YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

1월 4주차 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 4주차] 1) 일주일 내 이익 조정 이력이 있는 KOSPI 대형주 중 2) 12MF 영업이익, 순이익 주간 조정률 상위 20% 스크리닝

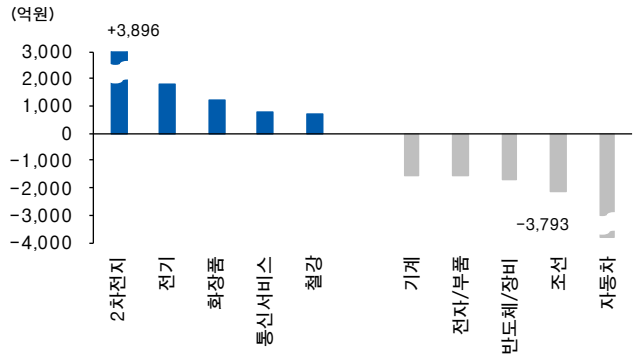
종목명	업종	시가총액 (억원)	12MF 영업이익 추정치(억원, %)			12MF 순이익 추정치(억원,%)		
			1/15일 기준	1/22일 기준	조정률	1/15일 기준	1/22일 기준	조정률
S-Oil	에너지	103,464	12,597	14,345	13.9	7,456	8,694	16.6
고려아연	비철,목재등	345,865	11,730	13,042	11.2	7,891	8,853	12.2
미래에셋증권	증권	168,708	18,002	18,891	4.9	14,938	15,662	4.9
SK하이닉스	반도체	5,387,218	936,447	980,314	4.7	756,889	793,151	4.8
SK이노베이션	에너지	178,858	17,954	18,345	2.2	696	747	7.3
키움증권	증권	83,374	15,725	16,326	3.8	12,194	12,624	3.5
삼성바이오로직스	건강관리	867,030	24,539	25,035	2.0	18,496	19,632	6.1
한국금융지주	증권	100,697	23,158	23,790	2.7	18,740	19,169	2.3
HMM	운송	189,591	8,712	8,910	2.3	11,749	12,035	2.4
한국항공우주	상사,자본재	160,054	5,074	5,150	1.5	3,851	3,906	1.4
포스코인터내셔널	상사,자본재	109,776	13,137	13,284	1.1	7,852	7,955	1.3
SK바이오팜	건강관리	89,277	3,443	3,492	1.4	2,839	2,867	1.0
하이브	미디어,교육	153,819	4,927	4,971	0.9	3,791	3,841	1.3
한화에어로스페이스	상사,자본재	678,059	44,678	45,136	1.0	24,360	24,540	0.7

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +1.0조원 순매수, 기관은 약 -4,887억원 순매도를 기록. 두 수급 주체 모두 2차전지 업종에 대한 강도 높은 순매수 확인
- CES 이후 로봇 관련 테마 강세로 현대차, 기아 강세보인 반면 외국인 및 기관 모두 순매도를 기록 (-2.3조원)

기관 주간 순매수 상/하위 업종

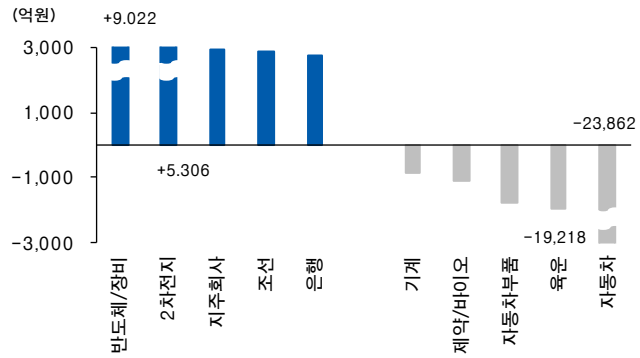


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	3,896	2,045	1,053	
2	전기	1,805	1,776	1,242	
3	화장품	1,194	126	1,081	
4	통신서비스	799	994	1,103	
5	철강	676	1,311	1,802	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	자동차	-3,793	-865	4,515	
2	조선	-2,119	-2,698	-5,159	
3	반도체/장비	-1,706	25,148	60,982	
4	전자/부품	-1,586	-3,813	-272	
5	기계	-1,558	1,634	-5,123	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

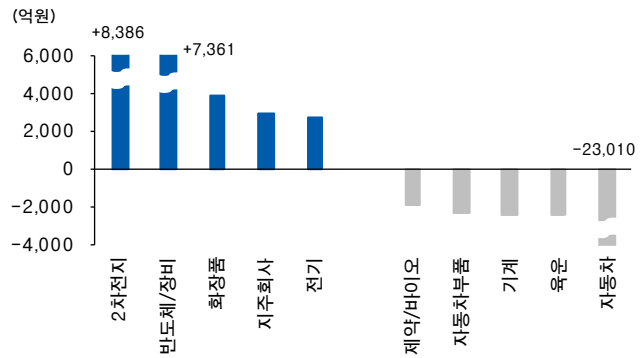


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	9,022	7,799	-111,788	
2	2차전지	5,306	8,379	9,092	
3	지주회사	2,922	10,421	13,339	
4	조선	2,856	19,383	6,573	
5	은행	2,748	4,971	-7,164	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	자동차	-19,218	-28,130	-26,486	
2	육운	-1,979	-3,885	-3,975	
3	자동차부품	-1,768	-7,791	-6,569	
4	제약/바이오	-1,074	3,847	10,000	
5	기계	-873	9,556	-1,168	

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	2차전지	9,202	10,424	10,145	
2	반도체/장비	7,316	32,947	-50,806	
3	화장품	3,927	2,915	5,174	
4	지주회사	2,952	6,565	13,197	
5	전기	2,707	5,918	7,198	
하위	**업종**	**1W 누적**	**1M 누적**	**3M 누적**	**5W 순매수 추이**
1	자동차	-23,010	-28,995	-21,971	
2	육운	-2,503	-5,019	-4,454	
3	기계	-2,430	11,190	-6,291	
4	자동차부품	-2,377	-6,692	-3,279	
5	제약/바이오	-1,888	1,732	10,363	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/22일 기준

업종별 | 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	16,813	325	0.56
A047040	대우건설	건설	20,656	341	0.43
A241710	코스메카코리아	화장품	8,672	109	0.35
A257720	실리콘투	화장품	29,730	345	0.31
A214450	파마리서치	의료기기	47,377	421	0.23
A006400	삼성SDI	2차전지	309,851	2,491	0.23
A006650	대한유화	화학	10,173	86	0.21
A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	22,177	159	0.21
A145020	휴젤	제약/바이오	31,375	213	0.18
A052690	한전기술	전기	52,247	366	0.17

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A018880	한온시스템	자동차부품	34,893	540	0.40
A278470	에이피알	화장품	107,052	1,470	0.38
A257720	실리콘투	화장품	29,730	387	0.35
A066970	엘앤에프	2차전지	50,651	522	0.28
A006400	삼성SDI	2차전지	309,851	2,789	0.26
A017670	SK텔레콤	통신서비스	132,525	1,219	0.23
A352820	하이브	미디어/엔터	157,385	1,446	0.23
A128940	한미약품	제약/바이오	55,151	499	0.22
A222800	심텍	전자/부품	18,167	157	0.21
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,061	75	0.21

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A257720	실리콘투	화장품	29,730	732	0.7
A278470	에이피알	화장품	107,052	1,924	0.5
A006400	삼성SDI	2차전지	309,851	5,280	0.5
A241710	코스메카코리아	화장품	8,672	138	0.4
A066970	엘앤에프	2차전지	50,651	794	0.4
A017670	SK텔레콤	통신서비스	132,525	1,993	0.4
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	16,813	199	0.3
A052690	한전기술	전기	52,247	686	0.3
A000150	두산	지주회사	145,745	1,657	0.3
A090430	아모레퍼시픽	화장품	74,110	695	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005930	삼성전자	반도체/장비	9,015,609	4,339.6	-171	-11,281
A214450	파마리서치	의료기기	47,377	185.6	-1,235	-2,187
A003230	삼양식품	음식료	93,033	581.0	-602	365
A010130	고려아연	비철금속	324,575	8.7	-1,168	-1,475
A307950	현대오토에버	SW/SI	127,659	141.6	-842	-340
A128940	한미약품	제약/바이오	55,151	352.6	-554	-140
A035720	카카오	인터넷/게임	258,417	283.9	-527	976
A096770	SK이노베이션	정유	189,677	327.6	-124	-736
A036460	한국가스공사	가스	38,079	103.7	-301	-109
A195940	HK이노엔	제약/바이오	13,584	38.4	-347	-186

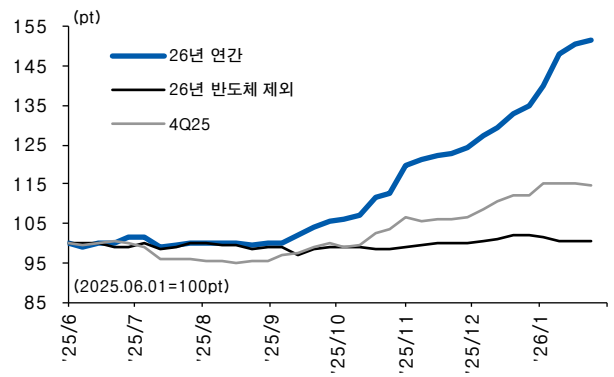
자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/22일 기준

업종별 종목별

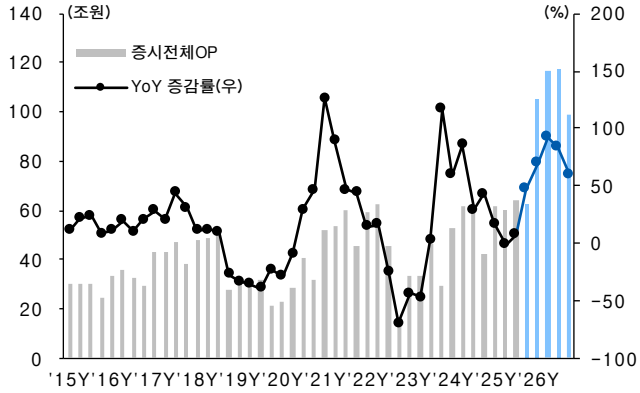
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 기준 '26년 연간 +0.5%, 반도체 제외 '26년 연간 +0.1% 소폭 상향조정. 25년 4분기 실적시즌이 시작되며 이익 추정치 조정이 활발하게 이뤄지고 있으며 주간 기준 소폭 하향조정 진행(-0.1%)
- 비철금속 업종의 '25년 4분기 이익 추정치는 조정률은 하위에 스크리닝되었지만 '26년 연간의 경우 상위에 스크리닝되며 상반된 이익 기대감 형성

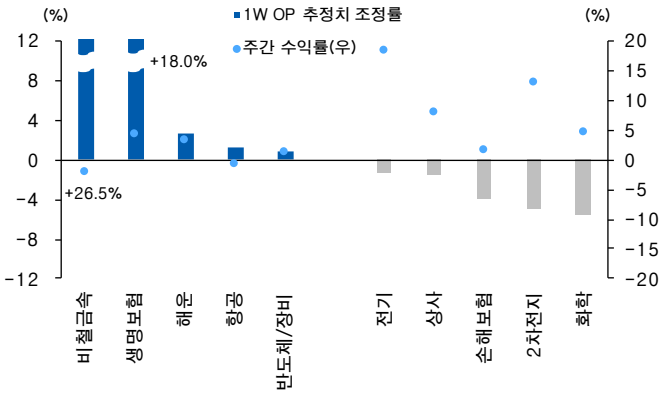
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

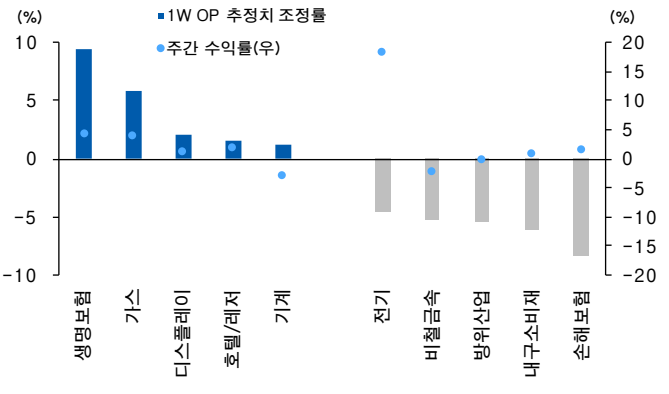


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	20,180	26.5	-2.0	
2	생명보험	33,270	18.0	4.4	
3	해운	13,702	2.7	3.3	
4	항공	15,040	1.3	-0.9	
5	반도체/장비	2,410,926	0.9	1.3	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	36,755	-5.5	4.7	
2	2차전지	14,447	-4.9	12.9	
3	손해보험	64,461	-3.9	1.7	
4	상사	18,013	-1.5	8.1	
5	전기	191,727	-1.3	18.2	

25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



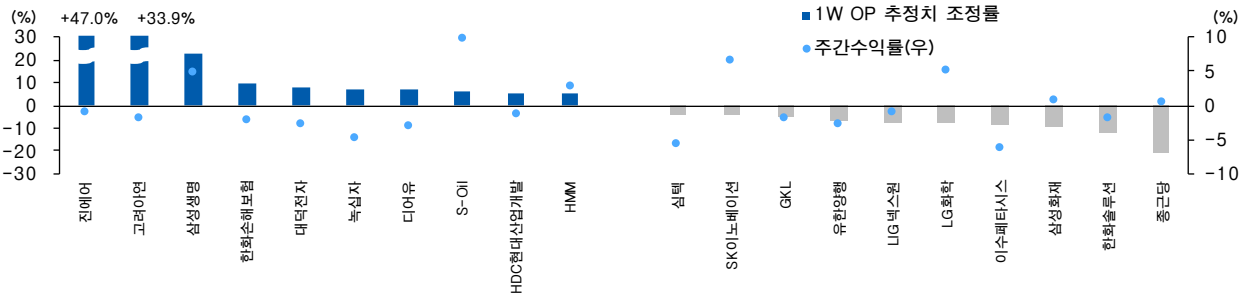
25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	생명보험	2,599	9.5	4.4	
2	가스	9,025	5.8	4.0	
3	디스플레이	3,355	2.0	1.2	
4	호텔/레저	1,725	1.5	2.0	
5	기계	15,232	1.3	-3.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	손해보험	8,046	-8.4	1.7	
2	내구소비재	2,717	-6.2	1.0	
3	방위산업	13,069	-5.5	-0.2	
4	비철금속	5,026	-5.4	-2.0	
5	전기	34,946	-4.5	18.2	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 1/21일 기준 추정치 (수익률 1/22일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



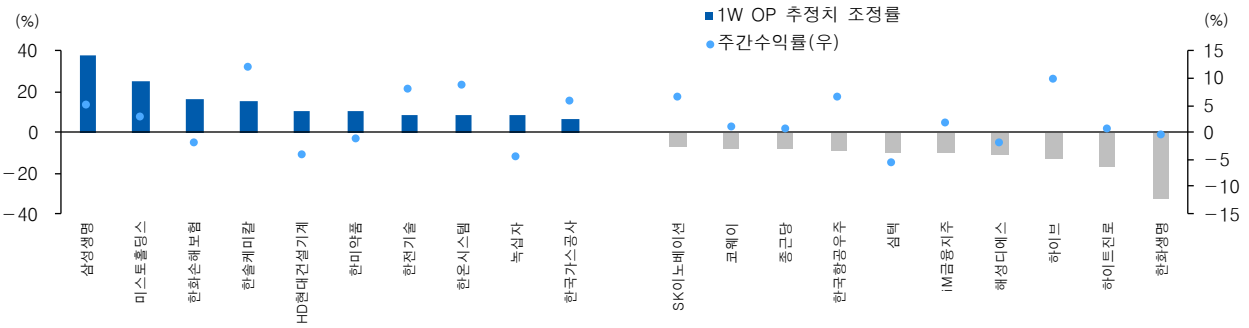
'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A272450	진에어	항공	512	47.0	-1.1
2	A010130	고려아연	비철금속	16,570	33.9	-1.9
3	A032830	삼성생명	생명보험	26,280	23.1	4.8
4	A000370	한화손해보험	손해보험	4,842	9.3	-2.1
5	A353200	대덕전자	전자/부품	1,550	8.0	-2.7
6	A006280	녹십자	제약/바이오	983	7.2	-4.7
7	A376300	디어유	미디어/엔터	492	6.8	-3.1
8	A010950	S-Oil	정유	15,531	5.9	9.8
9	A294870	HDC현대산업개발	건설	4,520	5.1	-1.2
10	A011200	HMM	해운	8,312	5.0	2.8

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A185750	종근당	제약/바이오	779	-21.1	0.5
2	A009830	한화솔루션	화학	4,763	-12.2	-1.9
3	A000810	삼성화재	손해보험	27,086	-10.0	0.6
4	A007660	이수페타시스	전자/부품	3,062	-8.5	-6.4
5	A051910	LG화학	화학	17,471	-8.0	5.1
6	A079550	LIG넥스원	방위산업	4,486	-7.7	-1.1
7	A000100	유한양행	제약/바이오	1,384	-6.5	-2.9
8	A114090	GKL	호텔/레저	678	-5.0	-2.0
9	A096770	SK이노베이션	정유	18,230	-4.7	6.5
10	A222800	심텍	전자/부품	1,373	-4.6	-5.7

'25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

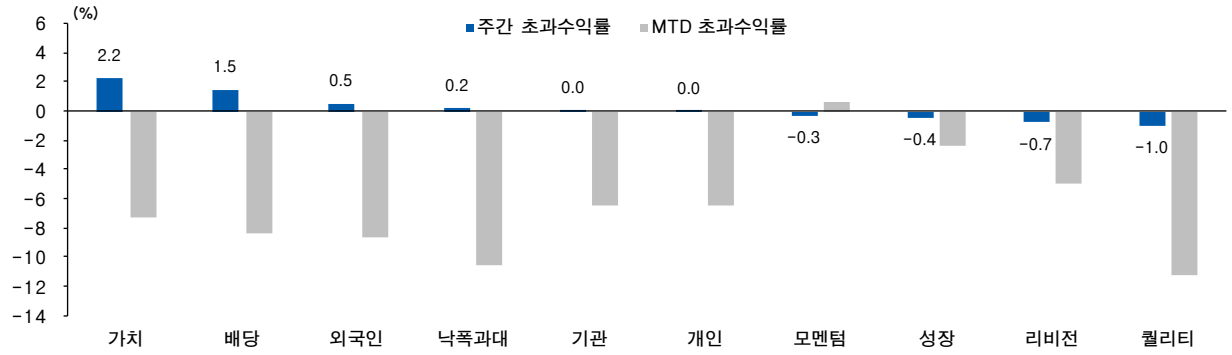
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A032830	삼성생명	생명보험	1,949	37.9	4.8
2	A081660	미스토홀딩스	섬유/의복	155	25.2	2.6
3	A000370	한화손해보험	손해보험	793	16.5	-2.1
4	A014680	한솔케미칼	화학	262	15.2	12.0
5	A267270	HD현대건설기계	기계	488	10.9	-4.2
6	A128940	한미약품	제약/바이오	705	10.5	-1.4
7	A052690	한전기술	전기	318	8.9	7.9
8	A018880	한온시스템	자동차부품	775	8.7	8.6
9	A006280	녹십자	제약/바이오	21	8.3	-4.7
10	A036460	한국가스공사	가스	7,932	6.7	5.6

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A088350	한화생명	생명보험	650	-32.3	-0.6
2	A000080	하이트진로	음식료	180	-17.0	0.4
3	A352820	하이브	미디어/엔터	55	-13.5	9.5
4	A195870	해성디에스	반도체/장비	206	-11.0	-2.0
5	A139130	iM금융지주	은행	306	-10.4	1.7
6	A222800	심텍	전자/부품	135	-10.0	-5.7
7	A047810	한국항공우주	방위산업	916	-9.2	6.3
8	A185750	종근당	제약/바이오	181	-8.1	0.5
9	A021240	코웨이	내구소비재	1,926	-8.0	0.7
10	A096770	SK이노베이션	정유	2,763	-7.4	6.5

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 1/21일 기준 추정치(수익률 1/22일 기준)

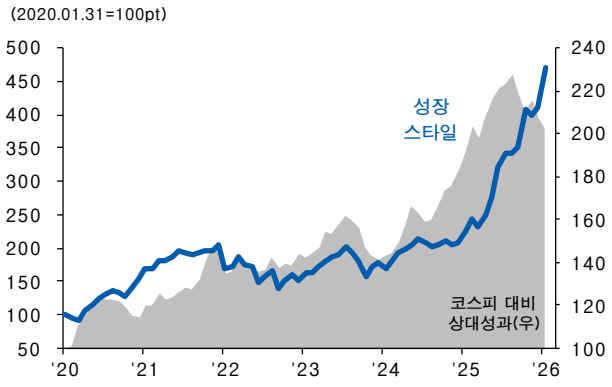
업종별 종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.1	1.1



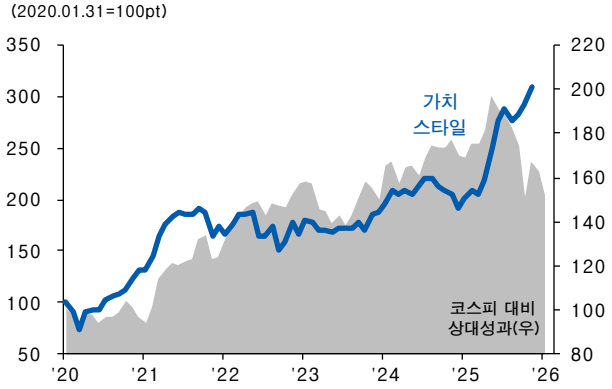
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A000660	SK하이닉스	9.8	6.1	5.4	21.2	-0.1
A329180	HD현대중공업	8.9	6.0	5.7	20.6	-1.3
A005930	삼성전자	7.9	6.3	5.9	20.1	2.4
A353200	대덕전자	7.2	6.4	6.2	19.8	-2.6
A278470	에이피알	9.7	5.3	4.6	19.6	18.1
A032350	롯데관광개발	9.4	5.9	3.2	18.4	13.1
A166090	하나머티리얼즈	6.7	5.8	5.5	18.0	-2.2
A195870	해성디에스	5.9	6.1	5.9	18.0	-1.6
A352820	하이브	8.8	6.2	2.9	17.8	9.5
A376300	디어유	7.2	5.0	5.4	17.6	-2.9

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
55.6	0.6



가치 스코어 Top 10

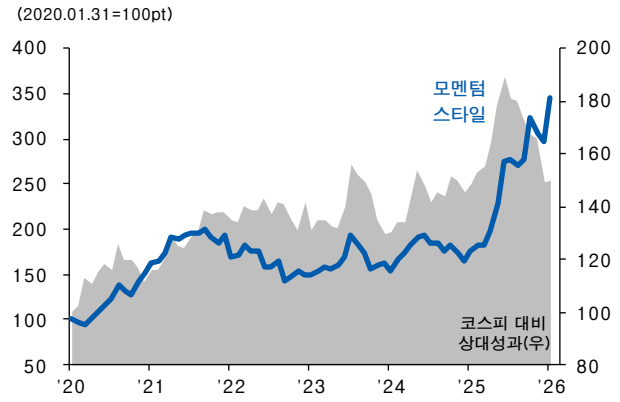
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.6	-0.6
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	-2.1
A036460	한국가스공사	9.7	9.7	9.8	29.2	5.7
A011170	롯데케미칼	10.0	9.8	9.2	29.0	3.7
A108670	LX하우시스	9.4	9.6	9.9	28.8	0.7
A001450	현대해상	9.9	8.8	9.7	28.4	3.6
A023530	롯데쇼핑	8.7	10.0	9.4	28.1	2.9
A139480	이마트	8.3	9.9	9.9	28.1	3.0
A047040	대우건설	9.3	9.4	9.1	27.8	10.8
A375500	DL이앤씨	9.5	9.6	8.6	27.6	0.5

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/22일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

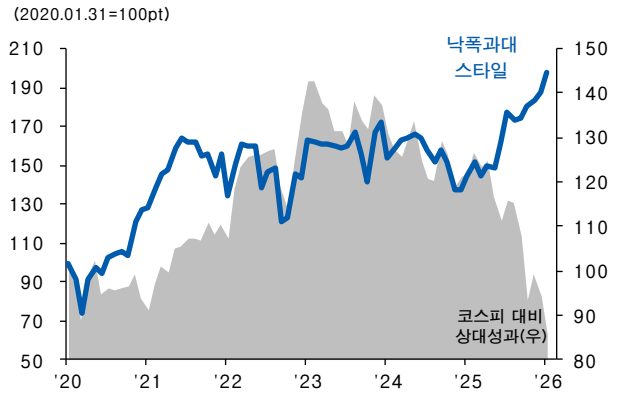
모멘텀 스타일 성과 추이

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	-0.1
A307950	현대오토에버	9.9	10.0	9.6	9.1	38.5	-2.0
A240810	원익IPS	9.0	9.4	9.9	9.4	37.6	-0.3
A001430	세아베스틸지주	10.0	9.9	8.7	9.0	37.6	8.0
A195870	해성디에스	9.2	9.8	9.6	8.8	37.4	-1.6
A005930	삼성전자	9.6	9.3	9.7	8.6	37.1	2.4
A011210	현대위아	9.7	9.6	9.2	8.1	36.5	1.5
A032350	롯데관광개발	9.7	9.1	7.8	9.5	36.0	13.1
A011070	LG이노텍	9.3	9.3	9.4	7.0	35.0	-1.0
A204320	HL만도	9.9	9.8	9.4	5.8	34.7	6.7

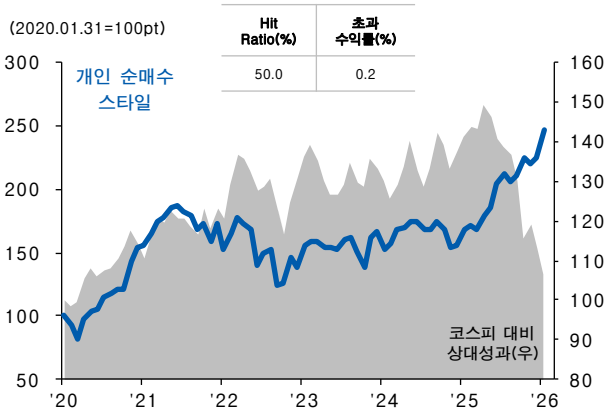
낙폭과대 스코어 Top 10

(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	2.0
A462870	시프트업	8.5	9.0	9.6	9.8	36.8	0.0
A259960	크래프톤	7.3	9.3	9.7	9.6	35.9	1.2
A251270	넷마블	8.8	9.7	9.3	7.8	35.6	1.8
A051900	LG생활건강	8.1	8.6	9.1	9.3	35.0	3.6
A140860	파크시스템스	9.4	9.5	9.5	6.0	34.4	-1.9
A145020	휴젤	4.7	9.8	9.9	9.4	33.8	5.9
A089590	제주항공	5.3	9.2	9.3	10.0	33.8	-1.7
A067160	SOOP	5.9	8.5	9.5	9.9	33.8	-0.1
A293490	카카오게임즈	7.3	7.6	9.2	9.2	33.3	-0.3

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/22일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

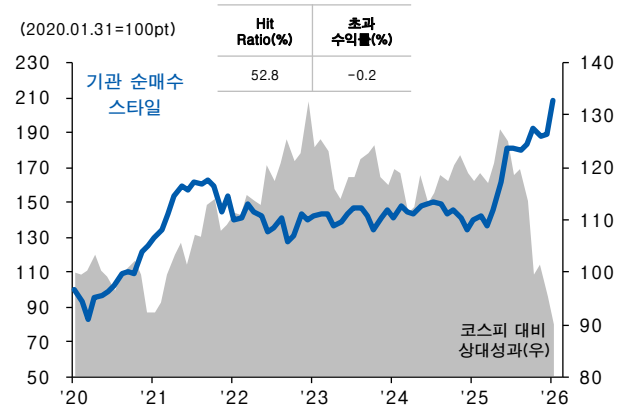


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	3.3
A161890	한국콜마	9.5	9.7	10.0	9.9	39.0	3.9
A051900	LG생활건강	9.4	9.5	9.8	9.8	38.4	3.6
A145720	덴티움	9.8	9.3	9.1	9.4	37.5	2.0
A204320	HL만도	10.0	9.4	8.7	9.1	37.1	6.7
A035420	NAVER	7.8	9.6	9.6	9.7	36.6	0.2
A036930	주성엔지니어링	8.2	9.0	9.3	9.5	36.0	-1.9
A067160	SOOP	8.1	8.1	9.8	9.8	35.7	-0.1
A140860	파크시스템스	9.1	9.2	9.2	8.4	35.7	-1.9
A192820	코스맥스	6.2	9.8	9.9	9.6	35.4	3.1

기관 순매수 스타일 성과 추이

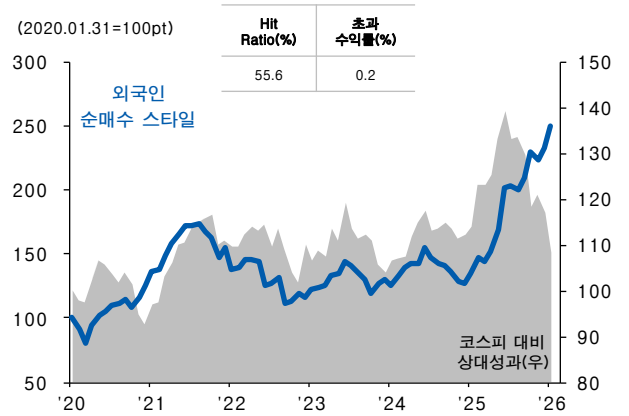


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-1.6
A032350	롯데관광개발	9.8	9.7	9.7	9.9	39.1	13.1
A004170	신세계	9.8	9.8	9.3	9.9	38.7	0.5
A166090	하나머티리얼즈	9.3	9.8	9.9	9.6	38.5	-2.2
A000720	현대건설	9.9	9.9	8.9	9.7	38.3	-0.1
A010060	OCI홀딩스	8.7	8.9	9.8	9.8	37.1	1.4
A120110	코오롱인더	8.8	9.7	9.0	9.4	36.9	6.9
A237690	에스티팜	9.4	9.5	9.6	8.4	36.8	-1.7
A240810	원익IPS	7.2	9.9	9.9	9.7	36.7	-0.3
A011210	현대위아	9.5	9.5	8.8	7.9	35.7	1.5

외국인 순매수 스타일 성과 추이



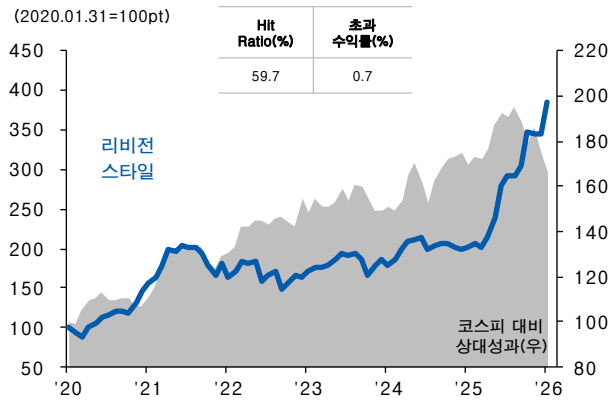
외국인 순매수 스코어 Top 10

(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	-2.6
A069620	대웅제약	9.9	9.8	9.5	9.2	38.3	0.3
A237690	에스티팜	9.7	9.9	9.4	9.3	38.2	-1.7
A241710	코스메카코리아	9.5	9.5	9.6	9.6	38.1	20.6
A011070	LG이노텍	9.6	9.7	9.7	8.8	37.8	-1.0
A012510	더존비즈온	9.0	9.7	9.5	8.7	36.8	5.7
A032350	롯데관광개발	7.1	9.4	10.0	9.9	36.3	13.1
A278470	에이피알	9.1	8.6	8.9	9.7	36.2	18.1
A071970	HD현대마린엔진	9.7	8.9	8.4	9.0	35.9	0.1
A007070	GS리테일	9.0	9.4	8.9	8.3	35.5	0.3

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/22일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

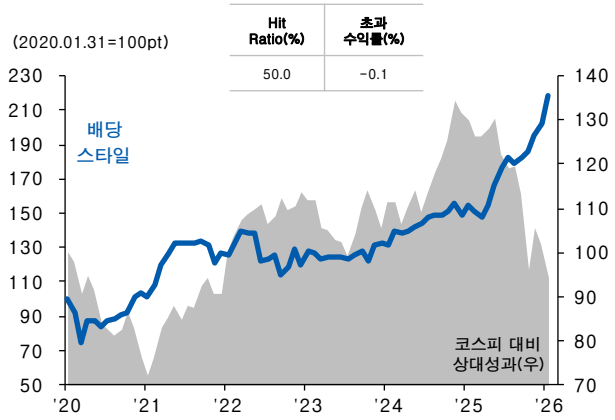


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.6	9.7	9.4	28.7	2.4
A000660	SK하이닉스	9.9	9.4	9.2	28.5	-0.1
A034730	SK	8.9	9.0	9.8	27.7	-2.5
A011070	LG이노텍	8.1	8.7	8.4	25.2	-1.0
A010950	S-Oil	5.6	9.7	9.6	24.9	9.6
A145720	덴티움	9.5	8.9	5.8	24.1	2.0
A195870	해성디에스	8.6	9.4	6.0	24.0	-1.6
A032350	롯데관광개발	9.1	8.8	5.6	23.5	13.1
A010130	고려아연	8.7	8.9	5.4	23.0	-1.7
A009150	삼성전기	5.7	8.3	8.3	22.4	-2.2

배당 스타일 성과 추이

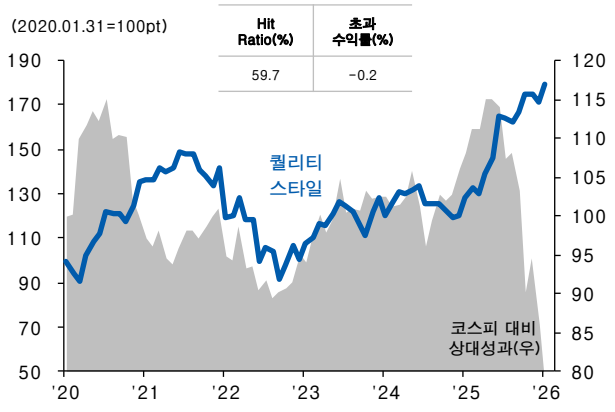


배당 스코어 Top 10

(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	-1.0
A030000	제일기획	8.9	9.6	9.1	9.8	37.4	0.3
A005940	NH투자증권	8.1	9.3	9.9	9.6	36.9	0.9
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.9	9.4	9.8	36.9	0.8
A214320	이노션	8.1	9.7	9.1	9.9	36.7	0.4
A032640	LG유플러스	9.2	9.3	9.0	8.8	36.3	3.0
A030200	KT	9.7	8.7	8.8	9.1	36.2	1.9
A024110	기업은행	6.8	9.8	9.8	9.7	36.2	2.4
A017670	SK텔레콤	8.9	9.8	9.4	7.8	35.8	11.3
A078930	GS	8.0	9.4	9.3	9.2	35.8	3.2

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	-7.1
A058470	리노공업	9.9	9.8	9.7	8.6	38.1	1.6
A042700	한미반도체	9.1	9.7	9.4	9.8	37.9	-4.6
A462870	시프트업	9.9	9.9	9.9	7.9	37.6	0.0
A214150	클래시스	8.9	9.8	9.6	9.2	37.4	-0.8
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.8	36.8	5.9
A000660	SK하이닉스	7.5	9.6	9.6	9.8	36.5	-0.1
A259960	크래프톤	9.6	9.5	9.8	7.5	36.4	1.2
A214450	파마리서치	7.9	9.6	9.3	9.0	35.7	8.3
A192080	더블유게임즈	9.8	9.4	9.4	6.9	35.5	-0.2

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/22일 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)