YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

12월 2주차 산타 랠리 스크리닝

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

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 스크리닝

산타 랠리 스크리닝

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/ETF Analyst

02 3770 3634

hyunyong.shin@yuantakorea.com

산타 랠리 스크리닝 (참고 자료: 산타의 썰매는 KOSDAQ이 끈다)

1) 12월이 되면 계속해서 언급되는 "산타 랠리"는 증시 이상현상(Market Anomaly) 중 월말/월초 단기적으로 유동성이 집중되며 초과 수익 기회가 확대된다는 내용의 월바뀜 현상의 연장선

2) '00년 이후 백 테스팅 결과 12월 KOSDAQ 지수가 유의미한 월바뀜 현상이 발생할 확률(약 76%)을 기록. KOSPI 지수는 매월 50% 내외 수준의 확률을 기록하며 뚜렷한 월바뀜 현상, 혹은 12월 산타 랠리가 높은 빈도로 나타났다고 보기 어려움

3) 또한, 올해 대형 주도주 중심의 상승장이 장기 지속되며 대형주 대비 중소형주, KOSPI 대비 KOSDAQ 지수의 성과 괴리가 역사적 수준까지 확대. 정부의 KOSDAQ 활성화 방안, 산타 랠리 등 중소형주 및 KOSDAQ 종목의 강세로 전환될 가능성이 높은 상황. 해당 국면 이익 리비전 상위와 거래대금이 집중되는 종목이 견조한 성과를 기록

[12월 2주차] KOSPI 중소형주 및 KOSDAQ 대상 이익 리비전 스코어 상위 30% + 60일 누적 거래대금(시총대비) 상위 30%

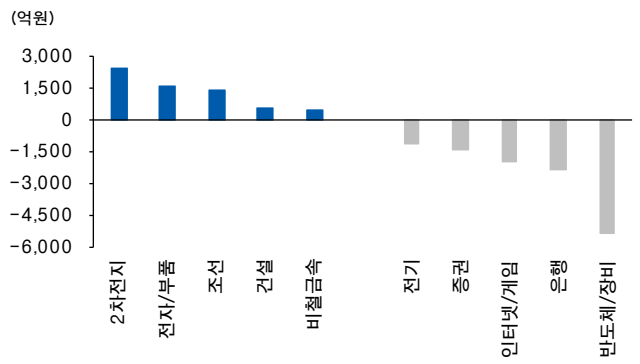
종목코드	종목명	시장 구분	시가총액	60일 누적 거래대금 (억원)	영업이익 추정치 월간 조정률		순이익 추정치 월간 조정률	
					12MF(%)	'26년 연간(%)	12MF(%)	'26년 연간(%)
A062040	산일전기	KS	45,363	56,057	6.3	3.9	4.3	2.0
A039030	이오테크닉스	KQ	33,386	19,904	7.5	4.6	6.3	2.8
A240810	원익IPS	KQ	30,236	23,990	8.3	4.7	10.2	6.4
A103590	일진전기	KS	27,085	37,066	10.0	8.2	14.1	12.1
A257720	실리콘투	KQ	25,203	21,137	3.2	1.0	3.5	1.3
A353200	대덕전자	KS	23,745	46,285	10.4	4.2	7.5	1.8
A009420	한올바이오파마	KS	26,904	21,407	25.7	18.4	29.4	21.2
A089030	테크윙	KQ	16,026	27,905	10.9	3.0	9.6	2.3
A067310	하나마이크론	KQ	16,263	30,876	18.9	15.5	13.0	5.7
A458870	씨어스테크놀로지	KQ	14,908	11,677	94.7	85.1	98.9	89.3
A032350	롯데관광개발	KS	18,374	16,736	8.8	6.4	17.5	8.1
A017960	한국카본	KS	15,261	9,202	13.8	13.5	4.8	4.4
A290650	엘앤씨바이오	KQ	16,322	32,094	64.8	51.2	114.9	57.2
A319660	피에스케이	KQ	9,501	9,314	5.5	4.1	10.7	9.6
A195870	해성디에스	KS	8,806	8,249	10.2	5.6	9.1	4.0
A131970	두산테스나	KQ	8,378	8,539	18.8	8.3	16.0	5.9
A100840	SNT에너지	KS	8,396	6,164	12.8	11.3	11.1	8.9
A166090	하나머티리얼즈	KQ	8,613	7,696	29.4	26.9	28.4	25.9
A356860	티엘비	KQ	6,303	21,354	16.6	12.7	15.8	11.7
A006730	서부T&D	KQ	9,206	6,085	7.9	6.5	13.5	11.2
A060250	NHN KCP	KQ	6,261	17,150	5.7	4.5	4.9	3.5
A089970	브이엠	KQ	7,128	8,648	10.3	4.7	11.0	5.1
A090460	비에이치	KS	6,294	6,169	8.1	3.2	7.6	1.7
A425420	티에프이	KQ	4,713	4,953	12.3	8.4	14.4	10.3
A010170	대한광통신	KQ	3,115	18,420	23.3	6.3	173.4	79.3

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주) 12/11일 기준 이익 리비전 스코어 = 12MF 및 FY1 영업이익/순이익 월간 조정률 스코어

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +1.1조원 순매수, 기관은 약 -1.3조원 순매도. 외국인이 지난주 약 +2.0조원 순매수에 이어 이번주 강도 높은 순매수세를 나타낸 반면 기관은 순매도 전환
- 순매수/매도 상위에 스크리닝된 업종 중 기관과 외국인의 수급 방향이 일치하는 업종이 확인되지 않으며 두 수급 주체의 방향성이 대체로 엇갈린 모습

기관 주간 순매수 상/하위 업종

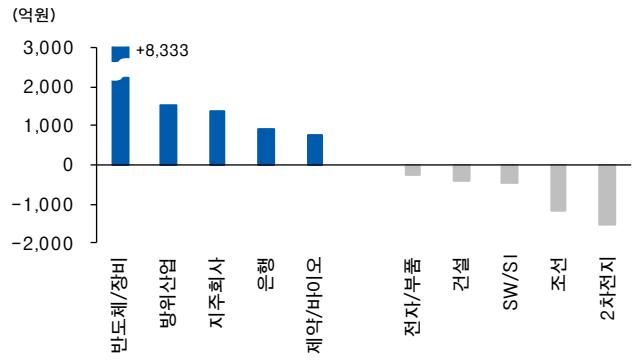


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	2,397	3,323	13,651	
2	전자/부품	1,537	3,493	5,103	
3	조선	1,405	1,176	270	
4	건설	489	2,292	1,229	
5	비철금속	462	1,639	1,785	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-5,346	13,286	62,042	
2	은행	-2,382	6,316	17,419	
3	인터넷/게임	-2,008	-4,802	-3,013	
4	증권	-1,450	-1,532	-77	
5	전기	-1,172	-605	-1,128	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

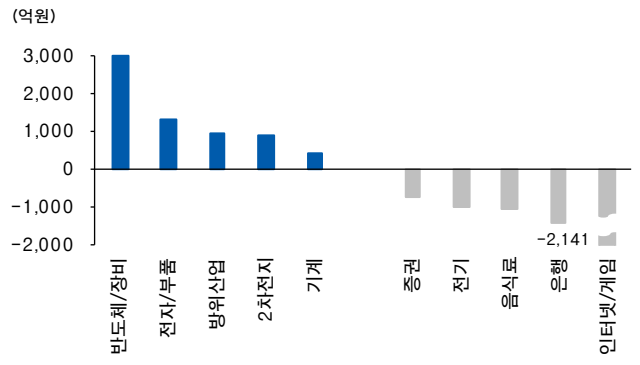


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	8,333	-29,312	-32,947	
2	방위산업	1,523	-631	-5,079	
3	지주회사	1,346	2,506	10,455	
4	은행	933	-6,972	-15,920	
5	제약/바이오	781	3,545	7,257	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	-1,522	-2,821	2,316	
2	조선	-1,200	-1,134	-6,228	
3	SW/SI	-457	263	1,023	
4	건설	-432	524	-1,897	
5	전자/부품	-244	1,117	14,192	

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	2,986	-16,026	29,094	
2	전자/부품	1,293	4,610	19,295	
3	방위산업	912	-602	-5,260	
4	2차전지	874	502	15,967	
5	기계	394	-2,575	-4,674	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	-2,141	-7,893	-14,204	
2	은행	-1,449	-656	1,499	
3	음식료	-1,077	834	-6,315	
4	전기	-1,044	1,400	4,624	
5	증권	-740	-1,878	-4,574	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 12/11일 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A007660	이수페타시스	전자/부품	108,792	1,995	1.87
A034230	파라다이스	호텔/레저	16,541	227	1.38
A004170	신세계	소매/유통	24,692	218	0.91
A237690	에스티팜	제약/바이오	26,767	197	0.75
A000720	현대건설	건설	81,958	579	0.71
A112610	씨에스윈드	기계	19,040	133	0.71
A066970	엘앤에프	2차전지	50,368	293	0.57
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	18,374	98	0.54
A307950	현대오토에버	SW/SI	81,998	359	0.44
A294870	HDC현대산업개발	건설	13,972	47	0.36

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A353200	대덕전자	전자/부품	23,745	295	1.22
A145720	덴티움	의료기기	5,507	62	1.12
A039130	하나투어	호텔/레저	7,551	82	1.08
A267270	HD현대건설기계	기계	18,330	146	0.84
A042670	HD현대인프라코어	기계	31,028	217	0.74
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	18,374	125	0.69
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	9,870	66	0.66
A006280	녹십자	제약/바이오	17,658	105	0.65
A090460	비에이치	전자/부품	6,294	41	0.65
A006650	대한유화	화학	9,451	60	0.64

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A007660	이수페타시스	전자/부품	108,792	1,444	1.4
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	18,374	223	1.2
A112610	씨에스윈드	기계	19,040	200	1.1
A267270	HD현대건설기계	기계	18,330	160	0.9
A237690	에스티팜	제약/바이오	26,767	215	0.8
A247540	에코프로비엠	2차전지	169,979	1,407	0.8
A042670	HD현대인프라코어	기계	31,028	223	0.8
A090460	비에이치	전자/부품	6,294	39	0.6
A006280	녹십자	제약/바이오	17,658	84	0.5
A195870	해성디에스	반도체/장비	8,806	43	0.5

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	4,113,213	9,858.0	-21,571	-83,816
A012450	한화에어로스페이스	방위산업	466,133	917.7	-534	-2,592
A207940	삼성바이오로직스	제약/바이오	772,596	299.7	-340	1,104
A064350	현대로템	기계	195,583	63.4	-486	-343
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	197,461	201.9	-236	1,167
A000880	한화	지주회사	61,466	13.5	-334	-345
A267270	HD현대건설기계	기계	18,330	159.7	-7	-171
A361610	SK아이이테크놀로지	2차전지	24,618	25.9	-109	-16
A011200	HMM	해운	192,421	20.5	-94	-2,424
A114090	GKL	호텔/레저	8,746	27.1	-9	-42

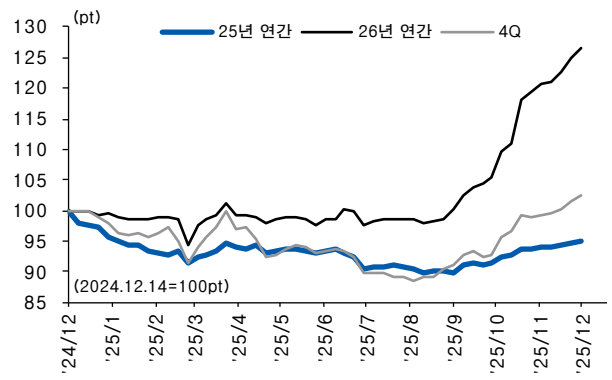
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 12/11일 기준

업종별 | 종목별

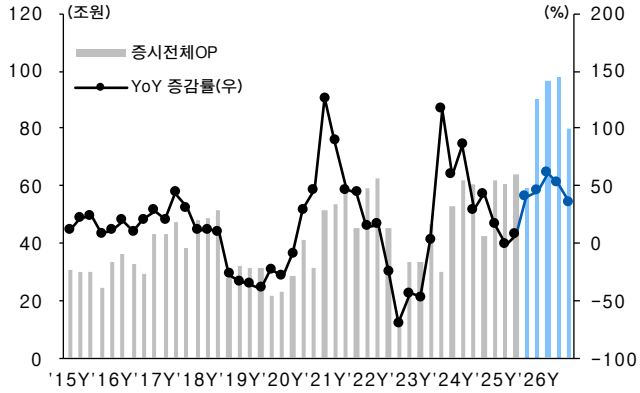
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 기준 '25년 연간 +0.3%, '26년 연간 +1.4% 수준의 상향조정이 진행되며 우상향 흐름 지속
- 월간 기준 반도체/장비(+10.6%), 정유(+9.2%), 비철금속(+6.4%), 지주회사(+4.1%), 디스플레이(+4.1%) 업종이 영업이익 추정치 조정률 상위에 스크리닝

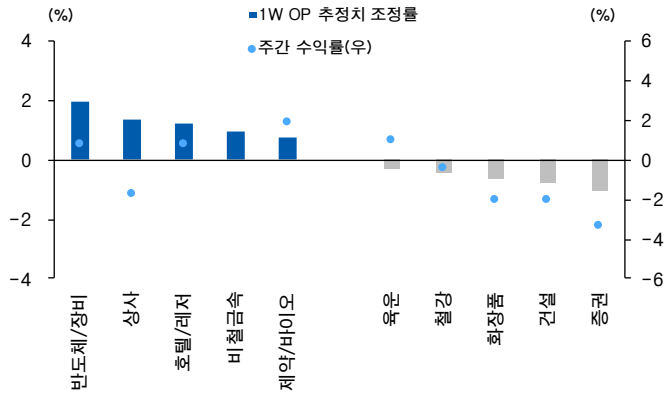
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

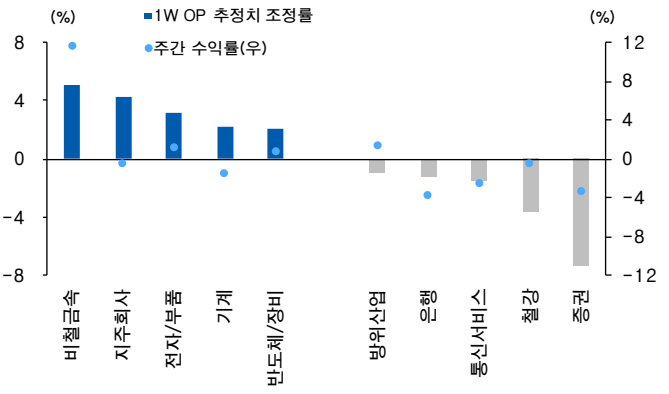


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	반도체/장비	1,684,990	2.0	0.8	
2	상사	17,076	1.4	-1.8	
3	호텔/레저	9,798	1.3	0.8	
4	비철금속	14,954	1.0	11.6	
5	제약/바이오	55,916	0.8	1.9	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	증권	80,965	-1.1	-3.4	
2	건설	36,251	-0.8	-2.0	
3	화장품	25,466	-0.7	-2.0	
4	철강	43,934	-0.5	-0.5	
5	육운	27,715	-0.3	1.0	

25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

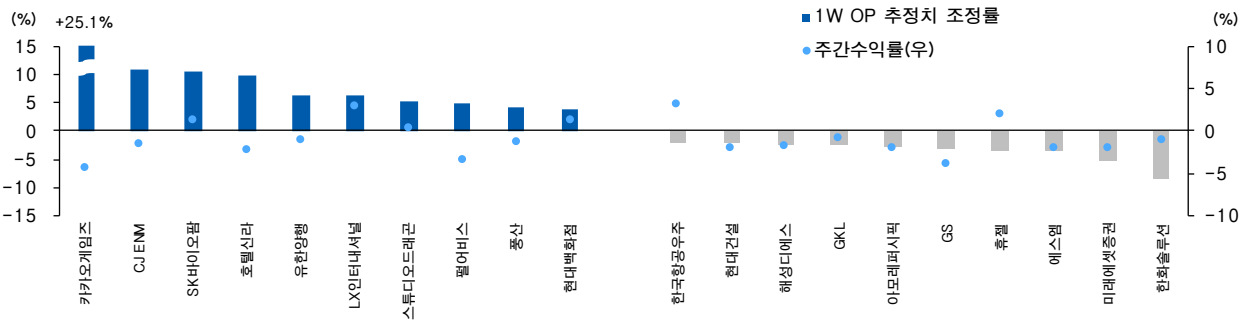
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	4,109	5.1	11.6	
2	지주회사	62,004	4.2	-0.4	
3	전자/부품	6,591	3.2	1.1	
4	기계	17,263	2.2	-1.5	
5	반도체/장비	315,450	2.1	0.8	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	증권	14,627	-7.4	-3.4	
2	철강	6,944	-3.7	-0.5	
3	통신서비스	7,184	-1.5	-2.6	
4	은행	47,347	-1.2	-3.7	
5	방위산업	14,838	-1.0	1.3	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 12/10일 기준 추정치 (수익률 12/11일 기준)

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



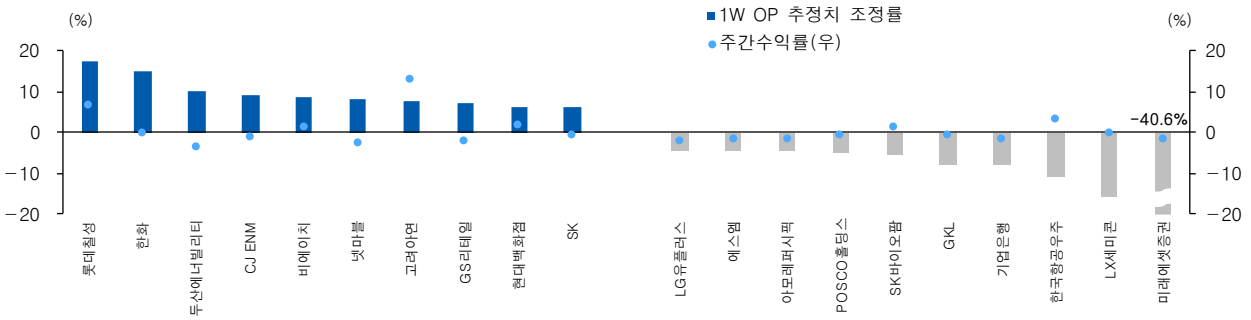
연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A293490	카카오게임즈	인터넷/게임	763	25.1	-4.5
2	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	1,958	11.0	-1.4
3	A326030	SK바이오팜	제약/바이오	3,580	10.5	1.3
4	A008770	호텔신라	호텔/레저	1,465	9.8	-2.2
5	A000100	유한양행	제약/바이오	2,100	6.5	-1.1
6	A001120	LX인터내셔널	상사	3,905	6.3	2.9
7	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	572	5.4	0.4
8	A263750	펄어비스	인터넷/게임	1,913	5.1	-3.5
9	A103140	풍산	비철금속	3,519	4.3	-1.4
10	A069960	현대백화점	소매/유통	4,535	3.7	1.4

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A009830	한화솔루션	화학	5,549	-8.5	-1.1
2	A006800	미래에셋증권	증권	13,994	-5.3	-2.1
3	A041510	에스엠	미디어/엔터	1,959	-3.6	-2.1
4	A145020	휴젤	제약/바이오	2,260	-3.4	2.0
5	A078930	GS	지주회사	27,805	-3.3	-3.9
6	A090430	아모레퍼시픽	화장품	4,428	-3.0	-2.0
7	A114090	GKL	호텔/레저	799	-2.5	-0.8
8	A195870	해성디에스	반도체/장비	851	-2.4	-1.9
9	A000720	현대건설	건설	8,190	-2.2	-2.0
10	A047810	한국항공우주	방위산업	4,782	-2.2	3.2

4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

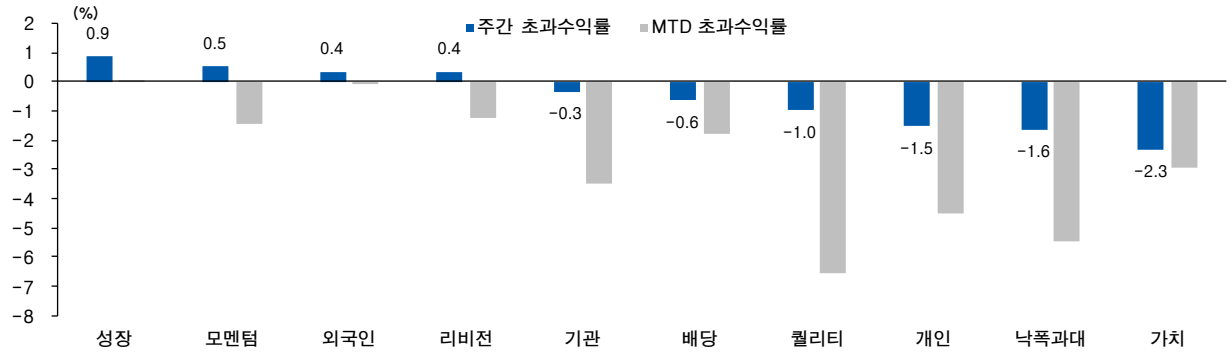
(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A005300	롯데칠성	음식료	139	17.3	6.5
2	A000880	한화	지주회사	13,032	14.8	-0.4
3	A034020	두산에너빌리티	기계	4,067	10.1	-3.9
4	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	529	9.1	-1.4
5	A090460	비에이치	전자/부품	246	8.8	1.2
6	A251270	넷마블	인터넷/게임	1,104	8.0	-3.1
7	A010130	고려아연	비철금속	3,248	7.9	13.0
8	A007070	GS리테일	소매/유통	642	7.1	-2.2
9	A069960	현대백화점	소매/유통	1,329	6.4	1.4
10	A034730	SK	지주회사	5,699	6.0	-0.9

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006800	미래에셋증권	증권	1,722	-40.6	-2.1
2	A108320	LX세미콘	디스플레이	256	-15.8	-0.2
3	A047810	한국항공우주	방위산업	1,087	-10.8	3.2
4	A024110	기업은행	은행	6,725	-8.0	-1.9
5	A114090	GKL	호텔/레저	150	-7.9	-0.8
6	A326030	SK바이오팜	제약/바이오	546	-5.7	1.3
7	A005490	POSCO홀딩스	철강	5,154	-4.9	-1.0
8	A090430	아모레퍼시픽	화장품	987	-4.7	-2.0
9	A041510	에스엠	미디어/엔터	434	-4.6	-2.1
10	A032640	LG유플러스	통신서비스	2,170	-4.6	-2.4

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 12/10일 기준 추정치(수익률 12/11일 기준)

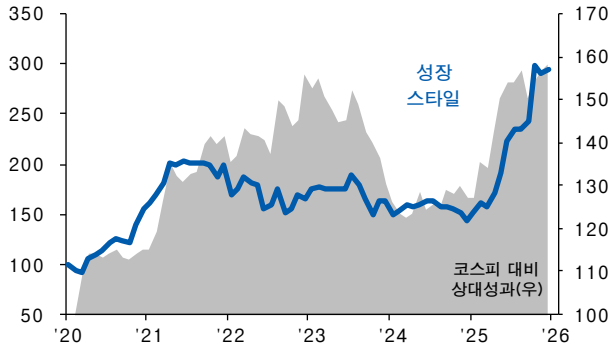
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
50.0	0.7

(2020.01.31=100pt)



성장 스코어 Top 10

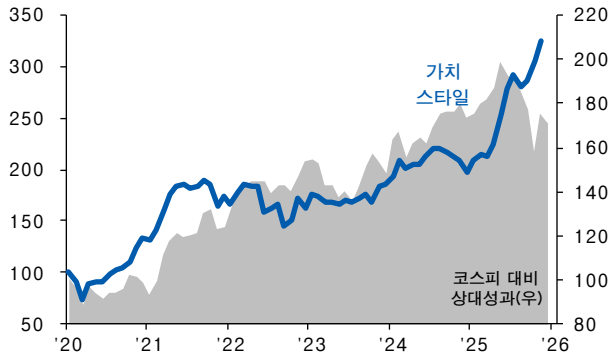
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A298040	효성중공업	8.7	9.0	8.7	26.4	-1.7
A064350	현대로템	8.7	8.4	7.6	24.7	-1.3
A278470	에이피알	9.7	9.2	5.2	24.0	-0.1
A012510	더존비즈온	8.0	7.7	8.2	23.8	-5.3
A010130	고려아연	8.8	7.2	7.1	23.1	12.5
A267260	HD현대일렉트릭	8.0	7.5	7.4	23.0	1.7
A005930	삼성전자	7.3	8.3	7.1	22.7	-1.0
A267250	HD현대	6.1	8.3	7.6	22.0	-2.5
A161390	한국타이어앤테크놀로지	8.3	6.5	7.1	22.0	-5.7
A007660	이수페타시스	9.3	9.0	3.1	21.5	9.3

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
59.7	0.7

(2020.01.31=100pt)



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

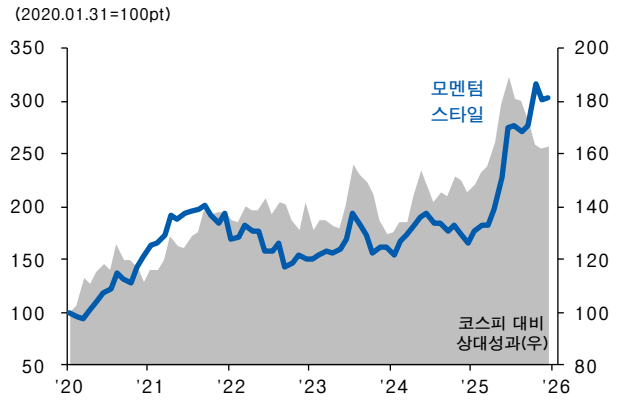
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.5	-2.3
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	-2.1
A036460	한국가스공사	9.8	9.7	9.8	29.2	-2.4
A011170	롯데케미칼	10.0	9.8	9.3	29.1	-0.7
A108670	LX하우시스	9.1	9.5	9.9	28.4	-2.2
A139480	이마트	8.4	9.9	10.0	28.2	-3.9
A001450	현대해상	9.9	8.5	9.7	28.1	-4.1
A023530	롯데쇼핑	8.6	10.0	9.4	28.0	-2.3
A001120	LX인터내셔널	8.9	9.1	10.0	27.9	2.9
A139130	iM금융지주	9.4	9.3	8.9	27.6	-4.4

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

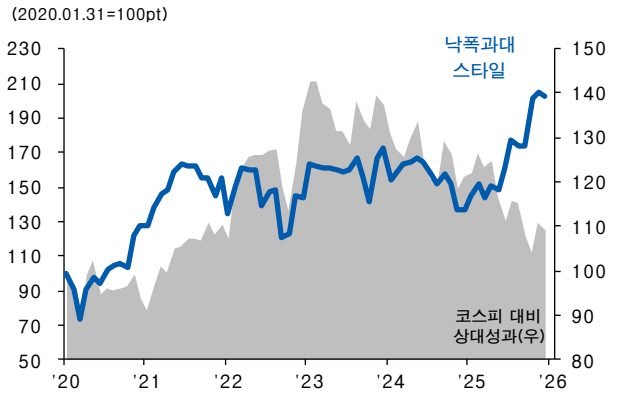
모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
47.2	0.7



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.8	0.1



모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A007660	이수페타시스	9.7	10.0	10.0	10.0	39.5	9.3
A353200	대덕전자	9.8	9.9	9.9	9.7	39.2	-0.3
A015760	한국전력	9.6	8.9	8.8	8.8	36.0	-6.7
A058470	리노공업	9.2	9.2	8.6	8.9	35.8	-1.4
A111770	영원무역	10.0	9.4	7.7	8.7	35.8	-1.5
A010120	LS ELECTRIC	7.4	9.7	9.1	9.6	35.7	-3.4
A020150	롯데에너지머티리	9.9	9.2	8.9	7.0	35.0	-8.6
A161390	한국타이어앤테크	9.9	9.4	8.3	7.2	34.6	-5.7
A009150	삼성전기	6.3	9.5	9.5	9.0	34.3	2.5
A181710	NHN	8.9	8.2	8.9	8.1	34.0	-8.6

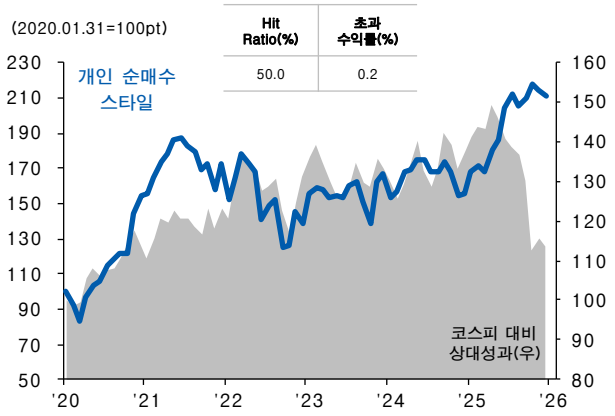
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A272450	진에어	7.2	9.6	9.8	9.8	36.3	3.0
A145020	휴젤	8.8	9.9	9.9	7.6	36.1	2.1
A078340	컴투스	7.7	9.5	9.5	9.2	35.9	-2.5
A259960	크래프톤	7.0	9.7	9.9	9.0	35.6	-2.4
A089590	제주항공	6.3	9.5	9.6	9.8	35.2	0.9
A241590	화승엔터프라이즈	5.1	9.8	10.0	9.9	34.8	-2.6
A145720	덴티움	7.6	8.7	9.1	9.5	34.8	-2.5
A067160	SOOP	6.2	8.9	9.7	9.3	34.1	-2.8
A161890	한국콜마	9.1	9.3	9.7	5.9	34.0	-2.6
A097950	CJ제일제당	7.8	8.5	8.7	9.0	34.0	-3.6

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

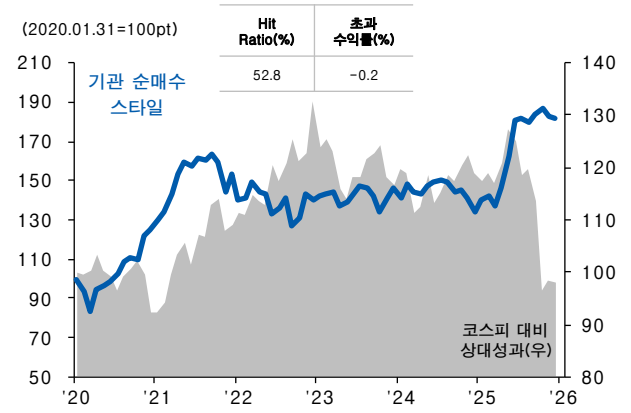


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A097950	CJ제일제당	9.7	9.7	9.9	10.0	39.2	-3.6
A161890	한국콜마	9.4	9.6	10.0	9.6	38.5	-2.6
A192820	코스맥스	9.8	9.1	9.9	9.3	38.0	-1.6
A103140	풍산	9.6	9.9	9.4	9.2	38.0	-1.4
A035900	JYP Ent.	10.0	9.9	9.8	8.2	37.8	-1.2
A035420	NAVER	9.7	8.5	9.7	9.5	37.3	-2.4
A005070	코스모신소재	9.0	9.1	9.5	9.9	37.3	3.1
A051900	LG생활건강	8.4	9.5	9.6	9.5	36.9	-5.0
A036570	엔씨소프트	9.2	9.4	8.6	9.1	36.2	-9.1
A272450	진에어	7.9	9.0	9.4	9.9	36.1	3.0

기관 순매수 스타일 성과 추이

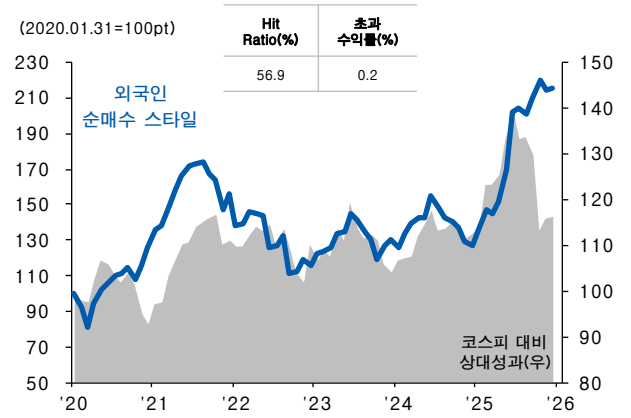


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A353200	대덕전자	9.7	9.9	9.9	9.9	39.4	-0.3
A240810	원익IPS	9.4	10.0	9.9	9.8	38.9	-0.3
A020150	롯데에너지머티	9.9	9.7	9.5	9.2	38.3	-8.6
A034230	파라다이스	9.0	9.3	9.8	10.0	38.1	2.6
A032350	롯데관광개발	9.6	9.2	9.5	9.7	37.9	8.4
A120110	코오롱인더	9.9	9.6	9.1	9.1	37.6	0.8
A069960	현대백화점	9.8	9.1	9.0	9.5	37.4	1.6
A195870	해성디에스	8.7	9.9	9.6	9.0	37.1	-1.9
A004170	신세계	10.0	9.5	7.9	9.6	36.8	5.8
A047810	한국항공우주	9.8	9.4	8.8	8.3	36.2	3.2

외국인 순매수 스타일 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

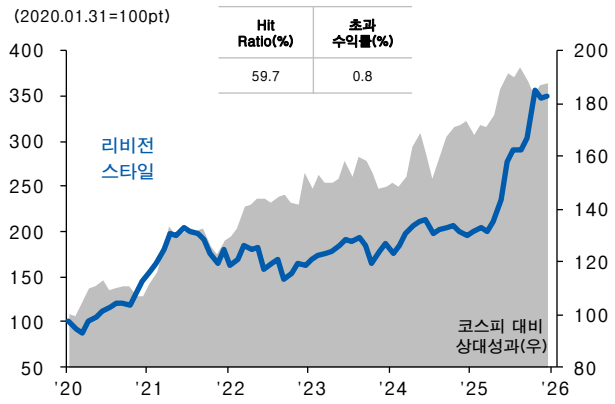
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A032350	롯데관광개발	9.9	9.9	10.0	9.9	39.6	8.4
A007660	이수페타시스	9.6	9.8	9.9	9.8	39.1	9.3
A090460	비에이치	9.9	9.9	9.8	9.2	38.8	1.2
A139480	이마트	9.6	9.5	9.8	9.8	38.6	-3.9
A237690	에스티팜	9.8	9.6	8.5	9.0	36.8	9.4
A011070	LG이노텍	9.7	9.8	9.3	8.0	36.7	3.5
A122870	와이지엔터	8.9	8.5	9.4	9.9	36.6	-0.8
A006260	LS	8.4	9.7	9.5	8.3	35.8	-2.7
A004020	현대제철	7.1	9.4	9.6	9.4	35.5	-3.0
A052690	한전기술	8.0	9.3	8.8	9.0	35.0	1.4

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

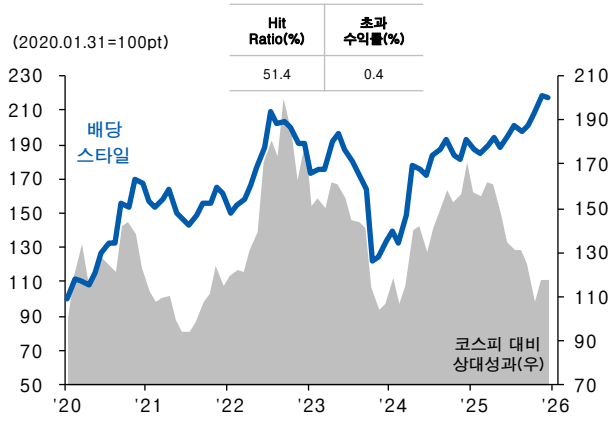


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A353200	대덕전자	9.5	9.7	9.4	28.6	-0.3
A006650	대한유화	9.0	9.3	8.9	27.3	1.2
A010620	HD현대미포	8.5	9.5	9.3	27.3	0.0
A161390	한국타이어앤테크	7.8	9.4	9.2	26.4	-5.7
A010950	S-Oil	8.2	9.4	8.4	25.9	0.2
A000660	SK하이닉스	8.9	8.4	8.3	25.6	4.1
A005930	삼성전자	8.3	8.8	8.3	25.4	-1.0
A000100	유한양행	7.6	9.1	8.7	25.3	-1.1
A111770	영원무역	8.8	7.4	8.9	25.1	-1.5
A240810	원익IPS	9.4	6.8	8.8	25.1	-0.3

배당 스타일 성과 추이

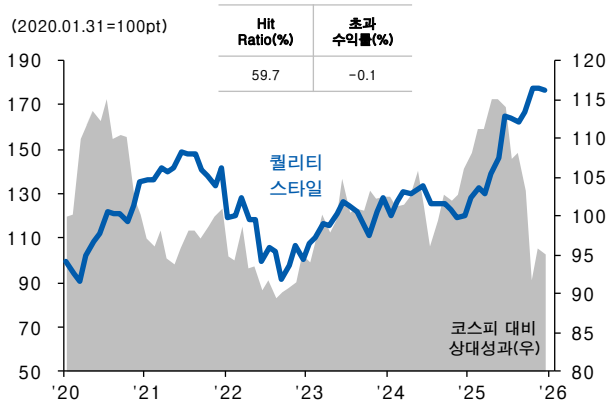


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A009240	한샘	9.6	9.9	9.9	9.9	39.3	-1.4
A005940	NH투자증권	8.2	9.5	9.9	9.6	37.2	-3.3
A030000	제일기획	9.0	9.4	9.0	9.8	37.1	-0.2
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.9	9.4	9.8	36.9	2.9
A214320	이노션	8.2	9.7	9.2	9.9	36.9	0.8
A030200	KT	9.7	8.6	8.7	9.3	36.3	-3.4
A024110	기업은행	6.9	9.8	9.8	9.5	36.1	-1.9
A001430	세아베스틸지주	9.9	8.9	8.8	8.5	36.0	22.0
A032640	LG유플러스	9.3	9.1	8.9	8.7	36.0	-2.4
A078930	GS	8.1	9.3	9.1	9.2	35.7	-4.0

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.7	9.9	9.9	1.0	30.4	-2.8
A058470	리노공업	9.9	9.7	9.8	0.9	30.3	-1.4
A042700	한미반도체	8.8	9.8	9.5	1.0	29.1	1.6
A214150	클래시스	8.8	9.8	9.6	0.9	29.2	8.0
A145020	휴젤	9.7	9.7	9.6	0.9	30.0	2.1
A000660	SK하이닉스	7.4	9.5	9.5	1.0	27.4	4.1
A192080	더블유게임즈	9.9	9.4	9.4	0.7	29.4	-2.0
A214450	파마리서치	7.7	9.5	9.4	0.9	27.5	-4.3
A035900	JYP Ent.	8.3	9.0	8.6	0.9	26.8	-1.2
A383220	F&F	8.3	8.9	8.7	0.9	26.8	-0.1

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

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)