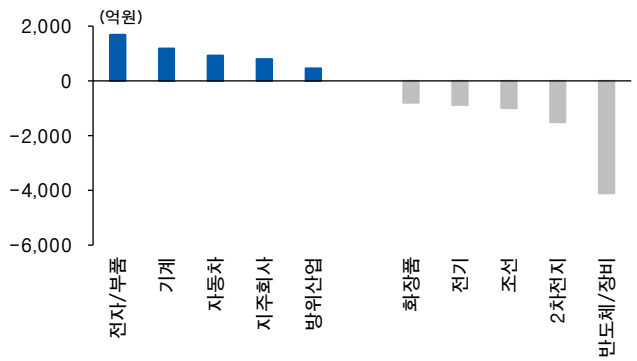


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	자동차	973	1,926	8,583	
2	기계	773	-693	-3,015	
3	전자/부품	471	4,045	7,822	
4	자동차부품	304	1,219	3,084	
5	방위산업	281	-1,690	1,073	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-4,019	-2,132	42,979	
2	은행	-798	-2,508	-1,809	
3	2차전지	-732	-1,923	-4,471	
4	조선	-652	1,630	10,585	
5	통신서비스	-594	-743	-1,209	

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	전자/부품	1,688	6,495	7,858	
2	기계	1,189	267	-9,922	
3	자동차	930	933	8,968	
4	지주회사	797	149	5,252	
5	방위산업	457	-2,619	1,551	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-4,100	-4,736	21,410	
2	2차전지	-1,511	1,544	5,075	
3	조선	-994	2,777	12,366	
4	전기	-873	1,887	5,345	
5	화장품	-788	-4,403	-7,101	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 8/28일 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A090460	비에이치	전자/부품	6,414	191	3.13
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	12,031	307	2.62
A006650	대한유화	화학	8,028	102	1.29
A007660	이수페타시스	전자/부품	47,936	415	0.88
A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	18,953	161	0.83
A353200	대덕전자	전자/부품	11,811	96	0.83
A004370	농심	음식료	25,091	147	0.60
A012510	더존비즈온	SW/SI	23,942	122	0.54
A128940	한미약품	제약/바이오	38,881	169	0.44
A009540	HD한국조선해양	조선	289,108	1,112	0.42

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A248070	솔루엠	전자/부품	7,780	88	1.17
A007660	이수페타시스	전자/부품	47,936	386	0.82
A240810	원익IPS	반도체/장비	20,002	158	0.78
A004020	현대제철	철강	42,636	321	0.74
A041510	에스엠	미디어/엔터	31,892	211	0.64
A010620	HD현대미포	조선	80,883	482	0.61
A006650	대한유화	화학	8,028	43	0.54
A010140	삼성중공업	조선	188,320	929	0.50
A058470	리노공업	반도체/장비	35,972	163	0.45
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	12,952	55	0.43

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A090460	비에이치	전자/부품	6,414	204	3.3
A006650	대한유화	화학	8,028	146	1.8
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	12,031	210	1.8
A007660	이수페타시스	전자/부품	47,936	801	1.7
A004370	농심	음식료	25,091	217	0.9
A353200	대덕전자	전자/부품	11,811	93	0.8
A248070	솔루엠	전자/부품	7,780	58	0.8
A128940	한미약품	제약/바이오	38,881	253	0.7
A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	18,953	127	0.7
A047810	한국항공우주	방위산업	93,869	516	0.6

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A012450	한화에어로	방위산업	468,196	754.1	-533	2,624
A192820	코스맥스	화장품	24,855	39.2	-936	-1,358
A064350	현대로템	기계	204,969	651.6	-321	-3,233
A034020	두산에너빌리티	기계	402,913	164.8	-577	-11,968
A047810	한국항공우주	방위산업	93,869	515.9	-190	887
A047050	포스코인터내셔널	상사	86,202	94.9	-584	-675
A000270	기아	자동차	416,235	148.4	-316	5,071
A069620	대웅제약	제약/바이오	15,932	15.8	-431	-245
A011780	금호석유화학	화학	29,211	5.6	-424	-364
A103140	풍산	비철금속	33,405	54.9	-300	714

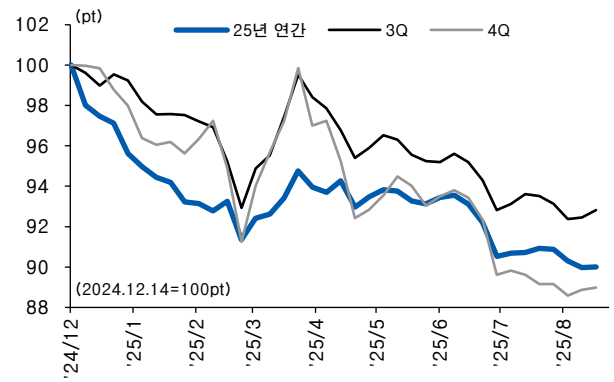
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 8/28일 기준

업종별 | 종목별

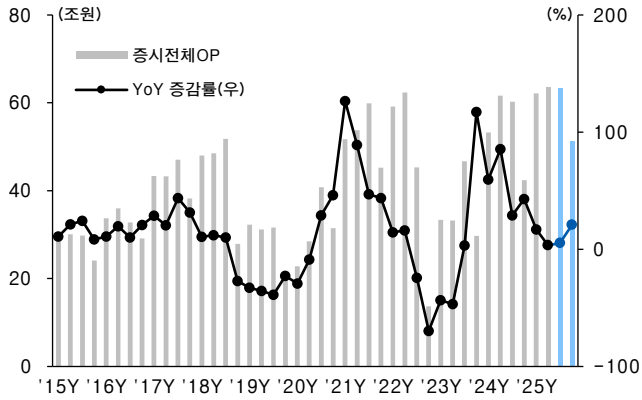
주간 컨센서스 Comment

- '25년 2분기 부진한 달성률 기록되며 이익 트렌드 하향조정 지속. '25년 연간 영업이익 추정치는 한달간 약 -0.8% 하향 조정(3Q -0.8%, 4Q -0.7%)
- 정부의 NCC 설비 25% 감축 유도 소식에 따른 이익 개선 기대감에 정유 업종 주간 컨센서스 조정률 상위에 스크리닝. 특히 하반기 흑자전환 기대감이 형성된 대한유화가 높은 조정률을 기록

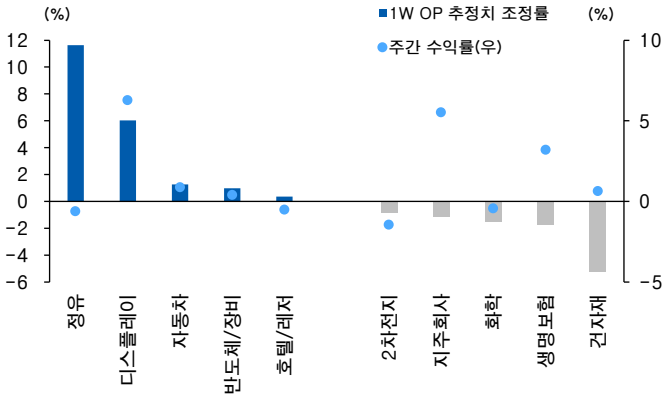
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

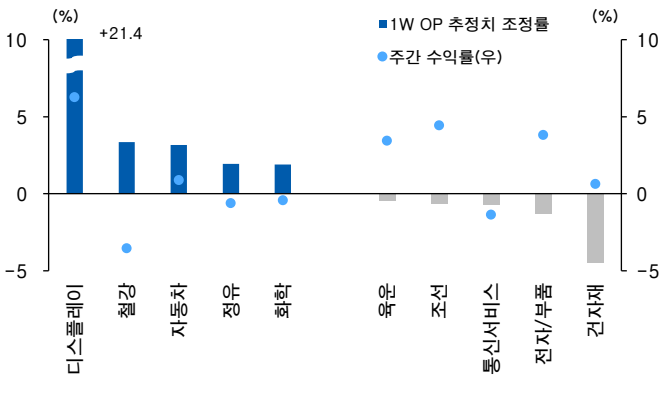


연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	정유	1,728	11.6	-0.6	
2	디스플레이	10,721	6.0	6.3	
3	자동차	238,440	1.3	0.9	
4	반도체/장비	673,980	1.0	0.4	
5	호텔/레저	7,731	0.4	-0.5	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	건자재	722	-5.2	0.6	
2	생명보험	34,544	-1.7	3.2	
3	화학	21,667	-1.5	-0.4	
4	지주회사	223,848	-1.1	5.5	
5	2차전지	2,605	-0.9	-1.5	

3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

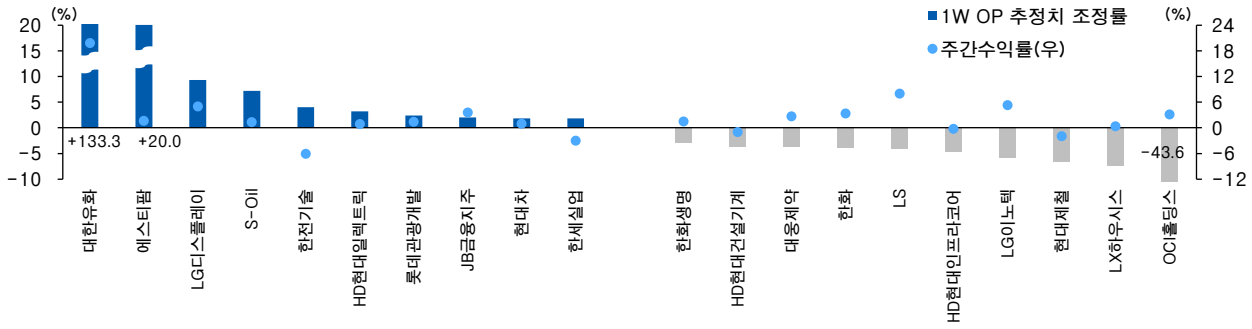
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 순매수 추이
1	디스플레이	4,760	21.4	6.3	
2	철강	8,891	3.3	-3.5	
3	자동차	53,929	3.2	0.9	
4	정유	4,475	1.9	-0.6	
5	화학	4,589	1.9	-0.4	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 순매수 추이**
1	건자재	219	-4.5	0.6	
2	전자/부품	11,119	-1.3	3.8	
3	통신서비스	8,539	-0.7	-1.4	
4	조선	20,821	-0.6	4.4	
5	육운	6,639	-0.4	3.4	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 8/27일 기준 추정치 (수익률 8/28일 기준)

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



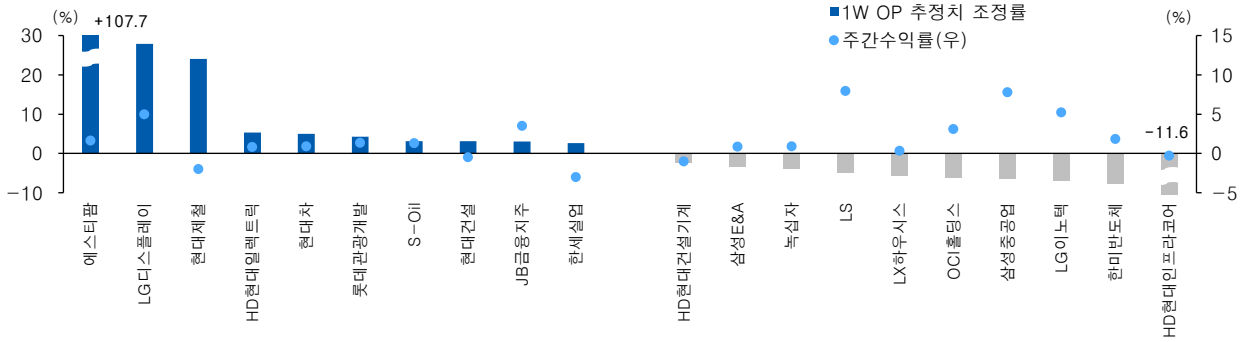
연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006650	대한유화	화학	140	133.3	19.8
2	A237690	에스티팜	제약/바이오	585	20.0	1.6
3	A034220	LG디스플레이	디스플레이	7,170	9.3	5.0
4	A010950	S-Oil	정유	2,691	7.2	1.3
5	A052690	한전기술	전기	363	4.0	-6.1
6	A267260	HD현대일렉	기계	9,485	3.2	0.8
7	A032350	롯데관광개발	호텔/레저	1,170	2.4	1.4
8	A175330	JB금융지주	은행	9,455	2.0	3.5
9	A005380	현대차	자동차	130,590	1.9	0.9
10	A105630	한세실업	섬유/의복	623	1.8	-3.0

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A010060	OCI홀딩스	화학	531	-43.6	3.1
2	A108670	LX하우시스	건자재	498	-7.4	0.4
3	A004020	현대제철	철강	3,683	-6.6	-2.0
4	A011070	LG이노텍	전자/부품	5,452	-5.8	5.2
5	A042670	HD현대인프라	기계	3,217	-4.6	-0.3
6	A006260	LS	지주회사	11,047	-4.1	8.0
7	A000880	한화	지주회사	43,310	-4.0	3.3
8	A069620	대웅제약	제약/바이오	1,958	-3.7	2.6
9	A267270	HD현대건설	기계	1,570	-3.7	-1.0
10	A088350	한화생명	생명보험	6,850	-2.9	1.5

3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

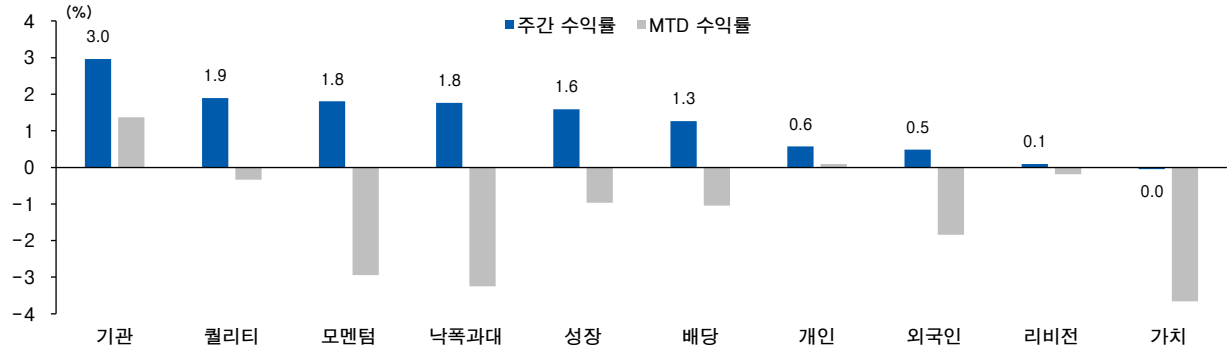
(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A237690	에스티팜	제약/바이오	144	107.7	1.6
2	A034220	LG디스플레이	디스플레이	3,840	27.9	5.0
3	A004020	현대제철	철강	1,485	24.0	-2.0
4	A267260	HD현대일렉	기계	2,450	5.4	0.8
5	A005380	현대차	자동차	29,011	5.0	0.9
6	A032350	롯데관광개발	호텔/레저	412	4.2	1.4
7	A010950	S-Oil	정유	2,776	3.2	1.3
8	A000720	현대건설	건설	2,248	3.1	-0.5
9	A175330	JB금융지주	은행	2,820	3.1	3.5
10	A105630	한세실업	섬유/의복	218	2.6	-3.0

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A042670	HD현대인프라	기계	761	-11.6	-0.3
2	A042700	한미반도체	반도체/장비	1,087	-7.7	1.8
3	A011070	LG이노텍	전자/부품	1,521	-7.0	5.2
4	A010140	삼성중공업	조선	2,025	-6.5	7.8
5	A010060	OCI홀딩스	화학	357	-6.2	3.1
6	A108670	LX하우시스	건자재	167	-5.8	0.4
7	A006260	LS	지주회사	2,440	-4.9	8.0
8	A006280	녹십자	제약/바이오	316	-3.9	0.9
9	A028050	삼성E&A	건설	1,660	-3.4	0.9
10	A267270	HD현대건설	기계	406	-2.3	-1.0

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 8/27일 기준 추정치(수익률 8/28일 기준)

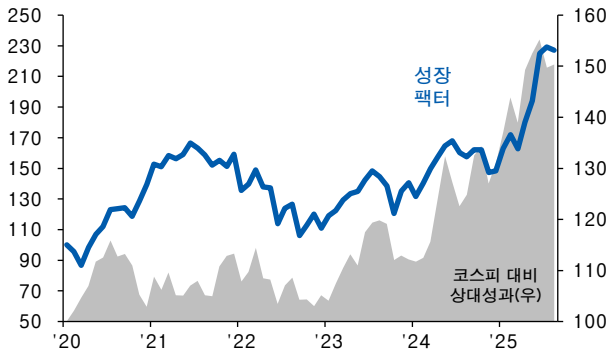
주간/MTD 팩터 수익률



성장 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.8	0.7

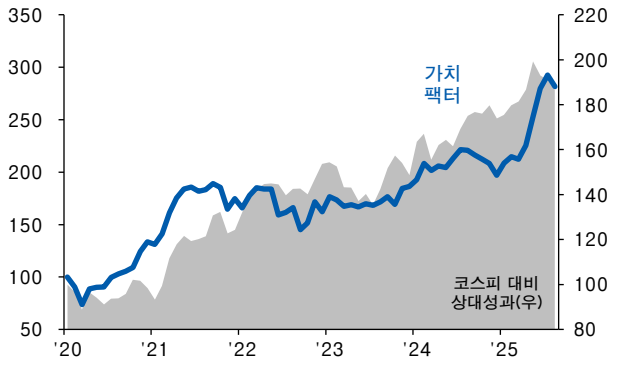
(2020.01.31=100pt)



가치 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
60.3	0.9

(2020.01.31=100pt)



자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

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	-0.8
A064350	현대로템	8.3	8.9	8.9	26.1	3.8
A352820	하이브	8.3	7.4	9.7	25.5	1.6
A267260	HD현대일렉트릭	8.6	7.5	8.0	24.0	0.8
A145020	휴젤	8.4	7.1	7.6	23.1	3.7
A298040	효성중공업	7.1	8.0	8.6	23.7	2.6
A010120	LS ELECTRIC	7.5	7.0	7.9	22.4	0.7
A278470	에이피알	9.7	9.0	4.1	22.8	-1.9
A012450	한화에어로스페이스	9.9	8.6	4.0	22.6	1.9
A030200	KT	3.1	8.9	9.0	20.9	-1.8

가치 스코어 Top 10

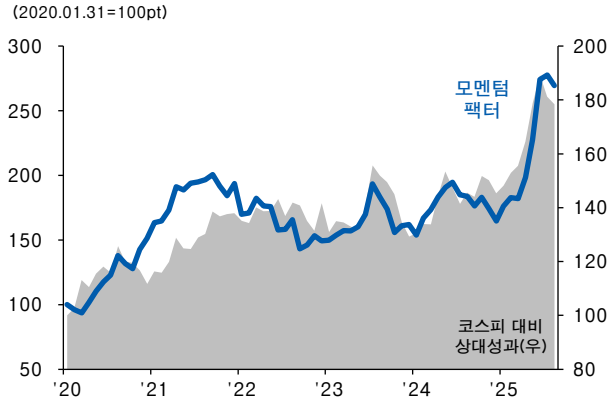
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.6	29.5	2.5
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	2.5
A088350	한화생명	9.8	9.8	9.9	29.4	1.5
A036460	한국가스공사	9.7	9.5	9.8	29.1	-1.5
A001450	현대해상	9.9	8.5	9.8	28.1	2.1
A001120	LX인터내셔널	9.3	8.9	9.9	28.1	0.3
A139480	이마트	8.1	9.8	9.9	27.8	-4.0
A002350	넥센타이어	9.5	9.6	8.6	27.7	-0.2
A023530	롯데쇼핑	8.3	10.0	9.2	27.5	1.2
A139130	iM금융지주	8.7	9.5	9.1	27.2	0.8

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 8/28일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

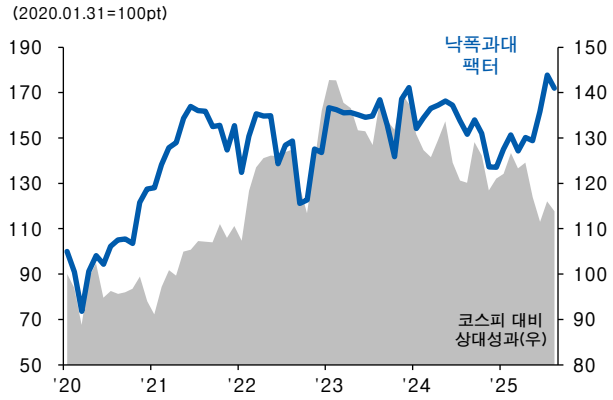
모멘텀 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
50.0	0.9



낙폭과대 팩터 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
47.1	0.2



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	1.4
A006800	미래에셋증권	9.3	9.8	9.7	9.7	38.4	7.3
A064350	현대로템	9.1	9.4	10.0	10.0	38.4	3.8
A103140	풍산	10.0	9.6	9.6	9.2	38.3	0.0
A298040	효성중공업	9.7	9.5	9.4	9.5	38.1	2.6
A032350	롯데관광개발	9.7	9.7	9.5	8.9	37.8	1.5
A000880	한화	8.0	9.9	9.9	9.9	37.6	3.4
A278470	에이피알	9.0	9.6	9.8	9.0	37.3	-1.9
A272210	한화시스템	8.4	9.2	9.6	9.7	36.8	-3.6
A079550	LIG넥스원	8.2	9.7	9.5	9.5	36.8	-5.1

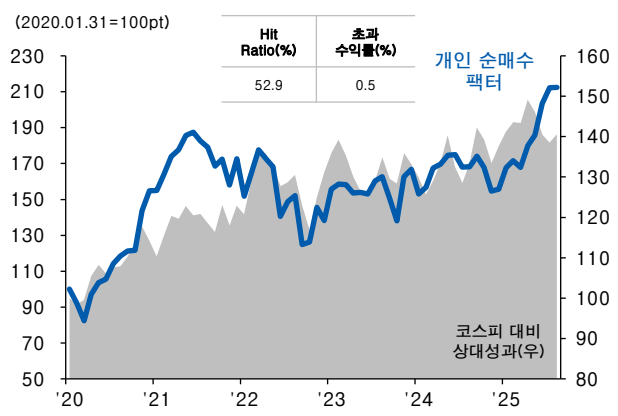
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A034020	두산에너빌리티	0.1	0.0	0.1	0.2	0.4	1.4
A064350	현대로템	0.9	0.6	0.0	0.0	1.6	3.8
A006800	미래에셋증권	0.7	0.2	0.3	0.3	1.6	7.3
A000880	한화	2.0	0.1	0.1	0.1	2.4	3.4
A278470	에이피알	1.0	0.4	0.2	1.0	2.7	-1.9
A079550	LIG넥스원	1.8	0.3	0.5	0.5	3.2	-5.1
A298040	효성중공업	0.3	0.5	0.6	0.5	1.9	2.6
A000720	현대건설	2.2	0.2	0.2	0.6	3.2	-0.4
A272210	한화시스템	1.6	0.8	0.4	0.3	3.2	-3.6
A071050	한국금융지주	1.4	0.6	1.0	0.9	4.0	4.1

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 8/28일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

개인 순매수 팩터 성과 추이

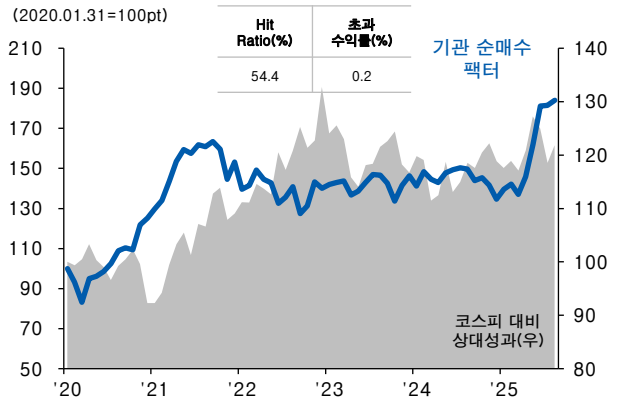


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	13.3
A105630	한세실업	9.7	9.7	9.8	9.9	39.0	-3.0
A005070	코스모신소재	9.8	9.4	9.9	9.8	38.8	-5.3
A066970	엘앤에프	9.5	9.5	9.9	9.8	38.5	-16.0
A006400	삼성SDI	9.1	9.6	9.8	9.9	38.4	0.0
A011070	LG이노텍	9.3	9.4	9.6	9.5	37.8	5.2
A181710	NHN	10.0	9.6	8.9	8.5	36.9	-1.9
A097950	CJ제일제당	7.4	9.8	9.7	9.7	36.5	0.5
A204320	HL만도	9.9	9.9	9.7	7.1	36.5	2.0
A004370	농심	9.7	9.2	8.7	8.7	36.2	7.3

기관 순매수 팩터 성과 추이

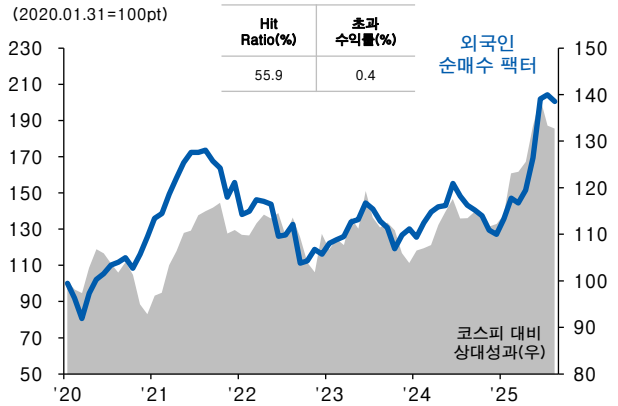


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-0.5
A001430	세아베스틸지주	9.9	9.8	9.3	9.7	38.6	1.1
A032350	롯데관광개발	9.5	9.9	9.7	9.4	38.4	1.5
A071050	한국금융지주	9.1	9.5	9.5	9.6	37.6	4.1
A004170	신세계	8.0	9.9	9.8	9.8	37.5	0.7
A039130	하나투어	9.9	9.4	8.8	8.9	36.9	-1.5
A042670	HD현대인프라코어	9.2	8.9	9.4	9.2	36.6	-0.3
A375500	DL이앤씨	8.7	9.6	8.5	9.0	35.8	0.8
A282330	BGF리테일	8.3	8.5	9.0	9.3	35.1	-0.4
A006800	미래에셋증권	9.2	8.8	8.4	8.1	34.4	7.3

외국인 순매수 팩터 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

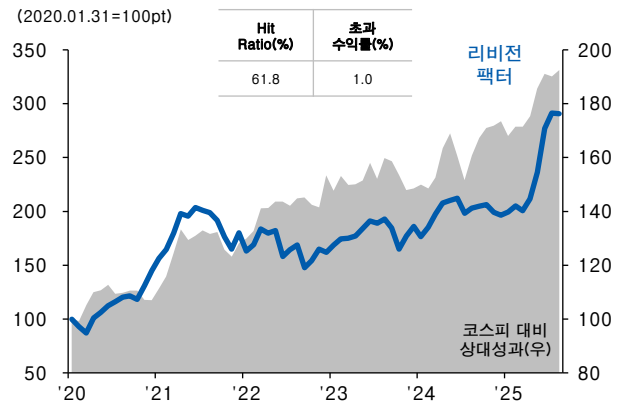
(단위: %)

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	-3.5
A161890	한국콜마	9.7	9.8	9.6	9.9	38.9	-1.7
A278470	에이피알	9.1	9.8	9.9	9.9	38.7	-1.9
A139480	이마트	9.9	9.7	9.7	9.5	38.7	-4.0
A114090	GKL	9.4	9.6	9.6	9.7	38.1	-1.3
A078340	컴투스	9.2	9.3	9.8	9.6	37.9	3.8
A010620	HD현대미포	9.8	9.9	9.4	8.8	37.8	6.7
A032350	롯데관광개발	9.9	9.7	9.0	9.1	37.7	1.5
A003230	삼양식품	8.7	9.6	9.8	9.6	37.6	10.8
A052690	한전기술	9.7	9.2	9.1	9.1	36.9	-6.0

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 8/28일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

리비전 팩터 성과 추이

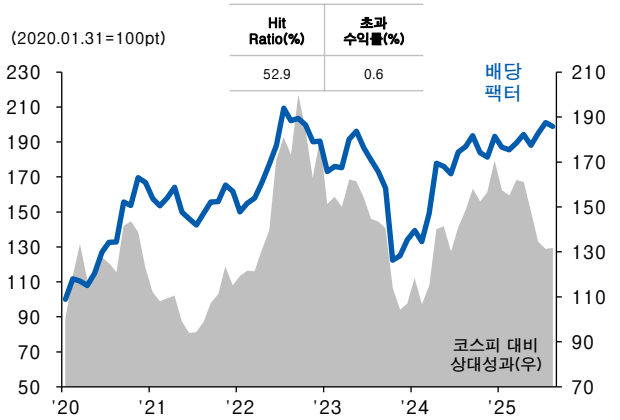


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.7	9.9	9.4	29.0	-3.3
A251270	넷마블	8.5	9.6	9.7	27.7	1.4
A278470	에이피알	9.3	8.9	8.3	26.5	-1.9
A257720	실리콘투	8.4	9.3	7.6	25.3	-3.1
A058470	리노공업	9.0	8.7	7.9	25.6	5.0
A012450	한화에어로스페이스	8.5	7.1	8.6	24.2	1.9
A214450	파마리서치	8.5	7.9	8.0	24.4	-2.2
A042670	HD현대인프라	7.1	8.7	6.2	22.1	-0.3
A353200	대덕전자	8.4	9.0	6.8	24.2	6.3
A009830	한화솔루션	9.1	6.1	6.6	21.7	-1.3

배당 팩터 성과 추이

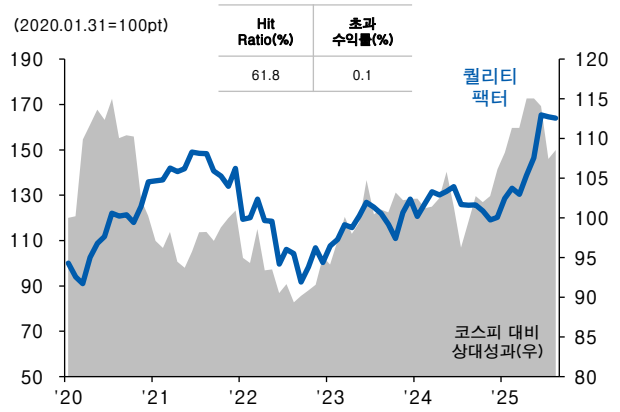


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A009240	한샘	9.5	9.9	9.6	9.7	38.8	0.7
A017670	SK텔레콤	8.9	9.7	9.4	9.9	37.8	-1.1
A030000	제일기획	8.8	9.5	9.1	9.8	37.2	0.2
A005940	NH투자증권	8.0	9.4	9.9	9.3	36.7	3.1
A001120	LX인터내셔널	7.6	9.5	9.3	9.9	36.3	0.3
A024110	기업은행	6.5	9.9	9.9	9.8	36.1	0.2
A030200	KT	9.7	8.9	9.0	8.7	36.3	-1.8
A078930	GS	7.9	9.3	9.2	9.5	35.9	4.3
A032640	LG유플러스	9.2	9.2	8.8	8.8	36.0	-0.8
A214320	이노션	7.9	9.3	8.9	9.7	35.8	-2.1

퀄리티 팩터 성과 추이



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	1.4
A058470	리노공업	4.8	9.7	9.6	8.8	32.9	5.0
A145020	휴젤	4.8	9.6	9.4	8.5	32.4	3.7
A259960	크래프톤	4.6	9.7	9.8	8.2	32.4	1.1
A042700	한미반도체	3.8	9.8	9.4	9.4	32.3	1.9
A214150	클래시스	3.7	9.8	9.6	9.2	32.3	-2.6
A192080	더블유게임즈	4.9	9.5	9.3	7.5	31.2	1.2
A000660	SK하이닉스	2.3	9.5	9.5	9.6	31.0	6.9
A214450	파마리서치	2.7	9.5	9.2	8.8	30.2	-2.2
A140860	파크시스템스	2.6	9.1	9.1	9.3	30.1	1.5

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 8/28일 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)