YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

1월 5주차 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 5주차] 1) 일주일 내 이익 조정 이력이 있는 KOSPI 대형주 중 2) 12MF 영업이익, 순이익 주간 조정률 상위 20% 스크리닝

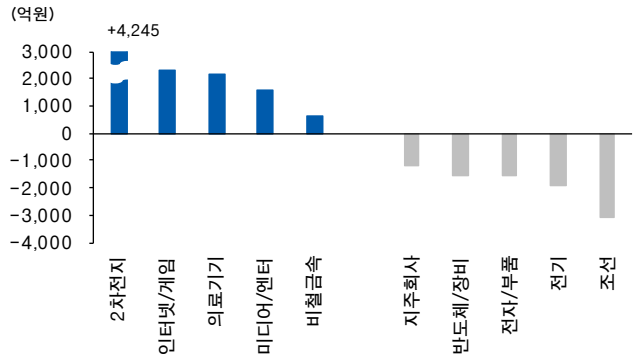
종목명	업종	시가총액 (억원)	12MF 영업이익 추정치(억원, %)			12MF 순이익 추정치(억원,%)		
			1/22일 기준	1/29일 기준	조정률	1/22일 기준	1/29일 기준	조정률
삼성전자	반도체	9,512,858	1,219,510	1,268,313	4.0	1,029,850	1,059,577	2.9
SK하이닉스	반도체	6,268,100	988,511	1,035,254	4.7	804,144	827,289	2.9
SK스퀘어	상사,자본재	701,383	106,764	130,609	22.3	104,347	127,642	22.3
삼성물산	상사,자본재	515,029	37,757	39,080	3.5	24,547	25,637	4.4
HD현대일렉트릭	기계	323,343	12,580	12,642	0.5	9,760	9,941	1.9
고려아연	비철,목재등	408,901	13,042	14,251	9.3	8,853	9,733	9.9
SK	에너지	234,909	45,803	45,902	0.2	26,536	28,136	6.0
삼성전기	IT하드웨어	208,769	12,418	13,089	5.4	9,836	10,417	5.9
LS ELECTRIC	기계	167,100	6,392	6,482	1.4	4,510	4,711	4.4
하이브	미디어,교육	161,316	4,994	5,050	1.1	3,865	3,916	1.3
S-Oil	에너지	112,921	14,345	15,583	8.6	8,694	10,243	17.8

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -1.2조원 순매도, 기관은 약 -4,733억원 순매도를 기록
- 두 수급 주체 모두 순매도를 기록한 반면 인터넷/게임과 2차전지 업종은 동시 순매수. CES 이후 로봇 테마에 시선이 집중된 자동차 업종에서 2차전지로 수급이 이동하는 순환매 장세 시현

기관 주간 순매수 상/하위 업종

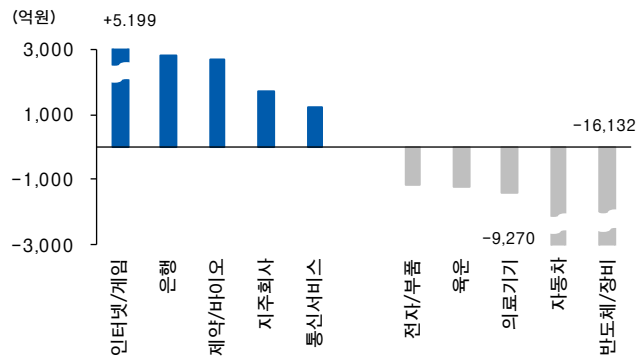


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	4,245	9,144	8,427	
2	인터넷/게임	2,303	2,445	-2,968	
3	의료기기	2,178	3,858	3,392	
4	미디어/엔터	1,588	-1,553	-124	
5	비철금속	651	2,767	3,566	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	-3,082	-5,577	-7,285	
2	전기	-1,905	120	-800	
3	전자/부품	-1,546	-4,395	-1,875	
4	반도체/장비	-1,522	4,681	65,616	
5	지주회사	-1,186	-3,841	-1,012	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

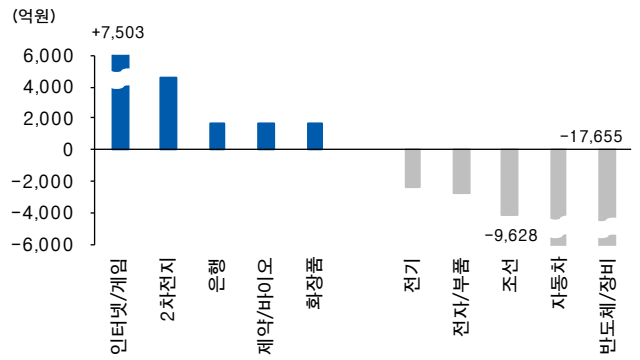


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	5,199	11,718	10,330	
2	은행	2,806	7,608	-1,922	
3	제약/바이오	2,686	7,406	13,395	
4	지주회사	1,738	12,839	13,675	
5	통신서비스	1,244	3,613	5,094	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-16,132	-46,759	-99,096	
2	자동차	-9,270	-42,071	-36,735	
3	의료기기	-1,399	-3,883	-4,007	
4	육운	-1,217	-5,493	-4,932	
5	전자/부품	-1,181	1,355	3,006	

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	인터넷/게임	7,503	14,163	7,362	
2	2차전지	4,573	13,952	10,699	
3	은행	1,733	6,395	9,380	
4	제약/바이오	1,668	5,810	14,466	
5	화장품	1,616	6,192	8,372	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-17,655	-42,079	-33,480	
2	자동차	-9,628	-44,445	-33,220	
3	조선	-4,141	14,730	5,539	
4	전자/부품	-2,726	-3,040	1,131	
5	전기	-2,376	3,839	4,053	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/29일 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	18,340	736	1.06
A058470	리노공업	반도체/장비	70,191	1,967	0.76
A214450	파마리서치	의료기기	55,481	1,615	0.76
A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	13,831	399	0.73
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	26,081	714	0.69
A237690	에스티팜	제약/바이오	32,005	861	0.69
A183300	코미코	반도체/장비	12,657	335	0.69
A222800	심텍	전자/부품	21,024	547	0.66
A263750	펄어비스	인터넷/게임	35,850	858	0.63
A403870	HPSP	반도체/장비	37,254	835	0.61

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A195940	HK이노엔	제약/바이오	16,176	268	0.44
A028050	삼성E&A	건설	61,642	834	0.35
A004170	신세계	소매/유통	29,611	277	0.25
A247540	에코프로비엠	2차전지	240,591	1,978	0.23
A103140	풍산	비철금속	36,291	313	0.22
A035420	NAVER	인터넷/게임	450,167	3,784	0.22
A128940	한미약품	제약/바이오	64,696	544	0.21
A018880	한온시스템	자동차부품	34,175	282	0.21
A006280	녹십자	제약/바이오	19,785	155	0.20
A017670	SK텔레콤	통신서비스	149,279	1,132	0.20

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	18,340	642	0.9
A195940	HK이노엔	제약/바이오	16,176	546	0.9
A247540	에코프로비엠	2차전지	240,591	6,762	0.8
A183300	코미코	반도체/장비	12,657	365	0.7
A403870	HPSP	반도체/장비	37,254	989	0.7
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	26,081	694	0.7
A222800	심텍	전자/부품	21,024	480	0.6
A237690	에스티팜	제약/바이오	32,005	698	0.6
A060250	NHN KCP	SW/SI	9,498	192	0.5
A257720	실리콘투	화장품	33,155	677	0.5

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

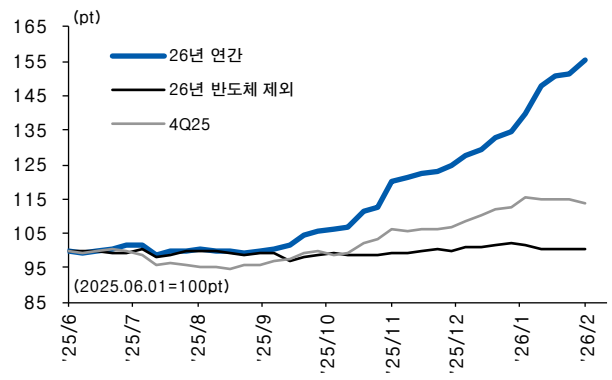
종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	26,081	694.4	-359	-1,979
A214450	파마리서치	의료기기	55,481	333.6	-718	-1,794
A041510	에스엠	미디어/엔터	27,313	221.4	-667	-303
A000100	유한양행	제약/바이오	88,125	153.4	-701	-506
A122870	와이지엔터	미디어/엔터	13,831	204.5	-153	-856
A009150	삼성전기	전자/부품	208,769	301.2	-6	445
A001440	대한전선	기계	52,765	22.8	-252	-723
A039130	하나투어	호텔/레저	7,242	3.7	-174	-314
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	9,796	71.6	-85	-141
A294870	HDC현대산업개발	건설	13,972	46.5	-103	53

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 1/29일 기준

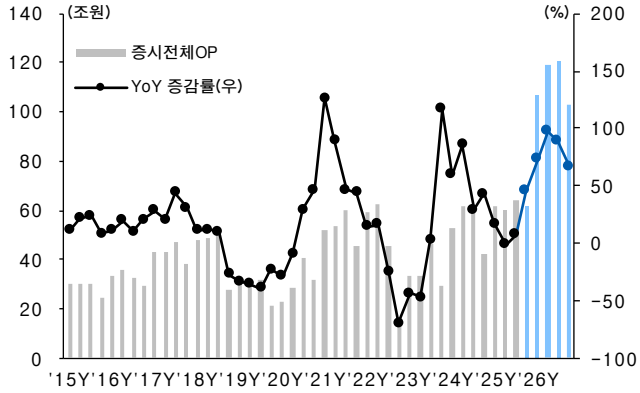
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +2.4% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.2% 소폭 하향조정. '26년 연간 기준 반도체와 그 외 업종간 이익 추정치 괴리가 확대되는 상황
- '25년 4분기 영업이익 추정치는 실적시즌이 진행됨에 따라 12월말 추정치(약 78.3조원) 대비 소폭 하향조정(약 77.1조원)

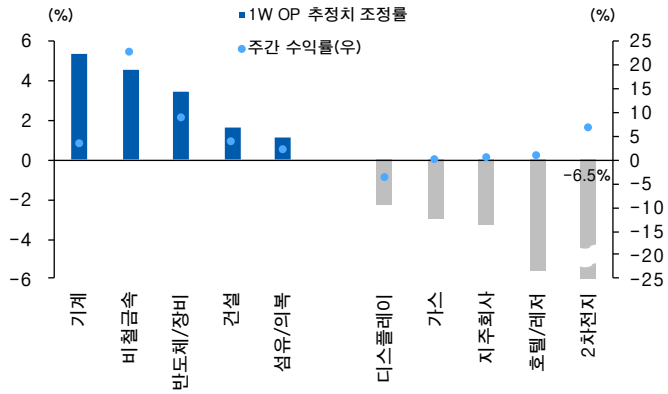
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

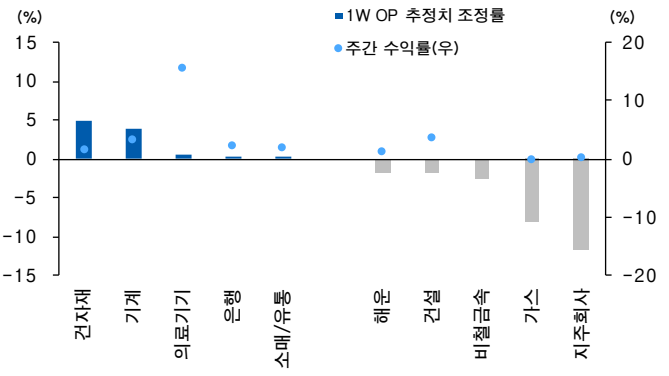


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	기계	75,002	5.4	3.4	
2	비철금속	21,126	4.6	22.4	
3	반도체/장비	2,526,864	3.5	8.6	
4	건설	35,966	1.6	3.5	
5	섬유/의복	21,227	1.2	1.8	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	2차전지	13,506	-6.5	6.7	
2	호텔/레저	9,101	-5.6	0.9	
3	지주회사	314,636	-3.3	0.3	
4	가스	27,068	-3.0	0.0	
5	디스플레이	13,698	-2.3	-4.0	

25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



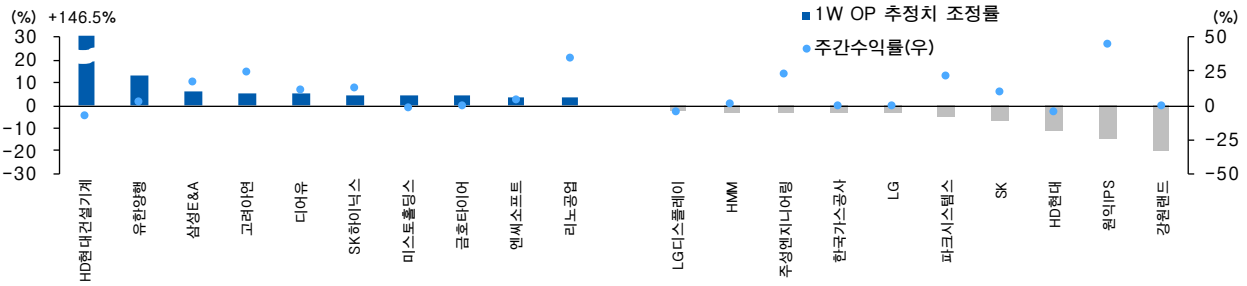
25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	건자재	200	4.9	1.5	
2	기계	15,692	3.9	3.4	
3	의료기기	1,327	0.6	15.5	
4	은행	46,457	0.4	2.3	
5	소매/유통	7,828	0.3	2.1	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	지주회사	60,410	-11.8	0.3	
2	가스	8,283	-8.2	0.0	
3	비철금속	4,888	-2.4	22.4	
4	건설	6,191	-1.9	3.5	
5	해운	3,820	-1.7	1.2	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 1/29일 기준

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



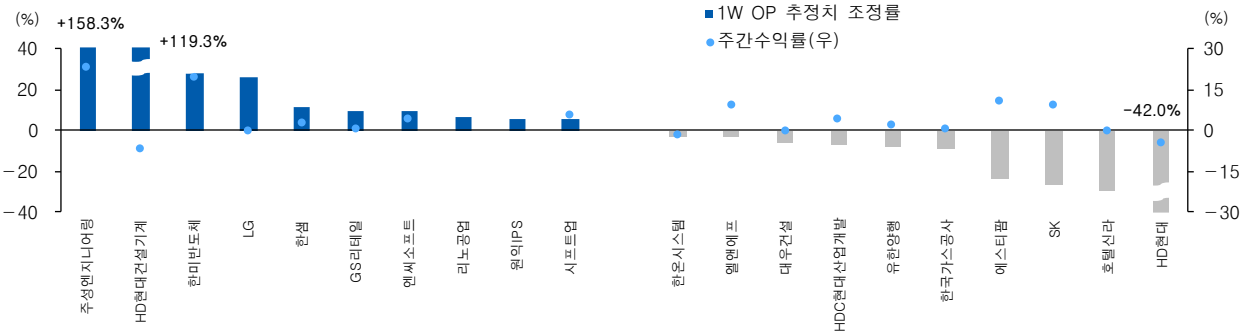
'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A267270	HD현대건설기계	기계	6,230	146.5	-7.5
2	A000100	유한양행	제약/바이오	1,605	13.4	1.8
3	A028050	삼성E&A	건설	8,561	6.5	16.5
4	A010130	고려아연	비철금속	17,510	5.7	24.0
5	A376300	디어유	미디어/엔터	506	5.0	11.4
6	A000660	SK하이닉스	반도체/장비	1,126,516	4.5	12.3
7	A081660	미스토홀딩스	섬유/의복	5,735	4.5	-1.5
8	A073240	금호타이어	자동차부품	5,994	4.4	-1.1
9	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	3,746	4.0	4.0
10	A058470	리노공업	반도체/장비	2,017	3.9	34.1

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,248	-20.4	-0.6
2	A240810	원익IPS	반도체/장비	1,555	-14.6	44.9
3	A267250	HD현대	지주회사	66,564	-11.0	-5.2
4	A034730	SK	지주회사	43,742	-6.7	9.3
5	A140860	파크시스템스	전자/부품	616	-5.3	20.6
6	A003550	LG	지주회사	18,924	-3.9	-1.0
7	A036460	한국가스공사	가스	22,328	-3.6	0.0
8	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	1,110	-3.5	22.6
9	A011200	HMM	해운	8,039	-3.3	0.2
10	A034220	LG디스플레이	디스플레이	12,839	-2.5	-5.7

'25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'25년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

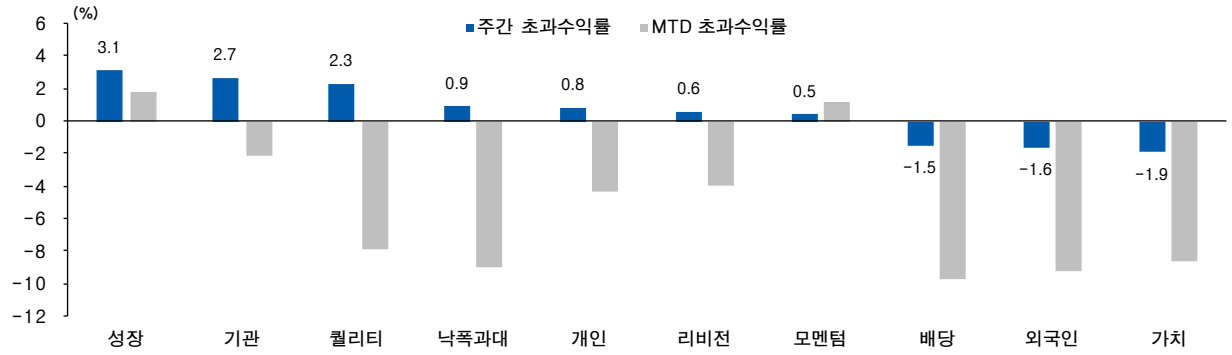
(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	93	158.3	22.6
2	A267270	HD현대건설기계	기계	1,070	119.3	-7.5
3	A042700	한미반도체	반도체/장비	730	28.1	18.9
4	A003550	LG	지주회사	2,033	26.1	-1.0
5	A009240	한샘	건자재	90	11.6	2.0
6	A007070	GS리테일	소매/유통	642	9.5	0.0
7	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	50	9.1	4.0
8	A058470	리노공업	반도체/장비	336	6.3	34.1
9	A240810	원익IPS	반도체/장비	324	5.9	44.9
10	A462870	시프트업	인터넷/게임	410	5.5	5.6

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A267250	HD현대	지주회사	9,383	-42.0	-5.2
2	A008770	호텔신라	호텔/레저	56	-29.4	-1.0
3	A034730	SK	지주회사	4,607	-26.5	9.3
4	A237690	에스티팜	제약/바이오	222	-24.0	10.7
5	A036460	한국가스공사	가스	7,191	-9.3	0.0
6	A000100	유한양행	제약/바이오	305	-8.2	1.8
7	A294870	HDC현대산업개발	건설	754	-7.4	3.7
8	A047040	대우건설	건설	851	-6.3	-0.4
9	A066970	엘앤에프	2차전지	255	-3.5	8.7
10	A018880	한온시스템	자동차부품	766	-3.4	-1.8

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 1/29일 기준

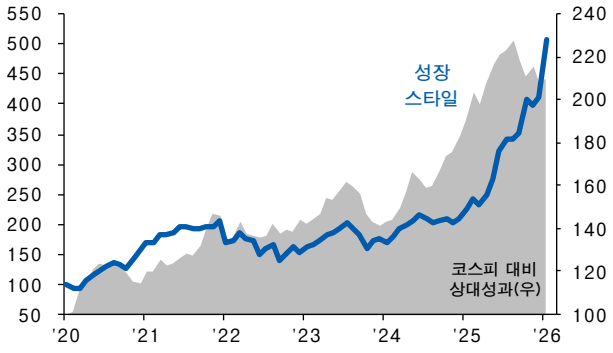
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.1	1.1

(2020.01.31=100pt)



성장 스코어 Top 10

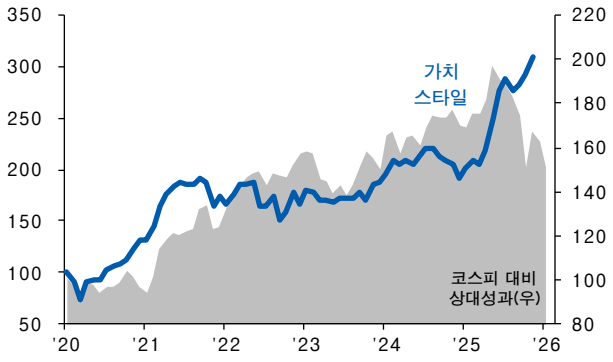
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A000660	SK하이닉스	9.8	6.1	5.4	21.2	12.2
A329180	HD현대중공업	8.9	6.0	5.7	20.6	-6.3
A005930	삼성전자	7.9	6.3	5.9	20.1	5.6
A353200	대덕전자	7.2	6.4	6.2	19.8	4.2
A278470	에이피알	9.7	5.3	4.6	19.6	0.0
A032350	롯데관광개발	9.4	5.9	3.2	18.4	2.7
A166090	하나머티리얼즈	6.7	5.8	5.5	18.0	19.2
A195870	해성디에스	5.9	6.1	5.9	18.0	11.0
A352820	하이브	8.8	6.2	2.9	17.8	-0.7
A376300	디어유	7.2	5.0	5.4	17.6	11.1

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
55.6	0.6

(2020.01.31=100pt)



가치 스코어 Top 10

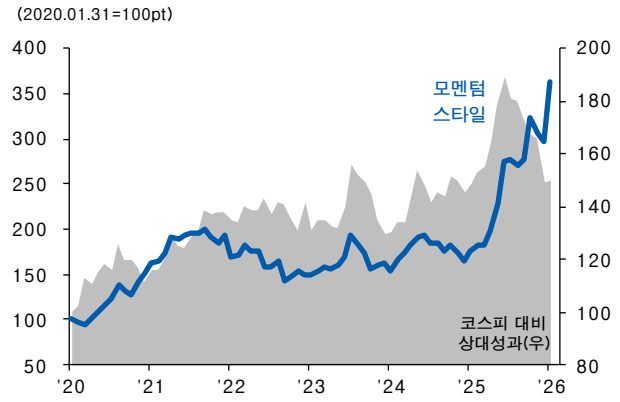
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.6	3.9
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	2.9
A036460	한국가스공사	9.7	9.7	9.8	29.2	0.0
A011170	롯데케미칼	10.0	9.8	9.2	29.0	7.5
A108670	LX하우시스	9.4	9.6	9.9	28.8	-0.5
A001450	현대해상	9.9	8.8	9.7	28.4	0.4
A023530	롯데쇼핑	8.7	10.0	9.4	28.1	0.3
A139480	이마트	8.3	9.9	9.9	28.1	2.9
A047040	대우건설	9.3	9.4	9.1	27.8	0.2
A375500	DL이앤씨	9.5	9.6	8.6	27.6	-0.2

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/29일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

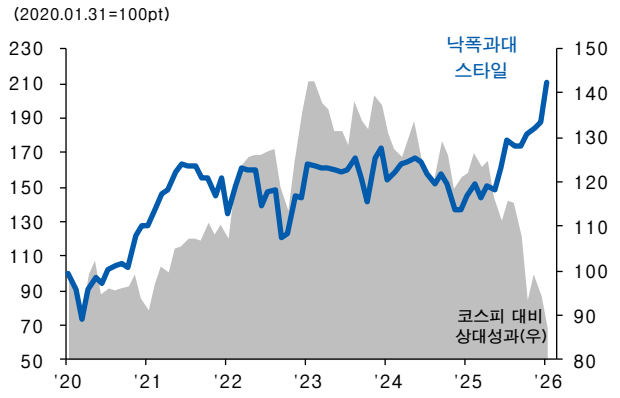
모멘텀 스타일 성과 추이

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	12.2
A307950	현대오토에버	9.9	10.0	9.6	9.1	38.5	8.4
A240810	원익IPS	9.0	9.4	9.9	9.4	37.6	39.1
A001430	세아베스틸지주	10.0	9.9	8.7	9.0	37.6	-2.0
A195870	해성디에스	9.2	9.8	9.6	8.8	37.4	11.0
A005930	삼성전자	9.6	9.3	9.7	8.6	37.1	5.6
A011210	현대위아	9.7	9.6	9.2	8.1	36.5	2.6
A032350	롯데관광개발	9.7	9.1	7.8	9.5	36.0	2.7
A011070	LG이노텍	9.3	9.3	9.4	7.0	35.0	-10.8
A204320	HL만도	9.9	9.8	9.4	5.8	34.7	0.3

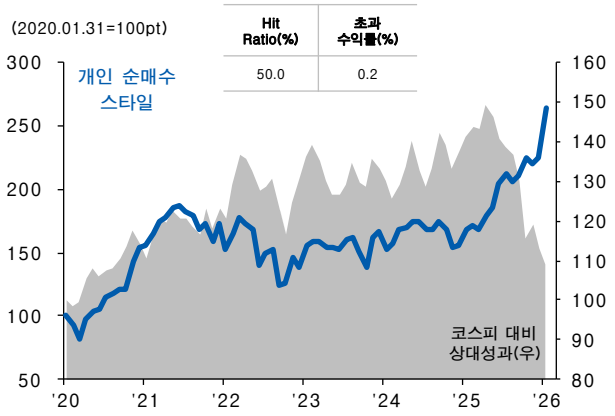
낙폭과대 스코어 Top 10

(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	2.5
A462870	시프트업	8.5	9.0	9.6	9.8	36.8	5.5
A259960	크래프톤	7.3	9.3	9.7	9.6	35.9	9.2
A251270	넷마블	8.8	9.7	9.3	7.8	35.6	3.5
A051900	LG생활건강	8.1	8.6	9.1	9.3	35.0	-2.7
A140860	파크시스템스	9.4	9.5	9.5	6.0	34.4	19.6
A145020	휴젤	4.7	9.8	9.9	9.4	33.8	10.0
A089590	제주항공	5.3	9.2	9.3	10.0	33.8	-4.1
A067160	SOOP	5.9	8.5	9.5	9.9	33.8	11.7
A293490	카카오게임즈	7.3	7.6	9.2	9.2	33.3	17.3

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/29일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

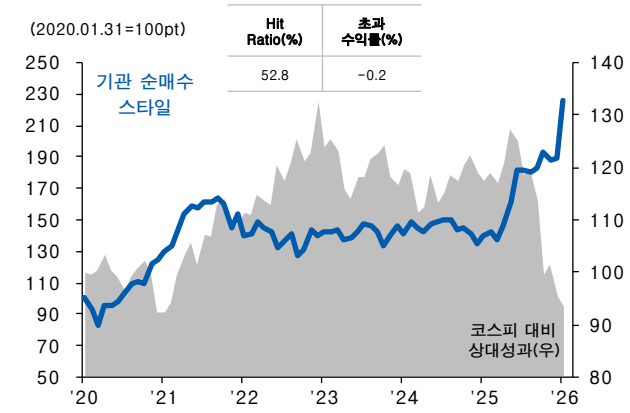


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	0.0
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	-2.7
A145720	덴티움	9.8	9.3	9.1	9.4	37.5	2.5
A204320	HL만도	10.0	9.4	8.7	9.1	37.1	0.3
A035420	NAVER	7.8	9.6	9.6	9.7	36.6	7.7
A036930	주성엔지니어링	8.2	9.0	9.3	9.5	36.0	21.0
A067160	SOOP	8.1	8.1	9.8	9.8	35.7	11.7
A140860	파크시스템스	9.1	9.2	9.2	8.4	35.7	19.6
A192820	코스맥스	6.2	9.8	9.9	9.6	35.4	2.6

기관 순매수 스타일 성과 추이

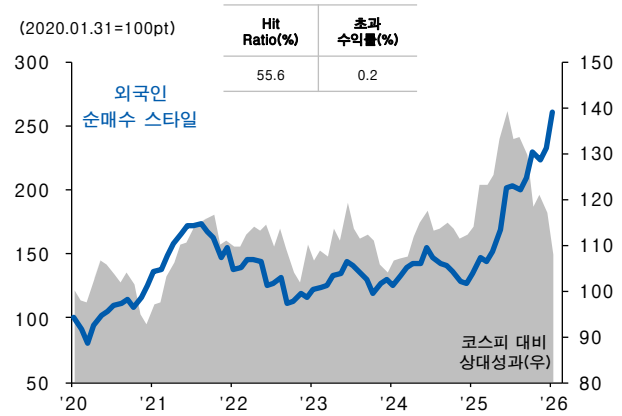


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	11.0
A032350	롯데관광개발	9.8	9.7	9.7	9.9	39.1	2.7
A004170	신세계	9.8	9.8	9.3	9.9	38.7	6.0
A166090	하나머티리얼즈	9.3	9.8	9.9	9.6	38.5	19.2
A000720	현대건설	9.9	9.9	8.9	9.7	38.3	-0.4
A010060	OCI홀딩스	8.7	8.9	9.8	9.8	37.1	-3.2
A120110	코오롱인더	8.8	9.7	9.0	9.4	36.9	14.4
A237690	에스티팜	9.4	9.5	9.6	8.4	36.8	10.5
A240810	원익IPS	7.2	9.9	9.9	9.7	36.7	39.1
A011210	현대위아	9.5	9.5	8.8	7.9	35.7	2.6

외국인 순매수 스타일 성과 추이



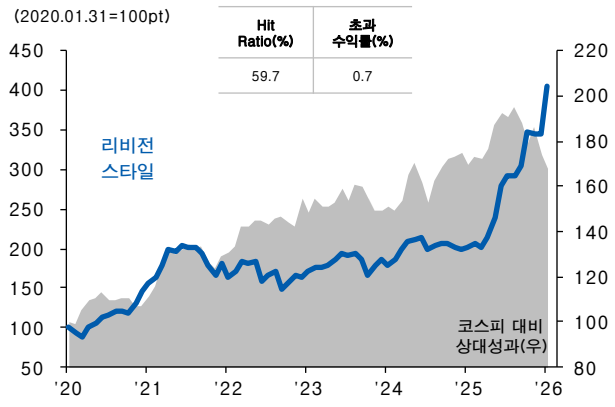
외국인 순매수 스코어 Top 10

(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	4.2
A069620	대웅제약	9.9	9.8	9.5	9.2	38.3	1.9
A237690	에스티팜	9.7	9.9	9.4	9.3	38.2	10.5
A241710	코스메카코리아	9.5	9.5	9.6	9.6	38.1	12.7
A011070	LG이노텍	9.6	9.7	9.7	8.8	37.8	-10.8
A012510	더존비즈온	9.0	9.7	9.5	8.7	36.8	-8.1
A032350	롯데관광개발	7.1	9.4	10.0	9.9	36.3	2.7
A278470	에이피알	9.1	8.6	8.9	9.7	36.2	0.0
A071970	HD현대마린엔진	9.7	8.9	8.4	9.0	35.9	-1.2
A007070	GS리테일	9.0	9.4	8.9	8.3	35.5	0.1

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 1/29일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

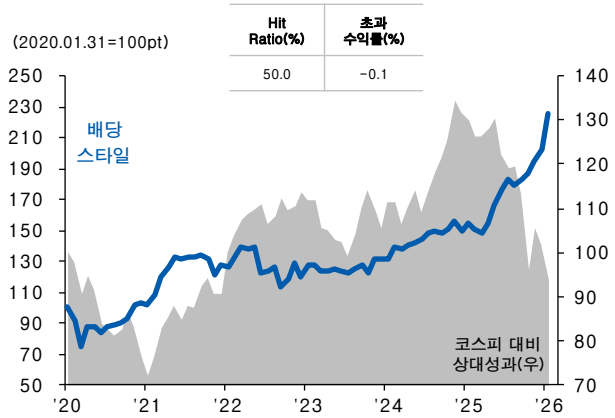


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.6	9.7	9.4	28.7	5.6
A000660	SK하이닉스	9.9	9.4	9.2	28.5	12.2
A034730	SK	8.9	9.0	9.8	27.7	9.2
A011070	LG이노텍	8.1	8.7	8.4	25.2	-10.8
A010950	S-Oil	5.6	9.7	9.6	24.9	0.9
A145720	덴티움	9.5	8.9	5.8	24.1	2.5
A195870	해성디에스	8.6	9.4	6.0	24.0	11.0
A032350	롯데관광개발	9.1	8.8	5.6	23.5	2.7
A010130	고려아연	8.7	8.9	5.4	23.0	22.8
A009150	삼성전기	5.7	8.3	8.3	22.4	2.7

배당 스타일 성과 추이

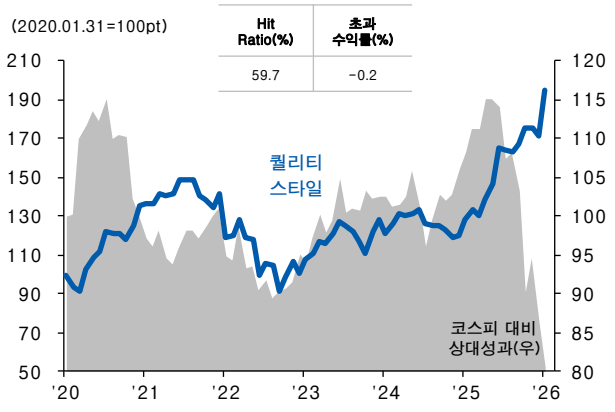


배당 스코어 Top 10

(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	2.0
A030000	제일기획	8.9	9.6	9.1	9.8	37.4	3.6
A005940	NH투자증권	8.1	9.3	9.9	9.6	36.9	8.4
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.9	9.4	9.8	36.9	4.4
A214320	이노션	8.1	9.7	9.1	9.9	36.7	1.0
A032640	LG유플러스	9.2	9.3	9.0	8.8	36.3	5.3
A030200	KT	9.7	8.7	8.8	9.1	36.2	3.5
A024110	기업은행	6.8	9.8	9.8	9.7	36.2	4.5
A017670	SK텔레콤	8.9	9.8	9.4	7.8	35.8	11.0
A078930	GS	8.0	9.4	9.3	9.2	35.8	6.8

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	28.2
A058470	리노공업	9.9	9.8	9.7	8.6	38.1	30.5
A042700	한미반도체	9.1	9.7	9.4	9.8	37.9	18.1
A462870	시프트업	9.9	9.9	9.9	7.9	37.6	5.5
A214150	클래시스	8.9	9.8	9.6	9.2	37.4	19.4
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.8	36.8	10.0
A000660	SK하이닉스	7.5	9.6	9.6	9.8	36.5	12.2
A259960	크래프톤	9.6	9.5	9.8	7.5	36.4	9.2
A214450	파마리서치	7.9	9.6	9.3	9.0	35.7	12.4
A192080	더블유게임즈	9.8	9.4	9.4	6.9	35.5	1.5

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

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)