

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

8월 2주차 KOSDAQ ETF 수급 민감도

CONTENTS

I 주간 스크리닝

KOSDAQ ETF 수급 민감도

II 수급

업종별

종목별

III 컨센서스&수익률

업종별

종목별

IV 스타일 Status

성장 / 가치

주가 - 모멘텀 / 낙폭과대

수급 - 개인 / 기관 / 외국인

기타 - 리비전 / 배당 / 퀄리티



신현용

Quant Analyst

02 3770 3634

hyunyong.shin@yuantakorea.com

KOSDAQ ETF 수급 민감도 - 투기성 매매의 진정, ETF 자금 유입은 지속

- 1) KOSPI의 하락이 지속된 기간(6/22~7/30일) 신용잔고는 급감하였으며, 삼성전자, SK하이닉스 단일종목 레버리지 ETF 매수세 또한 둔화되며 투기성 매매는 진정. 다만, 투자심리 악화로 강세장을 이끌어 온 주요 수급 주체인 개인의 순매수세가 둔화. 개인은 지난 5월 +35.1조원, 6월 +42.4조원 순매수한 반면 7월 이후 누적(8/12일 기준) 약 +10.9조원 수준으로 축소. 기관과 외국인 또한 뚜렷한 매수세가 나타나지 않는 모습
- 2) 다만, 개인의 국내 주식형 ETF(레버리지, 인버스 제외)의 순매수세는 지속되는 상황이며, 특히 ETF 수급은 KOSDAQ 시장 내 영향력이 확대되는 흐름. KOSDAQ 내 개인의 ETF 매수세가 지속성을 갖춘 유일한 매수 주체인 것으로 파악. 이에 따라 유동시가총액 대비 ETF 추종자금이 상대적으로 큰, ETF 수급 민감도가 높은 KOSDAQ 종목에 대한 접근이 유효할 것으로 판단

[8월 2주차] 유동 시가총액 대비 ETF 추종자금 상위 KOSDAQ 종목 스크리닝

종목명	업종	시가총액 (억원)	유동시가총액 (억원)	60일평균 거래대금(억원)	ETF 추종자금 (억원)	ETF 민감도(%)		
						시가총액 대비	유동시가총액 대비	60일평균 거래대금 대비
원익IPS	반도체	54,729	36,219	2,216	15,733	28.7	43.4	710.0
주성엔지니어링	반도체	80,877	54,155	5,320	20,704	25.6	38.2	389.2
이오테크닉스	반도체	47,492	32,712	748	11,513	24.2	35.2	1,539.1
리노공업	반도체	54,415	40,327	996	13,319	24.5	33.0	1,337.4
피에스케이	반도체	38,468	25,793	962	7,800	20.3	30.2	810.6
제룡전기	기계	8,176	5,467	116	1,616	19.8	29.6	1,398.5
하이젠알앤엠	기계	5,986	1,349	35	321	5.4	23.8	923.2
피에스케이홀딩스	반도체	23,309	8,046	330	1,888	8.1	23.5	572.8
HPSP	반도체	31,809	24,935	2,765	5,850	18.4	23.5	211.6
ISC	반도체	31,626	16,167	510	3,761	11.9	23.3	737.6
유진로봇	기계	5,089	2,755	67	629	12.4	22.8	945.9
두산테스나	반도체	16,312	9,853	412	2,214	13.6	22.5	538.1
심텍	IT하드웨어	39,187	26,451	1,050	5,743	14.7	21.7	547.0
하나마이크론	반도체	23,571	17,476	921	3,770	16.0	21.6	409.1
티씨케이	반도체	25,601	12,127	199	2,599	10.2	21.4	1,304.3
테크윙	반도체	17,915	12,951	1,028	2,723	15.2	21.0	265.0
제주반도체	반도체	29,965	25,797	3,184	5,302	17.7	20.6	166.5
SFA반도체	반도체	10,114	4,521	444	907	9.0	20.1	204.3
테스	반도체	28,246	17,552	892	3,455	12.2	19.7	387.1
에스앤에스텍	반도체	9,569	7,337	135	1,434	15.0	19.5	1,062.7
가온칩스	반도체	5,669	3,147	113	614	10.8	19.5	544.7
유진테크	반도체	29,608	18,416	410	3,545	12.0	19.3	864.3
하나머티리얼즈	반도체	12,539	6,675	135	1,264	10.1	18.9	934.0
유일로보틱스	기계	8,553	4,396	50	827	9.7	18.8	1,658.1
고영	IT하드웨어	21,689	16,557	608	3,069	14.1	18.5	504.3
나노신소재	화학	6,241	4,767	43	879	14.1	18.4	2,035.0
넥스틴	반도체	3,866	2,738	56	504	13.0	18.4	901.9
RFHIC	IT하드웨어	14,351	9,414	246	1,726	12.0	18.3	702.8
로보스타	기계	8,268	5,506	516	1,004	12.1	18.2	194.5
태성	IT하드웨어	15,177	10,478	156	1,899	12.5	18.1	1,215.8

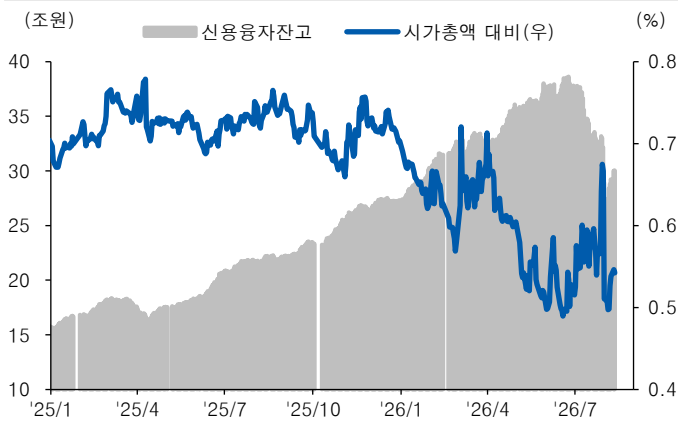
자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) AUM 3,000억원 이상 국내 주식형 ETF 내 포함된 구성종목 기준

주2) ETF 추종자금 = Σ(ETF AUM * 종목별 구성비중)

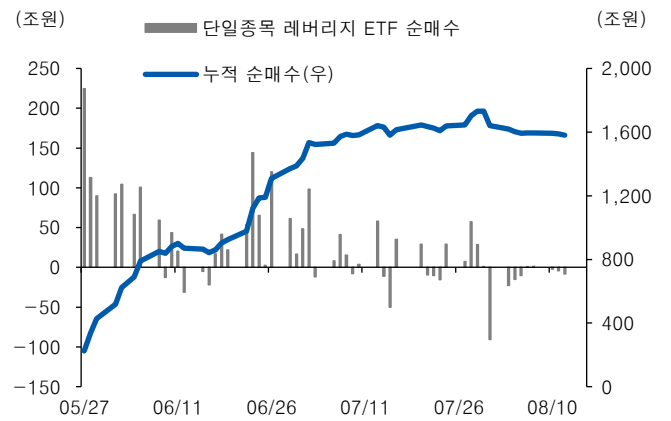
주3) 인버스 ETF 제외

7월 하락 기간을 거치며 신용잔고는 급감



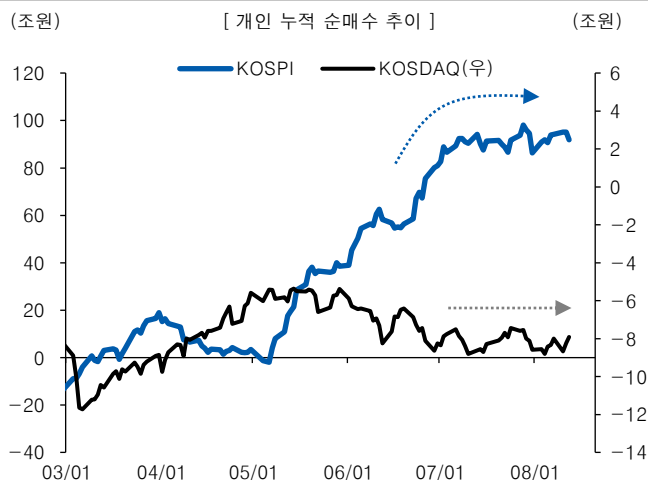
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: KOSPI, KOSDAQ 합산 기준

단일종목 레버리지 ETF 자금 유입세 또한 둔화



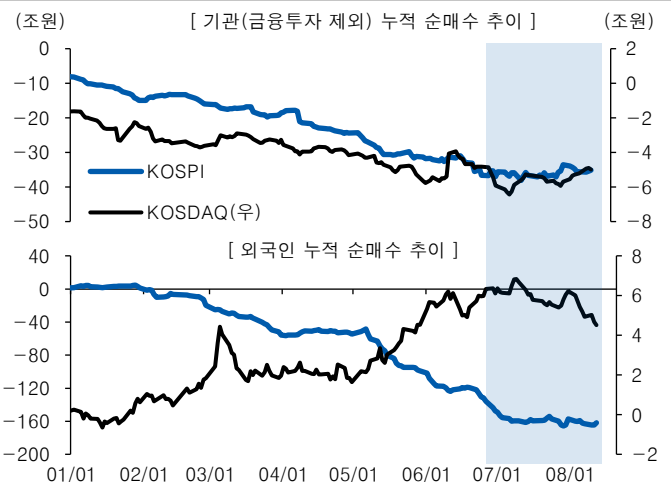
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: KODEX, TIGER 삼성전자, SK하이닉스 단일종목 레버리지 ETF 기준

투자심리 악화로 증시 내 개인 매수세 약화



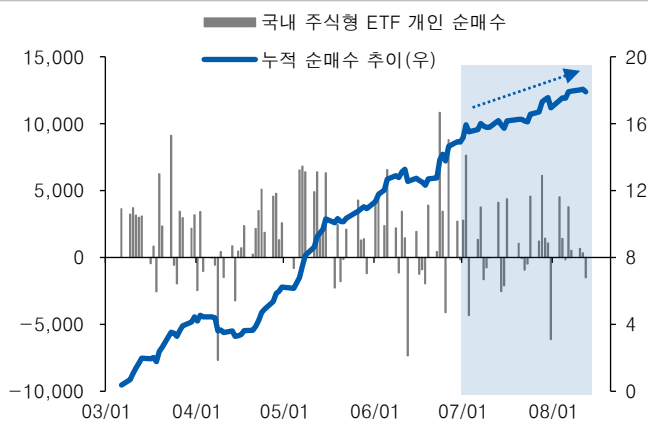
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

기관과 외국인 또한 뚜렷한 순매수세를 나타내지 못하는 모습



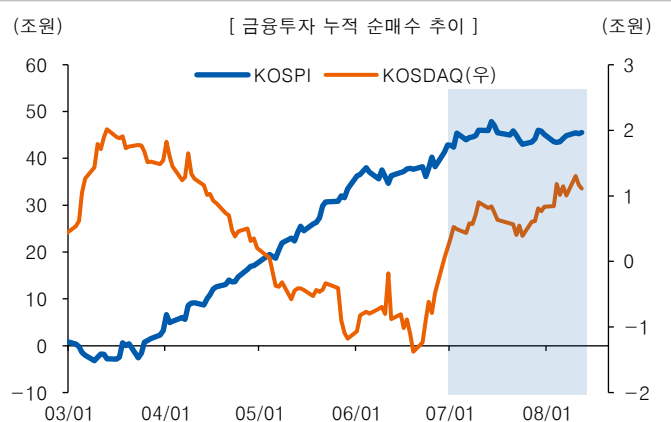
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

다만, 개인의 국내 주식형 ETF 순매수는 지속



자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 레버리지, 인버스 ETF 제외

ETF 수급은 KOSPI 보다 KOSDAQ 내 영향력 확대



자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

7월 이후 누적 ETF 순매수 상/하위 30

상위 30			하위 30		
ETF	AUM(억원)	누적 순유입(억원)	ETF	AUM(억원)	누적 순유입(억원)
KODEX 200	243,607	21,698	HANARO Fn K-반도체	33,494	-4,487
KODEX 코스닥150	53,135	10,170	KODEX Top5PlusTR	9,490	-3,893
TIGER 반도체TOP10	89,334	3,703	KODEX 은행	2,801	-1,295
KODEX 2차전지산업	16,582	3,260	SOL 자동차TOP3플러스	2,202	-639
KODEX 반도체	52,998	2,772	TIGER 화장품	2,674	-577
KODEX AI반도체TOP2플러스	37,658	1,518	TIGER K방산&우주	5,557	-545
1Q K반도체TOP2+	3,199	1,309	TIME K바이오액티브	2,349	-397
RISE ESG사회책임투자	6,343	1,211	KODEX 삼성그룹	32,902	-363
KODEX AI전력핵심설비	32,315	1,155	KoAct 바이오헬스케어액티브	4,037	-361
TIGER 코리아TOP10	19,609	1,105	KODEX 배당가치	906	-330
KODEX 코스피	10,680	1,002	RISE 네트워크인프라	6,522	-320
KoAct 코스피액티브	1,209	991	TIGER 지주회사	2,757	-292
KODEX 200액티브	10,434	870	TIGER 은행고배당플러스 TOP10	7,728	-282
TIGER 반도체	12,985	852	PLUS K방산	11,204	-277
SOL AI반도체TOP2플러스	53,371	832	KODEX 로봇액티브	11,082	-241
ACE AI반도체TOP3+	10,738	775	TIME 코스닥액티브	2,731	-236
SOL 반도체전공정	2,952	740	KoAct 코스닥액티브	4,744	-222
SOL 조선TOP3플러스	15,678	640	KODEX 200ESG	1,593	-221
TIGER 코리아AI전력기기TOP3 플러스	10,073	451	KoAct AI인프라액티브	422	-208
ACE K반도체TOP2+	2,952	435	TIGER 현대차그룹플러스	6,802	-202
DS 코스닥액티브	470	368	TIGER 증권	2,393	-198
TIGER 200 IT	25,946	359	TIGER 2차전지테마	8,883	-178
TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	6,570	340	ACE 원자력TOP10	2,120	-177
KODEX 증권	7,499	318	KODEX 코리아밸류업	6,549	-141
SOL 금융지주플러스고배당	3,684	287	KODEX 주주환원고배당주	1,491	-132
TIGER 코리아밸류업	5,068	286	KODEX 건설	1,929	-126
KODEX 코스피100	9,399	274	TIGER 바이오TOP10	2,969	-126
ACE 라이프자산주주가치액티브	1,669	273	KODEX 자동차	4,210	-108
ACE 코리아AI전력TOP10	381	221	TIGER 삼성그룹	1,438	-104
WON 반도체밸류체인액티브	3,390	218	SOL AI반도체소부장	9,808	-100

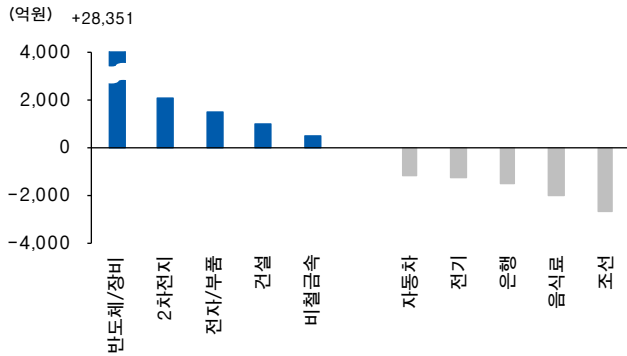
자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주: 7/1 ~ 8/12일 누적 기준

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +3.6 조원 순매수, 기관은 약 +1.7 조원 순매수를 기록. 가파른 낙폭 이후 기관과 외국인의 반도체/장비 업종 순매수가 회복세 전환에 주요하게 작용
- 또한, 전자/부품 업종을 기관과 외국인이 동시 순매수(+3,353억원)한 반면, 전기 업종은 동시 순매도(-1,625억원)를 기록

기관 주간 순매수 상/하위 업종

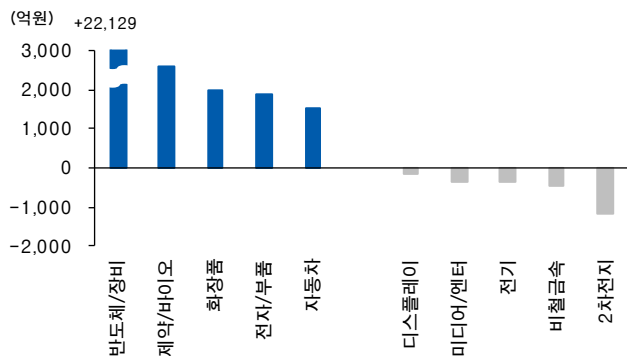


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	28,351	-18,618	102,462	
2	2차전지	2,047	2,707	-1,783	
3	전자/부품	1,484	6,276	-8,966	
4	건설	989	4,104	3,783	
5	비철금속	490	1,335	725	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	-2,730	-435	4,622	
2	음식료	-2,028	-1,290	-3,552	
3	은행	-1,568	305	15,413	
4	전기	-1,271	-1,589	-612	
5	자동차	-1,213	-4,004	-8,320	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

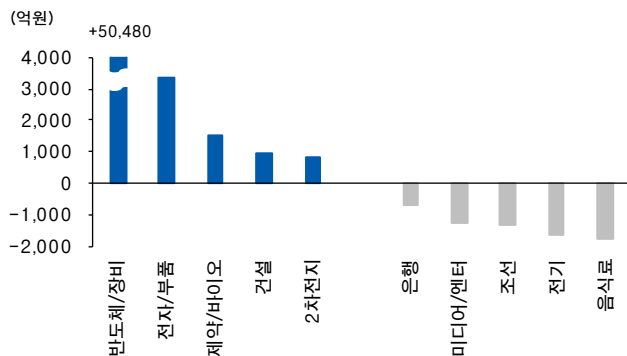


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	22,129	-24,631	-678,912	
2	제약/바이오	2,609	5,728	9,411	
3	화장품	1,973	3,299	2,101	
4	전자/부품	1,869	-9,928	-21,431	
5	자동차	1,538	4,880	-15,143	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	-1,192	-2,454	3,623	
2	비철금속	-447	-726	172	
3	전기	-353	826	-898	
4	미디어/엔터	-340	-142	30	
5	디스플레이	-151	-518	-346	

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	반도체/장비	50,480	-43,249	-576,450	
2	전자/부품	3,353	-3,652	-30,396	
3	제약/바이오	1,497	9,550	14,148	
4	건설	971	4,762	8,372	
5	2차전지	855	253	1,840	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	음식료	-1,779	616	673	
2	전기	-1,625	-764	-1,511	
3	조선	-1,328	1,949	-1,797	
4	미디어/엔터	-1,244	-1,568	1,191	
5	은행	-681	2,056	13,023	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 8/13일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	30,553	588	0.49
A181710	NHN	SW/SI	21,846	292	0.40
A066970	엘앤에프	2차전지	41,741	352	0.22
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	11,867	103	0.21
A240810	원익IPS	반도체/장비	58,901	395	0.19
A089860	롯데렌탈	내구소비재	15,431	111	0.18
A009830	한화솔루션	화학	82,198	528	0.17
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,945	63	0.16
A001430	세아베스틸지주	철강	15,618	96	0.16
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	83,341	435	0.14

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A192820	코스맥스	화장품	28,260	513	0.50
A214450	파마리서치	의료기기	44,208	605	0.35
A241710	코스메카코리아	화장품	13,297	157	0.33
A011780	금호석유화학	화학	32,428	379	0.30
A112610	씨에스원드	기계	19,778	224	0.29
A222800	심텍	전자/부품	39,637	312	0.19
A069960	현대백화점	소매/유통	21,500	152	0.17
A003230	삼양식품	음식료	91,827	633	0.17
A161890	한국콜마	화장품	31,914	191	0.17
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	28,147	164	0.14

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	30,553	640	0.5
A241710	코스메카코리아	화장품	13,297	175	0.4
A192820	코스맥스	화장품	28,260	373	0.4
A112610	씨에스원드	기계	19,778	268	0.4
A214450	파마리서치	의료기기	44,208	584	0.3
A240810	원익IPS	반도체/장비	58,901	648	0.3
A181710	NHN	SW/SI	21,846	203	0.3
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	83,341	810	0.3
A009830	한화솔루션	화학	82,198	617	0.2
A204320	HL만도	자동차부품	26,061	201	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	11,636,743	19,413.3	-30,621	-313,016
A005930	삼성전자	반도체/장비	15,668,027	28,504.2	-13,889	-252,381
A009150	삼성전기	전자/부품	1,122,646	2,037.3	-4,414	431
A011070	LG이노텍	전자/부품	145,553	30.9	-981	-12,956
A240810	원익IPS	반도체/장비	58,901	647.6	-147	-1,062
A403870	HPSP	반도체/장비	33,908	220.5	-336	-2,245
A010060	OCI홀딩스	화학	51,903	307.7	-204	293
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	147,562	166.2	-225	-414
A307950	현대오트옵터	SW/SI	123,134	48.7	-292	150
A008770	호텔신라	호텔/레저	17,034	1.9	-299	-36

자료: 에프엔가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 8/13일 기준

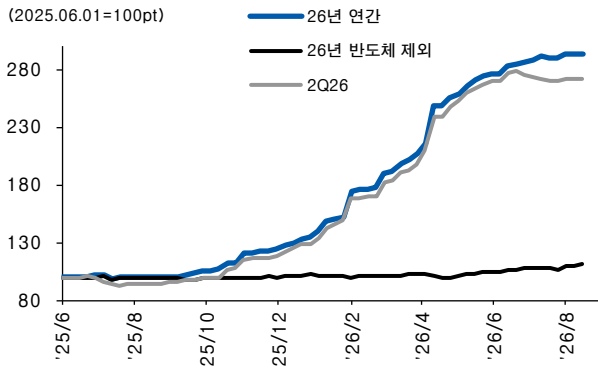
업종별

종목별

주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.1% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 +0.5% 상향 조정
- 이번주 가스(+9.6%) 업종의 경우 강도 높은 상향 조정이 나타났으며, 2차전지(+3.0%), 지주회사(+2.8%), SW/SI(+1.5%), 화장품(+1.5%) 업종 또한 상향 조정 진행

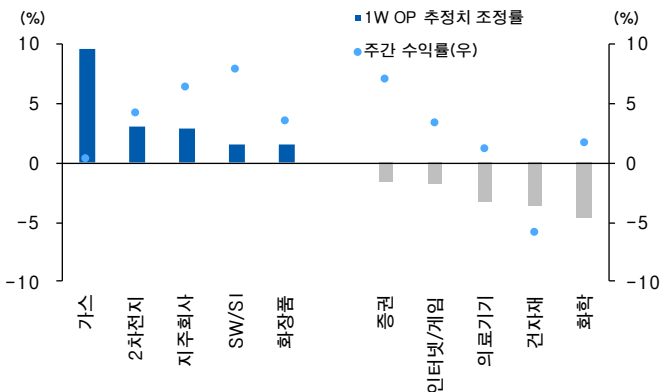
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

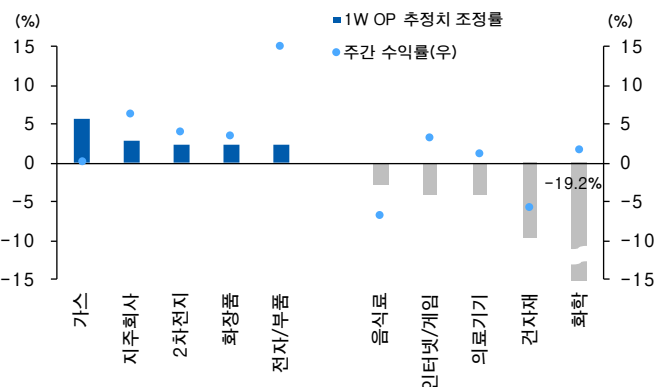


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	가스	30,188	9.6	0.3	
2	2차전지	12,979	3.0	4.1	
3	지주회사	426,672	2.8	6.3	
4	SW/SI	15,207	1.5	7.9	
5	화장품	26,190	1.5	3.5	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	40,790	-4.6	1.6	
2	전자재	1,770	-3.7	-5.9	
3	의료기기	5,439	-3.3	1.1	
4	인터넷/게임	62,877	-1.8	3.3	
5	증권	154,712	-1.6	6.9	

26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

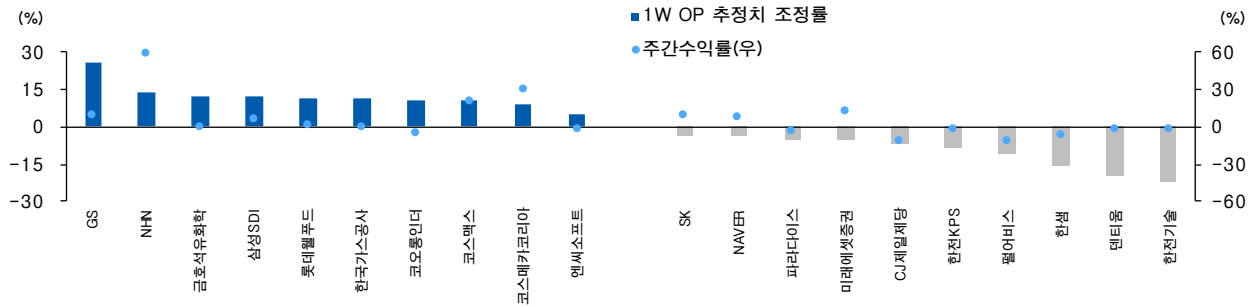
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	가스	5,835	5.8	0.3	
2	지주회사	103,688	2.7	6.3	
3	2차전지	4,005	2.4	4.1	
4	화장품	7,014	2.3	3.5	
5	전자/부품	22,956	2.3	14.9	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	7,053	-19.2	1.6	
2	전자재	368	-9.8	-5.9	
3	의료기기	1,397	-4.1	1.1	
4	인터넷/게임	14,966	-4.1	3.3	
5	음식료	14,711	-2.8	-6.7	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 8/12일 추정치 기준(수익률 8/13일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

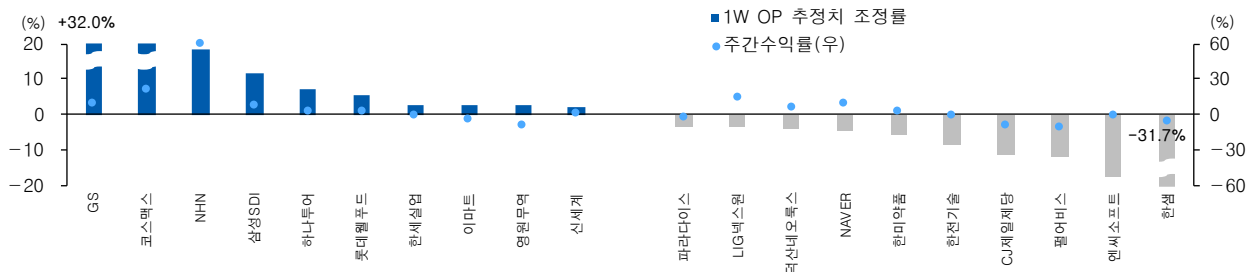


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A078930	GS	지주회사	49,465	25.9	8.6	1	A052690	한진기술	전기	642	-22.5	-2.1
2	A181710	NHN	SW/SI	2,041	13.5	59.6	2	A145720	덴티움	의료기기	694	-19.7	-1.6
3	A011780	금호석유화학	화학	5,526	12.6	-0.5	3	A009240	한샘	건자재	372	-15.5	-6.9
4	A006400	삼성SDI	2차전지	3,838	12.5	6.1	4	A263750	풀어비스	인터넷/게임	4,177	-10.9	-11.5
5	A280360	롯데웰푸드	음식료	2,145	11.9	2.0	5	A051600	한진KPS	전기	1,754	-8.6	-2.2
6	A036460	한국가스공사	가스	25,453	11.6	0.4	6	A097950	CJ제일제당	음식료	12,033	-6.8	-10.8
7	A120110	코오롱인더	화학	2,729	10.5	-4.9	7	A006800	미래에셋증권	증권	44,500	-5.7	12.2
8	A192820	코스맥스	화장품	2,568	10.4	21.2	8	A034230	파라다이스	호텔/레저	1,643	-5.6	-3.9
9	A241710	코스메카코리아	화장품	1,154	9.3	29.8	9	A035420	NAVER	인터넷/게임	22,284	-3.8	7.9
10	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	5,280	5.1	-2.0	10	A034730	SK	지주회사	74,450	-3.6	8.9

'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

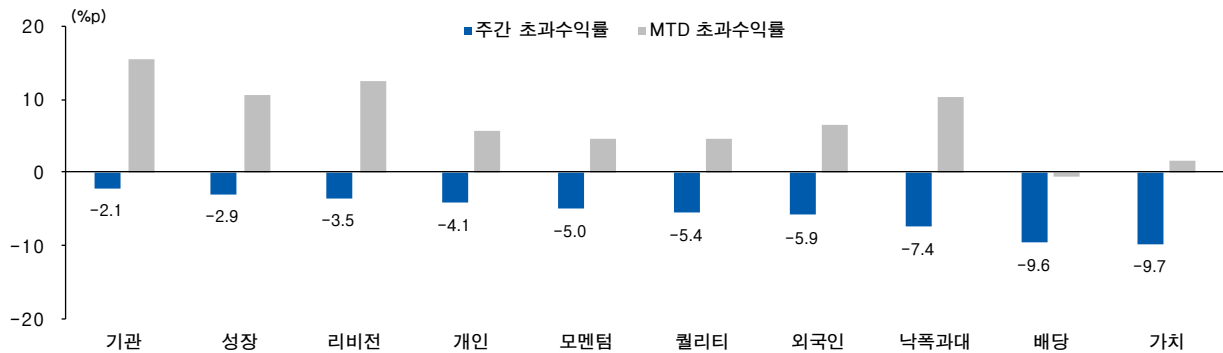
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A078930	GS	지주회사	11,431	32.0	8.6	1	A145720	덴티움	의료기기	118	-38.9	-1.6
2	A192820	코스맥스	화장품	684	22.6	21.2	2	A009240	한샘	건자재	86	-31.7	-6.9
3	A181710	NHN	SW/SI	557	18.4	59.6	3	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	912	-17.4	-2.0
4	A006400	삼성SDI	2차전지	1,065	11.8	6.1	4	A263750	풀어비스	인터넷/게임	751	-12.1	-11.5
5	A039130	하나투어	호텔/레저	107	7.0	1.4	5	A097950	CJ제일제당	음식료	3,444	-11.7	-10.8
6	A280360	롯데웰푸드	음식료	869	5.3	2.0	6	A052690	한진기술	전기	152	-8.5	-2.1
7	A105630	한세실업	섬유/의복	437	2.7	-2.1	7	A128940	한미약품	제약/바이오	516	-5.9	1.5
8	A139480	이마트	소매/유통	2,069	2.3	-4.3	8	A035420	NAVER	인터넷/게임	5,678	-5.0	7.9
9	A111770	영원무역	섬유/의복	2,223	2.3	-9.3	9	A247540	에코프로비엠	2차전지	176	-4.9	7.0
10	A004170	신세계	소매/유통	1,847	2.2	-0.1	10	A213420	덕산네오룩스	디스플레이	267	-4.1	5.4

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 8/12일 추정치 기준(수익률 8/13일 기준)

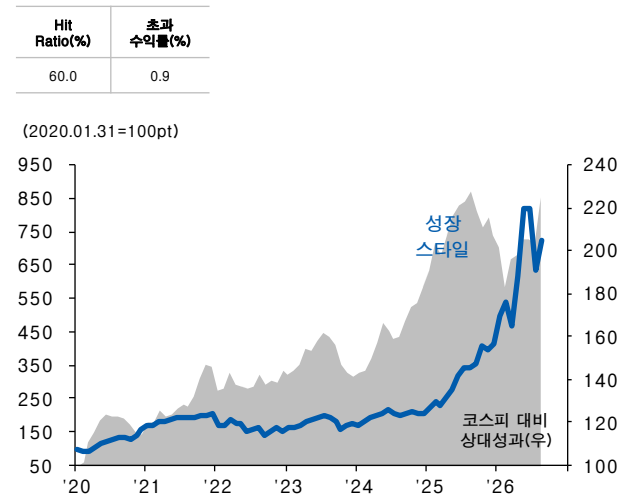
업종별

종목별

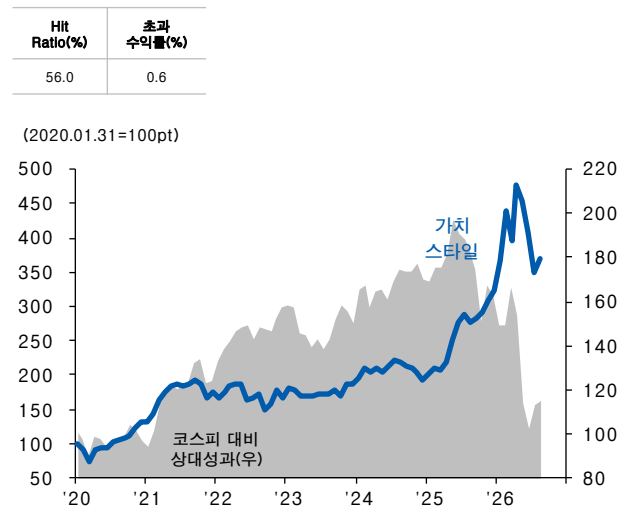
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이



가치 스타일 성과 추이



성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.5	9.3	9.2	28.0	16.0
A267270	HD건설기계	9.4	9.2	8.9	27.6	1.0
A353200	대덕전자	8.8	9.4	9.0	27.2	8.9
A009150	삼성전기	8.7	9.4	9.0	27.1	17.6
A010120	LS ELECTRIC	8.6	8.3	8.3	25.3	6.5
A298020	효성티앤씨	6.0	8.6	9.3	24.0	-4.7
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.2	23.8	3.9
A195870	해성디에스	8.1	7.8	7.5	23.4	10.8
A329180	HD현대중공업	7.1	8.2	8.0	23.4	-2.0
A068270	셀트리온	8.5	7.7	6.9	23.2	1.4

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	-5.9
A000370	한화손해보험	10.0	9.6	9.8	29.4	8.8
A108670	LX하우시스	9.9	9.5	9.8	29.2	-2.8
A088350	한화생명	9.3	9.8	9.8	28.8	10.4
A036460	한국가스공사	8.7	9.7	9.9	28.2	0.4
A006650	대한유화	9.1	9.6	9.3	28.0	-5.5
A097950	CJ제일제당	8.9	9.2	9.6	27.7	-10.8
A001450	현대해상	9.8	8.4	9.5	27.7	9.3
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.5	27.5	-7.0
A000120	CJ대한통운	8.4	9.4	9.4	27.3	-6.3

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 8/13일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

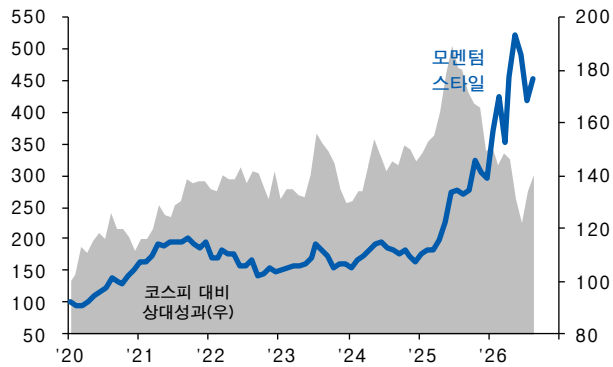
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

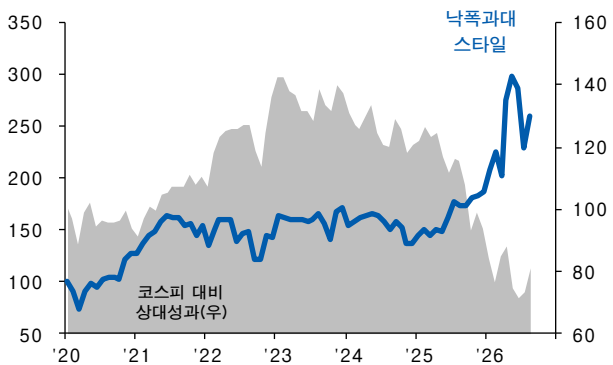
(2020.01.31=100pt)



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.3	-0.3

(2020.01.31=100pt)



모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A073240	금호타이어	10.0	9.7	8.5	8.3	36.4	4.2
A078930	GS	9.9	9.0	8.9	8.7	36.4	8.6
A001450	현대해상	9.0	9.8	9.1	7.8	35.6	9.3
A010950	S-Oil	9.7	7.6	8.4	9.1	34.7	2.4
A089860	롯데렌탈	9.9	9.4	8.8	6.5	34.6	5.2
A161390	한국타이어엔테크놀로지	8.8	9.3	7.2	8.2	33.4	1.4
A105560	KB금융	8.1	8.7	8.5	8.2	33.4	-4.4
A086790	하나금융지주	8.9	8.0	8.6	7.9	33.3	-2.7
A018260	삼성에스디에스	8.6	9.6	8.3	6.9	33.3	7.0
A000810	삼성화재	7.0	9.9	8.7	7.7	33.2	-5.3

낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A361610	SK아이이테크놀로지	7.5	9.4	9.6	9.3	35.8	6.0
A064350	현대로템	8.3	9.4	9.1	7.3	34.0	0.5
A032350	롯데관광개발	7.6	8.8	9.7	7.8	33.8	-1.7
A034230	파라다이스	8.8	8.0	9.3	7.3	33.3	-3.9
A352820	하이브	6.6	7.5	9.8	9.2	33.0	-4.6
A376300	디어유	5.0	7.9	9.5	10.0	32.4	0.7
A035760	CJ ENM	3.9	8.6	10.0	9.8	32.2	-2.4
A035900	JYP Ent.	7.1	6.9	8.9	8.8	31.6	-12.7
A122870	와이지엔터	5.8	6.5	9.6	9.8	31.5	-4.5
A011790	SKC	9.1	8.0	8.3	6.0	31.4	9.9

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 8/13일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

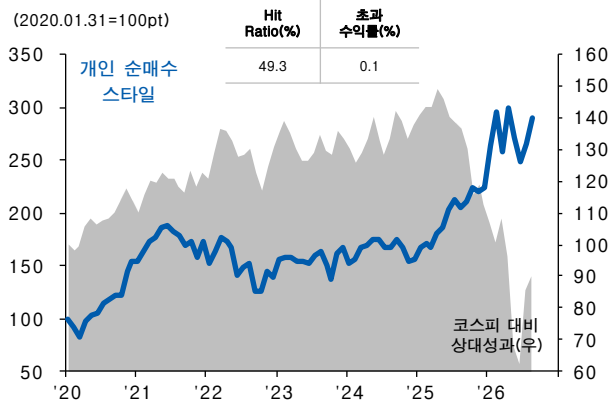
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

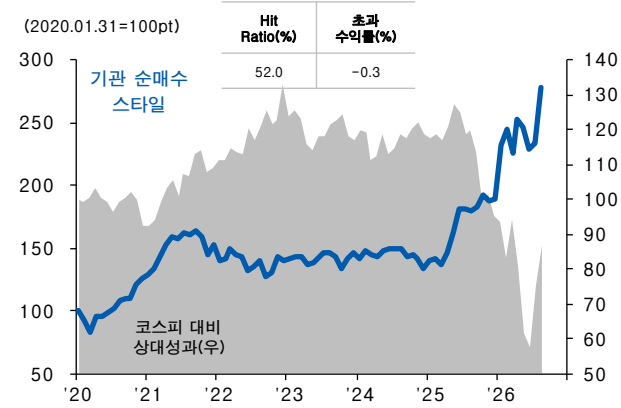


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A035760	CJ ENM	8.5	9.6	9.9	9.5	37.4	-2.4
A039130	하나투어	8.2	9.5	9.6	9.9	37.2	1.4
A010120	LS ELECTRIC	9.0	9.1	9.6	9.0	36.6	6.5
A042660	한화오션	9.3	9.0	9.0	9.1	36.4	1.5
A403870	HPSP	10.0	9.7	9.1	7.6	36.3	19.8
A011790	SKC	6.2	9.9	9.7	9.7	35.4	9.9
A000660	SK하이닉스	9.3	9.1	8.5	8.4	35.2	12.0
A361610	SK아이이테크놀로지	8.6	8.5	8.8	8.6	34.4	6.0
A114090	GKL	8.8	7.1	9.0	9.1	33.9	-2.5
A010140	삼성중공업	6.6	9.4	9.2	8.5	33.7	-0.2

기관 순매수 스타일 성과 추이

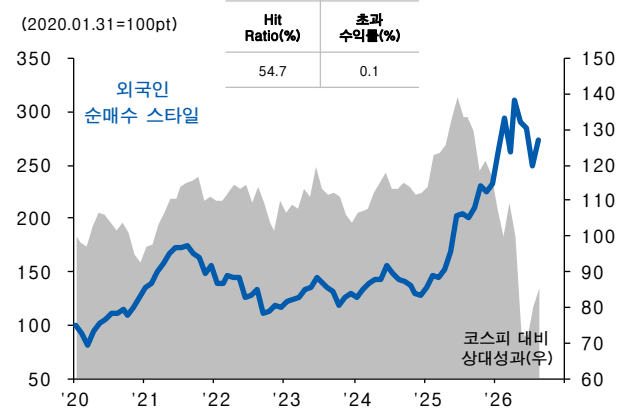


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A007660	이수페타시스	10.0	10.0	10.0	9.8	39.6	17.6
A222800	심텍	9.5	9.9	9.9	10.0	39.2	-3.8
A214450	파마리서치	9.9	9.9	9.5	9.3	38.6	12.4
A353200	대덕전자	9.1	9.5	9.7	9.5	37.6	8.9
A008770	호텔신라	8.6	9.7	9.8	9.5	37.6	1.6
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.6	9.1	8.9	37.4	40.3
A010060	OCI홀딩스	9.2	9.1	9.6	9.4	37.3	2.0
A047810	한국항공우주	9.2	9.6	8.6	9.2	36.6	-1.9
A138930	BNK금융지주	8.0	9.2	9.0	9.1	35.3	-2.0
A336260	두산퓨얼셀	5.8	9.7	9.9	9.9	35.2	24.7

외국인 순매수 스타일 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A004170	신세계	9.9	9.8	9.9	9.8	39.3	-0.1
A183300	코미코	9.7	9.9	10.0	9.8	39.3	0.0
A195870	해성디에스	9.8	9.4	9.8	9.9	38.8	10.8
A120110	코오롱인더	9.1	9.9	9.6	9.4	37.9	-4.9
A064350	현대로템	9.2	9.5	9.4	9.5	37.6	0.5
A023530	롯데쇼핑	9.5	9.6	8.7	8.1	35.8	-0.2
A140860	파크시스템스	9.4	9.6	9.7	7.0	35.6	12.8
A011210	현대위아	9.0	9.2	8.8	8.1	35.1	5.9
A006650	대한유화	8.7	9.7	6.9	9.2	34.4	-5.5
A001040	CJ	9.1	8.1	7.2	9.0	33.3	-5.6

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 8/13일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

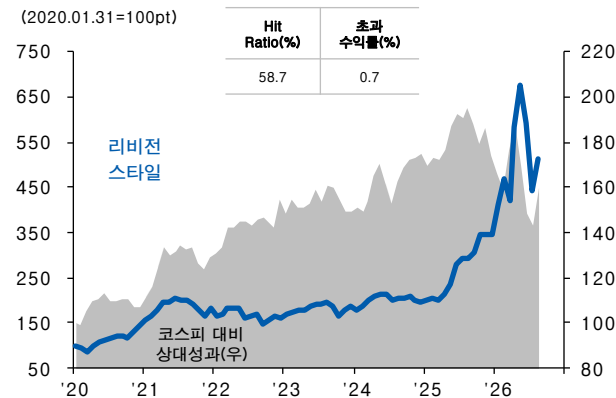
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

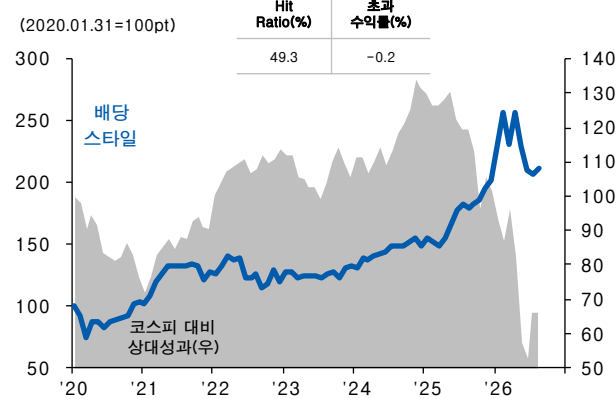


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.3	9.8	8.9	27.9	-3.4
A267270	HD건설기계	8.6	8.8	8.6	26.1	1.0
A096770	SK이노베이션	5.3	9.7	9.5	24.5	1.2
A108670	LX하우시스	8.1	9.5	6.4	23.9	-2.8
A195870	해성디에스	9.4	9.0	5.5	23.9	10.8
A016360	삼성증권	6.5	8.6	8.1	23.2	1.6
A353200	대덕전자	7.7	7.9	7.6	23.1	8.9
A011070	LG이노텍	8.1	8.1	6.3	22.4	11.4
A006800	미래에셋증권	4.3	9.3	8.5	22.1	12.2
A009150	삼성전기	8.1	8.7	5.2	22.0	17.6

배당 스타일 성과 추이

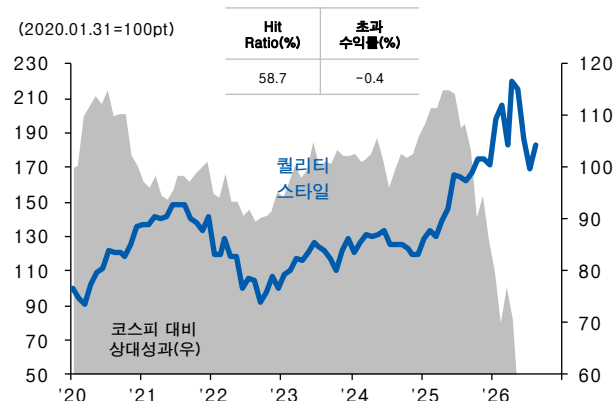


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.8	9.8	9.4	9.8	37.9	-2.4
A005940	NH투자증권	8.0	9.4	9.9	9.9	37.1	2.0
A214320	이노션	8.3	9.9	9.3	9.6	37.1	-2.4
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.5	9.6	9.7	37.0	-0.5
A035250	강원랜드	8.7	9.8	8.5	9.8	36.8	-2.4
A017670	SK텔레콤	9.4	9.3	9.2	8.1	35.9	3.3
A032640	LG유플러스	8.4	9.5	9.1	8.8	35.7	-1.7
A023530	롯데쇼핑	9.8	9.2	8.6	7.9	35.5	-0.2
A024110	기업은행	6.0	9.7	9.9	9.3	34.9	-3.6
A016360	삼성증권	6.9	8.8	9.4	9.9	34.9	1.6

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.1	9.9	9.9	9.4	38.3	19.8
A058470	리노공업	9.8	9.8	9.7	8.9	38.1	8.5
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	37.9	12.0
A042700	한미반도체	9.6	8.7	9.5	9.6	37.4	17.5
A214150	클래시스	8.3	9.7	9.6	9.2	36.8	-13.5
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.6	9.6	36.6	2.6
A145020	휴젤	9.9	9.5	9.3	7.6	36.3	-4.0
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.1	35.7	12.4
A376300	디어유	9.7	9.5	9.4	6.9	35.5	0.7
A383220	F&F	8.2	9.1	9.1	8.7	35.1	2.7

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 8/13일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

수급

기타

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 제3자에게 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 투자사결정은 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.