YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

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

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)

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 1주차] 대형주 중 '25년 2분기 영업이익 및 순이익 조정 상위 30% 종목

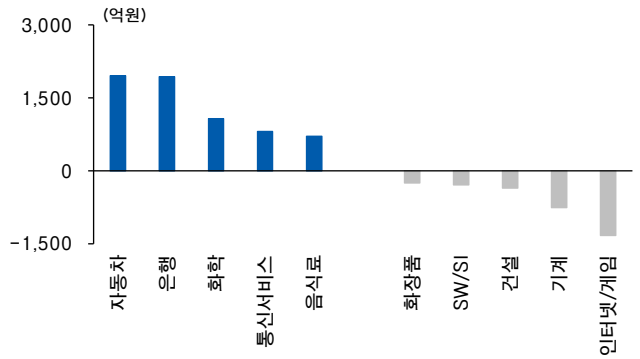
편입일	종목코드	종목명	시가총액 (억원)	'25년 2분기 영업이익 추정치		'25년 2분기 순이익 추정치		편입일 이후 누적 수익률(%)
				7/3일 기준(억원)	조정율(%)	7/3일 기준(억원)	조정율(%)	
7/1	A011200	HMM	244,984	3,712	21.3	3,464	4.9	6.1
7/1	A012450	한화에어로스페이스	386,410	7,187	5.6	3,593	4.1	-3.7
7/1	A251270	넷마블	53,377	636	4.7	590	10.9	0.2
7/1	A010620	HD현대미포	73,254	802	4.5	602	3.5	-13.6
7/1	A086790	하나금융지주	249,133	14,182	3.5	10,713	3.7	1.5
7/1	A006800	미래에셋증권	122,903	3,041	2.9	2,349	2.3	0.5
7/1	A128940	한미약품	37,600	576	2.6	384	1.9	2.6
7/1	A329180	HD현대중공업	349,766	4,580	2.5	3,077	11.3	-8.3
7/1	A138930	BNK금융지주	41,899	3,003	2.3	2,399	5.2	5.6
7/1	A005940	NH투자증권	66,114	2,529	2.0	1,869	2.4	2.0
신규 편입	A105560	KB금융	445,929	21,985	2.0	16,079	2.2	-
7/1	A055550	신한지주	315,851	19,687	1.9	14,310	2.1	3.7
신규 편입	A207940	삼성바이오로직스	743,057	4,272	1.7	3,455	2.8	-
신규 편입	A071050	한국금융지주	76,846	3,673	0.6	3,013	3.4	-

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 5월말 추정치 대비 조정률

주간 수급 Comment

- 지난 5 거래일 기준 기관 순매수 상위에 자동차 업종이 스크리닝된 반면 외국인 순매수 하위에 자동차 업종이 스크리닝
- 기계, 인터넷/게임 업종은 기관, 외국인 순매수 하위에 동시에 스크리닝. 기관 및 외국인 합 순매수 상위는 화학, 전기, 통신서비스 등.

기관 주간 순매수 상/하위 업종

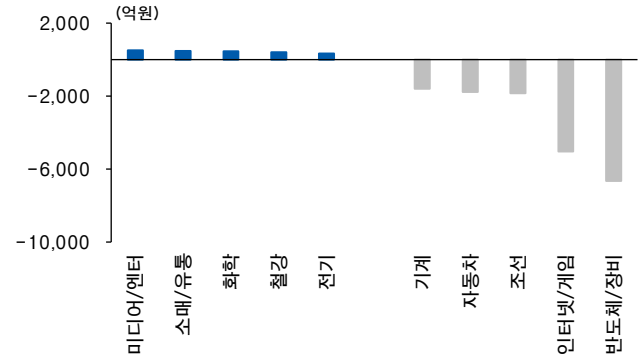


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	자동차	1,955	773	-1,170	
2	은행	1,933	-2,177	8,069	
3	화학	1,075	-1,309	-1,748	
4	통신서비스	810	455	-47	
5	음식료	709	-1,506	-2,400	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	-1,332	4,586	2,591	
2	기계	-759	-5,388	-4,427	
3	건설	-356	-606	3,173	
4	SW/SI	-288	1,251	1,836	
5	화장품	-252	-2,189	1,111	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

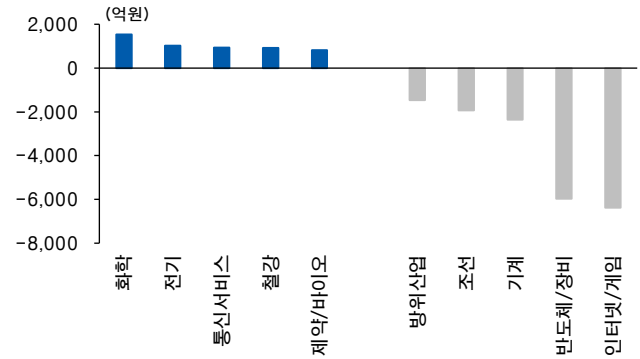


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	미디어/엔터	516	2,755	5,560	
2	소매/유통	478	1,269	738	
3	화학	462	977	-2,164	
4	철강	410	1,163	-1,029	
5	전기	338	857	4,930	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-6,647	20,462	-33,379	
2	인터넷/게임	-5,045	-13,579	-11,407	
3	조선	-1,840	2,896	14,872	
4	자동차	-1,777	3,016	-6,941	
5	기계	-1,592	-3,969	7,067	

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	화학	1,537	-332	-3,912	
2	전기	1,026	2,374	9,748	
3	통신서비스	931	1,210	-1,096	
4	철강	920	1,690	527	
5	제약/바이오	810	-2,217	-10,598	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	-6,377	-8,994	-8,816	
2	반도체/장비	-5,974	13,822	-28,058	
3	기계	-2,351	-9,356	2,641	
4	조선	-1,927	797	8,348	
5	방위산업	-1,472	-835	2,298	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A195870	해성디에스	반도체/장비	4,803	91	0.38
A120110	코오롱인더	화학	12,673	150	0.24
A009830	한화솔루션	화학	60,936	632	0.22
A001430	세아베스틸지주	철강	11,153	123	0.22
A010950	S-Oil	정유	70,027	116	0.17
A237690	에스티팜	제약/바이오	17,372	99	0.12
A257720	실리콘투	화장품	34,195	196	0.11
A081660	미스토홀딩스	섬유/의복	23,317	118	0.11
A001450	현대해상	손해보험	24,362	126	0.10
A139130	iM금융지주	은행	21,847	107	0.10

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A052690	한전기술	전기	36,385	766	0.39
A010950	S-Oil	정유	70,027	235	0.35
A139480	이마트	소매/유통	25,968	337	0.27
A042670	HD현대인프라코어	기계	25,403	283	0.23
A103140	풍산	비철금속	33,209	412	0.23
A161890	한국콜마	화장품	23,487	203	0.18
A007660	이수페타시스	전자/부품	36,081	293	0.16
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	13,415	88	0.13
A257720	실리콘투	화장품	34,195	229	0.13
A192820	코스맥스	화장품	30,076	192	0.12

기관 + 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A010950	S-Oil	정유	70,027	351	0.5
A001430	세아베스틸지주	철강	11,153	163	0.3
A009830	한화솔루션	화학	60,936	776	0.3
A042670	HD현대인프라코어	기계	25,403	324	0.3
A161890	한국콜마	화장품	23,487	284	0.3
A139480	이마트	소매/유통	25,968	306	0.2
A195870	해성디에스	반도체/장비	4,803	59	0.2
A257720	실리콘투	화장품	34,195	425	0.2
A237690	에스티팜	제약/바이오	17,372	158	0.2
A052690	한전기술	전기	36,385	375	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A207940	삼성바이오로직스	제약/바이오	718,146	138.6	-1,763	-2,793
A009830	한화솔루션	화학	60,936	776.0	-805	-6
A068270	셀트리온	제약/바이오	375,677	548.9	-348	-8,039
A066570	LG전자	전자/부품	124,700	38.3	-761	-2,719
A051600	한전KPS	전기	26,055	41.2	-660	-825
A004370	농심	음식료	24,604	133.5	-518	-493
A018260	삼성에스디에스	SW/SI	127,673	51.6	-330	278
A010950	S-Oil	정유	70,027	351.2	-7	-599
A039490	키움증권	증권	55,846	42.8	-314	-12
A000100	유한양행	제약/바이오	85,246	166.5	-165	-29

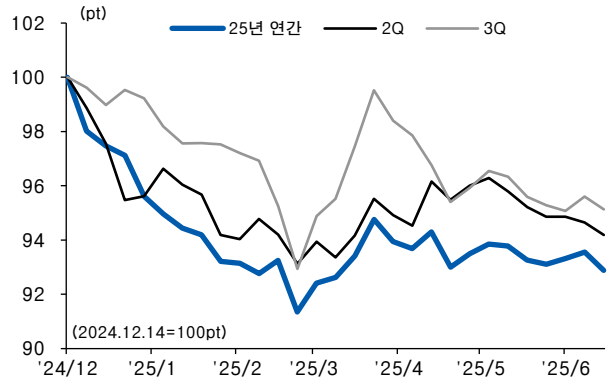
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준

업종별 | 종목별

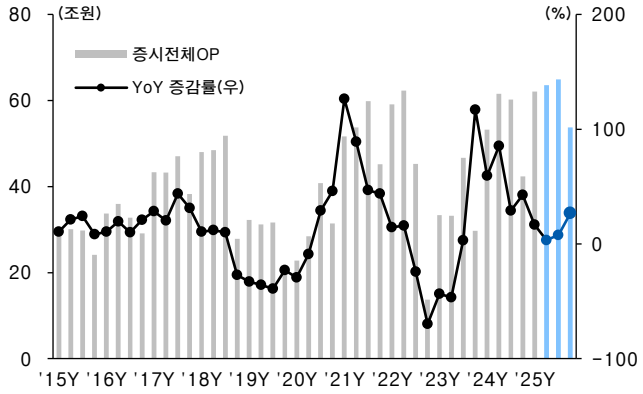
주간 컨센서스 Comment

- 25년 연간, 2분기, 3분기 영업이익 추정치는 둔화세 지속. 시장은 올해 2분기 사이클(YoY 증감률) 바닥 이후 반등 기대
- 지난 5거래일 기준 해운(+1.4%) 및 화장품(+0.8%) 업종이 연간 및 2분기 영업이익 추정치 상향 조정 상위에 스크리닝

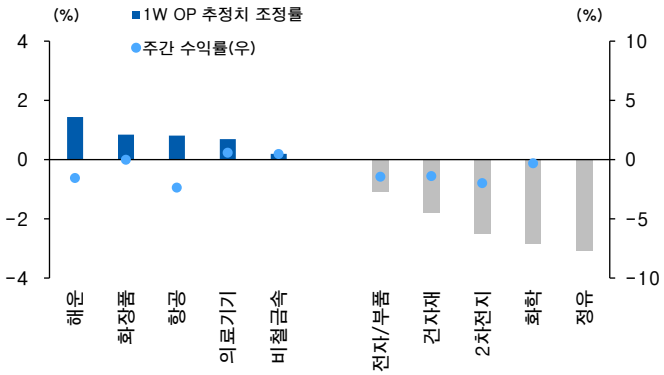
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

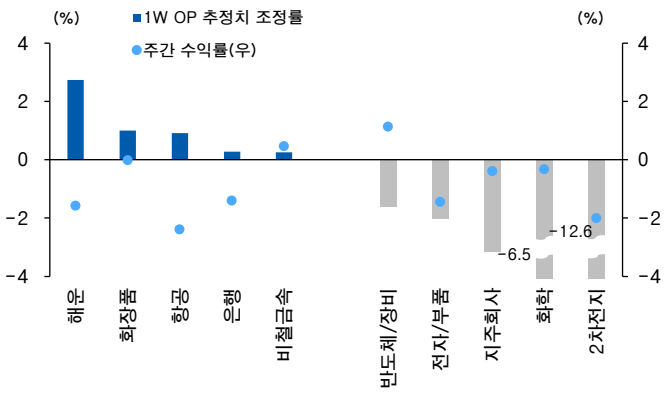


연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	해운	23,073	1.4	-1.6	
2	화장품	22,835	0.8	0.0	
3	항공	21,439	0.8	-2.4	
4	의료기기	4,681	0.7	0.6	
5	비철금속	14,539	0.2	0.5	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	정유	7,619	-3.1	14.8	
2	화학	33,454	-2.9	-0.3	
3	2차전지	12,085	-2.5	-2.0	
4	건자재	1,039	-1.8	-1.4	
5	전자/부품	49,940	-1.1	-1.4	

2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

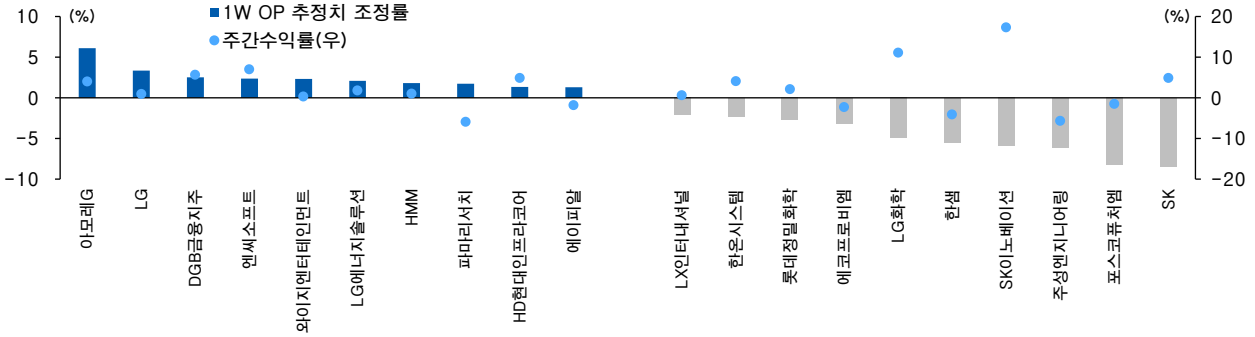
(단위:억원,%)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	해운	4,917	2.7	-1.6	
2	화장품	5,569	1.0	0.0	
3	항공	3,871	0.9	-2.4	
4	은행	86,254	0.3	-1.4	
5	비철금속	3,878	0.3	0.5	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	2차전지	891	-12.6	-2.0	
2	화학	5,372	-6.5	-0.3	
3	지주회사	58,805	-3.2	-0.4	
4	전자/부품	12,208	-2.0	-1.4	
5	반도체/장비	156,289	-1.6	1.1	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

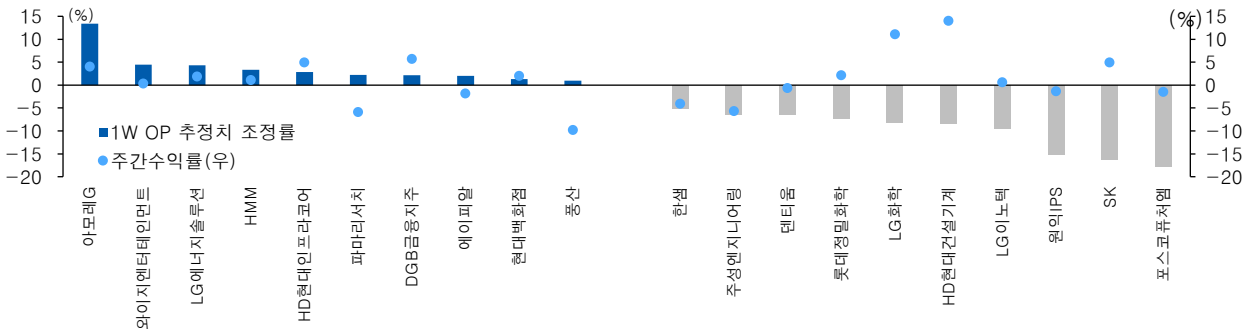


연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A002790	아모레G	화장품	4,430	6.1	4.1	1	A001120	LX인터내셔널	상사	4,047	-2.1	0.6
2	A003550	LG	지주회사	17,773	3.4	1.0	2	A018880	한온시스템	자동차부품	1,639	-2.3	4.1
3	A139130	DGB금융지주	은행	6,026	2.5	5.7	3	A004000	롯데정밀화학	화학	860	-2.7	2.1
4	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	573	2.4	7.1	4	A247540	에코프로비엠	2차전지	611	-3.2	-2.3
5	A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	633	2.4	0.3	5	A051910	LG화학	화학	17,953	-4.9	11.1
6	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	16,975	2.1	1.9	6	A009240	한샘	건자재	327	-5.5	-4.1
7	A011200	HMM	해운	18,362	1.8	1.1	7	A096770	SK이노베이션	정유	4,348	-5.9	17.3
8	A214450	파마리서치	의료기기	1,943	1.8	-5.9	8	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	1,025	-6.1	-5.7
9	A042670	HD현대인프라코어	기계	2,438	1.3	4.9	9	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	753	-8.2	-1.5
10	A278470	에이피알	화장품	2,313	1.3	-1.8	10	A034730	SK	지주회사	36,168	-8.4	4.9

2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

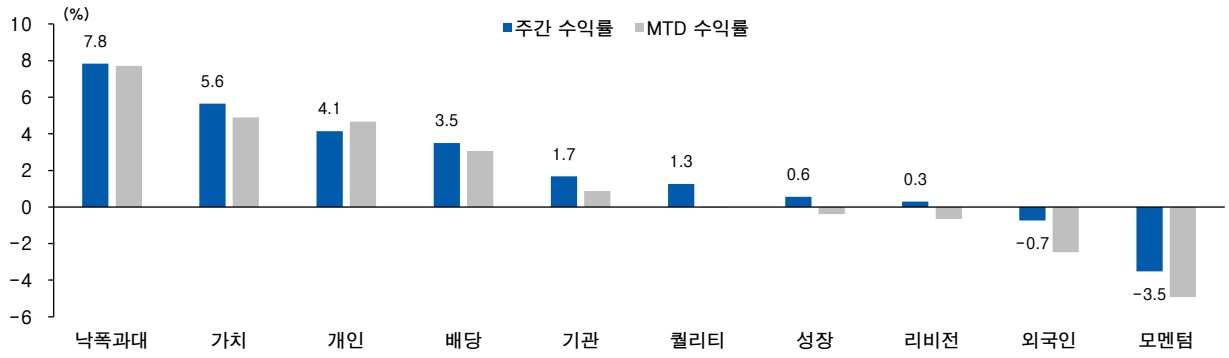
(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A002790	아모레G	화장품	850	13.4	4.1	1	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	120	-17.9	-1.5
2	A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	31	4.5	0.3	2	A034730	SK	지주회사	9,475	-16.2	4.9
3	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	3,055	4.3	1.9	3	A240810	원익IPS	반도체/장비	195	-15.1	-1.3
4	A011200	HMM	해운	3,712	3.4	1.1	4	A011070	LG이노텍	전자/부품	546	-9.5	0.6
5	A042670	HD현대인프라코어	기계	773	2.8	4.9	5	A267270	HD현대건설기계	기계	352	-8.3	14.0
6	A214450	파마리서치	의료기기	485	2.2	-5.9	6	A051910	LG화학	화학	3,303	-8.2	11.1
7	A139130	DGB금융지주	은행	1,861	2.1	5.7	7	A004000	롯데정밀화학	화학	117	-7.4	2.1
8	A278470	에이피알	화장품	557	2.0	-1.8	8	A145720	덴티움	의료기기	217	-6.4	-0.6
9	A069960	현대백화점	소매/유통	849	1.3	2.0	9	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	311	-6.4	-5.7
10	A103140	풍산	비철금속	1,052	1.0	-9.8	10	A009240	한샘	건자재	87	-5.0	-4.1

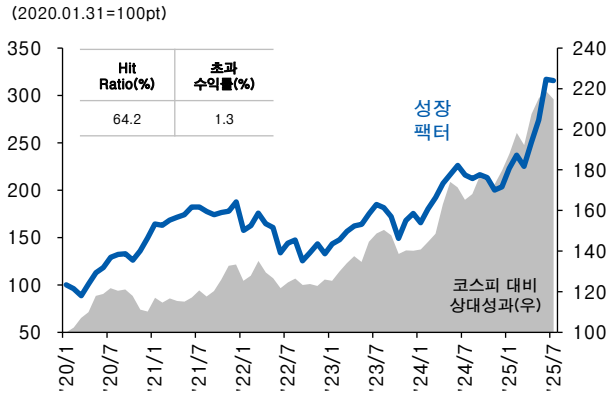
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준

업종별 종목별

주간/MTD 팩터 수익률



성장 팩터 성과 추이

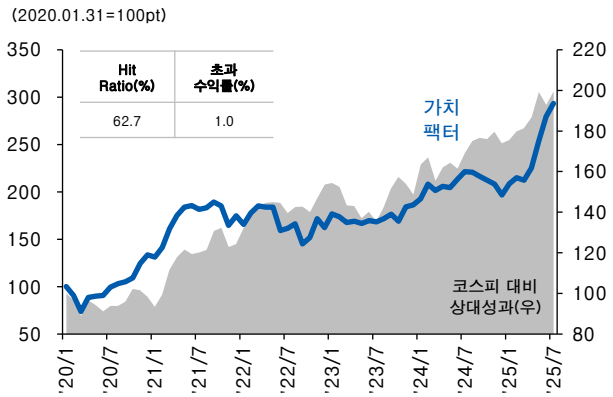


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A064350	현대로템	8.3	8.9	9.0	26.1	-0.1
A352820	하이브	8.4	7.2	9.3	24.8	-6.0
A298040	효성중공업	7.2	8.1	8.7	24.0	1.9
A012450	한화에어로스페이스	9.9	8.6	5.2	23.7	-3.7
A145020	휴젤	8.3	7.2	7.9	23.4	-2.6
A010120	LS ELECTRIC	7.7	7.4	8.2	23.2	-7.7
A278470	에이피알	9.7	8.9	4.1	22.7	-4.9
A207940	삼성바이오로직스	8.6	6.3	7.4	22.3	5.2
A214150	클래시스	9.5	8.0	4.6	22.1	-0.3
A068270	셀트리온	8.9	8.4	4.5	21.9	7.8

가치 팩터 성과 추이



자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

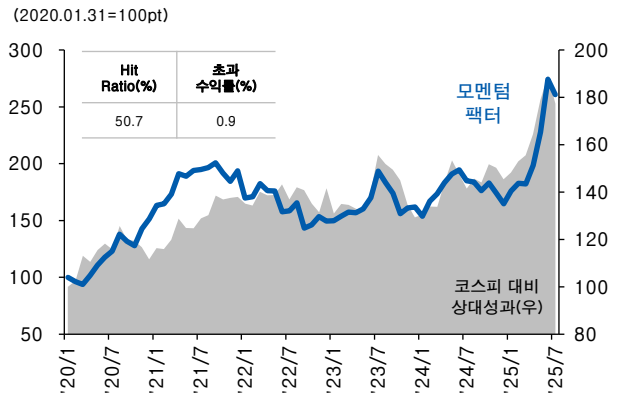
가치 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.6	29.5	15.6
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	-0.1
A088350	한화생명	9.8	9.8	9.9	29.4	-0.1
A036460	한국가스공사	9.7	9.5	9.8	29.1	9.7
A001450	현대해상	9.9	8.5	9.8	28.1	2.4
A001120	LX인터내셔널	9.3	8.9	9.9	28.1	0.1
A139480	이마트	8.1	9.8	9.9	27.8	9.5
A002350	넥센타이어	9.5	9.6	8.6	27.7	3.7
A023530	롯데쇼핑	8.3	10.0	9.2	27.5	3.7
A139130	iM금융지주	8.7	9.5	9.1	27.2	5.9

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 6/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

모멘텀 팩터 성과 추이

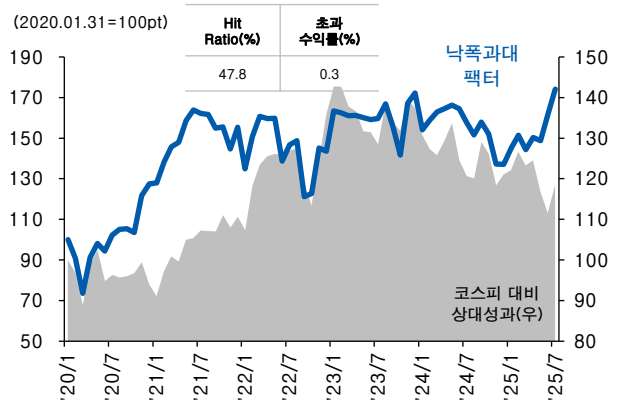


모멘텀 스코어 Top 10

(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	-5.6
A006800	미래에셋증권	9.3	9.8	9.7	9.7	38.4	1.0
A064350	현대로템	9.1	9.4	10.0	10.0	38.4	-2.4
A103140	풍산	10.0	9.6	9.6	9.2	38.3	-12.4
A298040	효성중공업	9.7	9.5	9.4	9.5	38.1	5.9
A032350	롯데관광개발	9.7	9.7	9.5	8.9	37.8	1.4
A000880	한화	8.0	9.9	9.9	9.9	37.6	-2.1
A278470	에이피알	9.0	9.6	9.8	9.0	37.3	-1.2
A272210	한화시스템	8.4	9.2	9.6	9.7	36.8	-7.9
A079550	LIG넥스원	8.2	9.7	9.5	9.5	36.8	-5.1

낙폭과대 팩터 성과 추이



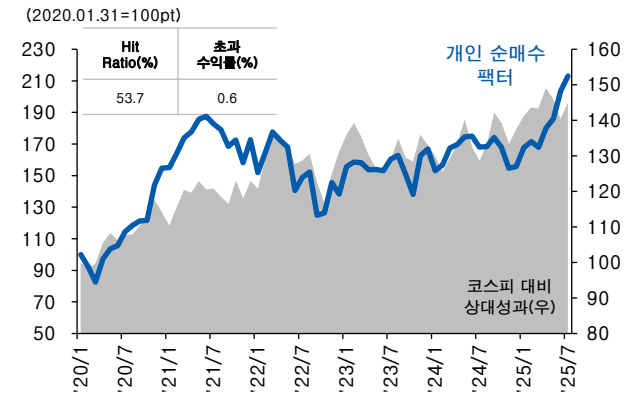
낙폭과대 스코어 Top 10

(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	10.7
A105630	한세실업	9.5	9.1	9.7	9.6	37.8	10.9
A009420	한올바이오파마	9.6	9.6	9.9	7.9	36.9	7.7
A090460	비에이치	8.0	9.5	9.8	9.7	36.9	4.2
A005070	코스모신소재	7.2	9.8	9.9	10.0	36.7	14.7
A204320	HL만도	8.9	9.8	9.5	8.4	36.6	6.7
A006400	삼성SDI	7.5	9.3	9.7	9.8	36.3	8.9
A011170	롯데케미칼	8.7	9.5	8.2	9.6	36.0	15.6
A020150	롯데에너지머티	8.3	9.0	8.7	9.9	35.8	5.4
A018880	한온시스템	7.4	9.7	9.6	8.9	35.5	7.7

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 6/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

개인 순매수 팩터 성과 추이

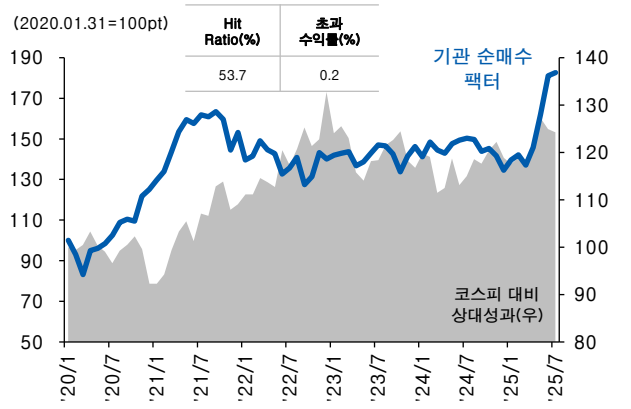


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	4.2
A105630	한세실업	9.7	9.7	9.8	9.9	39.0	10.9
A005070	코스모신소재	9.8	9.4	9.9	9.8	38.8	14.7
A066970	엘앤에프	9.5	9.5	9.9	9.8	38.5	10.7
A006400	삼성SDI	9.1	9.6	9.8	9.9	38.4	8.9
A011070	LG이노텍	9.3	9.4	9.6	9.5	37.8	5.6
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	7.9
A204320	HL만도	9.9	9.9	9.7	7.1	36.5	6.7
A004370	농심	9.7	9.2	8.7	8.7	36.2	3.0

기관 순매수 팩터 성과 추이

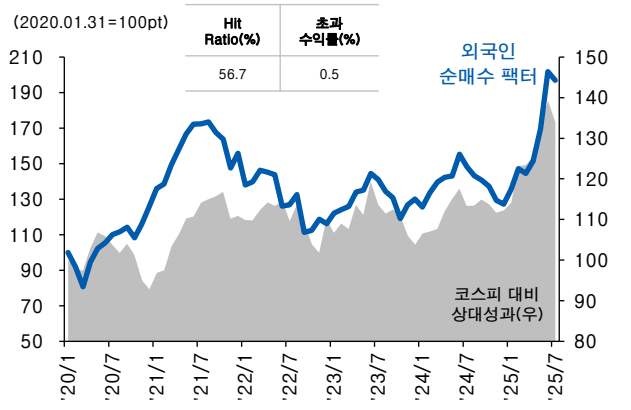


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-6.1
A001430	세아베스틸지주	9.9	9.8	9.3	9.7	38.6	0.6
A032350	롯데관광개발	9.5	9.9	9.7	9.4	38.4	1.4
A071050	한국금융지주	9.1	9.5	9.5	9.6	37.6	-1.8
A004170	신세계	8.0	9.9	9.8	9.8	37.5	1.4
A039130	하나투어	9.9	9.4	8.8	8.9	36.9	1.5
A042670	HD현대인프라	9.2	8.9	9.4	9.2	36.6	-3.6
A375500	DL이앤씨	8.7	9.6	8.5	9.0	35.8	-6.2
A282330	BGF리테일	8.3	8.5	9.0	9.3	35.1	6.2
A006800	미래에셋증권	9.2	8.8	8.4	8.1	34.4	1.0

외국인 순매수 팩터 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

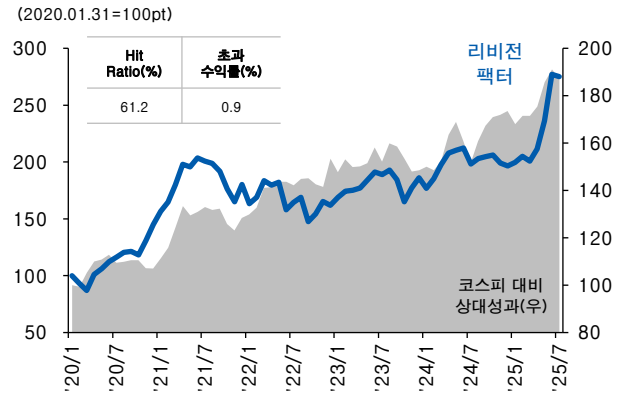
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A041510	에스엠	9.6	10.0	10.0	10.0	39.5	-1.1
A161890	한국콜마	9.7	9.8	9.6	9.9	38.9	8.9
A139480	이마트	9.9	9.7	9.7	9.5	38.7	9.5
A278470	에이피알	9.1	9.8	9.9	9.9	38.7	-1.2
A032350	롯데관광개발	9.9	9.7	9.0	9.1	37.7	1.4
A114090	GKL	9.4	9.6	9.6	9.7	38.1	8.6
A010620	HD현대미포	9.8	9.9	9.4	8.8	37.8	-7.6
A078340	컴투스	9.2	9.3	9.8	9.6	37.9	-1.2
A052690	한전기술	9.7	9.2	9.1	9.1	36.9	-12.0
A003230	삼양식품	8.7	9.6	9.8	9.6	37.6	-0.2

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 6/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

리비전 팩터 성과 추이



자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

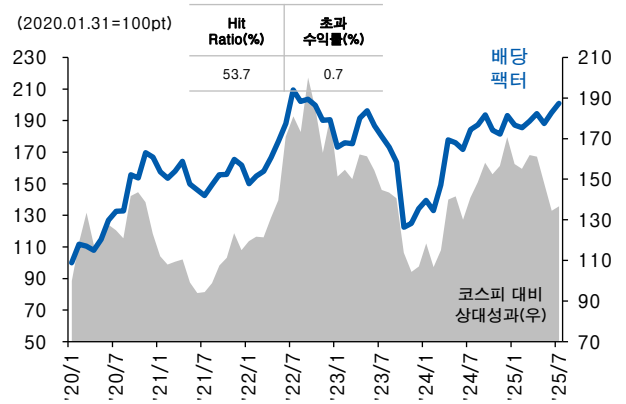
리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.7	9.9	9.4	29.0	6.6
A251270	넷마블	8.5	9.6	9.7	27.7	5.1
A278470	에이피알	9.3	8.9	8.3	26.5	-1.2
A103140	풍산	8.2	9.0	8.5	25.6	-12.4
A058470	리노공업	9.0	8.7	7.9	25.6	1.7
A257720	실리콘투	8.4	9.3	7.6	25.3	-4.3
A014680	한솔케미칼	8.6	7.9	8.3	24.8	2.3
A008770	호텔신라	8.5	6.6	9.7	24.8	-0.1
A214450	파마리서치	8.5	7.9	8.0	24.4	3.1
A353200	대덕전자	8.4	9.0	6.8	24.2	2.1

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 6/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

배당 팩터 성과 추이



자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

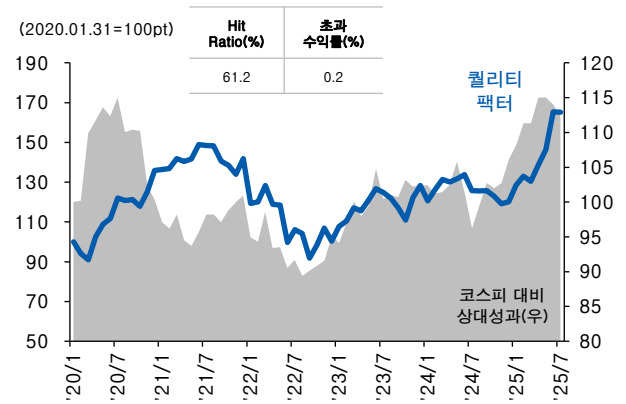
배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A017670	SK텔레콤	8.6	9.7	9.4	9.9	37.4	2.5
A030000	제일기획	8.5	9.5	9.1	9.8	36.9	2.0
A005940	NH투자증권	7.5	9.4	9.9	9.3	36.2	2.4
A030200	KT	9.5	8.9	9.0	8.7	36.2	3.9
A001120	LX인터내셔널	7.3	9.5	9.3	9.9	36.0	0.1
A024110	기업은행	6.4	9.9	9.9	9.8	35.9	3.4
A032640	LG유플러스	9.0	9.2	8.8	8.8	35.7	1.8
A001430	세아베스틸지주	9.9	8.6	8.9	8.2	35.5	0.6
A078930	GS	7.5	9.3	9.2	9.5	35.5	7.7
A033780	KT&G	7.7	9.1	9.3	8.8	34.9	4.2

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 6/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

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	-2.5
A058470	리노공업	4.8	9.7	9.6	8.8	32.9	1.7
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	2.2
A042700	한미반도체	3.8	9.8	9.4	9.4	32.3	-7.5
A214150	클래시스	3.7	9.8	9.6	9.2	32.3	0.8
A192080	더블유게임즈	4.9	9.5	9.3	7.5	31.2	2.7
A000660	SK하이닉스	2.3	9.5	9.5	9.6	31.0	-1.9
A214450	파마리서치	2.7	9.5	9.2	8.8	30.2	3.1
A140860	파크시스템스	2.6	9.1	9.1	9.3	30.1	4.1

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 6/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

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.

YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)