YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

2월 2주차 순환매 수혜 전략 리밸런싱

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

유안타증권 Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 리밸런싱

순환매 수혜 전략 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

순환매 수혜 전략 스크리닝 (참고 자료: 대형주 코어...근데 순환매·배당을 곁들인)

1) 대형주 쏠림이 지속되는 상황 속 급등 종목 출회 비율이 급격히 증가하며 순환매에 대한 갈증이 심화되는 환경

2) 수급 측면에서 순환매를 확인하기 위해 HHI(Herfindahl-Hirschman Index) 지수에 수급 데이터를 접목. 결과적으로 업종 및 종목 측면에서 수급의 분산 현상이 확인

3) '15년 이후 KOSPI 지수의 상승과 수급 분산이 동반되는 국면 속 HHI 지수 분위별 주간 성과를 분석. 결과적으로 매수과열(1분위) 혹은 시장 소외(2분위) 종목의 경우 차주 순환매 수혜가 나타날 가능성이 가장 낮은 것으로 확인. 시장의 관심이 적당한 온도로 유지되는 종목(2~4분위)에 주목

[2월 2주차] 1) 주간 누적 기관 및 외국인 순매수 2~4분위 종목 중 2) 주간 이익 추정치 조정률 상위 20% 종목 스크리닝

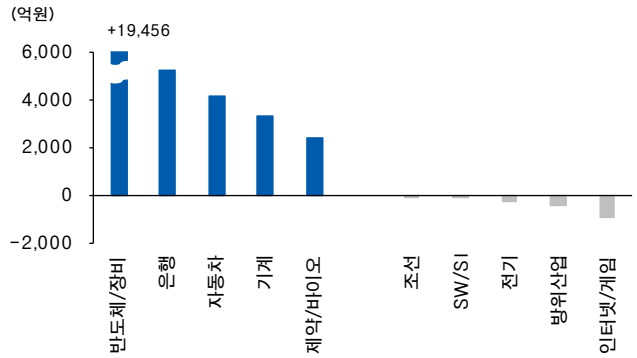
종목명		업종	시가총액 (억원)	12MF 영업이익 추정치(억원, %)			12MF 순이익 추정치(억원,%)		
				2/4일 기준	2/11일 기준	조정률	2/4일 기준	2/11일 기준	조정률
A475960	토모큐브	건강관리	6,101	37	42	13.4	41	45	10.3
A089970	브이엠	반도체	6,017	633	680	7.3	530	579	9.2
A005940	NH투자증권	증권	85,523	14,677	16,134	9.9	10,795	11,665	8.1
A016360	삼성증권	증권	76,887	15,271	16,099	5.4	11,274	11,885	5.4
A004170	신세계	소매(유통)	27,971	5,774	5,980	3.6	3,188	3,425	7.4
A010780	아이에스동서	건설,건축관련	6,777	1,841	1,903	3.4	853	900	5.5
A000240	한국앤컴퍼니	자동차	25,253	5,132	5,304	3.4	5,513	5,893	6.9
A251270	넷마블	소프트웨어	44,524	4,204	4,382	4.2	3,535	3,650	3.2
A069260	TKG휴켐스	화학	7,591	949	991	4.4	872	897	2.8
A282330	BGF리테일	소매(유통)	20,257	2,683	2,782	3.7	2,024	2,116	4.6
A039490	키움증권	증권	92,833	17,340	18,172	4.8	13,160	13,484	2.5
A138930	BNK금융지주	은행	49,342	10,985	11,285	2.7	8,781	9,013	2.6

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +3.8조원 순매수, 기관은 약 +5.0조원 순매수를 기록
- 두 수급 주체 반도체/장비 업종에 강도 높은 순매수(+5.5조원)를 기록. 특히 외국인 + 기관의 삼성전자 및 SK하이닉스에 집중되며 두 종목이 3개월 누적대비 주간 순매수 전환 상위(P.5)에 스크리닝

기관 주간 순매수 상/하위 업종

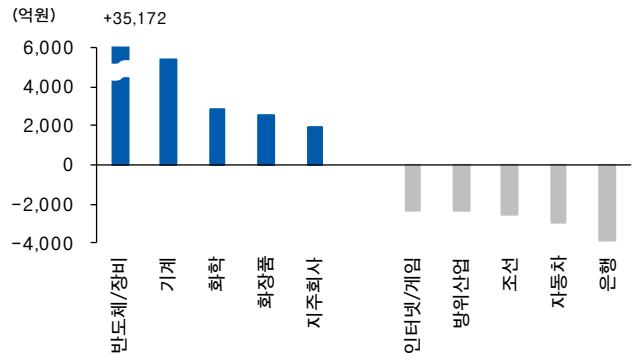


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	19,459	44,005	93,825	
2	은행	5,228	4,664	10,878	
3	자동차	4,103	-3,524	4,524	
4	기계	3,318	-442	1,279	
5	제약/바이오	2,354	1,299	2,104	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	-994	-3,399	-6,781	
2	방위산업	-446	1,526	11,218	
3	전기	-274	75	-1,215	
4	SW/SI	-114	-2,141	-2,208	
5	조선	-43	-8,340	-10,719	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

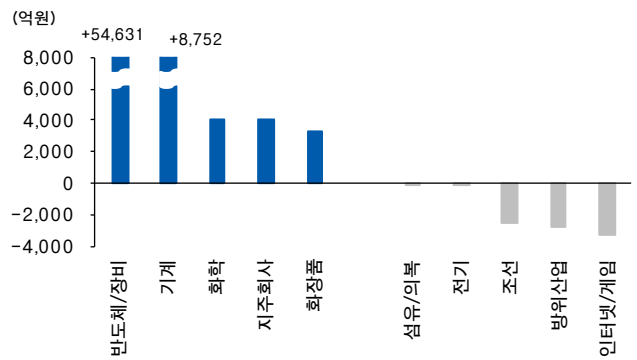


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	35,172	-87,453	-129,751	
2	기계	5,434	10,275	17,544	
3	화학	2,885	4,041	5,506	
4	화장품	2,537	7,945	8,619	
5	지주회사	1,898	8,827	16,908	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	은행	-3,876	4,064	116	
2	자동차	-2,964	-47,379	-49,842	
3	조선	-2,513	821	13,719	
4	방위산업	-2,371	-8,106	-3,236	
5	인터넷/게임	-2,322	2,628	6,149	

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	54,631	-43,447	-35,925	
2	기계	8,752	9,833	18,823	
3	화학	4,070	4,936	4,810	
4	지주회사	3,995	9,455	14,885	
5	화장품	3,281	10,163	11,456	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	-3,316	-771	-632	
2	방위산업	-2,817	-6,580	7,982	
3	조선	-2,556	-7,519	3,000	
4	전기	-152	620	4,307	
5	섬유/의복	-31	944	1,425	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 2/12일 기준

업종별 | 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A267270	HD현대건설기계	기계	69,562	1,075	0.42
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	11,236	177	0.41
A047040	대우건설	건설	32,003	471	0.40
A000120	CJ대한통운	육운	32,576	442	0.36
A006360	GS건설	건설	18,571	218	0.30
A034230	파라다이스	호텔/레저	19,174	231	0.30
A009830	한화솔루션	화학	81,735	830	0.25
A003230	삼양식품	음식료	91,827	841	0.24
A039130	하나투어	호텔/레저	7,915	74	0.24
A000370	한화손해보험	손해보험	8,732	76	0.23

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A009830	한화솔루션	화학	81,735	1,737	0.53
A073240	금호타이어	자동차부품	20,395	372	0.45
A090430	아모레퍼시픽	화장품	93,237	1,106	0.29
A039130	하나투어	호텔/레저	7,915	90	0.29
A278470	에이피알	화장품	105,554	1,182	0.29
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	31,627	299	0.24
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	25,370	233	0.23
A089590	제주항공	항공	5,177	44	0.22
A271560	오리온	음식료	54,797	370	0.18
A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	13,981	95	0.17

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A009830	한화솔루션	화학	81,735	2,567	0.8
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	11,236	229	0.5
A039130	하나투어	호텔/레저	7,915	164	0.5
A047040	대우건설	건설	32,003	503	0.4
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	31,627	526	0.4
A006360	GS건설	건설	18,571	304	0.4
A090430	아모레퍼시픽	화장품	93,237	1,554	0.4
A122870	와이지엔터테인먼트	미디어/엔터	13,981	200	0.4
A267270	HD현대건설기계	기계	69,562	891	0.3
A089590	제주항공	항공	5,177	68	0.3

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

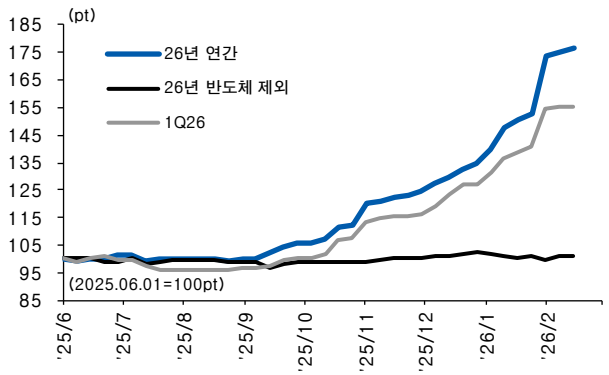
종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005930	삼성전자	반도체/장비	10,572,473	43,181.8	-12,150	-20,617
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	6,464,661	11,659.6	-38,429	-28,190
A086280	현대글로비스	육운	195,750	643.4	-5,233	-6,981
A051910	LG화학	화학	237,543	924.1	-1,964	-2,198
A012330	현대모비스	자동차부품	404,667	108.2	-2,165	-632
A011070	LG이노텍	전자/부품	59,996	27.9	-2,150	-234
A373220	LG에너지솔루션	2차전지	959,400	496.4	-1,455	-2,506
A005490	POSCO홀딩스	철강	309,973	1,673.0	-134	3,899
A047810	한국항공우주	방위산업	161,321	76.6	-1,164	-503
A018260	삼성에스디에스	SW/SI	133,477	67.8	-937	-129

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 2/12일 기준

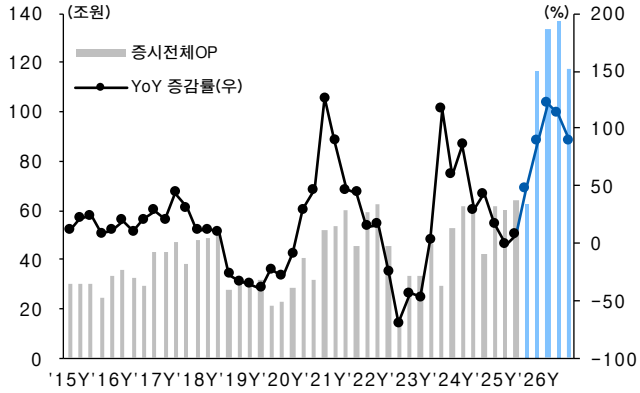
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.6% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 +0.3% 상향조정. 상향 조정폭은 단기적으로 축소되는 모습이지만 '26년 분기 전반의 상향조정은 지속
- 증권, 비철금속, 정유, 소매/유통 업종이 '26년 연간, '26년 1분기 이익 추정치 모두 조정률 상위에 스크리닝

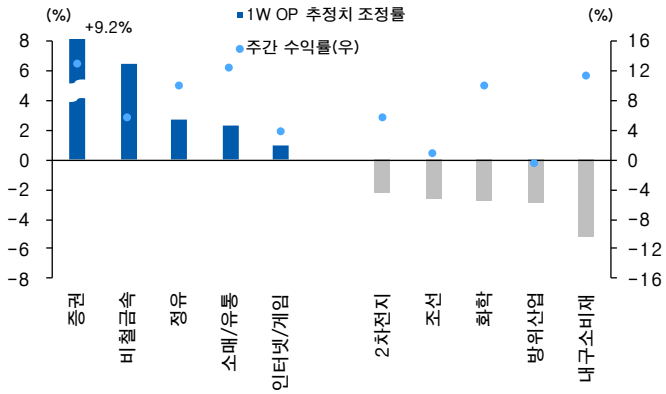
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

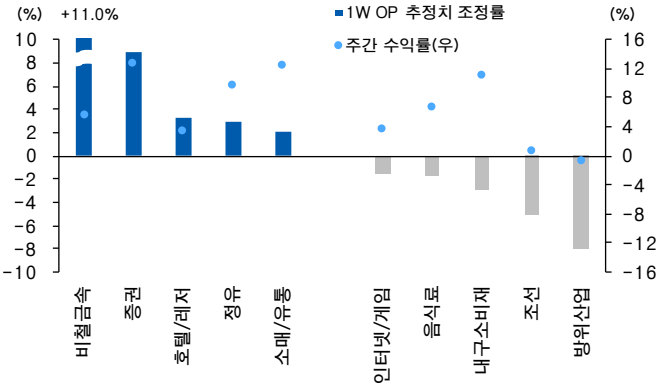


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	증권	102,174	9.2	12.8	
2	비철금속	22,548	6.5	5.5	
3	정유	35,106	2.7	9.8	
4	소매/유통	28,856	2.3	12.4	
5	인터넷/게임	61,670	0.9	3.8	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	내구소비재	13,164	-5.2	11.2	
2	방위산업	56,450	-2.9	-0.7	
3	화학	31,754	-2.7	9.8	
4	조선	126,564	-2.7	0.7	
5	2차전지	8,807	-2.3	5.6	

26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

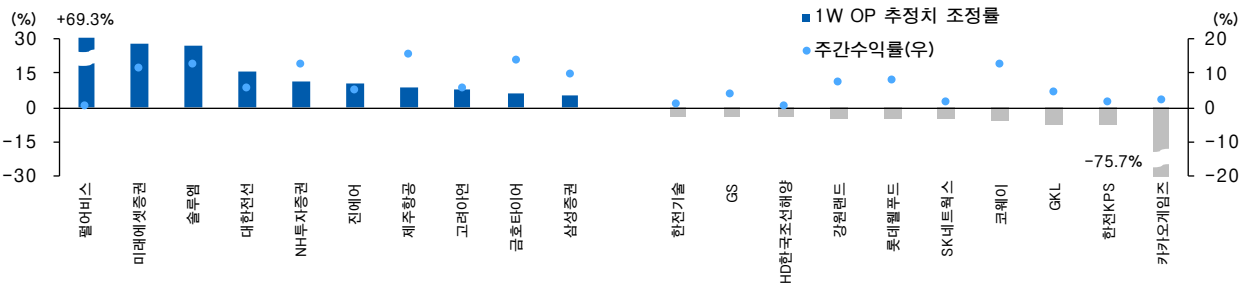
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	6,247	11.0	5.5	
2	증권	29,415	8.9	12.8	
3	호텔/레저	1,979	3.3	3.4	
4	정유	8,604	2.9	9.8	
5	소매/유통	6,887	2.0	12.4	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	방위산업	11,182	-8.1	-0.7	
2	조선	27,293	-5.1	0.7	
3	내구소비재	3,101	-3.0	11.2	
4	음식료	11,014	-1.7	6.9	
5	인터넷/게임	15,885	-1.5	3.8	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 2/11일 기준(수익률 2/12일 기준)

업종별 | 종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



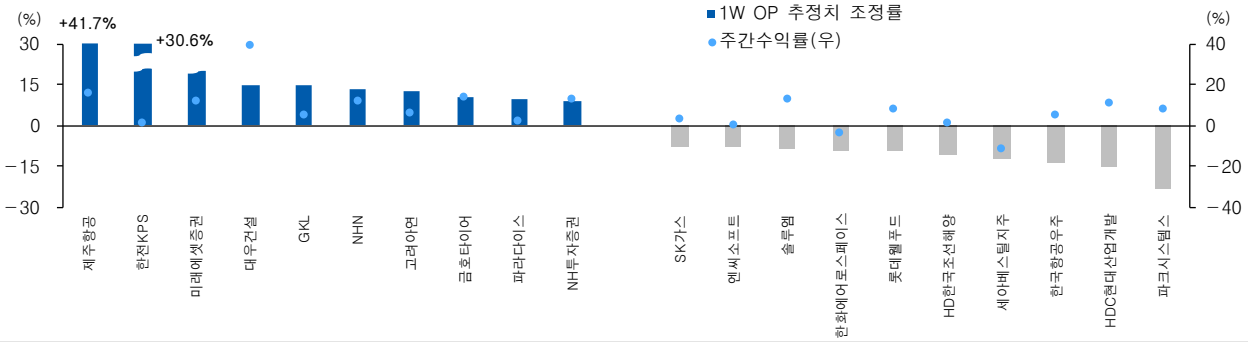
'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A263750	펄어비스	인터넷/게임	3,629	69.3	0.4
2	A006800	미래에셋증권	증권	26,663	27.8	11.3
3	A248070	솔루엠	전자/부품	876	27.3	12.7
4	A001440	대한전선	기계	1,647	16.0	5.3
5	A005940	NH투자증권	증권	16,166	11.1	12.3
6	A272450	진에어	항공	552	10.2	5.1
7	A089590	제주항공	항공	535	9.2	15.5
8	A010130	고려아연	비철금속	18,909	8.0	5.5
9	A073240	금호타이어	자동차부품	6,387	6.6	13.8
10	A016360	삼성증권	증권	16,476	5.4	9.5

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A052690	한전기술	전기	667	-4.5	1.0
2	A078930	GS	지주회사	28,027	-4.7	3.7
3	A009540	HD한국조선해양	조선	54,310	-4.8	0.4
4	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,222	-5.1	7.4
5	A280360	롯데웰푸드	음식료	1,755	-5.1	7.6
6	A001740	SK네트웍스	상사	1,161	-5.6	1.8
7	A021240	코웨이	내구소비재	9,660	-6.3	12.4
8	A114090	GKL	호텔/레저	626	-7.7	4.7
9	A051600	한전KPS	전기	1,789	-8.0	1.2
10	A293490	카카오게임즈	인터넷/게임	48	-75.7	1.9

'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

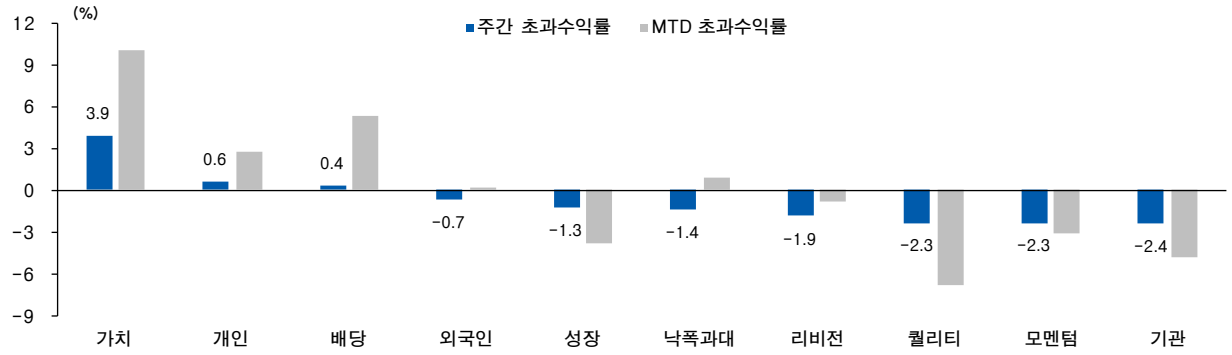
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A089590	제주항공	항공	510	41.7	15.5
2	A051600	한전KPS	전기	495	30.6	1.2
3	A006800	미래에셋증권	증권	9,915	22.0	11.3
4	A047040	대우건설	건설	1,204	15.2	39.5
5	A114090	GKL	호텔/레저	160	15.2	4.7
6	A181710	NHN	SW/SI	340	13.3	12.0
7	A010130	고려아연	비철금속	5,345	13.1	5.5
8	A073240	금호타이어	자동차부품	1,438	10.3	13.8
9	A034230	파라다이스	호텔/레저	511	9.8	2.0
10	A005940	NH투자증권	증권	4,301	9.0	12.3

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A018670	SK가스	가스	1,151	-7.9	3.2
2	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	813	-7.9	-0.5
3	A248070	솔루엠	전자/부품	156	-8.2	12.7
4	A012450	한화에어로스페이스	방위산업	8,480	-9.2	-4.2
5	A280360	롯데웰푸드	음식료	236	-9.5	7.6
6	A009540	HD한국조선해양	조선	11,310	-10.4	0.4
7	A001430	세아베스틸지주	철강	306	-12.0	-11.8
8	A047810	한국항공우주	방위산업	840	-13.5	4.5
9	A294870	HDC현대산업개발	건설	1,008	-14.9	10.8
10	A140860	파크시스템스	전자/부품	82	-23.2	7.6

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 2/11일 기준(수익률 2/12일 기준)

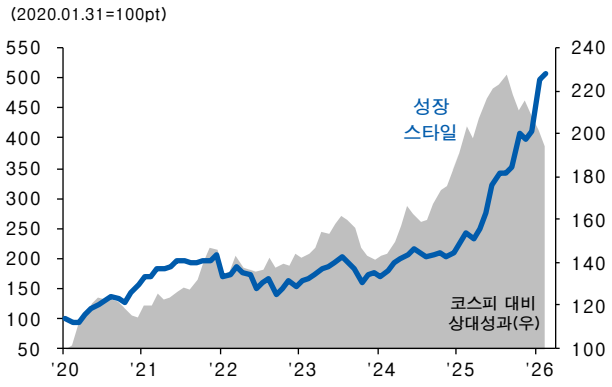
업종별 종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
61.1	1.1



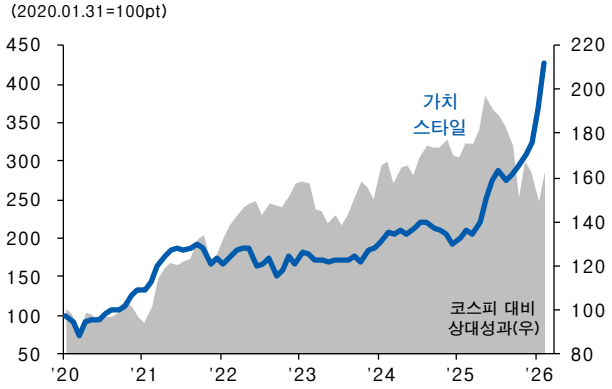
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	8.4	9.7	9.6	27.7	12.2
A353200	대덕전자	7.3	9.7	9.7	26.7	1.1
A068270	셀트리온	8.8	8.2	7.8	24.8	8.3
A329180	HD현대중공업	9.2	9.2	5.9	24.3	0.0
A010120	LS ELECTRIC	8.1	7.7	8.0	23.8	12.5
A195870	해성디에스	6.4	8.3	8.1	22.8	-1.3
A267270	HD건설기계	9.9	6.4	6.5	22.8	15.5
A000660	SK하이닉스	9.8	6.4	6.3	22.5	5.9
A071970	HD현대마린엔진	9.3	9.2	3.9	22.4	4.7
A278470	에이피알	9.5	8.1	4.8	22.4	9.6

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
55.6	0.6



가치 스코어 Top 10

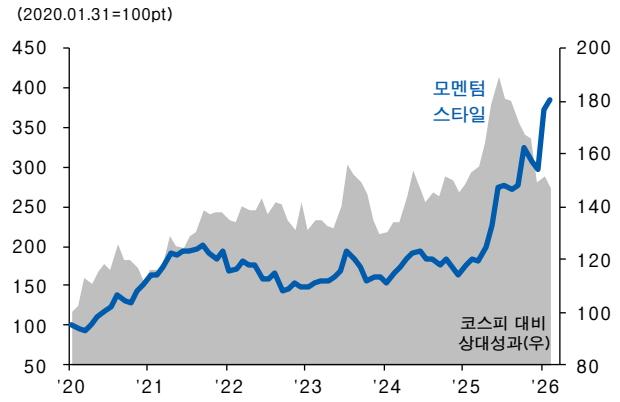
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A088350	한화생명	9.7	9.9	9.9	29.5	23.6
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.8	29.4	19.8
A036460	한국가스공사	9.7	9.7	9.8	29.2	4.6
A001450	현대해상	9.9	9.4	9.8	29.1	12.0
A011170	롯데케미칼	10.0	9.7	9.3	29.1	12.0
A108670	LX하우시스	8.8	9.6	9.9	28.4	8.2
A023530	롯데쇼핑	8.6	10.0	9.4	28.0	15.3
A139480	이마트	8.2	9.8	10.0	28.0	15.3
A139130	iM금융지주	9.6	9.4	9.0	28.0	14.9
A375500	DL이앤씨	9.5	9.5	8.6	27.6	10.4

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/12일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

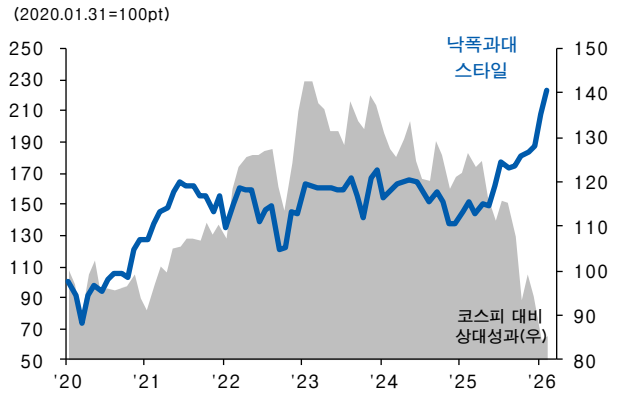
모멘텀 스타일 성과 추이

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		
A240810	원익IPS	9.7	9.7	10.0	9.8	39.1	25.0
A006800	미래에셋증권	10.0	9.4	9.4	9.9	38.6	11.4
A001430	세아베스틸지주	9.1	9.9	9.6	9.6	38.1	-12.2
A307950	현대오토에버	8.7	10.0	9.9	9.4	37.9	15.6
A058470	리노공업	9.9	9.8	9.5	8.5	37.6	2.6
A000660	SK하이닉스	8.8	9.3	9.9	9.7	37.6	5.9
A005380	현대차	9.8	9.9	9.4	8.4	37.4	8.1
A166090	하나머티리얼즈	9.6	9.3	9.7	8.5	37.0	-0.2
A039490	키움증권	9.5	8.8	9.2	9.4	36.9	11.5
A353200	대덕전자	8.4	9.5	9.8	9.1	36.8	1.1

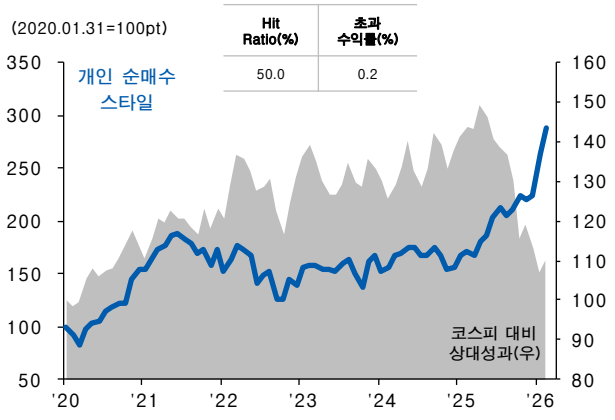
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A462870	시프트업	8.8	9.1	9.3	10.0	37.1	3.6
A272450	진에어	8.9	8.4	9.8	9.9	37.0	5.0
A248070	솔루엠	9.4	9.4	8.3	9.5	36.5	12.3
A145720	덴티움	7.2	9.6	9.9	9.8	36.5	3.7
A051900	LG생활건강	8.0	9.0	9.5	9.5	36.0	5.5
A089590	제주항공	8.4	8.2	9.6	9.9	35.9	14.9
A000080	하이트진로	9.3	8.5	9.0	8.9	35.5	3.2
A039130	하나투어	9.4	7.7	9.0	9.4	35.5	5.6
A259960	크래프톤	7.4	8.4	9.8	9.7	35.3	8.3
A112610	씨에스윈드	9.0	8.9	8.7	8.6	35.2	6.4

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/12일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

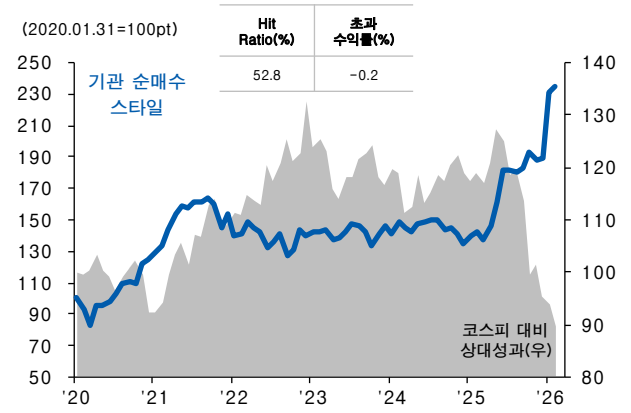


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A204320	HL만도	10.0	10.0	9.9	9.9	39.7	4.4
A161890	한국콜마	9.1	9.7	10.0	9.9	38.5	4.8
A086280	현대글로비스	9.9	9.8	9.4	9.1	38.1	9.2
A005380	현대차	9.9	9.7	9.2	9.3	38.1	8.1
A000080	하이트진로	9.1	9.2	9.7	9.5	37.5	3.2
A035900	JYP Ent.	7.2	9.9	9.8	9.8	36.6	4.6
A006360	GS건설	9.7	8.6	8.9	9.0	36.1	13.1
A214450	파마리서치	9.5	9.8	9.4	7.5	36.0	2.5
A097950	CJ제일제당	6.4	9.6	9.9	10.0	35.8	5.5
A018880	한온시스템	9.4	9.5	8.2	8.5	35.6	17.2

기관 순매수 스타일 성과 추이

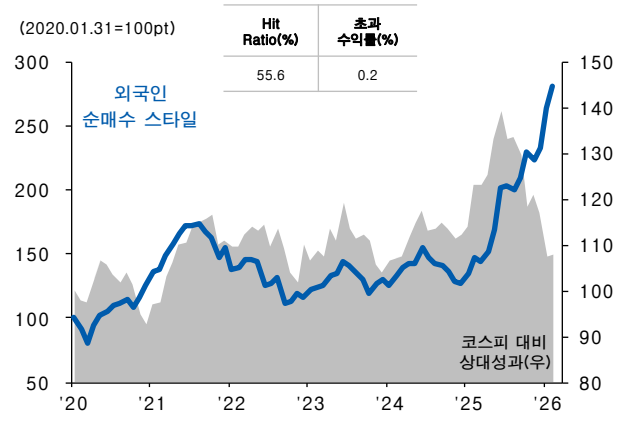


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A240810	원익IPS	9.8	9.6	10.0	9.9	39.2	25.0
A237690	에스티팜	9.8	9.9	9.7	9.8	39.2	0.9
A403870	HPSP	9.9	9.7	9.8	9.8	39.1	-7.4
A166090	하나머티리얼즈	9.4	9.9	9.9	9.7	38.8	-0.2
A195870	해성디에스	8.6	9.8	9.9	9.9	38.1	-1.3
A058470	리노공업	9.6	9.6	9.6	9.4	38.1	2.6
A257720	실리콘투	9.6	9.5	9.7	9.3	38.0	4.5
A036930	주성엔지니어링	10.0	10.0	9.6	8.1	37.6	5.7
A247540	에코프로비엠	9.2	9.4	9.5	9.2	37.2	4.5
A140860	파크시스템스	9.3	9.2	9.5	9.1	37.1	7.5

외국인 순매수 스타일 성과 추이



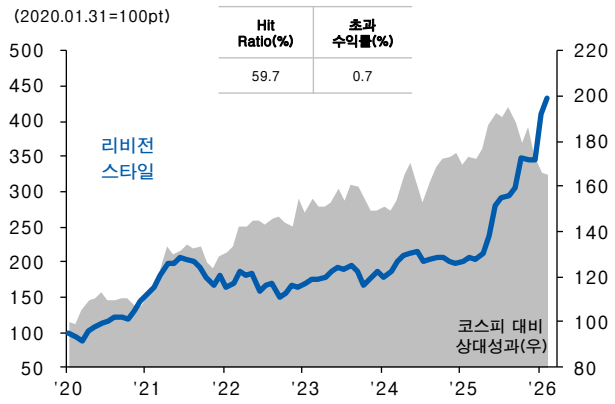
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A032350	롯데관광개발	9.8	9.9	9.9	9.9	39.4	-2.7
A353200	대덕전자	9.2	10.0	9.9	9.5	38.5	1.1
A018880	한온시스템	9.9	9.8	9.7	9.1	38.5	17.2
A278470	에이피알	9.4	9.4	9.7	9.9	38.3	9.6
A069620	대웅제약	8.8	9.9	9.8	9.7	38.2	6.3
A403870	HPSP	10.0	9.8	9.3	9.1	38.1	-7.4
A052690	한전기술	9.9	9.1	9.4	9.3	37.6	1.1
A012510	더존비즈온	9.1	9.7	9.6	9.2	37.5	3.5
A028050	삼성E&A	8.9	8.4	9.4	9.4	36.1	6.1
A004000	롯데정밀화학	8.0	9.3	9.5	9.0	35.7	7.7

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/12일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

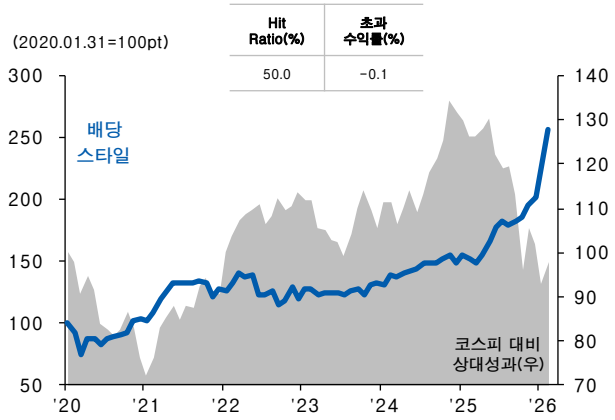


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.6	9.7	9.2	28.5	12.2
A000660	SK하이닉스	9.6	9.4	9.1	28.2	5.9
A010130	고려아연	8.6	9.3	6.5	24.4	5.5
A052690	한전기술	9.1	9.5	5.4	24.0	1.1
A105630	한세실업	7.7	8.7	7.2	23.6	-14.1
A071970	HD현대마린엔진	8.7	9.4	5.5	23.6	4.7
A329180	HD현대중공업	9.5	8.3	5.6	23.3	0.0
A195870	해성디에스	8.6	9.0	5.6	23.2	-1.3
A128940	한미약품	8.4	7.7	6.8	22.8	11.0
A028260	삼성물산	7.9	7.5	7.2	22.6	14.8

배당 스타일 성과 추이

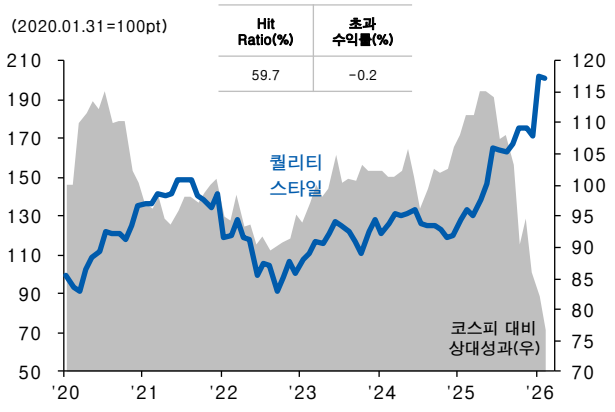


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A009240	한샘	9.5	9.9	9.7	9.9	39.1	4.2
A030000	제일기획	8.9	9.8	9.3	9.8	37.8	5.9
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.7	9.9	9.5	36.9	10.0
A032640	LG유플러스	9.2	9.6	9.1	8.7	36.6	10.3
A005940	NH투자증권	8.1	9.2	9.7	9.2	36.1	11.9
A016360	삼성증권	7.0	9.8	9.9	9.4	36.1	9.2
A017670	SK텔레콤	8.9	9.0	8.9	8.9	35.7	12.2
A024110	기업은행	6.8	9.4	9.8	9.7	35.7	13.1
A214320	이노션	8.1	8.9	8.5	9.8	35.2	4.7
A000810	삼성화재	7.5	9.5	9.3	8.8	35.1	11.5

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.5	9.9	9.7	9.4	38.5	-7.4
A058470	리노공업	9.9	9.8	9.7	8.6	38.0	2.6
A042700	한미반도체	9.1	9.7	9.4	9.7	37.9	7.2
A462870	시프트업	9.9	9.9	9.9	7.7	37.5	3.6
A214150	클래시스	8.9	9.8	9.6	9.2	37.4	-0.8
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.8	36.7	8.8
A000660	SK하이닉스	7.5	9.6	9.6	9.8	36.5	5.9
A259960	크래프톤	9.6	9.5	9.8	7.3	36.2	8.3
A214450	파마리서치	7.9	9.6	9.3	8.9	35.7	2.5
A192080	더블유게임즈	9.8	9.4	9.4	6.8	35.5	-0.5

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/12일 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)