YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

1월 3주차 대마불사(大馬不死) 리밸런싱

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

유안타증권 Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 리밸런싱

대마불사(大馬不死) 리밸런싱

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

대마불사(大馬不死) 스크리닝 (참고 자료: 대마불사(大馬不死))

1) 대표적인 반도체 강세장인 '16~17년과 '23~24년의 사례를 살펴보면 ① YoY 기준 이익 – 주가의 Gap이 역전되고, ② 이익 트렌드가 둔화 -> 하락 전환되는 모습이 순차적으로 발생한 뒤 주가 상승 모멘텀 둔화

2) 현재 ① 시그널은 확인되지만, 이익 트렌드는 견조한 흐름 지속되며 강세장 하프라인 부근에 위치하는 것으로 판단. 또한 해당 강세장 사례의 또 다른 특징은 대형주 종목군의 상대우위 지속. 두 케이스 모두 지수 강세와 KOSPI 대비 대형주의 상대강도 확대 주기가 일치

3) 마지막으로 최근 단기 이익 추정치 변동폭이 높고 대형주의 이익과 주가간 상관성이 높아짐에 따라 대형주 중심으로 이익 추정치 변화에 더욱 민첩하게 대응할 필요. 이에 따라 최근 일주일 내 이익 추정치 조정 이력이 있는 KOSPI 대형주 종목 중 이익 추정치 조정률 상위 종목을 스크리닝

[1월 3주차] 1) 일주일 내 이익 조정 이력이 있는 KOSPI 대형주 중 2) 12MF 영업이익, 순이익 주간 조정률 상위 20% 스크리닝

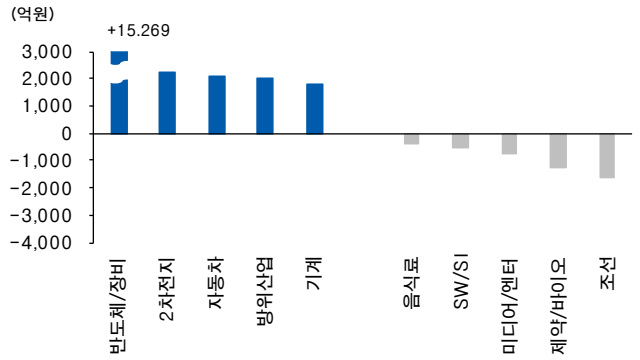
종목명	업종	시가총액 (억원)	12MF 영업이익 추정치(억원, %)			12MF 순이익 추정치(억원,%)		
			1/8일 기준	1/15일 기준	조정률	1/8일 기준	1/15일 기준	조정률
삼성전자	반도체	8,305,252	1,102,132	1,203,009	9.2	935,576	1,031,325	10.2
미래에셋증권	증권	167,290	15,942	16,944	6.3	13,121	13,999	6.7
SK하이닉스	반도체	5,401,778	894,476	936,447	4.7	723,285	756,889	4.6
삼성바이오로직스	건강관리	892,027	24,539	25,046	2.1	18,496	19,810	7.1
삼성중공업	조선	249,480	14,757	15,176	2.8	11,966	12,246	2.3
한화오션	조선	435,107	18,118	18,491	2.1	13,983	14,348	2.6
두산에너빌리티	기계	573,943	13,367	13,461	0.7	3,971	4,213	6.1
한국전력	유틸리티	344,093	177,128	179,862	1.5	109,115	111,153	1.9
카카오	소프트웨어	260,187	8,998	9,056	0.6	6,679	6,880	3.0
한국항공우주	상사,자본재	150,502	5,026	5,074	1.0	3,802	3,851	1.3
키움증권	증권	86,409	15,544	15,663	0.8	11,845	12,013	1.4
효성중공업	기계	198,147	9,916	9,968	0.5	7,196	7,252	0.8
현대글로비스	운송	193,125	22,306	22,427	0.5	18,034	18,135	0.6

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -1.1조원 순매도, 기관은 약 +2.9조원 순매수를 기록하며 두 수급 주체 모두 지난주와 상반된 자금 흐름 확인(외국인 +1.0조원 순매수, 기관 -1.9조원 순매도)
- 업종단에서는 기관과 외국인은 상반된 수급흐름 기록. 종목단에서는 대덕전자, 심텍, 효성티앤씨 등을 동시 순매수

기관 주간 순매수 상/하위 업종

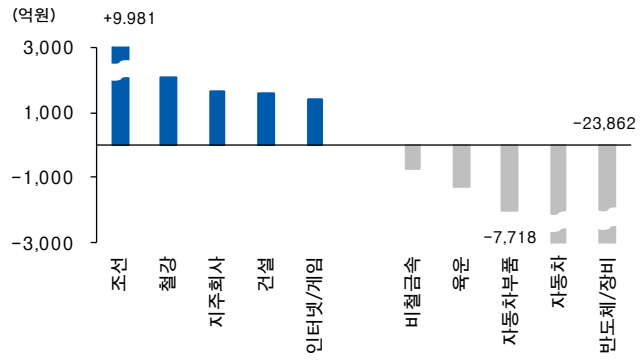


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	15,269	27,620	70,004	
2	2차전지	2,219	-4,565	2,876	
3	자동차	2,068	2,328	9,266	
4	방위산업	2,018	9,289	12,580	
5	기계	1,810	1,306	-2,631	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	조선	-1,596	-601	-2,208	
2	제약/바이오	-1,288	-56	1,169	
3	미디어/엔터	-768	-420	-196	
4	SW/SI	-519	-939	-401	
5	음식료	-395	-1,214	-1,334	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

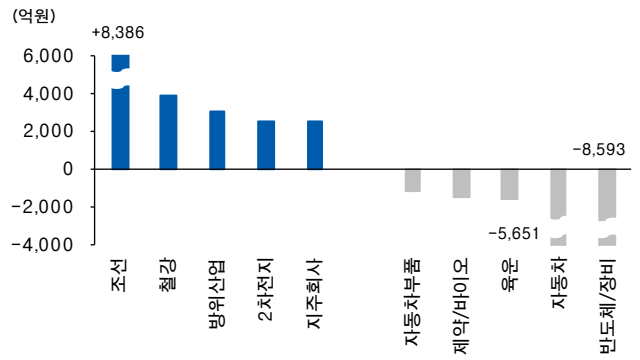


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	9,981	15,180	7,741	
2	철강	2,078	1,136	418	
3	지주회사	1,670	7,712	12,007	
4	건설	1,600	1,763	-368	
5	인터넷/게임	1,411	5,682	269	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	반도체/장비	-23,862	-19,946	-123,111	
2	자동차	-7,718	-7,259	-6,941	
3	자동차부품	-1,985	-7,066	-4,110	
4	육운	-1,281	-1,633	-1,748	
5	비철금속	-721	-3,023	-4,360	

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	8,386	14,579	5,533	
2	철강	3,861	2,451	2,535	
3	방위산업	3,078	14,622	15,117	
4	2차전지	2,531	-2,443	5,411	
5	지주회사	2,490	3,432	13,295	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	반도체/장비	-8,593	7,674	-53,107	
2	자동차	-5,651	-4,931	2,324	
3	육운	-1,666	-2,075	-1,669	
4	제약/바이오	-1,517	4,893	11,368	
5	자동차부품	-1,213	-4,362	-76	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/15일 기준

업종별 | 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,486	141	0.40
A353200	대덕전자	전자/부품	25,005	248	0.27
A006650	대한유화	화학	10,348	87	0.23
A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	52,567	462	0.22
A010060	OCI홀딩스	화학	22,218	181	0.22
A011780	금호석유화학	화학	37,069	314	0.22
A066970	엘앤에프	2차전지	46,508	366	0.20
A006280	녹십자	제약/바이오	19,926	150	0.20
A222800	심텍	전자/부품	19,418	138	0.19
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	11,490	79	0.19

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A222800	심텍	전자/부품	19,418	452	0.62
A052690	한전기술	전기	43,341	799	0.48
A042660	한화오션	조선	456,250	6,497	0.36
A000720	현대건설	건설	111,244	1,450	0.34
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	11,490	121	0.29
A001120	LX인터내셔널	상사	14,031	130	0.25
A001430	세아베스틸지주	철강	24,099	232	0.24
A353200	대덕전자	전자/부품	25,005	200	0.22
A298050	HS효성첨단소재	화학	9,049	75	0.22
A376300	디어유	미디어/엔터	8,119	70	0.21

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A222800	심텍	전자/부품	19,418	590	0.8
A052690	한전기술	전기	43,341	1,040	0.6
A353200	대덕전자	전자/부품	25,005	448	0.5
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	11,490	200	0.5
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,486	160	0.4
A000720	현대건설	건설	111,244	1,876	0.4
A042660	한화오션	조선	456,250	6,419	0.4
A005490	POSCO홀딩스	철강	284,479	3,589	0.3
A011780	금호석유화학	화학	37,069	472	0.3
A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	52,567	649	0.3

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A010130	고려아연	비철금속	300,153	538.4	-2,907	-2,155
A204320	HL만도	자동차부품	29,348	143.9	-2,020	-2,115
A373220	LG에너지솔루션	2차전지	917,280	709.8	-1,239	2,953
A000150	두산	지주회사	135,057	481.9	-1,439	-591
A006400	삼성SDI	2차전지	234,907	636.1	-841	-2,085
A096770	SK이노베이션	정유	181,901	401.8	-788	584
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	173,801	302.2	-740	-1,329
A007660	이수페타시스	전자/부품	89,706	0.9	-924	2
A278470	에이피알	화장품	88,898	256.9	-623	1,065
A222800	심텍	전자/부품	19,418	590.4	-105	-523

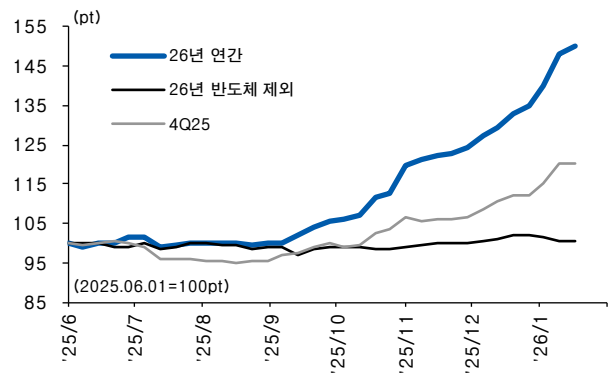
자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/15일 기준

업종별 | 종목별

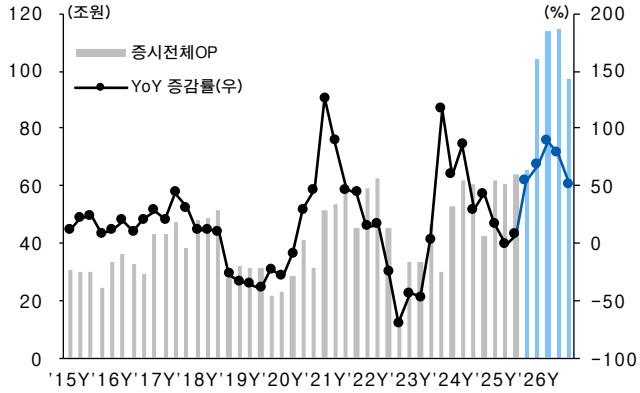
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 기준 '26년 연간 +1.6%, 반도체 제외 '26년 연간 -0.4% 하향조정. '26년 연간 영업이익 추정치 확대는 지속되고 있지만, 반도체 제외 시 부진한 흐름 확인
- 전기 업종의 4Q25 영업이익 추정치는 3주간 약 -18.3%의 하향조정 이후 이번주 약 +26.2%의 상향조정을 기록하며 우상향 전환

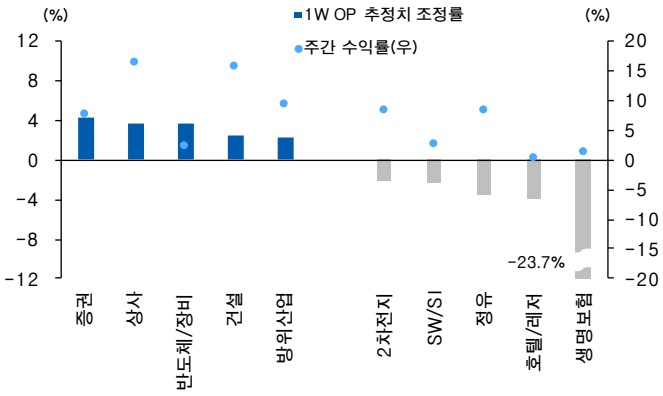
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

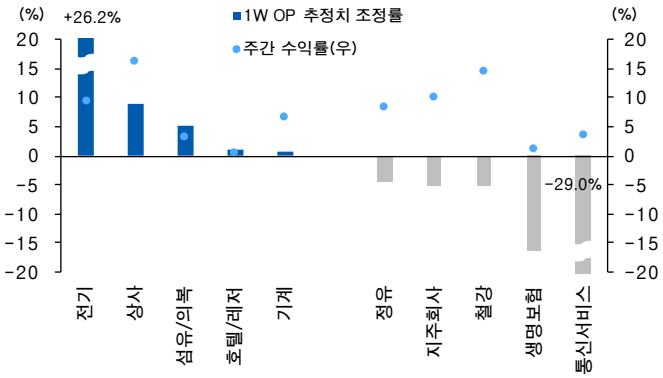


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	증권	88,451	4.2	7.8	
2	상사	18,313	3.7	16.4	
3	반도체/장비	2,380,012	3.7	2.4	
4	건설	35,291	2.5	15.8	
5	방위산업	59,188	2.2	9.4	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	생명보험	28,425	-23.7	1.4	
2	호텔/레저	9,782	-4.0	0.4	
3	정유	32,183	-3.6	8.4	
4	SW/SI	16,795	-2.4	2.5	
5	2차전지	15,774	-2.2	8.3	

25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

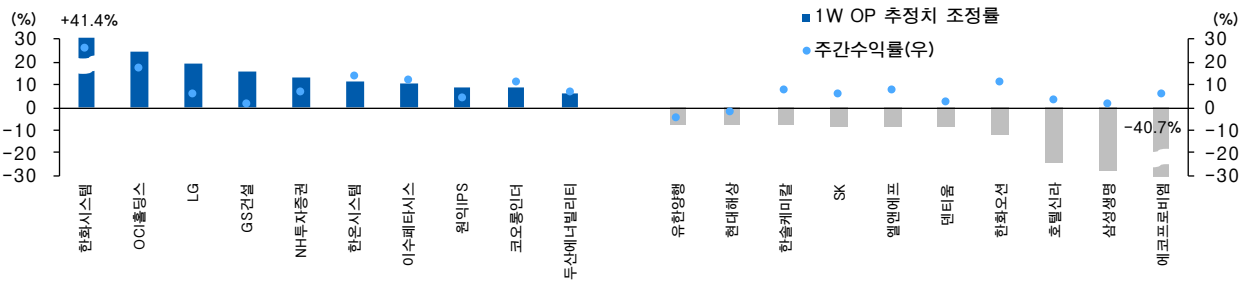
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	36,582	26.2	9.5	
2	상사	3,449	8.8	16.4	
3	섬유/의복	3,046	5.3	3.3	
4	호텔/레저	1,722	1.1	0.4	
5	기계	15,553	0.7	6.6	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	통신서비스	4,891	-29.0	3.7	
2	생명보험	2,126	-16.5	1.4	
3	철강	5,601	-5.2	14.4	
4	지주회사	66,259	-5.1	10.2	
5	정유	7,142	-4.4	8.4	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 1/14일 기준 추정치 (수익률 1/15일 기준)

업종별 | 종목별

연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



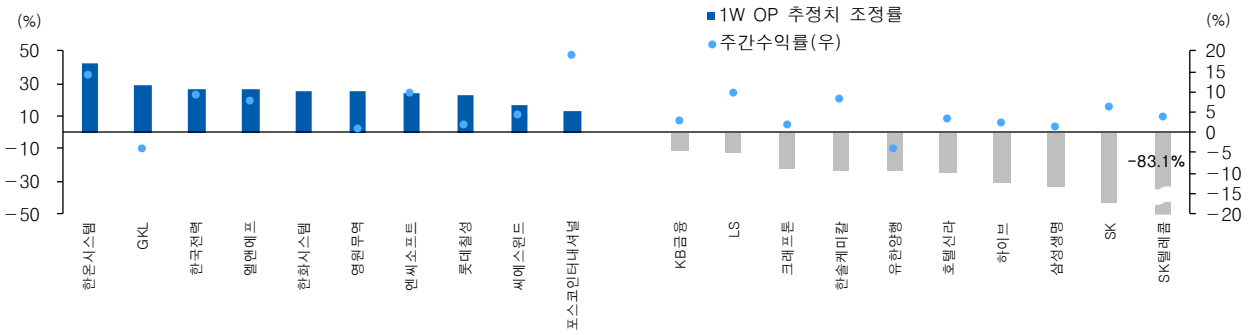
연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A272210	한화시스템	방위산업	3,720	41.4	25.5
2	A010060	OCI홀딩스	화학	3,733	24.5	17.0
3	A003550	LG	지주회사	19,440	19.6	5.6
4	A006360	GS건설	건설	5,542	15.7	1.5
5	A005940	NH투자증권	증권	14,434	13.2	6.7
6	A018880	한온시스템	자동차부품	3,582	11.6	14.0
7	A007660	이수페타시스	전자/부품	3,346	10.5	11.7
8	A240810	원익IPS	반도체/장비	1,820	9.0	3.7
9	A120110	코오롱인더	화학	2,191	9.0	11.3
10	A034020	두산에너빌리티	기계	15,031	6.6	6.3

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A247540	에코프로비엠	2차전지	893	-40.7	6.1
2	A032830	삼성생명	생명보험	21,340	-28.2	1.1
3	A008770	호텔신라	호텔/레저	1,355	-24.3	3.1
4	A042660	한화오션	조선	19,222	-12.3	10.8
5	A145720	덴티움	의료기기	776	-9.0	2.1
6	A066970	엘앤에프	2차전지	1,107	-8.7	7.3
7	A034730	SK	지주회사	46,893	-8.7	6.2
8	A014680	한솔케미칼	화학	2,121	-7.6	7.9
9	A001450	현대해상	손해보험	10,937	-7.6	-2.4
10	A000100	유한양행	제약/바이오	1,481	-7.5	-4.5

4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

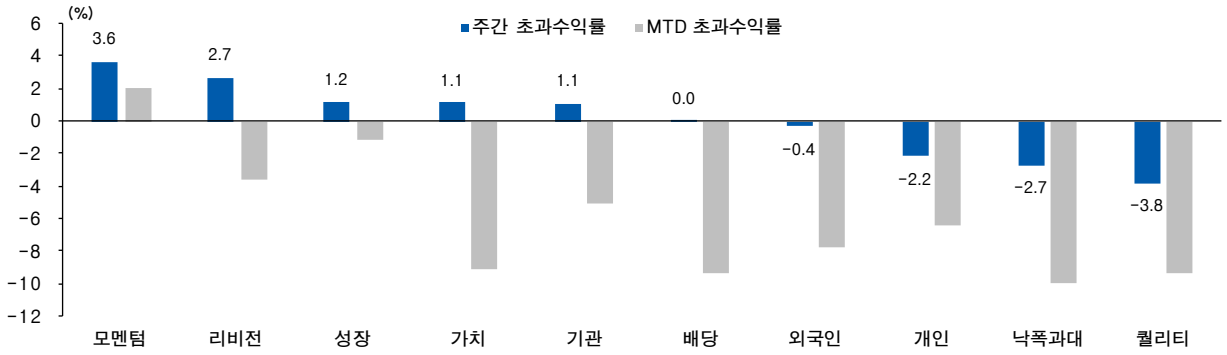
(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A018880	한온시스템	자동차부품	713	42.5	14.0
2	A114090	GKL	호텔/레저	90	28.6	-4.3
3	A015760	한국전력	전기	35,701	27.0	8.9
4	A066970	엘앤에프	2차전지	278	26.4	7.3
5	A272210	한화시스템	방위산업	220	25.7	25.5
6	A111770	영원무역	섬유/의복	791	25.7	0.7
7	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	39	24.6	9.4
8	A005300	롯데칠성	음식료	62	22.8	1.4
9	A112610	씨에스윈드	기계	634	16.7	3.9
10	A047050	포스코인터내셔널	상사	2,430	13.0	18.5

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A017670	SK텔레콤	통신서비스	1,070	-63.1	3.6
2	A034730	SK	지주회사	4,970	-42.8	6.2
3	A032830	삼성생명	생명보험	856	-33.0	1.1
4	A352820	하이브	미디어/엔터	70	-31.2	2.3
5	A008770	호텔신라	호텔/레저	69	-24.5	3.1
6	A000100	유한양행	제약/바이오	423	-23.6	-4.5
7	A014680	한솔케미칼	화학	227	-23.1	7.9
8	A259960	크래프톤	인터넷/게임	1,089	-22.6	1.5
9	A006260	LS	지주회사	2,586	-12.6	9.4
10	A105560	KB금융	은행	10,413	-11.8	2.8

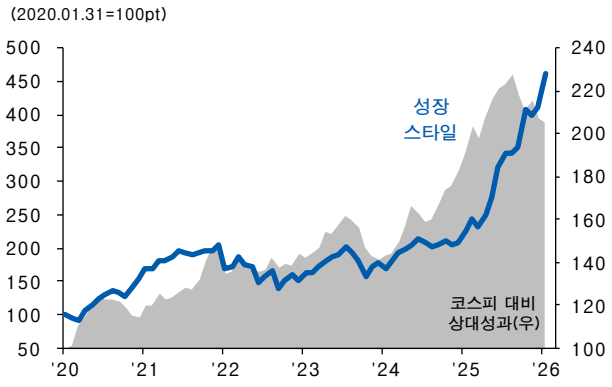
자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 1/14일 기준 추정치(수익률 1/15일 기준)

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.1	1.1



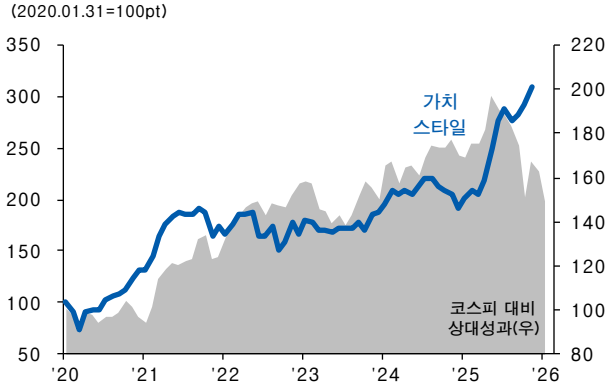
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A000660	SK하이닉스	9.8	6.1	5.4	21.2	0.7
A329180	HD현대중공업	8.9	6.0	5.7	20.6	3.9
A005930	삼성전자	7.9	6.3	5.9	20.1	3.5
A353200	대덕전자	7.2	6.4	6.2	19.8	19.3
A278470	에이피알	9.7	5.3	4.6	19.6	4.0
A032350	롯데관광개발	9.4	5.9	3.2	18.4	-1.4
A166090	하나머티리얼즈	6.7	5.8	5.5	18.0	16.6
A195870	해성디에스	5.9	6.1	5.9	18.0	16.8
A352820	하이브	8.8	6.2	2.9	17.8	2.3
A376300	디어유	7.2	5.0	5.4	17.6	-5.4

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
55.6	0.6



가치 스코어 Top 10

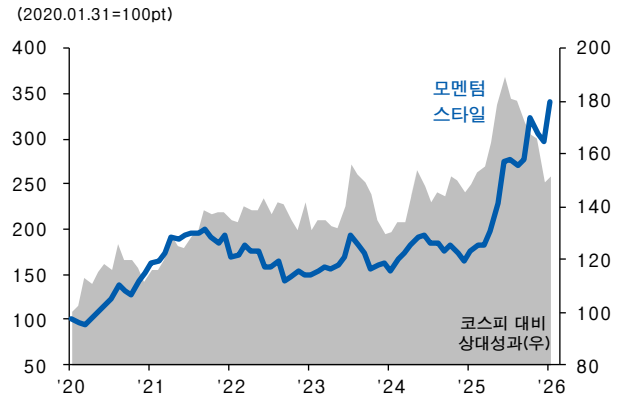
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.6	5.8
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	4.6
A036460	한국가스공사	9.7	9.7	9.8	29.2	2.4
A011170	롯데케미칼	10.0	9.8	9.2	29.0	9.4
A108670	LX하우시스	9.4	9.6	9.9	28.8	2.9
A001450	현대해상	9.9	8.8	9.7	28.4	-2.4
A023530	롯데쇼핑	8.7	10.0	9.4	28.1	6.8
A139480	이마트	8.3	9.9	9.9	28.1	1.0
A047040	대우건설	9.3	9.4	9.1	27.8	5.3
A375500	DL이앤씨	9.5	9.6	8.6	27.6	1.7

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/15일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

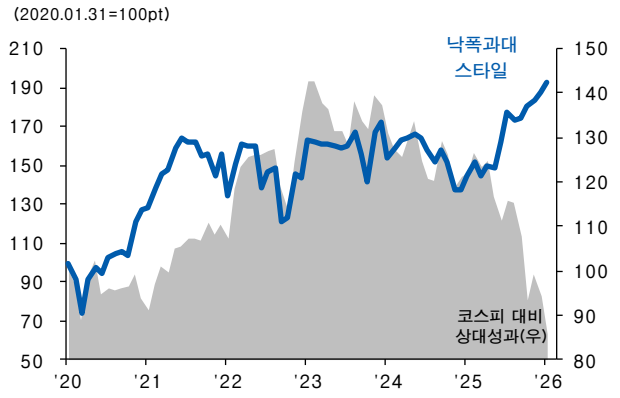
모멘텀 스타일 성과 추이

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	0.7
A307950	현대오토에버	9.9	10.0	9.6	9.1	38.5	4.7
A240810	원익IPS	9.0	9.4	9.9	9.4	37.6	3.8
A001430	세아베스틸지주	10.0	9.9	8.7	9.0	37.6	9.1
A195870	해성디에스	9.2	9.8	9.6	8.8	37.4	16.8
A005930	삼성전자	9.6	9.3	9.7	8.6	37.1	3.5
A011210	현대위아	9.7	9.6	9.2	8.1	36.5	-3.6
A032350	롯데관광개발	9.7	9.1	7.8	9.5	36.0	-1.4
A011070	LG이노텍	9.3	9.3	9.4	7.0	35.0	6.8
A204320	HL만도	9.9	9.8	9.4	5.8	34.7	9.7

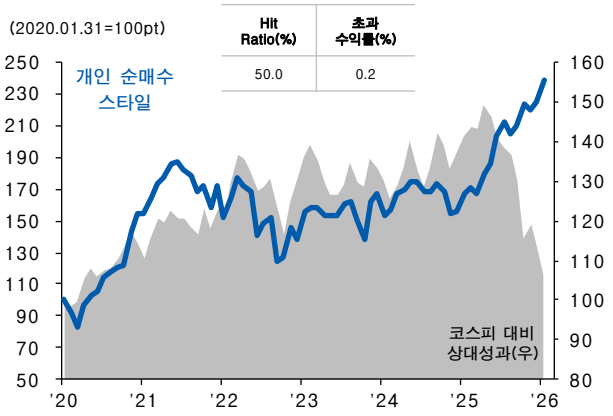
낙폭과대 스코어 Top 10

(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	2.1
A462870	시프트업	8.5	9.0	9.6	9.8	36.8	5.0
A259960	크래프톤	7.3	9.3	9.7	9.6	35.9	1.6
A251270	넷마블	8.8	9.7	9.3	7.8	35.6	4.5
A051900	LG생활건강	8.1	8.6	9.1	9.3	35.0	0.4
A140860	파크시스템스	9.4	9.5	9.5	6.0	34.4	2.7
A145020	휴젤	4.7	9.8	9.9	9.4	33.8	-6.3
A089590	제주항공	5.3	9.2	9.3	10.0	33.8	5.8
A067160	SOOP	5.9	8.5	9.5	9.9	33.8	-0.3
A293490	카카오게임즈	7.3	7.6	9.2	9.2	33.3	0.8

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/15일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

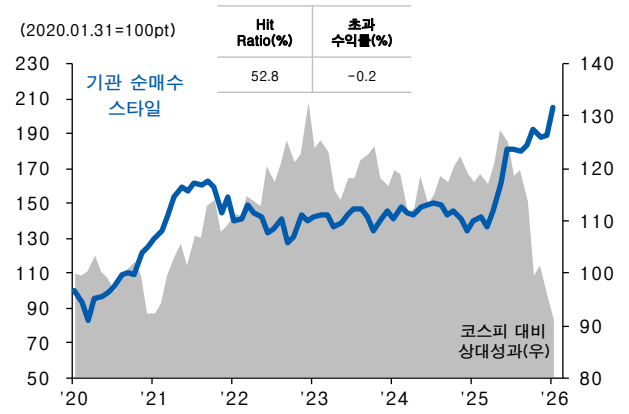


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	1.9
A161890	한국콜마	9.5	9.7	10.0	9.9	39.0	1.6
A051900	LG생활건강	9.4	9.5	9.8	9.8	38.4	0.4
A145720	덴티움	9.8	9.3	9.1	9.4	37.5	2.1
A204320	HL만도	10.0	9.4	8.7	9.1	37.1	9.7
A035420	NAVER	7.8	9.6	9.6	9.7	36.6	-2.4
A036930	주성엔지니어링	8.2	9.0	9.3	9.5	36.0	-2.8
A067160	SOOP	8.1	8.1	9.8	9.8	35.7	-0.3
A140860	파크시스템스	9.1	9.2	9.2	8.4	35.7	2.7
A192820	코스맥스	6.2	9.8	9.9	9.6	35.4	4.0

기관 순매수 스타일 성과 추이

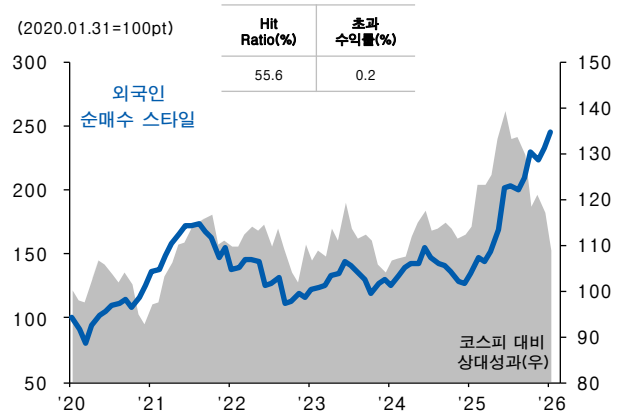


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A195870	해성디에스	10.0	10.0	9.8	9.8	39.5	16.8
A032350	롯데관광개발	9.8	9.7	9.7	9.9	39.1	-1.4
A004170	신세계	9.8	9.8	9.3	9.9	38.7	7.4
A166090	하나머티리얼즈	9.3	9.8	9.9	9.6	38.5	16.6
A000720	현대건설	9.9	9.9	8.9	9.7	38.3	29.6
A010060	OCI홀딩스	8.7	8.9	9.8	9.8	37.1	16.2
A120110	코오롱인더	8.8	9.7	9.0	9.4	36.9	11.4
A237690	에스티팜	9.4	9.5	9.6	8.4	36.8	-5.3
A240810	원익IPS	7.2	9.9	9.9	9.7	36.7	3.8
A011210	현대위아	9.5	9.5	8.8	7.9	35.7	-3.6

외국인 순매수 스타일 성과 추이



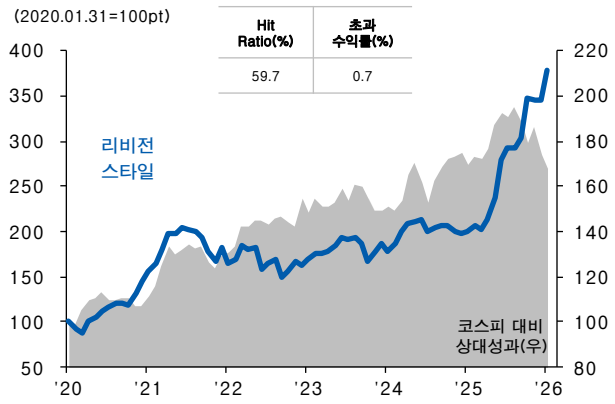
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A353200	대덕전자	10.0	10.0	9.8	9.5	39.2	19.3
A069620	대웅제약	9.9	9.8	9.5	9.2	38.3	-4.6
A237690	에스티팜	9.7	9.9	9.4	9.3	38.2	-5.3
A241710	코스메카코리아	9.5	9.5	9.6	9.6	38.1	-4.3
A011070	LG이노텍	9.6	9.7	9.7	8.8	37.8	6.8
A012510	더존비즈온	9.0	9.7	9.5	8.7	36.8	1.1
A032350	롯데관광개발	7.1	9.4	10.0	9.9	36.3	-1.4
A278470	에이피알	9.1	8.6	8.9	9.7	36.2	4.0
A071970	HD현대마린엔진	9.7	8.9	8.4	9.0	35.9	-7.6
A007070	GS리테일	9.0	9.4	8.9	8.3	35.5	5.2

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/15일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

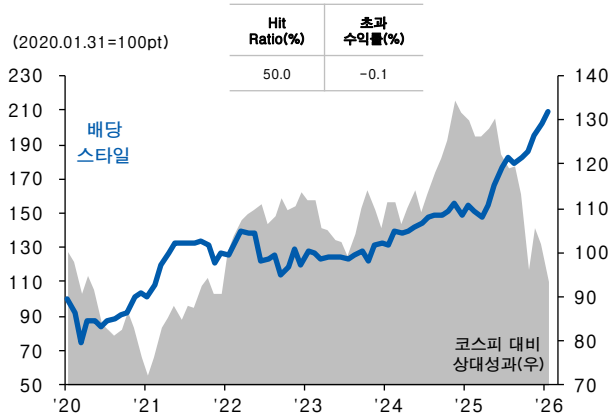


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.6	9.7	9.4	28.7	3.5
A000660	SK하이닉스	9.9	9.4	9.2	28.5	0.7
A034730	SK	8.9	9.0	9.8	27.7	6.2
A011070	LG이노텍	8.1	8.7	8.4	25.2	6.8
A010950	S-Oil	5.6	9.7	9.6	24.9	9.1
A145720	덴티움	9.5	8.9	5.8	24.1	2.1
A195870	해성디에스	8.6	9.4	6.0	24.0	16.8
A032350	롯데관광개발	9.1	8.8	5.6	23.5	-1.4
A010130	고려아연	8.7	8.9	5.4	23.0	24.3
A009150	삼성전기	5.7	8.3	8.3	22.4	8.7

배당 스타일 성과 추이

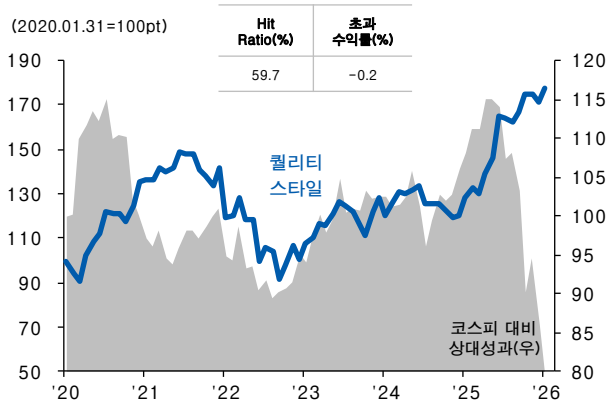


배당 스코어 Top 10

(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	5.4
A030000	제일기획	8.9	9.6	9.1	9.8	37.4	3.4
A005940	NH투자증권	8.1	9.3	9.9	9.6	36.9	6.6
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.9	9.4	9.8	36.9	12.5
A214320	이노션	8.1	9.7	9.1	9.9	36.7	1.1
A032640	LG유플러스	9.2	9.3	9.0	8.8	36.3	6.1
A030200	KT	9.7	8.7	8.8	9.1	36.2	2.5
A024110	기업은행	6.8	9.8	9.8	9.7	36.2	1.5
A017670	SK텔레콤	8.9	9.8	9.4	7.8	35.8	3.6
A078930	GS	8.0	9.4	9.3	9.2	35.8	6.2

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	4.2
A058470	리노공업	9.9	9.8	9.7	8.6	38.1	3.3
A042700	한미반도체	9.1	9.7	9.4	9.8	37.9	2.3
A462870	시프트업	9.9	9.9	9.9	7.9	37.6	5.0
A214150	클래시스	8.9	9.8	9.6	9.2	37.4	0.6
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.8	36.8	-6.3
A000660	SK하이닉스	7.5	9.6	9.6	9.8	36.5	0.7
A259960	크래프톤	9.6	9.5	9.8	7.5	36.4	1.6
A214450	파마리서치	7.9	9.6	9.3	9.0	35.7	-12.9
A192080	더블유게임즈	9.8	9.4	9.4	6.9	35.5	-2.3

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/15일 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)