09 Jan, 2026 **Yuanta Research**

YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

1월 2주차 이익 반영 국면 소외주 스크리닝

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

유안타증권 Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 스크리닝

이익 반영 국면 소외주 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 Analyst

02 3770 3634

hyunyong.shin@yuantakorea.com

이익 반영국면 소외주 스크리닝 (참고 자료: 소외된 모두 왼발을 한 보 앞으로)

1) "1월 효과"는 다른 월 대비 1월에 가장 수익률이 높으며, 특히 중소형주 프리미엄이 강하게 나타나는 1월의 계절성을 뜻함. 분석결과 시가총액이 작아질수록 KOSPI 대비 프리미엄 확대되는 경향 확인. 대형주 종목군 또한 KOSPI 대피 프리미엄이 존재하며 Hit Ratio 기준 안정성이 가장 높음

2) 시가총액 규모별 1월의 성과를 견인한 종목군의 특성을 파악하기 위해 유니버스를 구분해 스타일 성과를 분석. 결과적으로 대형주 및 중소형주 유니버스 모두 리비전+낙폭과대 스타일이 가장 우수한 성과를 기록

3) 4분기 실적시즌을 통해 이익에 대한 민감도가 높아지며 이익 트렌드가 견조한 낙폭과대 종목이 재차 주목받으며 1월효과가 나타나는 것으로 해석. 주도주 쏠림에 가려져 주목 받지 못한 종목이 4분기 실적시즌을 통해 재조명되며 초과수익 기회가 확대될 것이라 전망

[1월 2주차] 1) 4Q25 및 '26 년 영업이익 추정치 1M 조정률 상위 30%, 2) 1M 수익률 하위 30%에 모두 속하는 종목 스크리닝

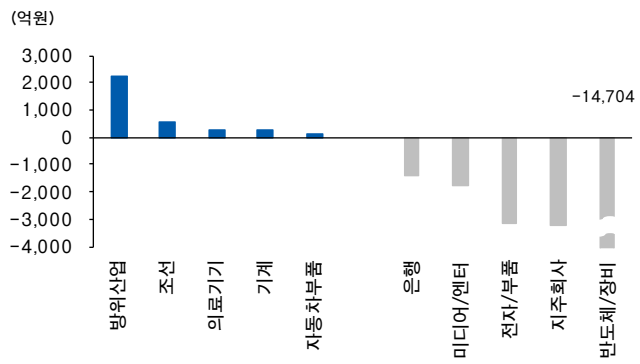
종목명	업종	시가총액 (억원)	1M 수익률(%)	4Q25 영업이익 추정치(억원, %)			'25E 연간 영업이익 추정치(억원,%)		
				12/8일 기준	1/7일 기준	변동률	12/8일 기준	1/7일 기준	변동률
에이피알	화장품 등	87,962	-19.5	3,266	3,348	2.5	11,285	11,581	2.6
F&F	화장품 등	25,091	-12.1	209	213	1.6	1,252	1,308	4.5
한온시스템	자동차	20,329	-24.2	1,091	1,096	0.5	4,794	4,850	1.2
롯데관광개발	호텔,레저	17,101	-8.5	1,367	1,378	0.8	5,134	5,148	0.3
금호타이어	자동차	16,489	-11.0	747	779	4.3	3,309	3,391	2.5
롯데웰푸드	필수소비재	10,412	-11.3	455	468	3.0	1,961	2,012	2.6
해성디에스	반도체	8,806	-12.6	1,112	1,174	5.6	5,305	5,502	3.7
동국제약	건강관리	7,843	-8.6	215	215	0.1	1,908	1,911	0.2
넥센타이어	자동차	7,520	-9.6	185	192	4.0	869	891	2.6
인카금융서비스	보험	6,536	-21.5	451	451	0.1	2,148	2,164	0.7
대한해운	운송	5,671	-8.3	232	232	0.0	1,281	1,284	0.3
덴티움	건강관리	5,308	-7.4	191	195	2.1	1,016	1,072	5.5

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +2.9조원 순매수, 기관은 약 -3.1조원 순매도를 기록. 기관은 순매수 상위에 스크리닝된 5개 업종 외 33개 업종 모두 순매도를 기록
- 조선(+6,525억원) , 방위산업(5,549억원), 기계(4,680억원) 업종이 기관과 외국인 순매수 상위 리스트에 동시에 스크리닝

기관 주간 순매수 상/하위 업종

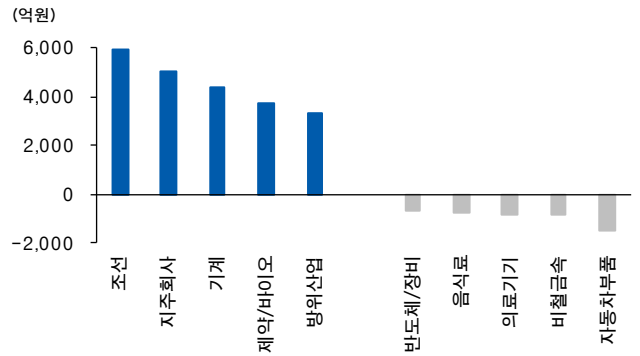


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	방위산업	2,249	6,132	7,389	
2	조선	592	1,185	-2,437	
3	의료기기	288	274	-35	
4	기계	283	-621	-5,853	
5	자동차부품	91	1,196	2,930	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-14,704	7,020	56,991	
2	지주회사	-3,217	-5,922	1,522	
3	전자/부품	-3,137	-3,750	548	
4	미디어/엔터	-1,805	315	-289	
5	은행	-1,412	-2,867	15,480	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

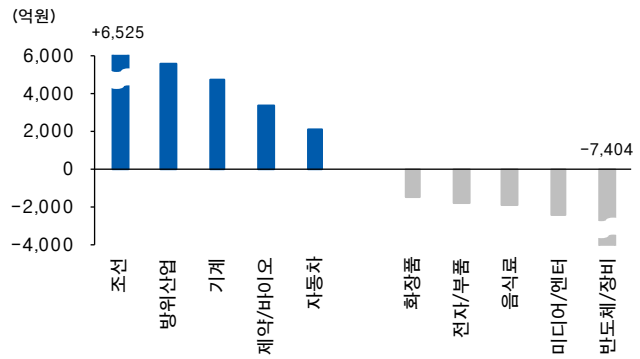


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	5,933	2,126	-5,030	
2	지주회사	5,049	7,013	10,342	
3	기계	4,397	6,294	-5,600	
4	제약/바이오	3,748	5,430	12,110	
5	방위산업	3,300	4,868	-2,799	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	자동차부품	-1,536	-4,112	-690	
2	비철금속	-885	-1,709	-4,382	
3	의료기기	-850	-1,048	-1,549	
4	음식료	-784	-304	9	
5	반도체/장비	-672	27,244	-74,960	

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	조선	6,525	3,311	-7,467	
2	방위산업	5,549	11,000	4,590	
3	기계	4,680	5,673	-11,452	
4	제약/바이오	3,341	6,236	14,810	
5	자동차	2,099	256	9,588	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-15,376	34,264	-17,969	
2	미디어/엔터	-2,422	-1,256	-4,017	
3	음식료	-1,967	-2,357	-2,247	
4	전자/부품	-1,778	-3,246	9,793	
5	화장품	-1,472	-1,682	-1,239	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/8일 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	16,520	300	0.49
A403870	HPSP	반도체/장비	28,762	366	0.31
A240810	원익IPS	반도체/장비	37,402	409	0.26
A042700	한미반도체	반도체/장비	176,995	1,595	0.23
A237690	에스티팜	제약/바이오	26,540	230	0.22
A071970	HD현대마린엔진	기계	32,632	263	0.21
A214450	파마리서치	의료기기	48,052	368	0.20
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	9,671	77	0.20
A103140	풍산	비철금속	31,948	251	0.20
A257720	실리콘투	화장품	25,967	186	0.18

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A403870	HPSP	반도체/장비	28,762	2,091	1.76
A006650	대한유화	화학	8,398	143	0.41
A042700	한미반도체	반도체/장비	176,995	2,208	0.32
A018880	한온시스템	자동차부품	19,005	208	0.26
A016360	삼성증권	증권	68,493	708	0.26
A120110	코오롱인더	화학	11,324	117	0.25
A000150	두산	지주회사	122,911	996	0.20
A000720	현대건설	건설	83,517	569	0.17
A006260	LS	지주회사	63,717	429	0.16
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	16,743	105	0.16

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A403870	HPSP	반도체/장비	28,762	2,456	2.1
A042700	한미반도체	반도체/장비	176,995	3,803	0.6
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	16,520	275	0.4
A042660	한화오션	조선	397,418	3,682	0.2
A071970	HD현대마린엔진	기계	32,632	301	0.2
A000720	현대건설	건설	83,517	765	0.2
A267270	HD현대건설기계	기계	17,965	152	0.2
A257720	실리콘투	화장품	25,967	207	0.2
A012450	한화에어로스페이스	방위산업	562,041	3,863	0.2
A052690	한전기술	전기	36,921	264	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005380	현대차	자동차	697,200	1,837.8	-1,185	5,739
A015760	한국전력	전기	315,525	970.8	-220	4,820
A016360	삼성증권	증권	68,493	168.5	-746	-595
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	158,769	16.0	-853	-968
A010140	삼성중공업	조선	231,880	461.4	-222	-3,641
A052690	한전기술	전기	36,921	264.4	-302	426
A009150	삼성전기	전자/부품	203,167	150.4	-295	2,509
A066970	엘앤에프	2차전지	41,921	127.2	-214	1,651
A034220	LG디스플레이	디스플레이	61,150	1.3	-320	-1,119
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	19,583	53.1	-268	652

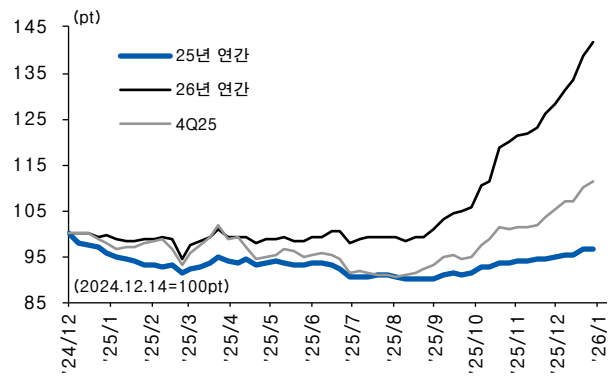
자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/8일 기준

업종별 | 종목별

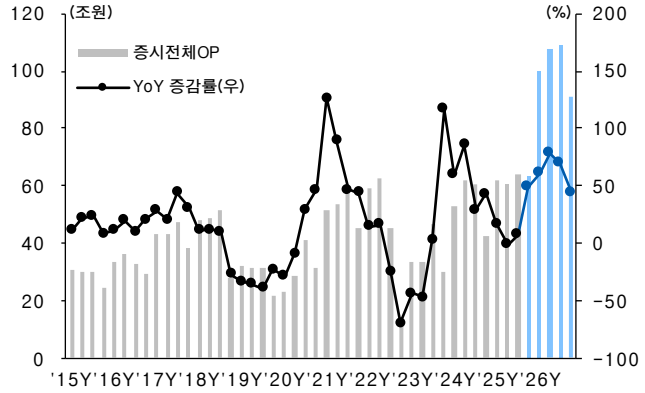
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 기준 '25년 연간 +0.2%, '26년 연간 +2.2% 상향조정. 1/8일 삼성전자는 4Q25 잠정실적을 발표하였으며, 영업이익은 20조원으로 분기말 컨센서스(19.2조원) 대비 104.2%의 달성률을 기록
- 지난주 조선 업종이 4Q25 및 '26년 연간 영업이익 추정치(+20.0%, +10.0%) 모두 주간 조정률 상위에 스크리닝. 철강업종은 4Q25 추정치는 상향조정(+16.5%)되었으나 '26년 추정치는 가파른 하향조정(-10.9%) 진행

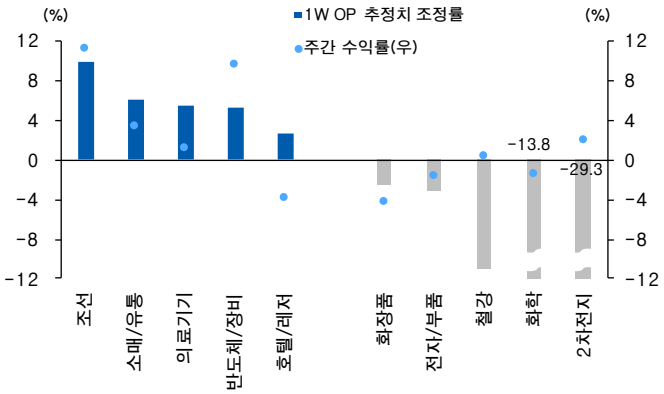
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

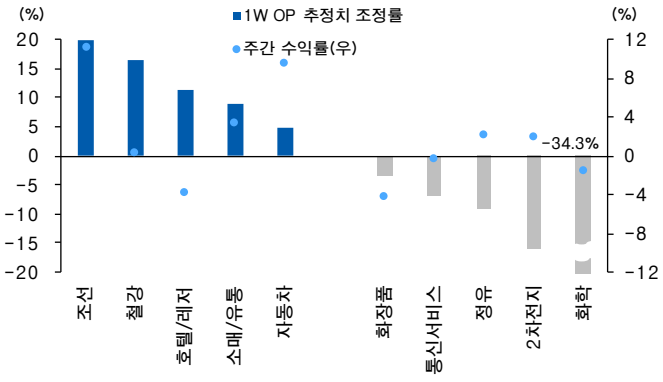


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	조선	134,689	10.0	11.3	
2	소매/유통	28,533	6.1	3.4	
3	의료기기	6,398	5.5	1.2	
4	반도체/장비	2,134,893	5.3	9.5	
5	호텔/레저	10,082	2.7	-3.9	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	2차전지	19,094	-29.3	2.1	
2	화학	41,631	-13.8	-1.5	
3	철강	40,452	-10.9	0.4	
4	전자/부품	60,635	-3.1	-1.7	
5	화장품	21,123	-2.6	-4.2	

25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

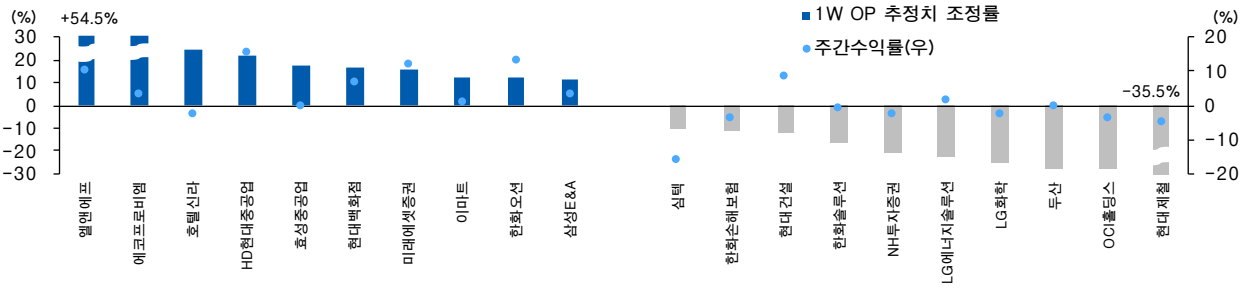
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	조선	40,257	20.0	11.3	
2	철강	9,886	16.5	0.4	
3	호텔/레저	2,268	11.3	-3.9	
4	소매/유통	9,092	9.0	3.4	
5	자동차	62,430	4.7	9.5	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	12,257	-34.3	-1.5	
2	2차전지	11,490	-15.9	2.1	
3	정유	7,074	-9.0	2.3	
4	통신서비스	9,336	-6.8	-0.3	
5	화장품	5,772	-3.4	-4.2	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 1/7일 기준 추정치 (수익률 1/8일 기준)

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



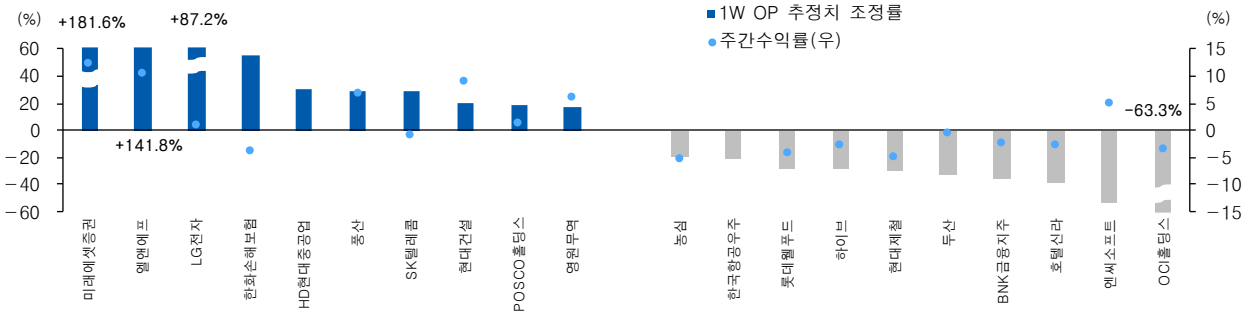
연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A066970	엘앤에프	2차전지	1,213	54.5	10.5
2	A247540	에코프로비엠	2차전지	1,455	39.8	3.2
3	A008770	호텔신라	호텔/레저	1,790	24.3	-2.7
4	A329180	HD현대중공업	조선	37,783	21.9	15.5
5	A298040	효성중공업	기계	10,489	17.5	-0.3
6	A069960	현대백화점	소매/유통	4,476	16.8	6.9
7	A006800	미래에셋증권	증권	18,064	16.1	12.2
8	A139480	이마트	소매/유통	5,638	12.3	0.6
9	A042660	한화오션	조선	21,528	11.9	13.1
10	A028050	삼성E&A	건설	7,979	11.8	3.2

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A004020	현대제철	철강	7,390	-35.5	-5.1
2	A010060	OCI홀딩스	화학	2,998	-28.3	-3.5
3	A000150	두산	지주회사	13,600	-27.8	-0.5
4	A051910	LG화학	화학	19,920	-25.3	-2.3
5	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	21,836	-22.5	1.4
6	A005940	NH투자증권	증권	11,029	-20.7	-2.3
7	A009830	한화솔루션	화학	6,759	-16.1	-0.9
8	A000720	현대건설	건설	7,700	-12.4	8.7
9	A000370	한화손해보험	손해보험	4,430	-11.5	-3.8
10	A222800	심텍	전자/부품	1,440	-10.8	-15.7

4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

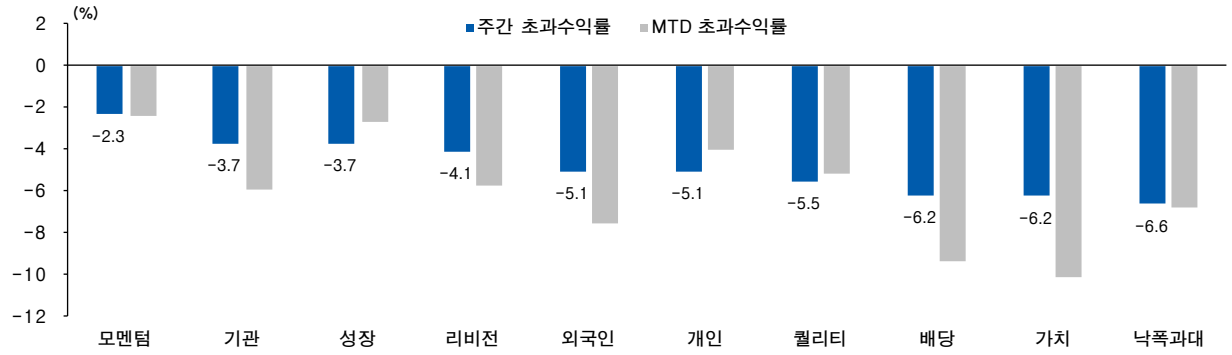
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006800	미래에셋증권	증권	4,850	181.6	12.2
2	A066970	엘앤에프	2차전지	220	141.8	10.5
3	A066570	LG전자	전자/부품	210	87.2	0.9
4	A000370	한화손해보험	손해보험	680	55.3	-3.8
5	A329180	HD현대중공업	조선	8,670	30.9	15.5
6	A103140	풍산	비철금속	919	29.2	6.8
7	A017670	SK텔레콤	통신서비스	2,901	29.1	-0.9
8	A000720	현대건설	건설	959	19.9	8.7
9	A005490	POSCO홀딩스	철강	3,828	18.1	1.0
10	A111770	영원무역	섬유/의복	629	17.9	5.8

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A010060	OCI홀딩스	화학	155	-63.3	-3.5
2	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	142	-53.6	4.8
3	A008770	호텔신라	호텔/레저	91	-39.3	-2.7
4	A138930	BNK금융지주	은행	650	-35.5	-2.5
5	A000150	두산	지주회사	3,220	-32.3	-0.5
6	A004020	현대제철	철강	1,074	-30.4	-5.1
7	A352820	하이브	미디어/엔터	152	-28.6	-3.0
8	A280360	롯데웰푸드	음식료	151	-28.1	-4.3
9	A047810	한국항공우주	방위산업	1,094	-20.6	22.3
10	A004370	농심	음식료	385	-19.7	-5.4

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 1/7일 기준 추정치(수익률 1/8일 기준)

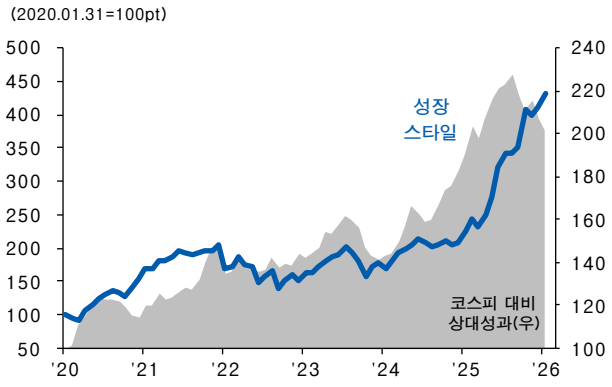
업종별 종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.1	1.1



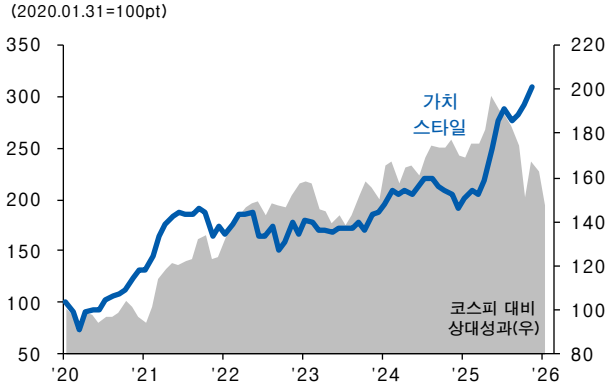
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A000660	SK하이닉스	9.8	6.1	5.4	21.2	11.2
A329180	HD현대중공업	8.9	6.0	5.7	20.6	14.8
A005930	삼성전자	7.9	6.3	5.9	20.1	8.0
A353200	대덕전자	7.2	6.4	6.2	19.8	-11.6
A278470	에이피알	9.7	5.3	4.6	19.6	-6.8
A032350	롯데관광개발	9.4	5.9	3.2	18.4	-6.9
A166090	하나머티리얼즈	6.7	5.8	5.5	18.0	7.9
A195870	해성디에스	5.9	6.1	5.9	18.0	-15.0
A352820	하이브	8.8	6.2	2.9	17.8	-3.0
A376300	디어유	7.2	5.0	5.4	17.6	-10.0

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
55.6	0.6



가치 스코어 Top 10

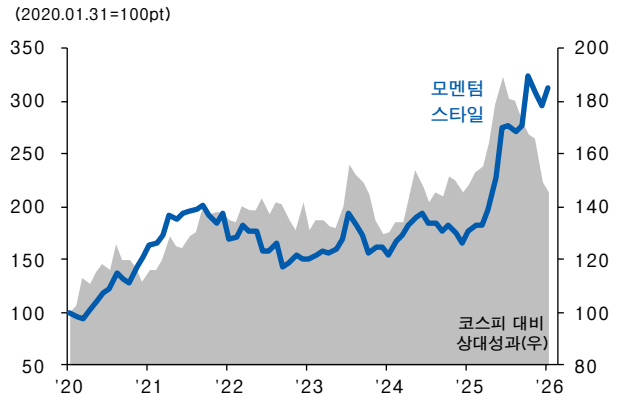
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.6	-5.3
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	-3.8
A036460	한국가스공사	9.7	9.7	9.8	29.2	-0.8
A011170	롯데케미칼	10.0	9.8	9.2	29.0	2.4
A108670	LX하우시스	9.4	9.6	9.9	28.8	-2.1
A001450	현대해상	9.9	8.8	9.7	28.4	-9.0
A023530	롯데쇼핑	8.7	10.0	9.4	28.1	0.5
A139480	이마트	8.3	9.9	9.9	28.1	0.8
A047040	대우건설	9.3	9.4	9.1	27.8	-2.5
A375500	DL이앤씨	9.5	9.6	8.6	27.6	-1.1

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/8일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

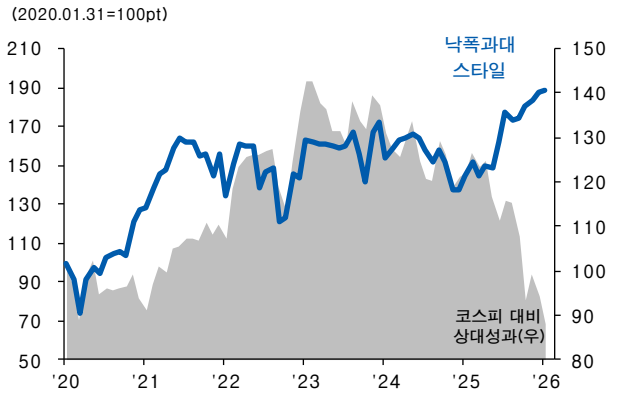
모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
47.2	0.6



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		
A000660	SK하이닉스	9.8	9.9	9.8	9.7	39.1	11.2
A307950	현대오토에버	9.9	10.0	9.6	9.1	38.5	20.7
A240810	원익IPS	9.0	9.4	9.9	9.4	37.6	-4.8
A001430	세아베스틸지주	10.0	9.9	8.7	9.0	37.6	3.8
A195870	해성디에스	9.2	9.8	9.6	8.8	37.4	-15.0
A005930	삼성전자	9.6	9.3	9.7	8.6	37.1	8.0
A011210	현대위아	9.7	9.6	9.2	8.1	36.5	6.1
A032350	롯데관광개발	9.7	9.1	7.8	9.5	36.0	-6.9
A011070	LG이노텍	9.3	9.3	9.4	7.0	35.0	5.7
A204320	HL만도	9.9	9.8	9.4	5.8	34.7	-13.6

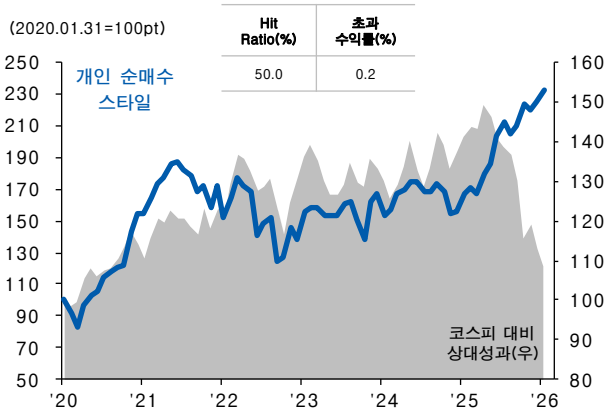
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A145720	덴티움	9.3	9.3	9.4	9.3	37.2	-3.1
A462870	시프트업	8.5	9.0	9.6	9.8	36.8	-5.4
A259960	크래프톤	7.3	9.3	9.7	9.6	35.9	-7.5
A251270	넷마블	8.8	9.7	9.3	7.8	35.6	-1.3
A051900	LG생활건강	8.1	8.6	9.1	9.3	35.0	-2.8
A140860	파크시스템스	9.4	9.5	9.5	6.0	34.4	-0.3
A145020	휴젤	4.7	9.8	9.9	9.4	33.8	-2.1
A089590	제주항공	5.3	9.2	9.3	10.0	33.8	-3.8
A067160	SOOP	5.9	8.5	9.5	9.9	33.8	-6.7
A293490	카카오게임즈	7.3	7.6	9.2	9.2	33.3	-5.6

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/8일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

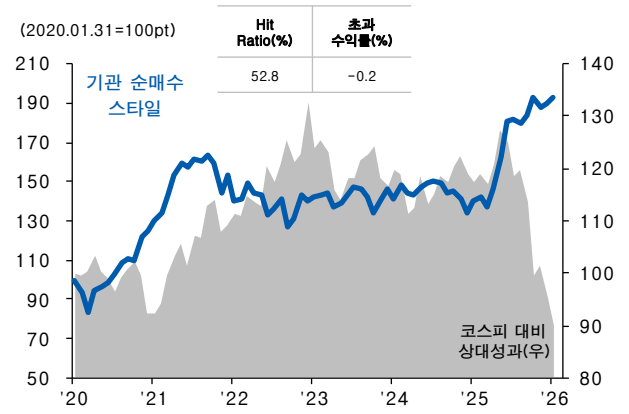


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A097950	CJ제일제당	9.6	9.9	9.9	10.0	39.3	-1.7
A161890	한국콜마	9.5	9.7	10.0	9.9	39.0	-3.7
A051900	LG생활건강	9.4	9.5	9.8	9.8	38.4	-2.8
A145720	덴티움	9.8	9.3	9.1	9.4	37.5	-3.1
A204320	HL만도	10.0	9.4	8.7	9.1	37.1	-13.6
A035420	NAVER	7.8	9.6	9.6	9.7	36.6	1.8
A036930	주성엔지니어링	8.2	9.0	9.3	9.5	36.0	14.7
A067160	SOOP	8.1	8.1	9.8	9.8	35.7	-6.7
A140860	파크시스템스	9.1	9.2	9.2	8.4	35.7	-0.3
A192820	코스맥스	6.2	9.8	9.9	9.6	35.4	-2.7

기관 순매수 스타일 성과 추이

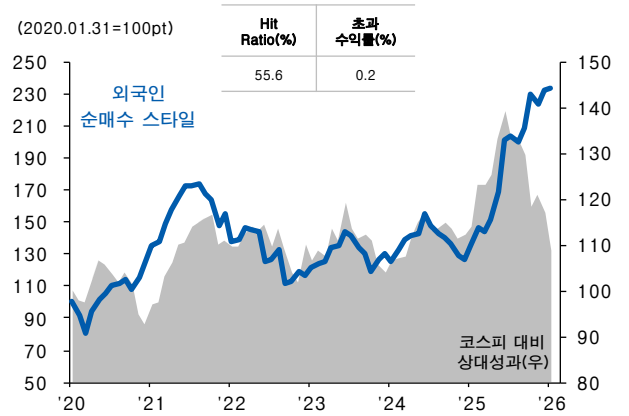


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A195870	해성디에스	10.0	10.0	9.8	9.8	39.5	-15.0
A032350	롯데관광개발	9.8	9.7	9.7	9.9	39.1	-6.9
A004170	신세계	9.8	9.8	9.3	9.9	38.7	10.8
A166090	하나머티리얼즈	9.3	9.8	9.9	9.6	38.5	7.9
A000720	현대건설	9.9	9.9	8.9	9.7	38.3	8.7
A010060	OCI홀딩스	8.7	8.9	9.8	9.8	37.1	-3.5
A120110	코오롱인더	8.8	9.7	9.0	9.4	36.9	-3.2
A237690	에스티팜	9.4	9.5	9.6	8.4	36.8	11.2
A240810	원익IPS	7.2	9.9	9.9	9.7	36.7	-4.8
A011210	현대위아	9.5	9.5	8.8	7.9	35.7	6.1

외국인 순매수 스타일 성과 추이



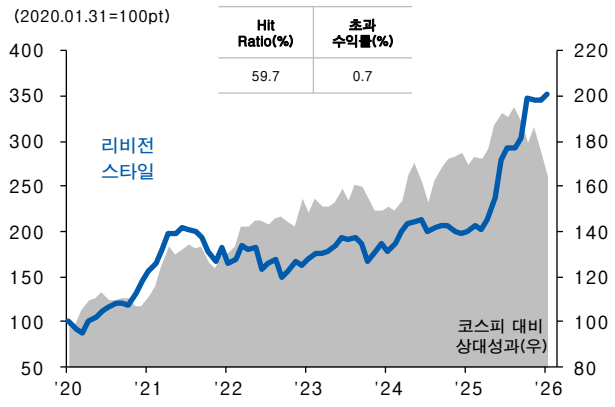
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A353200	대덕전자	10.0	10.0	9.8	9.5	39.2	-11.6
A069620	대웅제약	9.9	9.8	9.5	9.2	38.3	4.3
A237690	에스티팜	9.7	9.9	9.4	9.3	38.2	11.2
A241710	코스메카코리아	9.5	9.5	9.6	9.6	38.1	-5.9
A011070	LG이노텍	9.6	9.7	9.7	8.8	37.8	5.7
A012510	더존비즈온	9.0	9.7	9.5	8.7	36.8	3.5
A032350	롯데관광개발	7.1	9.4	10.0	9.9	36.3	-6.9
A278470	에이피알	9.1	8.6	8.9	9.7	36.2	-6.8
A071970	HD현대마린엔진	9.7	8.9	8.4	9.0	35.9	13.0
A007070	GS리테일	9.0	9.4	8.9	8.3	35.5	2.0

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/8일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

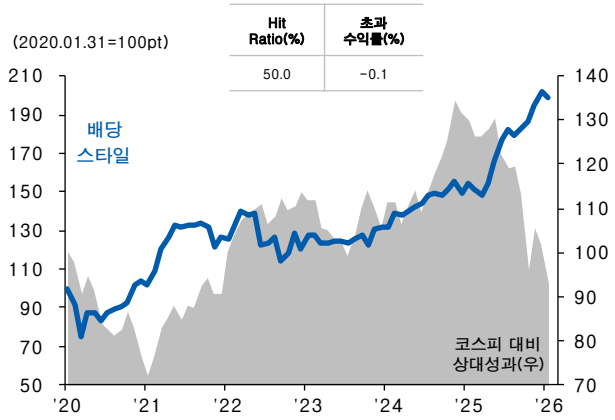


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.6	9.7	9.4	28.7	8.0
A000660	SK하이닉스	9.9	9.4	9.2	28.5	11.2
A034730	SK	8.9	9.0	9.8	27.7	7.9
A011070	LG이노텍	8.1	8.7	8.4	25.2	5.7
A010950	S-Oil	5.6	9.7	9.6	24.9	1.8
A145720	덴티움	9.5	8.9	5.8	24.1	-3.1
A195870	해성디에스	8.6	9.4	6.0	24.0	-15.0
A032350	롯데관광개발	9.1	8.8	5.6	23.5	-6.9
A010130	고려아연	8.7	8.9	5.4	23.0	-6.2
A009150	삼성전기	5.7	8.3	8.3	22.4	0.8

배당 스타일 성과 추이

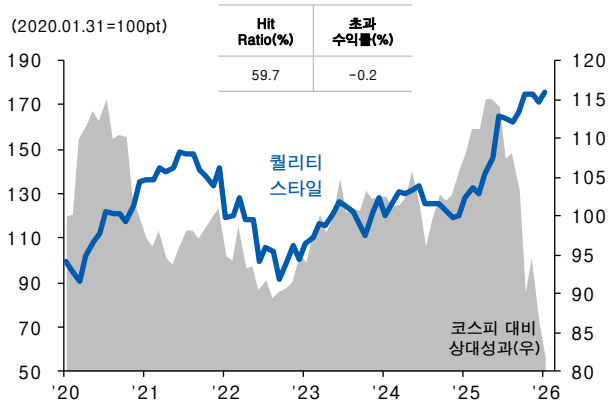


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A009240	한샘	9.5	9.9	9.9	9.9	39.3	-4.2
A030000	제일기획	8.9	9.6	9.1	9.8	37.4	-2.7
A005940	NH투자증권	8.1	9.3	9.9	9.6	36.9	-2.2
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.9	9.4	9.8	36.9	-0.3
A214320	이노션	8.1	9.7	9.1	9.9	36.7	-1.9
A032640	LG유플러스	9.2	9.3	9.0	8.8	36.3	-0.5
A030200	KT	9.7	8.7	8.8	9.1	36.2	0.4
A024110	기업은행	6.8	9.8	9.8	9.7	36.2	-2.2
A017670	SK텔레콤	8.9	9.8	9.4	7.8	35.8	-0.9
A078930	GS	8.0	9.4	9.3	9.2	35.8	1.1

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.5	9.9	9.7	9.4	38.5	1.9
A058470	리노공업	9.9	9.8	9.7	8.6	38.1	-0.9
A042700	한미반도체	9.1	9.7	9.4	9.8	37.9	26.7
A462870	시프트업	9.9	9.9	9.9	7.9	37.6	-5.4
A214150	클래시스	8.9	9.8	9.6	9.2	37.4	-4.4
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.8	36.8	-2.1
A000660	SK하이닉스	7.5	9.6	9.6	9.8	36.5	11.2
A259960	크래프톤	9.6	9.5	9.8	7.5	36.4	-7.5
A214450	파마리서치	7.9	9.6	9.3	9.0	35.7	6.7
A192080	더블유게임즈	9.8	9.4	9.4	6.9	35.5	-2.2

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/8일 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)