1. 목표

PER, PBR, dividend yield를 가지고 코스피+코스닥 전체에 대해서 분류를 하다보니, 섹터의 특성을 고려하지 못했다고 생각이 되었다. 따라서 섹터별로 따로 팩터들을 표준화 시켜서 점수를 매겨보았는데 성과는 더 나빠졌다. 그 이유는 코스피+코스닥 전체에서 저평가된 종목들을 고르는 경우 섹터 특성상 고평가 되어있는 섹터 전체가 빠지는 경우가 생기는데 섹터별로 스코어링을 하는 경우 항상 모든 팩터가 포함(확인해볼 것)되는 경우가 발생. ?

모멘텀 섹터 찾아보았다 -> 섹터별 비중을 정해보는거…