YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

4월 4주차 Bull/Bear 베타 + 리비전 전략

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

유안타증권 Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 스크리닝

Bull/Bear 베타 + 리비전 전략

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

Bull/Bear 베타 + 리비전 전략(참고자료: 기적의 선반영, 선반영의 기적)

1) 과거 증시 변동성 피크 국면 케이스 스터디 기반, 4월 변동성의 점진적인 완화와 방향성이 구체화되는 흐름이 나타날 전망

2) 변동성 장세 속 종목별 낙폭 이후 회복 탄력이 차별화됨에 따라 하락에 대한 민감도는 낮고, 상승에 대한 민감도는 높은, 초과회복을 나타낼 가능성이 높은 종목에 주목

3) 또한, 4월 펀더멘탈에 대한 주가 반응 강도가 가장 확대되는 기간으로, 1) 하락 민감도(Bear Beta) 대비 상승 민감도(Bull Beta)가 높으며 2) 이익 추정치 1개월 조정률 상위 종목 스크리닝

[4월 4주차] 1) Bear Beta 대비 Bull Beta가 높은 2) 12MF 영업이익 및 순이익 1M 조정률 상위 20% 종목 스크리닝

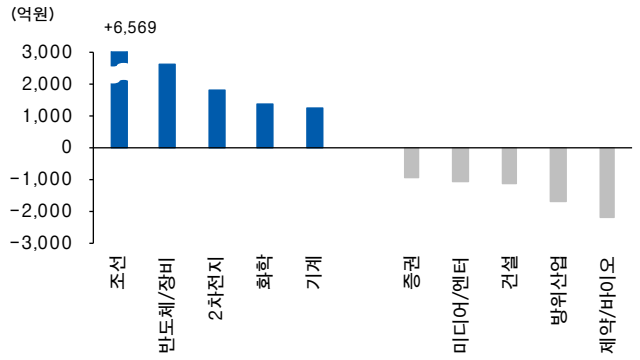
종목명	업종	시가총액(억원)	60일 베타		12MF 영업이익(억원, %)			12MF 순이익(억원, %)		
			Bull	Bear	3/22일 기준	4/22일 기준	변동률	3/22일 기준	4/22일 기준	변동률
삼성전자	반도체	13,124,895	1.46	1.11	2,251,504	3,425,098	52.1	1,875,949	2,740,968	46.1
SK하이닉스	반도체	8,730,604	1.40	0.98	1,863,919	2,523,011	35.4	1,501,756	2,029,566	35.1
미래에셋증권	증권	378,827	1.51	1.39	26,921	31,980	18.8	19,594	23,805	21.5
HD현대일렉트릭	기계	406,972	1.11	0.81	12,928	13,715	6.1	10,016	10,763	7.5
삼성전기	IT하드웨어	578,129	1.08	0.99	15,590	16,637	6.7	12,377	13,148	6.2
LIG디펜스앤에어로스페이스	상사,자본재	212,520	1.55	0.01	4,597	5,148	12.0	3,960	4,384	10.7
한화	상사,자본재	90,321	1.05	1.00	56,838	64,076	12.7	10,608	11,134	5.0
리노공업	반도체	93,969	1.22	0.74	2,093	2,386	14.0	1,784	2,049	14.9
이오테크닉스	반도체	59,688	1.50	0.82	1,361	1,447	6.3	1,117	1,304	16.7
대덕전자	IT하드웨어	48,873	1.22	1.13	2,045	2,162	5.7	1,710	1,790	4.7
DL이앤씨	건설,건축관련	37,765	1.09	0.91	4,500	4,902	8.9	3,322	3,605	8.5
피에스케이	반도체	25,230	1.50	1.08	1,226	1,501	22.4	1,061	1,288	21.4
RFHIC	IT하드웨어	26,580	1.71	0.93	563	588	4.5	464	490	5.7
쎄트렉아이	상사,자본재	19,318	1.17	0.94	186	209	12.3	149	197	31.9
엘앤씨바이오	건강관리	17,393	1.10	0.98	277	478	72.2	234	302	28.9

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +3,554.0 억원 순매수, 기관은 약 +2,071.9 억원 순매수. 두 주체 모두 반도체/장비 업종과 기계 업종을 순매수한 반면 증권 업종을 순매도
- 특히, 두 주체 모두 해성디에스 및 주성엔지니어링에 강도 높은 순매수 기록하며 반도체 업종 내 소부장 종목에 수급 집중되는 모습 확인

기관 주간 순매수 상/하위 업종

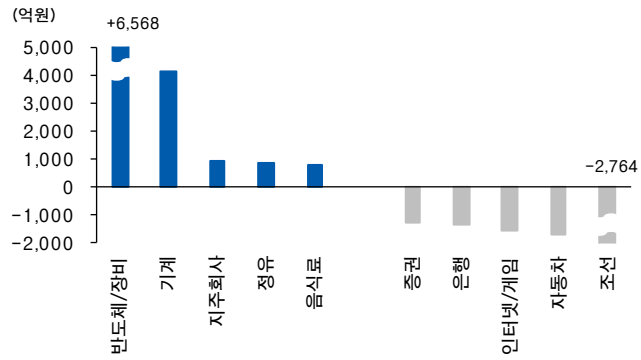


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	6,569	11,419	4,412	
2	반도체/장비	2,604	24,101	94,643	
3	2차전지	1,761	13,133	20,872	
4	화학	1,367	2,223	1,773	
5	기계	1,252	7,358	9,875	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	-2,244	419	-2,288	
2	방위산업	-1,737	994	4,459	
3	건설	-1,184	1,773	392	
4	미디어/엔터	-1,097	-2,896	-5,855	
5	증권	-962	1,411	5,085	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

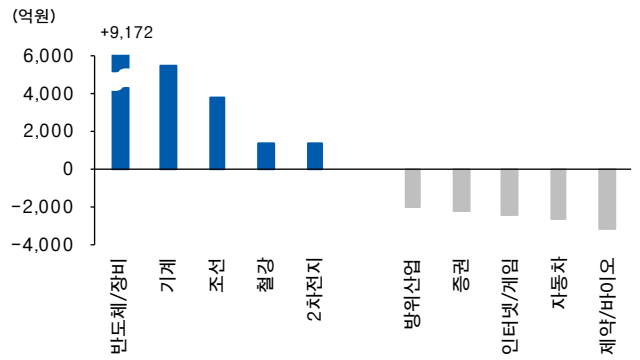


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	6,568	-68,210	-485,418	
2	기계	4,179	7,657	25,747	
3	지주회사	908	3,238	9,422	
4	정유	845	2,465	2,007	
5	음식료	759	525	1,104	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	조선	-2,764	-11,026	-6,706	
2	자동차	-1,711	-7,935	-60,008	
3	인터넷/게임	-1,526	-3,485	-10,976	
4	은행	-1,337	-8,708	-17,816	
5	증권	-1,298	-4,256	-17,562	

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	9,172	-44,108	-390,776	
2	기계	5,431	15,015	35,621	
3	조선	3,805	394	-2,293	
4	철강	1,393	3,413	40	
5	2차전지	1,381	20,237	35,885	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	-3,180	-322	10,891	
2	자동차	-2,644	-9,195	-59,166	
3	인터넷/게임	-2,423	-3,410	-17,357	
4	증권	-2,259	-2,844	-12,477	
5	방위산업	-2,018	4,205	-6,851	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 4/23일 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	33,200	462	0.38
A008770	호텔신라	호텔/레저	22,254	313	0.36
A195870	해성디에스	반도체/장비	12,937	167	0.36
A021240	코웨이	내구소비재	56,331	668	0.29
A120110	코오롱인더	화학	26,742	265	0.25
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	54,011	512	0.25
A009830	한화솔루션	화학	80,446	731	0.23
A011070	LG이노텍	전자/부품	118,336	941	0.22
A443060	HD현대마린솔루션	조선	102,220	822	0.21
A112610	씨에스윈드	기계	29,014	193	0.17

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	54,011	1,731	0.83
A195870	해성디에스	반도체/장비	12,937	230	0.50
A007660	이수페타시스	전자/부품	110,261	1,982	0.47
A241710	코스메카코리아	화장품	9,067	136	0.37
A403870	HPSP	반도체/장비	41,973	575	0.37
A140860	파크시스템스	전자/부품	19,978	222	0.29
A060250	NHN KCP	SW/SI	8,193	66	0.20
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	31,241	221	0.19
A353200	대덕전자	전자/부품	48,873	357	0.18
A375500	DL이앤씨	건설	37,765	259	0.17

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	54,011	2,243	1.1
A195870	해성디에스	반도체/장비	12,937	397	0.9
A007660	이수페타시스	전자/부품	110,261	2,123	0.5
A403870	HPSP	반도체/장비	41,973	647	0.4
A008770	호텔신라	호텔/레저	22,254	342	0.4
A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	33,200	298	0.2
A006360	GS건설	건설	35,559	337	0.2
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	31,241	260	0.2
A120110	코오롱인더	화학	26,742	204	0.2
A112610	씨에스윈드	기계	29,014	214	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

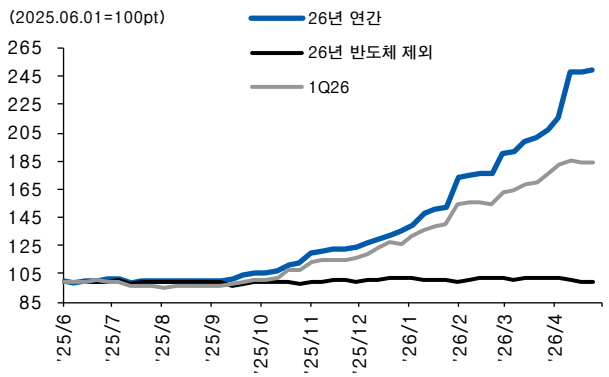
종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005930	삼성전자	반도체/장비	13,124,895	4,371.3	-39,115	-302,141
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	8,730,604	1,943.3	-4,261	-101,586
A329180	HD현대중공업	조선	672,801	656.4	-3,457	-5,033
A298040	효성중공업	기계	304,726	1,102.7	-1,425	2,917
A042700	한미반도체	반도체/장비	279,741	103.4	-2,167	6,510
A006360	GS건설	건설	35,559	336.9	-365	-1,016
A010060	OCI홀딩스	화학	60,118	32.1	-618	134
A028260	삼성물산	지주회사	518,941	123.9	-487	-827
A375500	DL이앤씨	건설	37,765	227.4	-335	-828
A051600	한전KPS	전기	28,215	34.2	-212	-429

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 4/23일 기준

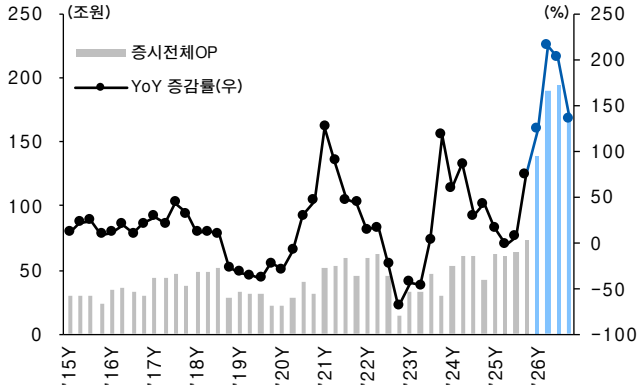
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.3% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -3.5% 하향조정
- 26년 1분기 실적시즌 이후 증시 전체 영업이익 추정치는 상향조정 지속되는 반면 반도체 제외 업종의 경우 부진한 흐름 지속. KOSPI 지수는 전고점을 돌파하며 약 6,475.8Pt 수준을 기록하고 있지만 P/E는 여전히 7.6배 수준

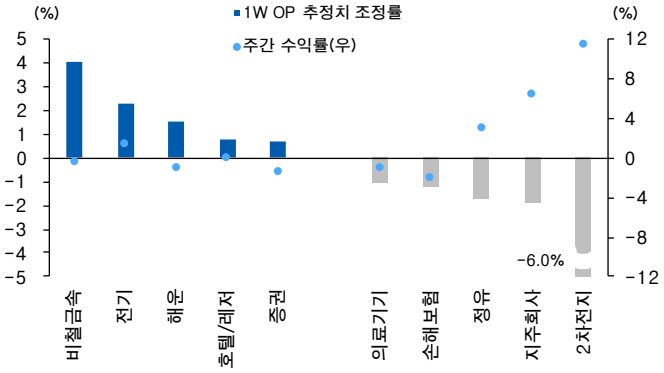
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

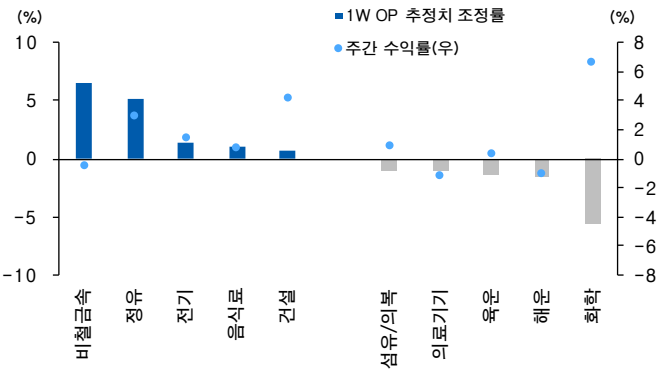


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	23,987	4.1	-0.4	
2	전기	112,609	2.3	1.4	
3	해운	15,260	1.5	-1.0	
4	호텔/레저	8,828	0.8	0.0	
5	증권	121,666	0.7	-1.5	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	2차전지	9,458	-6.0	11.4	
2	지주회사	325,116	-1.9	6.3	
3	정유	65,232	-1.7	3.0	
4	손해보험	64,163	-1.3	-2.0	
5	의료기기	5,731	-1.1	-1.1	

26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

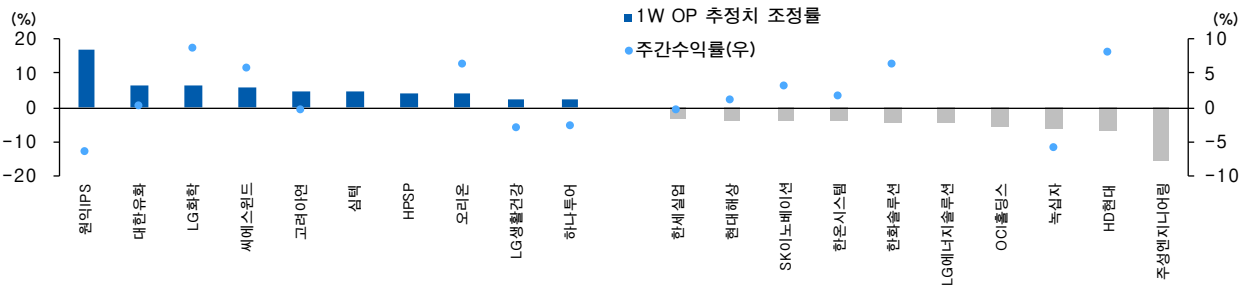
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	7,565	6.6	-0.4	
2	정유	33,384	5.2	3.0	
3	전기	39,930	1.3	1.4	
4	음식료	11,209	1.0	0.8	
5	건설	7,907	0.8	4.2	
하위	**업종**	**OP 추정치**	**1W 조정률**	**1W 수익률**	**5W 추정치 추이**
1	화학	2,050	-5.7	6.6	
2	해운	4,179	-1.6	-1.0	
3	육운	6,382	-1.3	0.4	
4	의료기기	1,100	-1.0	-1.1	
5	섬유/의복	5,314	-0.9	1.0	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 4/22일 추정치 기준(수익률 4/23일 기준)

업종별 | 종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



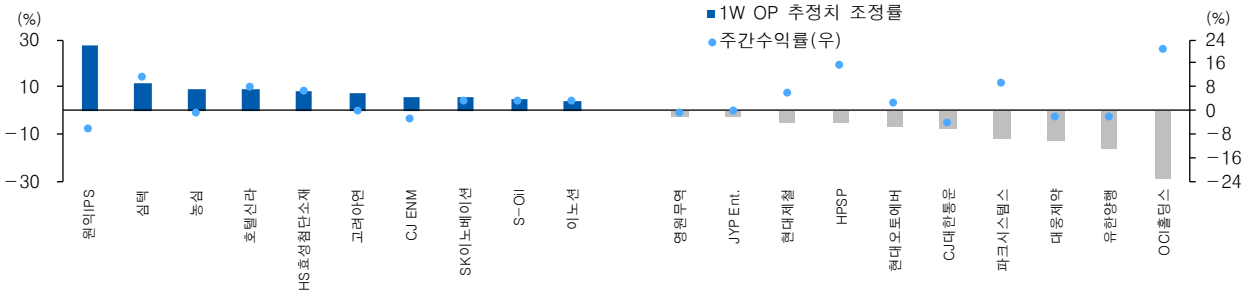
'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A240810	원익IPS	반도체/장비	1,824	17.1	-6.6
2	A006650	대한유화	화학	1,897	6.4	0.2
3	A051910	LG화학	화학	7,837	6.3	8.7
4	A112610	씨에스윈드	기계	2,998	5.8	5.8
5	A010130	고려아연	비철금속	20,405	4.8	-0.3
6	A222800	심텍	전자/부품	1,362	4.8	11.2
7	A403870	HPSP	반도체/장비	1,283	4.0	14.6
8	A271560	오리온	음식료	6,539	3.9	6.3
9	A051900	LG생활건강	화장품	2,761	2.6	-3.1
10	A039130	하나투어	호텔/레저	686	2.5	-2.7

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	654	-15.7	65.1
2	A267250	HD현대	지주회사	78,285	-7.0	7.9
3	A006280	녹십자	제약/바이오	752	-6.4	-6.0
4	A010060	OCI홀딩스	화학	4,036	-5.8	20.4
5	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	11,425	-4.7	11.6
6	A009830	한화솔루션	화학	6,506	-4.4	6.2
7	A018880	한온시스템	자동차부품	4,106	-4.2	1.7
8	A096770	SK이노베이션	정유	39,195	-4.0	2.9
9	A001450	현대해상	손해보험	9,799	-3.9	1.0
10	A105630	한세실업	섬유/의복	981	-3.6	-0.3

'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

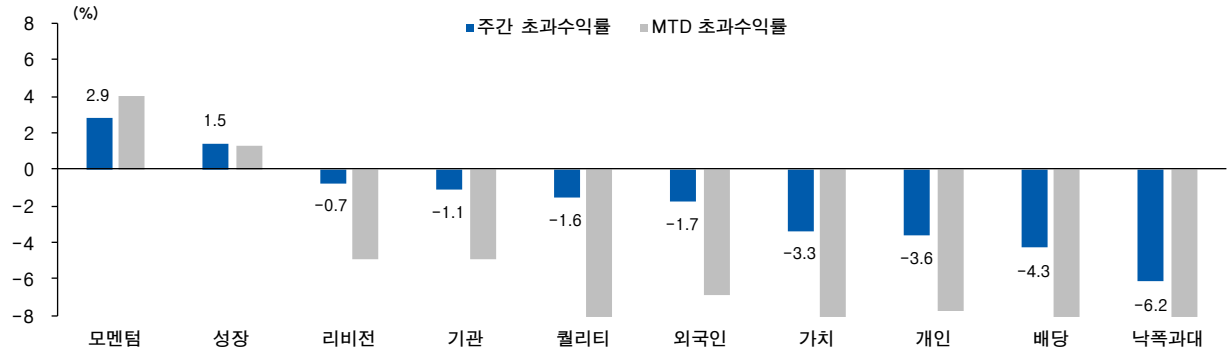
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A240810	원익IPS	반도체/장비	23	27.8	-6.6
2	A222800	심텍	전자/부품	82	11.3	11.2
3	A004370	농심	음식료	598	9.3	-1.2
4	A008770	호텔신라	호텔/레저	32	8.7	7.2
5	A298050	HS효성첨단소재	화학	266	7.9	6.3
6	A010130	고려아연	비철금속	6,574	7.6	-0.3
7	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	235	5.5	-3.2
8	A096770	SK이노베이션	정유	21,555	5.4	2.9
9	A010950	S-Oil	정유	11,829	4.9	3.0
10	A214320	이노션	미디어/엔터	333	3.7	2.9

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A010060	OCI홀딩스	화학	272	-28.7	20.4
2	A000100	유한양행	제약/바이오	123	-16.2	-2.9
3	A069620	대웅제약	제약/바이오	350	-13.3	-2.8
4	A140860	파크시스템스	전자/부품	38	-12.4	8.8
5	A000120	CJ대한통운	육운	1,044	-7.5	-4.4
6	A307950	현대오토에버	SW/SI	362	-6.9	1.9
7	A403870	HPSP	반도체/장비	160	-5.4	14.6
8	A004020	현대제철	철강	443	-5.3	5.5
9	A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	265	-3.0	-0.3
10	A111770	영원무역	섬유/의복	1,078	-2.9	-1.1

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 4/22일 추정치 기준(수익률 4/23일 기준)

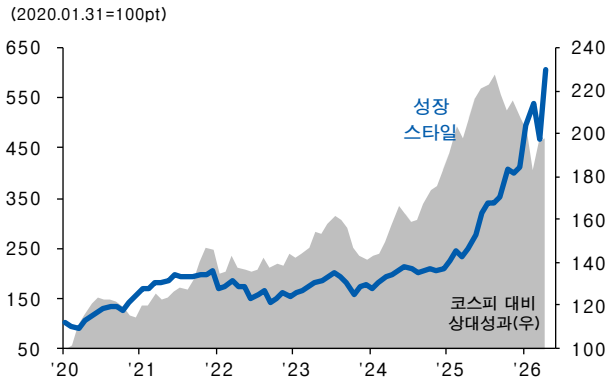
업종별 | 종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
60.0	1.0



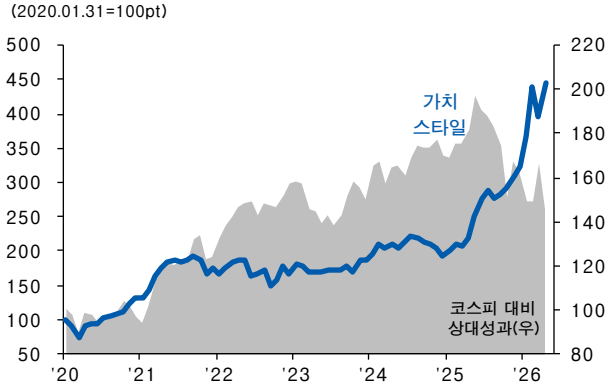
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.7	9.6	28.6	3.9
A353200	대덕전자	8.7	9.7	9.4	27.9	4.9
A298040	효성중공업	7.2	8.5	8.4	24.1	9.7
A068270	셀트리온	8.0	8.1	7.9	24.0	-0.7
A267270	HD건설기계	7.7	7.9	8.4	23.9	13.8
A267250	HD현대	6.5	8.4	8.9	23.8	7.9
A010130	고려아연	8.4	7.0	8.2	23.6	-0.3
A278470	에이피알	9.6	8.7	5.2	23.5	3.9
A009150	삼성전기	6.8	8.2	7.8	22.8	14.0
A064350	현대로템	8.0	7.6	7.2	22.8	9.0

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
56.0	0.5



가치 스코어 Top 10

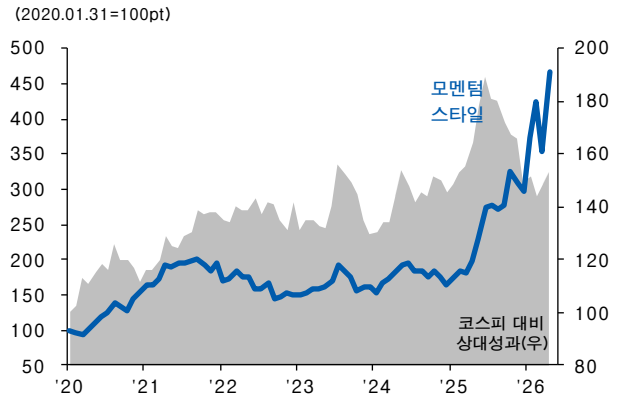
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A036460	한국가스공사	9.8	9.7	9.9	29.4	2.0
A000370	한화손해보험	9.8	9.7	9.9	29.4	-1.9
A011170	롯데케미칼	10.0	9.7	9.4	29.1	6.1
A001450	현대해상	9.9	9.3	9.9	29.1	1.0
A088350	한화생명	9.2	9.8	9.9	28.9	-1.0
A139480	이마트	7.9	9.9	9.9	27.7	1.7
A139130	iM금융지주	9.3	9.4	8.9	27.6	2.4
A294870	HDC현대산업개발	9.5	9.5	8.1	27.1	3.2
A015760	한국전력	9.9	8.7	8.3	27.0	0.7
A023530	롯데쇼핑	7.9	10.0	9.0	26.9	0.4

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 4/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

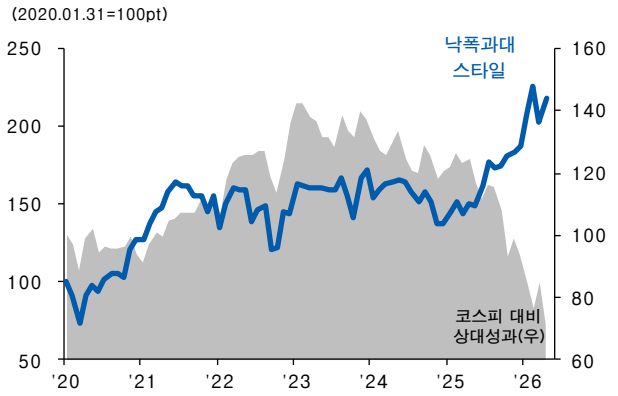
모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.3	-0.4



모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A047040	대우건설	10.0	10.0	10.0	9.9	39.7	15.9
A353200	대덕전자	9.8	9.5	9.9	9.8	38.9	4.9
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.5	9.4	9.1	37.8	20.4
A272210	한화시스템	8.8	9.8	9.0	9.4	37.0	0.5
A263750	펄어비스	9.9	9.7	9.1	8.2	36.8	2.8
A120110	코오롱인더	9.3	9.4	9.5	8.6	36.7	3.4
A066970	엘앤에프	9.6	9.1	9.1	8.4	36.0	1.9
A010120	LS ELECTRIC	7.0	9.2	9.7	9.6	35.4	16.4
A278470	에이피알	9.3	8.9	6.8	9.8	34.7	3.9
A009150	삼성전기	6.8	9.3	9.4	9.2	34.6	14.0

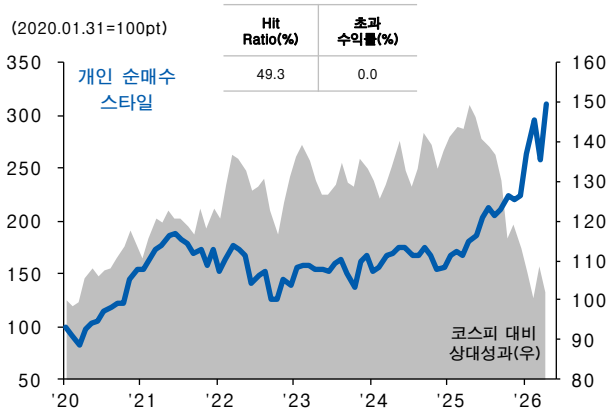
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A122870	와이지엔터테인먼트	9.7	9.7	9.9	7.5	36.7	-3.6
A376300	디어유	7.6	9.8	9.8	9.2	36.4	-6.9
A041510	에스엠	8.4	10.0	9.9	8.2	36.4	-2.1
A293490	카카오게임즈	6.8	9.5	9.3	9.2	34.8	-0.1
A039130	하나투어	6.7	9.4	9.0	9.5	34.6	-2.7
A361610	SK아이이테크놀로지	7.8	8.8	8.8	9.1	34.5	11.2
A253450	스튜디오드래곤	7.3	9.0	8.8	9.3	34.4	-3.2
A067160	SOOP	6.6	8.7	9.1	9.9	34.4	-0.2
A035720	카카오	9.1	9.7	9.4	5.9	34.2	-3.2
A035420	NAVER	7.6	9.2	9.6	7.7	34.1	0.5

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 4/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

개인 순매수 스타일 성과 추이

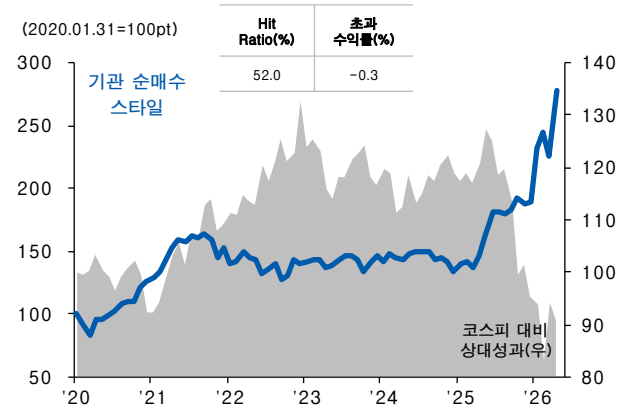


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A103140	풍산	10.0	9.9	9.9	9.9	39.6	-2.2
A005380	현대차	9.7	9.8	9.8	9.6	38.9	-1.1
A375500	DL이앤씨	9.6	9.4	9.3	9.4	37.7	-0.1
A204320	HL만도	7.8	9.9	9.8	10.0	37.4	0.9
A122870	와이지엔터	9.9	9.0	10.0	8.5	37.3	-3.6
A006360	GS건설	9.8	9.4	9.1	8.9	37.2	6.5
A079550	LIG넥스원	9.7	9.3	9.2	8.6	36.8	10.3
A035420	NAVER	8.8	8.1	9.6	9.8	36.3	0.5
A004020	현대제철	9.6	9.7	9.6	7.0	35.8	5.5
A000660	SK하이닉스	8.5	8.9	9.1	8.7	35.2	8.6

기관 순매수 스타일 성과 추이

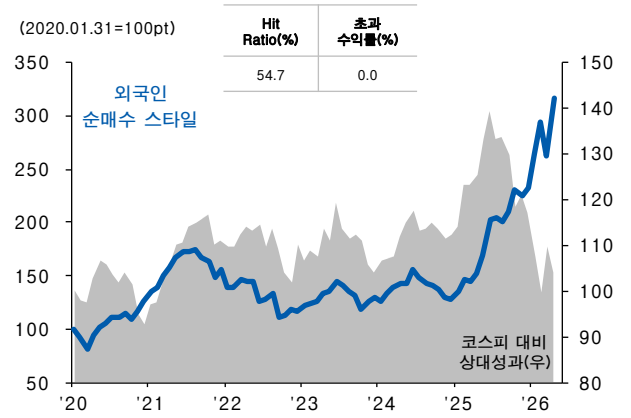


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A012510	더존비즈온	10.0	10.0	9.9	9.8	39.6	-0.1
A403870	HPSP	9.7	9.9	9.9	9.9	39.4	14.6
A240810	원익IPS	9.5	9.9	10.0	9.9	39.2	-6.6
A058470	리노공업	9.6	9.8	9.8	9.8	38.9	6.9
A034230	파라다이스	9.0	9.7	9.6	10.0	38.2	-2.7
A120110	코오롱인더	9.8	9.4	9.5	9.5	38.1	3.4
A353200	대덕전자	9.8	9.6	9.1	9.5	38.0	4.9
A001120	LX인터내셔널	9.3	9.6	9.4	9.7	38.0	9.0
A166090	하나머티리얼즈	9.4	9.2	9.7	9.2	37.5	-2.9
A237690	에스티팜	8.4	9.7	9.7	9.6	37.3	5.0

외국인 순매수 스타일 성과 추이



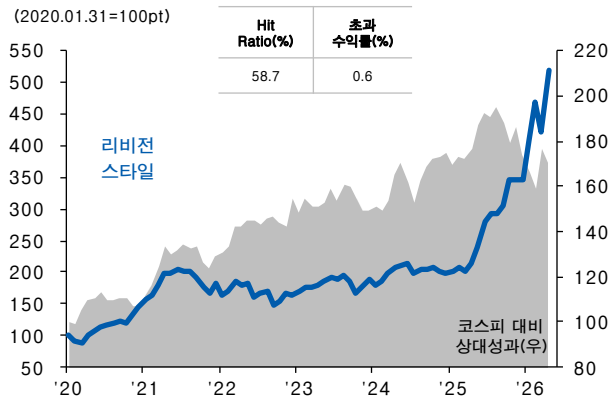
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A278470	에이피알	9.5	9.9	9.9	9.9	39.1	3.9
A004170	신세계	9.5	9.9	9.6	9.5	38.4	1.5
A192820	코스맥스	9.6	9.8	9.3	8.5	37.1	2.3
A069620	대웅제약	8.6	8.8	9.9	9.7	37.0	-2.8
A011780	금호석유화학	9.6	8.8	9.3	9.1	36.7	-1.2
A195870	해성디에스	7.5	9.7	9.8	9.7	36.7	25.8
A222800	심텍	9.9	9.6	7.4	9.5	36.2	11.2
A271560	오리온	8.8	9.4	8.5	9.4	36.0	6.3
A336260	두산퓨얼셀	8.4	7.9	9.8	9.8	35.8	3.6
A195940	HK이노엔	9.0	8.7	9.1	8.7	35.4	-2.7

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 4/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

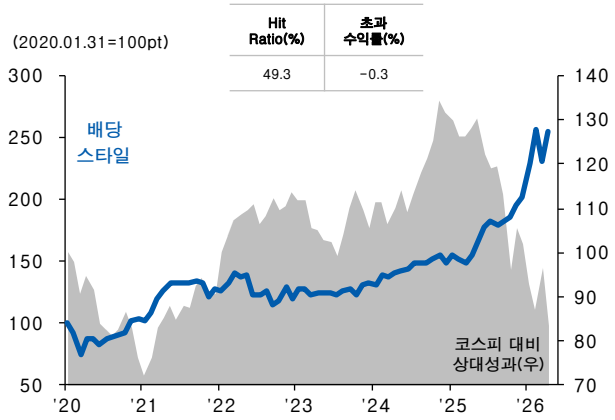


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.1	9.4	8.8	27.2	3.9
A000660	SK하이닉스	9.5	9.1	8.7	27.2	8.6
A263750	펄어비스	9.8	9.6	6.2	25.6	2.8
A353200	대덕전자	8.1	8.9	8.1	25.1	4.9
A010950	S-Oil	9.5	9.5	6.0	25.0	3.0
A006800	미래에셋증권	6.5	9.5	8.7	24.7	-3.8
A004000	롯데정밀화학	9.4	9.5	5.7	24.5	2.6
A036570	엔씨소프트	9.3	9.4	5.7	24.3	3.2
A011200	HMM	6.6	9.1	8.5	24.2	-1.7
A052690	한전기술	8.5	8.2	6.6	23.2	3.4

배당 스타일 성과 추이

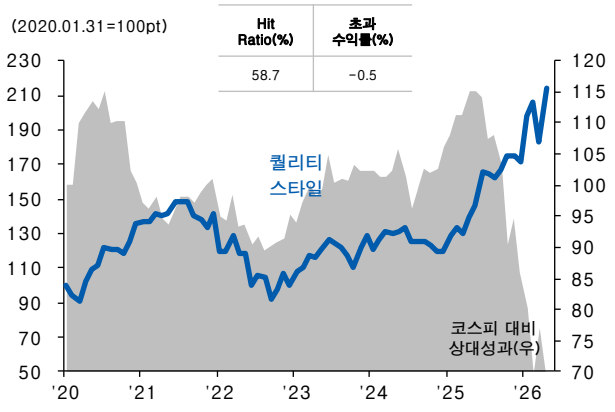


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.6	9.8	9.3	9.9	37.7	0.3
A214320	이노션	7.9	9.9	9.2	9.9	36.9	2.9
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.3	9.8	36.5	0.9
A005940	NH투자증권	7.5	9.6	9.9	9.3	36.3	-1.0
A035250	강원랜드	8.5	9.7	8.2	9.5	35.9	-1.7
A001120	LX인터내셔널	7.9	9.2	9.8	8.9	35.7	9.0
A032640	LG유플러스	8.1	9.4	9.0	8.7	35.2	-4.9
A023530	롯데쇼핑	9.8	8.9	8.5	7.9	35.1	0.4
A016360	삼성증권	6.2	9.5	9.5	9.6	34.7	1.6
A024110	기업은행	5.1	9.8	9.9	9.7	34.5	-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	9.8	9.6	9.2	38.2	14.6
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	6.9
A042700	한미반도체	9.6	9.4	9.4	9.7	38.1	2.4
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	-0.9
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.3	8.6
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.8	37.1	3.7
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.4	-3.5
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	-2.4
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.1	35.8	-0.8
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.9	35.3	-6.9

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 4/23일 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)