YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

12월 4주차 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 4주차] KOSPI 중소형주 및 KOSDAQ 대상 이익 리비전 스코어 상위 30% + 60일 누적 거래대금(시총대비) 상위 30%

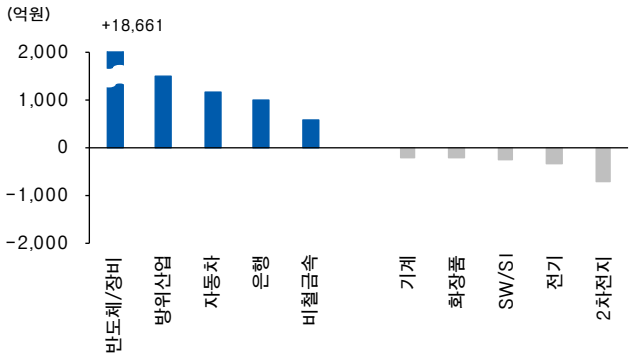
종목코드	종목명	시장 구분	시가총액	60일 누적 거래대금 (억원)	영업이익 추정치 월간 조정률		순이익 추정치 월간 조정률	
					12MF(%)	'26년 연간(%)	12MF(%)	'26년 연간(%)
A001440	대한전선	KS	42,044	63,318	5.8	3.8	5.5	1.8
A240810	원익IPS	KQ	30,972	24,001	7.0	3.3	9.0	5.3
A103590	일진전기	KS	25,750	37,463	8.0	6.3	9.5	7.5
A353200	대덕전자	KS	23,053	47,058	10.6	4.4	9.8	4.0
A009420	한올바이오파마	KS	22,202	24,571	25.7	18.4	29.4	21.2
A067310	하나마이크론	KQ	15,964	30,847	4.4	0.7	7.1	0.4
A458870	씨어스테크놀로지	KQ	15,072	12,547	62.5	54.5	64.8	57.1
A032350	롯데관광개발	KS	18,334	15,641	10.6	8.1	19.5	10.0
A290650	엘앤씨바이오	KQ	15,879	25,562	54.4	45.4	240.9	43.9
A100090	SK오션플랜트	KS	12,433	16,694	7.3	4.8	6.3	3.0
A229640	LS에코에너지	KS	10,749	7,492	1.2	0.8	2.9	2.6
A195870	해성디에스	KS	9,095	9,667	7.7	3.2	9.3	4.1
A100840	SNT에너지	KS	7,848	5,582	11.1	9.5	11.1	8.9
A166090	하나머티리얼즈	KQ	8,297	6,147	14.3	11.1	12.0	8.5
A356860	티엘비	KQ	5,811	20,330	10.5	6.5	4.5	0.3
A060250	NHN KCP	KQ	6,084	15,347	6.2	4.8	5.3	3.9
A089970	브이엠	KQ	6,786	8,354	8.8	3.2	10.7	4.9
A090460	비에이치	KS	5,687	4,480	6.2	1.2	6.1	0.2
A338220	뷰노	KQ	3,220	2,238	18.9	3.1	25.5	9.1
A010170	대한광통신	KQ	3,022	18,488	24.7	6.3	187.7	79.3

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주) 12/23일 기준 이익 리비전 스코어 = 12MF 및 FY1 영업이익/순이익 월간 조정률 스코어

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +2.4조원 순매수, 기관은 약 +2.1조원 순매수를 기록
- 반도체/장비(+4.2조원), 은행(+1,565억원) 등의 업종이 기관과 외국인 순매수 상위 리스트에 동시에 스크리닝

기관 주간 순매수 상/하위 업종

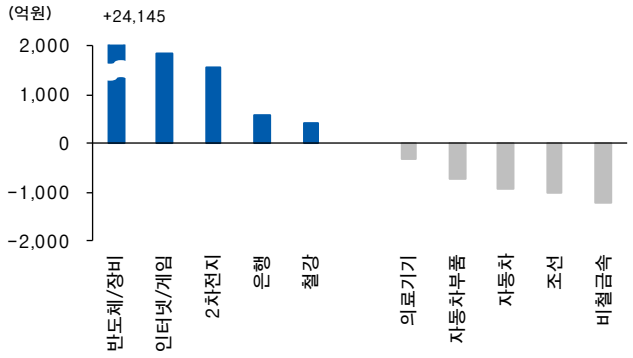


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	18,661	40,525	73,064	
2	방위산업	1,489	3,147	2,580	
3	자동차	1,153	4,226	6,783	
4	은행	982	3,249	16,670	
5	비철금속	553	109	331	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	-734	1,310	10,158	
2	전기	-343	-1,162	-430	
3	SW/SI	-274	511	-630	
4	화장품	-216	-336	624	
5	기계	-213	336	-4,849	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

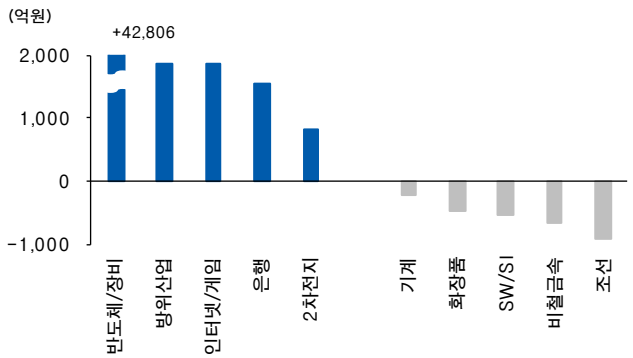


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	24,145	13,155	-61,638	
2	인터넷/게임	1,835	472	-9,888	
3	2차전지	1,552	-3,435	3,709	
4	은행	583	-1,931	-14,505	
5	철강	422	-341	-1,290	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	비철금속	-1,216	-537	-3,700	
2	조선	-1,000	-2,649	-8,304	
3	자동차	-936	4,557	161	
4	자동차부품	-710	-1,108	1,879	
5	의료기기	-323	-63	-489	

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	42,806	53,680	11,426	
2	방위산업	1,882	3,969	-3,739	
3	인터넷/게임	1,861	-3,484	-13,526	
4	은행	1,565	1,318	2,165	
5	2차전지	818	-2,125	13,868	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	-928	-3,791	-8,296	
2	비철금속	-663	-428	-3,369	
3	SW/SI	-538	410	45	
4	화장품	-462	-358	1,285	
5	기계	-233	1,190	-12,767	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 12/24일 기준

업종별 | 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A078340	컴투스	인터넷/게임	3,777	42	0.37
A041510	에스엠	미디어/엔터	29,511	248	0.29
A214450	파마리서치	의료기기	41,143	331	0.27
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,095	74	0.26
A204320	HL만도	자동차부품	25,498	154	0.20
A272210	한화시스템	방위산업	106,362	646	0.20
A139480	이마트	소매/유통	23,512	117	0.16
A145020	휴젤	제약/바이오	28,484	134	0.16
A047810	한국항공우주	방위산업	110,927	447	0.13
A138930	BNK금융지주	은행	50,937	204	0.13

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A353200	대덕전자	전자/부품	23,053	224	0.32
A237690	에스티팜	제약/바이오	25,856	142	0.18
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	18,334	93	0.17
A034230	파라다이스	호텔/레저	15,182	65	0.14
A067160	SOOP	미디어/엔터	7,908	29	0.12
A009420	한올바이오파마	제약/바이오	22,202	80	0.12
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	25,654	89	0.12
A003490	대한항공	항공	84,691	291	0.12
A035720	카카오	인터넷/게임	264,569	852	0.11
A004370	농심	음식료	27,037	87	0.11

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A353200	대덕전자	전자/부품	23,053	176	0.3
A272210	한화시스템	방위산업	106,362	802	0.2
A003490	대한항공	항공	84,691	605	0.2
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	25,654	182	0.2
A138930	BNK금융지주	은행	50,937	338	0.2
A237690	에스티팜	제약/바이오	25,856	164	0.2
A004370	농심	음식료	27,037	158	0.2
A003230	삼양식품	음식료	95,368	570	0.2
A041510	에스엠	미디어/엔터	29,511	167	0.2
A006280	녹십자	제약/바이오	18,324	99	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

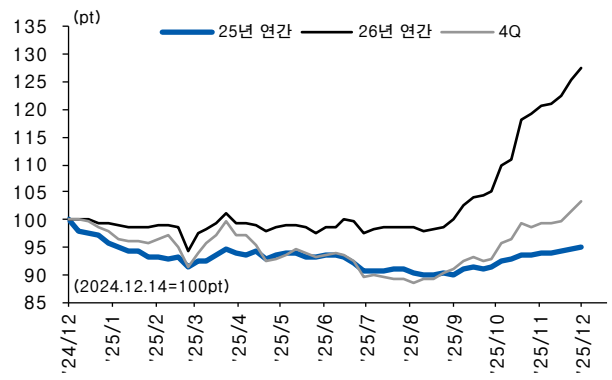
종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A035420	NAVER	인터넷/게임	370,956	584.8	-5,666	-8,613
A006400	삼성SDI	2차전지	225,639	74.2	-2,493	-1,188
A007660	이수페타시스	전자/부품	87,430	231.4	-1,836	972
A373220	LG에너지솔루션	2차전지	913,770	249.7	-1,186	6,942
A034020	두산에너빌리티	기계	486,186	517.7	-648	-8,819
A042700	한미반도체	반도체/장비	118,759	544.4	-525	896
A003230	삼양식품	음식료	95,368	569.7	-385	36
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	176,114	319.4	-504	476
A051910	LG화학	화학	244,250	4.1	-446	5,296
A000810	삼성화재	손해보험	229,596	187.7	-180	142

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 12/24일 기준

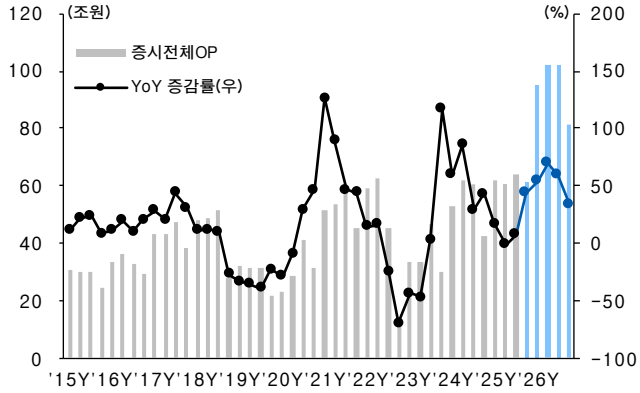
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 기준 '25년 연간 +0.3%, '26년 연간 +0.9% 수준의 상향조정이 진행되며 이익 트렌드의 우상향 흐름 지속
- 해운(+12.4%), 반도체(+10.7%), 정유(+7.4%), 전기(+5.8%), 비철금속(+5.2%) 업종이 영업이익 추정치 월간 조정률 상위에 스크리닝

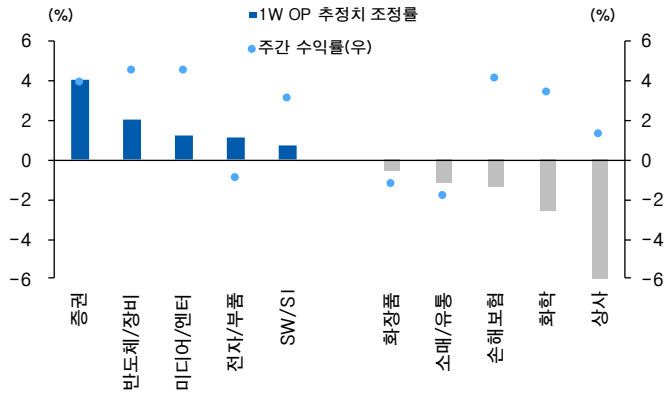
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

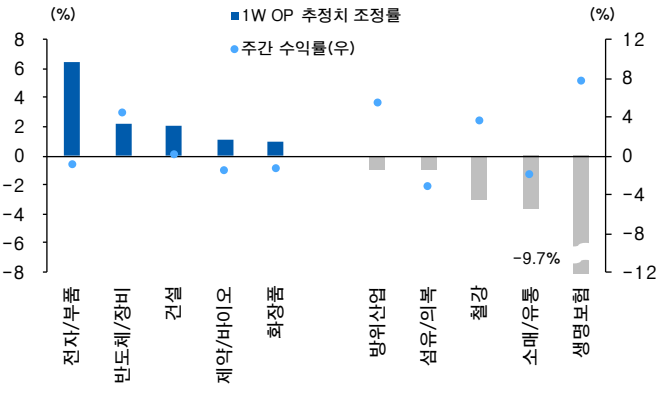


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	증권	79,745	4.1	3.9	
2	반도체/장비	1,828,825	2.0	4.5	
3	미디어/엔터	19,059	1.3	4.5	
4	전자/부품	63,127	1.1	-0.9	
5	SW/SI	15,149	0.7	3.1	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	상사	17,015	-6.0	1.3	
2	화학	46,429	-2.6	3.4	
3	손해보험	68,753	-1.4	4.1	
4	소매/유통	28,101	-1.2	-1.8	
5	화장품	25,286	-0.6	-1.3	

25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

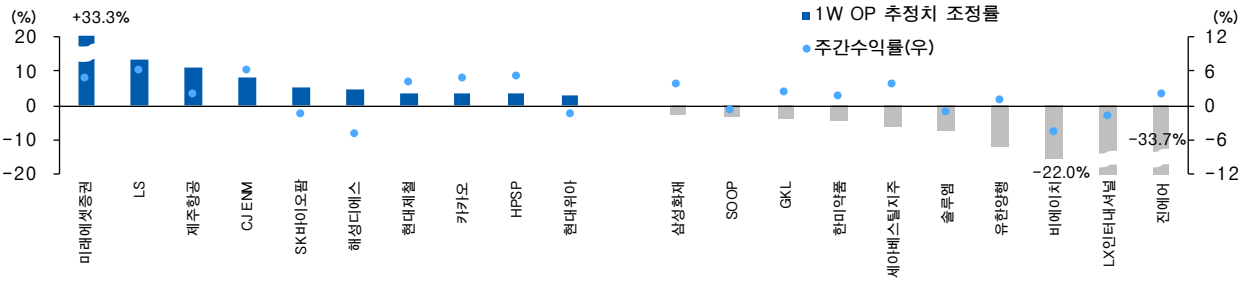
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전자/부품	7,557	6.5	-0.9	
2	반도체/장비	344,951	2.2	4.5	
3	건설	6,171	2.1	0.2	
4	제약/바이오	13,779	1.1	-1.5	
5	화장품	4,737	1.0	-1.3	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	생명보험	2,547	-9.7	7.8	
2	소매/유통	7,729	-3.7	-1.8	
3	철강	6,431	-3.0	3.7	
4	섬유/의복	3,231	-1.0	-3.2	
5	방위산업	14,921	-0.9	5.4	

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 12/23일 기준 추정치 (수익률 12/24일 기준)

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



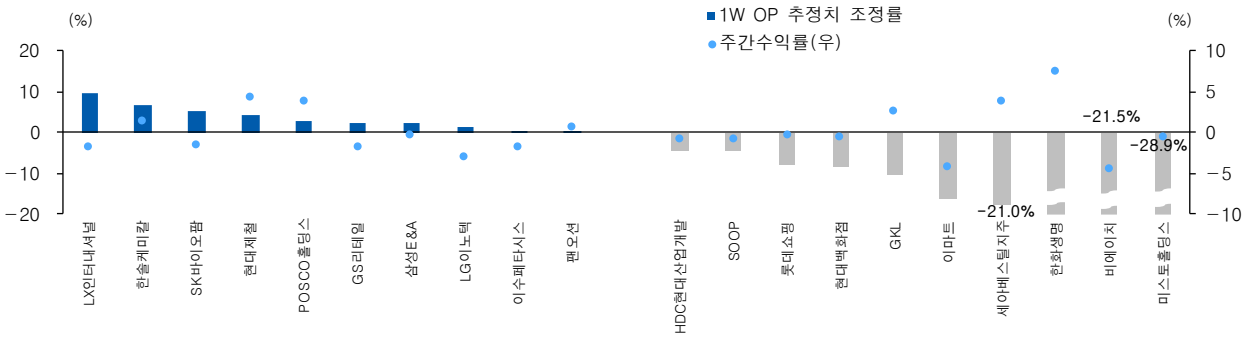
연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006800	미래에셋증권	증권	12,450	33.3	4.8
2	A006260	LS	지주회사	14,430	13.4	6.2
3	A089590	제주항공	항공	151	11.2	2.1
4	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	2,090	8.0	6.1
5	A326030	SK바이오팜	제약/바이오	3,774	5.2	-1.6
6	A195870	해성디에스	반도체/장비	930	4.6	-5.0
7	A004020	현대제철	철강	9,433	3.7	4.1
8	A035720	카카오	인터넷/게임	10,225	3.6	4.7
9	A403870	HPSP	반도체/장비	1,232	3.5	5.1
10	A011210	현대위아	자동차부품	2,703	3.1	-1.5

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A272450	진에어	항공	127	-33.7	2.0
2	A001120	LX인터내셔널	상사	3,868	-22.0	-1.8
3	A090460	비에이치	전자/부품	965	-15.9	-4.7
4	A000100	유한양행	제약/바이오	1,810	-12.0	1.0
5	A248070	솔루엠	전자/부품	696	-7.7	-1.2
6	A001430	세아베스틸지주	철강	1,636	-6.7	3.6
7	A128940	한미약품	제약/바이오	2,640	-4.5	1.5
8	A114090	GKL	호텔/레저	756	-4.1	2.4
9	A067160	SOOP	미디어/엔터	1,376	-3.2	-0.9
10	A000810	삼성화재	손해보험	30,160	-3.2	3.5

4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

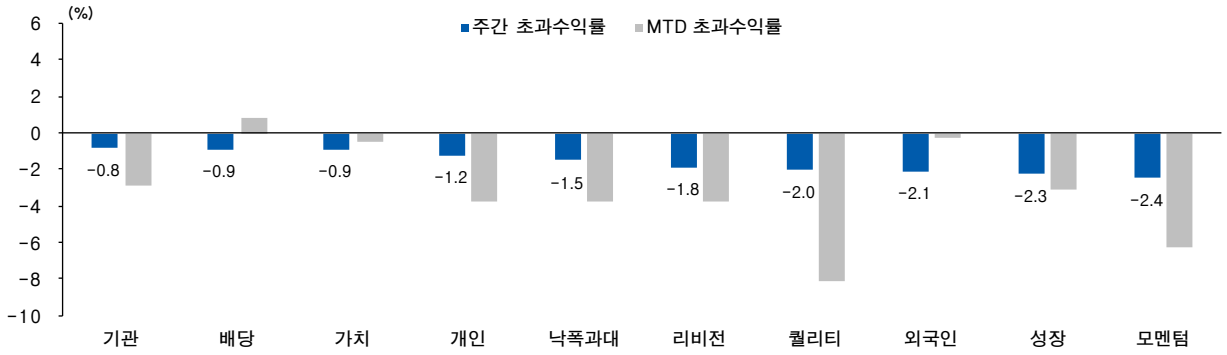
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A001120	LX인터내셔널	상사	835	9.8	-1.8
2	A014680	한솔케미칼	화학	438	6.9	1.4
3	A326030	SK바이오팜	제약/바이오	830	5.5	-1.6
4	A004020	현대제철	철강	2,550	4.1	4.1
5	A005490	POSCO홀딩스	철강	9,215	3.0	3.6
6	A007070	GS리테일	소매/유통	725	2.2	-1.8
7	A028050	삼성E&A	건설	2,360	2.2	-0.4
8	A011070	LG이노텍	전자/부품	3,701	1.4	-3.0
9	A007660	이수페타시스	전자/부품	798	0.6	-2.0
10	A028670	팬오션	해운	1,406	0.5	0.6

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A081660	미스토홀딩스	섬유/의복	237	-28.9	-0.7
2	A090460	비에이치	전자/부품	314	-21.5	-4.7
3	A088350	한화생명	생명보험	1,410	-21.0	7.3
4	A001430	세아베스틸지주	철강	319	-17.9	3.6
5	A139480	이마트	소매/유통	1,437	-16.2	-4.5
6	A114090	GKL	호텔/레저	146	-10.6	2.4
7	A069960	현대백화점	소매/유통	1,365	-8.6	-0.8
8	A023530	롯데쇼핑	소매/유통	2,359	-7.8	-0.5
9	A067160	SOOP	미디어/엔터	340	-4.8	-0.9
10	A294870	HDC현대산업개발	건설	1,280	-4.7	-0.9

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 12/23일 기준 추정치(수익률 12/24일 기준)

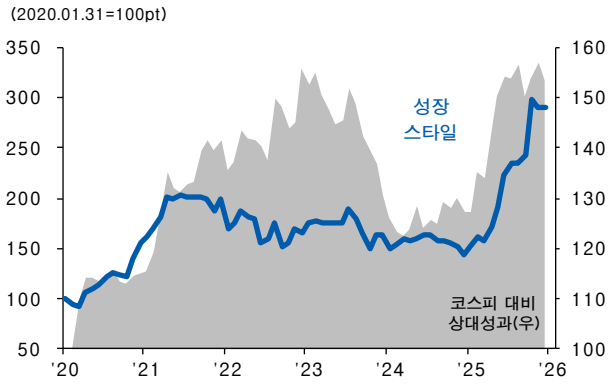
업종별 종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
50.0	0.6



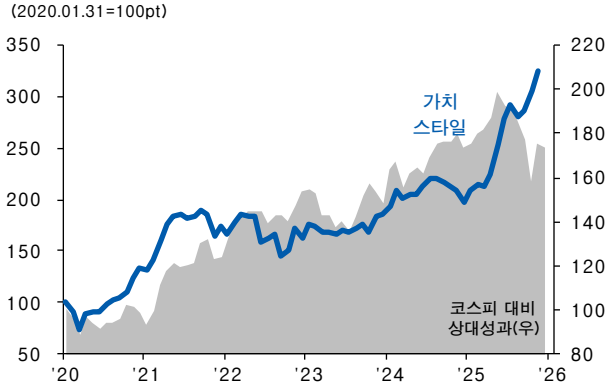
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A298040	효성중공업	8.7	9.0	8.7	26.4	-3.3
A064350	현대로템	8.7	8.4	7.6	24.7	2.5
A278470	에이피알	9.7	9.2	5.2	24.0	-4.1
A012510	더존비즈온	8.0	7.7	8.2	23.8	-0.9
A010130	고려아연	8.8	7.2	7.1	23.1	0.7
A267260	HD현대일렉트릭	8.0	7.5	7.4	23.0	-3.4
A005930	삼성전자	7.3	8.3	7.1	22.7	4.5
A267250	HD현대	6.1	8.3	7.6	22.0	-3.0
A161390	한국타이어앤테크놀로지	8.3	6.5	7.1	22.0	-3.5
A007660	이수페타시스	9.3	9.0	3.1	21.5	-1.9

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
58.3	0.7



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

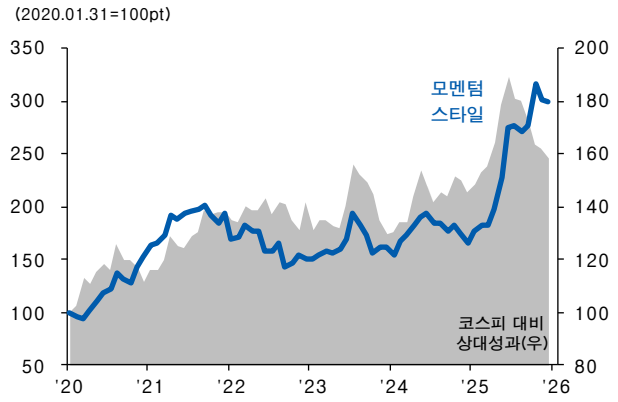
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.5	5.7
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	3.5
A036460	한국가스공사	9.8	9.7	9.8	29.2	0.6
A011170	롯데케미칼	10.0	9.8	9.3	29.1	4.2
A108670	LX하우시스	9.1	9.5	9.9	28.4	-0.2
A139480	이마트	8.4	9.9	10.0	28.2	-0.3
A001450	현대해상	9.9	8.5	9.7	28.1	3.8
A023530	롯데쇼핑	8.6	10.0	9.4	28.0	1.6
A001120	LX인터내셔널	8.9	9.1	10.0	27.9	-1.2
A139130	iM금융지주	9.4	9.3	8.9	27.6	6.9

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/24일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

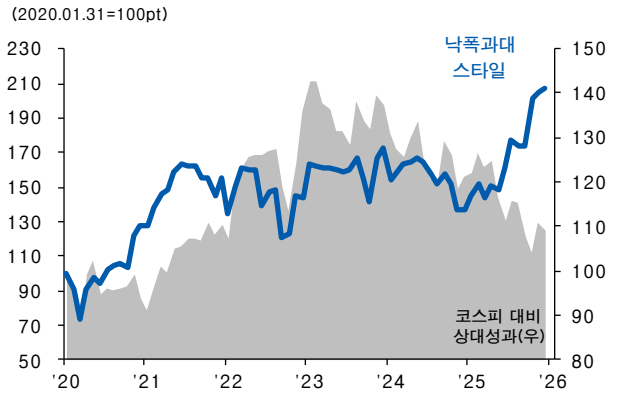
모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
47.2	0.7



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.8	0.2



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	-1.9
A353200	대덕전자	9.8	9.9	9.9	9.7	39.2	0.4
A015760	한국전력	9.6	8.9	8.8	8.8	36.0	-2.4
A058470	리노공업	9.2	9.2	8.6	8.9	35.8	2.4
A111770	영원무역	10.0	9.4	7.7	8.7	35.8	-4.9
A010120	LS ELECTRIC	7.4	9.7	9.1	9.6	35.7	-1.4
A020150	롯데에너지머티리	9.9	9.2	8.9	7.0	35.0	3.2
A161390	한국타이어앤테크	9.9	9.4	8.3	7.2	34.6	-3.5
A009150	삼성전기	6.3	9.5	9.5	9.0	34.3	0.2
A181710	NHN	8.9	8.2	8.9	8.1	34.0	0.6

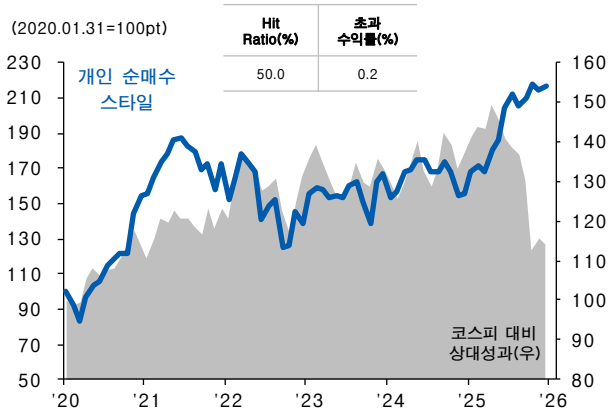
낙폭과대 스코어 Top 10

(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	1.3
A145020	휴젤	8.8	9.9	9.9	7.6	36.1	-0.6
A078340	컴투스	7.7	9.5	9.5	9.2	35.9	1.2
A259960	크래프톤	7.0	9.7	9.9	9.0	35.6	0.4
A089590	제주항공	6.3	9.5	9.6	9.8	35.2	2.8
A241590	화승엔터프라이즈	5.1	9.8	10.0	9.9	34.8	-2.1
A145720	덴티움	7.6	8.7	9.1	9.5	34.8	-2.2
A067160	SOOP	6.2	8.9	9.7	9.3	34.1	-1.0
A161890	한국콜마	9.1	9.3	9.7	5.9	34.0	-1.3
A097950	CJ제일제당	7.8	8.5	8.7	9.0	34.0	0.5

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/24일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

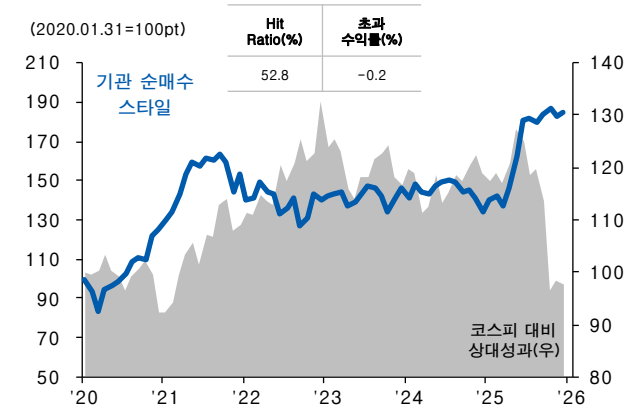


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	0.5
A161890	한국콜마	9.4	9.6	10.0	9.6	38.5	-1.3
A192820	코스맥스	9.8	9.1	9.9	9.3	38.0	-0.9
A103140	풍산	9.6	9.9	9.4	9.2	38.0	3.3
A035900	JYP Ent.	10.0	9.9	9.8	8.2	37.8	2.9
A035420	NAVER	9.7	8.5	9.7	9.5	37.3	0.4
A005070	코스모신소재	9.0	9.1	9.5	9.9	37.3	1.4
A051900	LG생활건강	8.4	9.5	9.6	9.5	36.9	0.0
A036570	엔씨소프트	9.2	9.4	8.6	9.1	36.2	7.3
A272450	진에어	7.9	9.0	9.4	9.9	36.1	1.3

기관 순매수 스타일 성과 추이

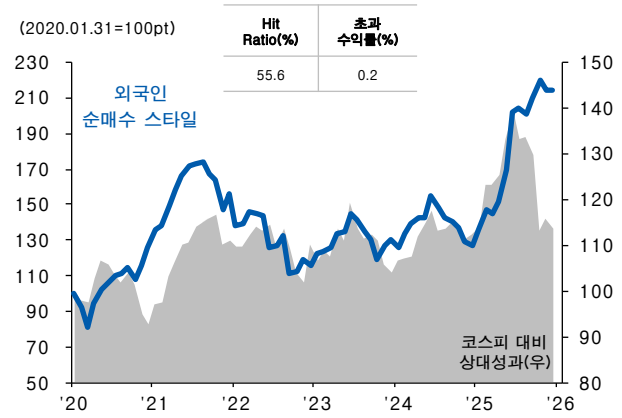


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	0.4
A240810	원익IPS	9.4	10.0	9.9	9.8	38.9	9.5
A020150	롯데에너지머티	9.9	9.7	9.5	9.2	38.3	3.2
A034230	파라다이스	9.0	9.3	9.8	10.0	38.1	-2.0
A032350	롯데관광개발	9.6	9.2	9.5	9.7	37.9	0.2
A120110	코오롱인더	9.9	9.6	9.1	9.1	37.6	0.4
A069960	현대백화점	9.8	9.1	9.0	9.5	37.4	-0.4
A195870	해성디에스	8.7	9.9	9.6	9.0	37.1	-1.4
A004170	신세계	10.0	9.5	7.9	9.6	36.8	1.6
A047810	한국항공우주	9.8	9.4	8.8	8.3	36.2	4.6

외국인 순매수 스타일 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

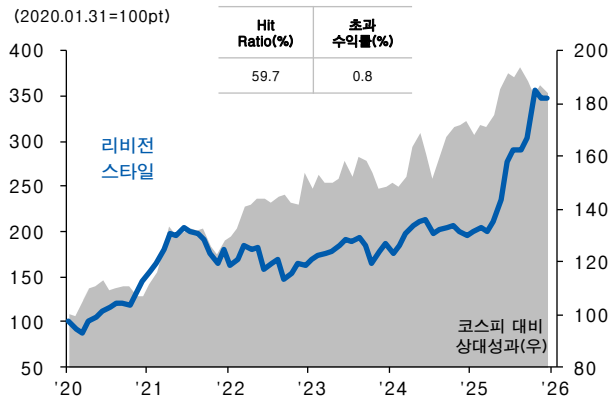
(단위: %)

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	0.2
A007660	이수페타시스	9.6	9.8	9.9	9.8	39.1	-1.9
A090460	비에이치	9.9	9.9	9.8	9.2	38.8	-4.1
A139480	이마트	9.6	9.5	9.8	9.8	38.6	-0.3
A237690	에스티팜	9.8	9.6	8.5	9.0	36.8	-2.2
A011070	LG이노텍	9.7	9.8	9.3	8.0	36.7	-3.1
A122870	와이지엔터	8.9	8.5	9.4	9.9	36.6	4.4
A006260	LS	8.4	9.7	9.5	8.3	35.8	4.2
A004020	현대제철	7.1	9.4	9.6	9.4	35.5	3.6
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) 12/24일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

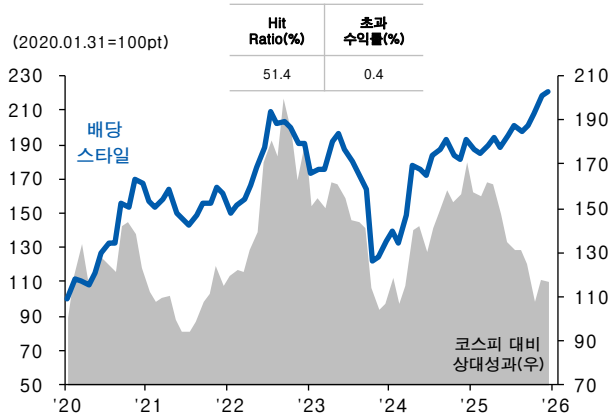


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A353200	대덕전자	9.5	9.7	9.4	28.6	0.4
A006650	대한유화	9.0	9.3	8.9	27.3	0.3
A010620	HD현대미포	8.5	9.5	9.3	27.3	0.0
A161390	한국타이어앤테크	7.8	9.4	9.2	26.4	-3.5
A010950	S-Oil	8.2	9.4	8.4	25.9	2.1
A000660	SK하이닉스	8.9	8.4	8.3	25.6	7.4
A005930	삼성전자	8.3	8.8	8.3	25.4	4.5
A000100	유한양행	7.6	9.1	8.7	25.3	-1.0
A111770	영원무역	8.8	7.4	8.9	25.1	-4.9
A240810	원익IPS	9.4	6.8	8.8	25.1	9.5

배당 스타일 성과 추이

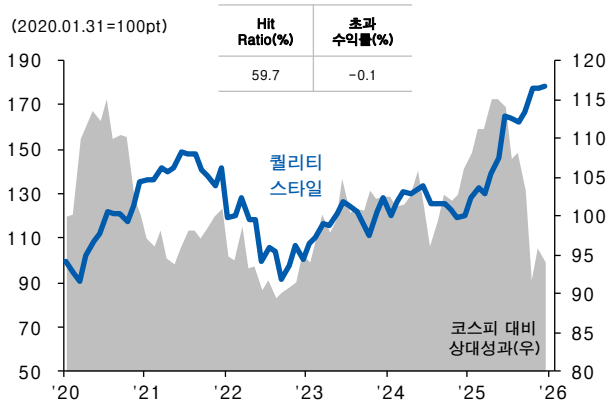


배당 스코어 Top 10

(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	3.8
A005940	NH투자증권	8.2	9.5	9.9	9.6	37.2	1.4
A030000	제일기획	9.0	9.4	9.0	9.8	37.1	-2.0
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.9	9.4	9.8	36.9	-1.2
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	-0.7
A024110	기업은행	6.9	9.8	9.8	9.5	36.1	1.2
A001430	세아베스틸지주	9.9	8.9	8.8	8.5	36.0	9.1
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	-1.5

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	4.7
A058470	리노공업	9.9	9.7	9.8	0.9	30.3	2.4
A042700	한미반도체	8.8	9.8	9.5	1.0	29.1	7.2
A214150	클래시스	8.8	9.8	9.6	0.9	29.2	-7.5
A145020	휴젤	9.7	9.7	9.6	0.9	30.0	-0.6
A000660	SK하이닉스	7.4	9.5	9.5	1.0	27.4	7.4
A192080	더블유게임즈	9.9	9.4	9.4	0.7	29.4	1.1
A214450	파마리서치	7.7	9.5	9.4	0.9	27.5	3.8
A035900	JYP Ent.	8.3	9.0	8.6	0.9	26.8	2.9
A383220	F&F	8.3	8.9	8.7	0.9	26.8	-5.1

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 12/24일 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)