

Y U A N T A

# Quant Weekly Evaluation Report

6월 2주차 밸류에이션 무용론 스크리닝

# CONTENTS

## I 주간 스크리닝

밸류에이션 무용론 스크리닝

## 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

**밸류에이션 무용론 스크리닝 (참고자료: Quant Playbook 6월호 - 밸류에이션 무용론)**

- 1) 고물가 부담, 지정학적 리스크, 극단적 쏠림 등 펀더멘털 외적인 요인으로 인한 주가 급등락이 반복. 급등세가 나타난 종목은 단기 밸류에이션 부담이 가중되고 있는 한편, 극단적 쏠림으로 인해 견조한 펀더멘털 대비 소외된 업종의 저평가 매력 또한 부각되는 상황
- 2) 다만, 백 테스트 결과 단기적인 P/E의 급격한 변동과 무관하게 이익 모멘텀이 지속되고 있는 종목의 성과가 우수한 것으로 확인. 또한, 펀더멘털이 견조한 종목 중 3M 주가 모멘텀 상위 종목의 성과가 우수.
- 3) 주가 모멘텀은 단순한 수익률을 넘어 시장 내 인지도와 수급의 유입 가능성을 나타내는 신호. 3개월 내 한 차례 시장의 관심을 받아 매수 후보군에 편입되어 있는 종목 중 펀더멘털이 견조한 종목의 성과가 우수한 것으로 해석

**[6월 2주차] 12MF 순이익 월간 조정률, 3개월 주가 모멘텀 상위 30% 종목 중 1M/3M 평균 추정치 괴리 확대 종목 스크리닝**

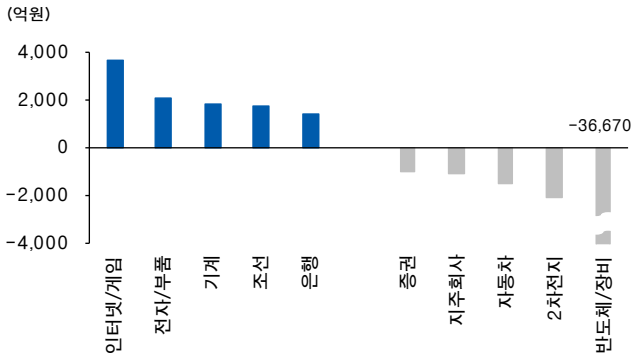
종목명	업종	시가총액 (억원)	1M 평균 12MF 순이익 추정치(억원, %)			1M/3M 평균 추정치 괴리(%)	3M 수익률 (%)
			5/11 기준	6/11 기준	조정률		
삼성전자	반도체	17,480,373	3,203,737	3,430,812	7.1	1.2	57.4
SK하이닉스	반도체	14,973,877	2,361,348	2,564,343	8.6	1.1	120.0
삼성전기	IT하드웨어	1,348,221	15,587	18,592	19.3	4.7	344.6
LG에너지솔루션	IT가전	899,730	13,642	14,819	8.6	1.2	4.1
삼성생명	보험	730,000	27,595	36,846	33.5	5.5	61.2
SK	에너지	416,891	189,334	232,125	22.6	7.5	59.9
LG이노텍	IT하드웨어	253,711	8,048	9,642	19.8	7.2	310.7
LG화학	화학	223,425	12,674	18,661	47.2	27.1	0.3
LG씨엔에스	소프트웨어	90,104	5,205	5,485	5.4	4.4	41.3
대덕전자	IT하드웨어	77,486	2,207	2,407	9.1	2.8	150.9
대한전선	기계	72,419	1,162	1,585	36.4	16.7	21.8
신세계	소매(유통)	67,439	3,703	4,756	28.5	0.8	108.8
롯데쇼핑	소매(유통)	57,143	3,662	4,166	13.8	1.5	105.7
OCI홀딩스	화학	52,930	3,336	3,642	9.2	4.8	93.3

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
주: 6/11일 기준

### 주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -5.5 조원 순매도, 기관은 약 -2.9 조원 순매도. 외국인은 약 9주 연속 순매도를 지속하고 있으며 기관은 약 3주간의 순매수 이후 이번주 순매도로 돌아선 모습 확인
- 기관과 외국인 모두 반도체/장비 업종이 순매도 상위 1위에 위치. 반도체/장비 업종은 지난 한 달간 외국인+기관 누적 약 -40.3 조원 순매도를 기록

#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

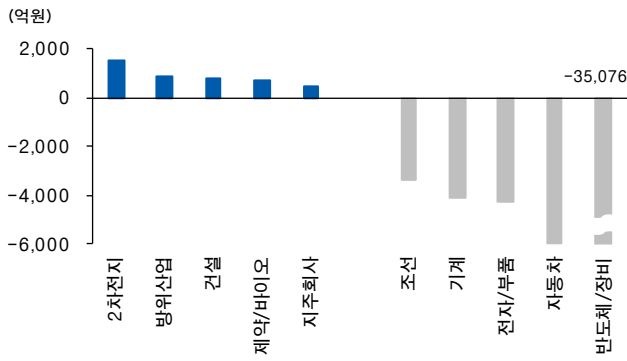


#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	3,637	7,437	1,932	
2	전자/부품	2,035	9,355	19,879	
3	기계	1,777	-11,968	2,402	
4	조선	1,735	2,447	11,557	
5	은행	1,382	2,966	12,945	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-36,670	80,658	158,351	
2	2차전지	-2,110	-5,478	12,401	
3	자동차	-1,516	2,591	3,084	
4	지주회사	-1,124	-5,777	-1,690	
5	증권	-1,073	-7,145	-6,283	

#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

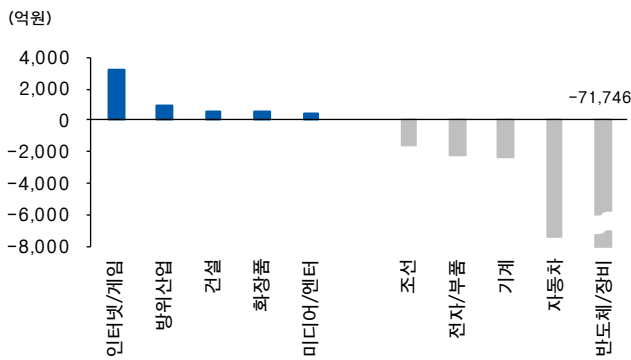


#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	2차전지	1,471	5,910	19,844	
2	방위산업	889	2,686	1,544	
3	건설	760	5,017	-9,141	
4	제약/바이오	693	1,874	-1,692	
5	지주회사	459	4,785	6,608	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-35,076	-483,985	-684,777	
2	자동차	-5,947	-29,049	-50,736	
3	전자/부품	-4,266	-55,386	-52,948	
4	기계	-4,127	-7,633	-12,808	
5	조선	-3,352	-12,390	-29,217	

#### 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	3,219	-3,247	-15,941	
2	방위산업	933	5,071	-346	
3	건설	583	2,166	-14,682	
4	화학품	511	-693	2,836	
5	미디어/엔터	497	1,060	-10,292	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-71,746	-403,327	-526,426	
2	자동차	-7,463	-26,458	-47,652	
3	기계	-2,349	-19,601	-10,406	
4	전자/부품	-2,231	-46,031	-33,069	
5	조선	-1,617	-9,943	-17,660	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 6/11일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A222800	심택	전자/부품	49,939	1,065	0.62
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	114,111	1,806	0.47
A267270	HD현대건설기계	기계	68,576	1,091	0.40
A069960	현대백화점	소매/유통	40,348	538	0.37
A007660	이수페타시스	전자/부품	90,440	1,170	0.35
A403870	HPSP	반도체/장비	45,265	491	0.28
A008770	호텔신라	호텔/레저	21,861	219	0.26
A443060	HD현대마린솔루션	조선	110,066	974	0.24
A081660	미스토홀딩스	섬유/의복	23,307	192	0.22
A035420	NAVER	인터넷/게임	351,397	3,413	0.22

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	22,422	486	0.54
A114090	GKL	호텔/레저	7,614	102	0.34
A001740	SK네트웍스	상사	23,409	295	0.28
A120110	코오롱인더	화학	21,531	202	0.25
A214450	파마리서치	의료기기	29,974	271	0.24
A128940	한미약품	제약/바이오	52,653	500	0.23
A403870	HPSP	반도체/장비	45,265	342	0.20
A183300	코미코	반도체/장비	14,561	86	0.19
A079550	LIG넥스원	방위산업	168,080	1,132	0.17
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	14,043	96	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	114,111	1,863	0.5
A403870	HPSP	반도체/장비	45,265	833	0.5
A222800	심택	전자/부품	49,939	362	0.2
A035420	NAVER	인터넷/게임	351,397	3,140	0.2
A000370	한화손해보험	손해보험	7,296	54	0.2
A041510	에스엠	미디어/엔터	20,330	119	0.2
A001740	SK네트웍스	상사	23,409	179	0.2
A034230	파라다이스	호텔/레저	13,672	79	0.1
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	57,143	288	0.1
A079550	LIG넥스원	방위산업	168,080	884	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A011070	LG이노텍	전자/부품	253,711	995.5	-12,492	-9,520
A035420	NAVER	인터넷/게임	351,397	3,139.8	-2,439	-12,171
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	114,111	1,863.3	-2,476	-1,422
A003550	LG	지주회사	165,788	435.0	-3,615	-3,118
A015760	한국전력	전기	230,465	223.3	-1,914	-7,014
A066970	엘앤에프	2차전지	51,034	8.7	-1,905	2,416
A007660	이수페타시스	전자/부품	90,440	274.7	-1,405	784
A011790	SKC	화학	69,438	59.1	-1,568	-2,106
A090430	아모레퍼시픽	화장품	65,395	109.7	-958	-2,208
A051910	LG화학	화학	223,425	51.3	-998	2,868

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 6/11일 기준

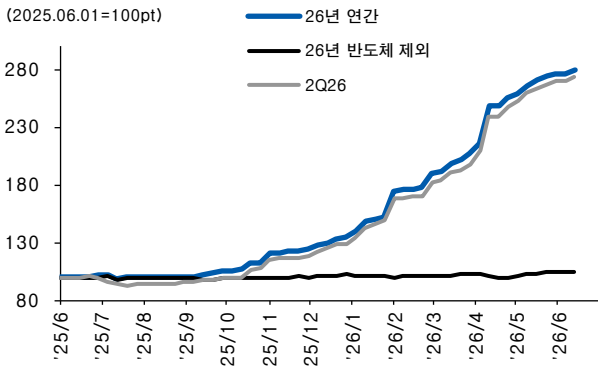
업종별

종목별

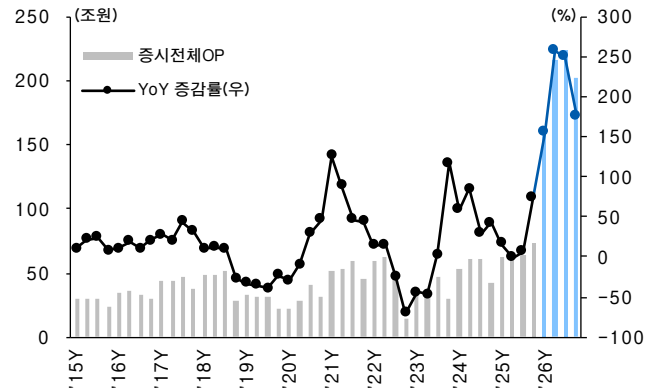
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간+1.3% 상향, 반도체 제외 '26년 연간+0.5% 상향 조정
- '26년 연간 영업이익 기준 비철금속(+4.8%), 2차전지(+4.0%), 전자재(+2.4%) 등의 업종은 주간 조정을 상위에 스크리닝. 특히, 2차전지 업종의 경우 2Q26 영업이익 추정치 기준 약 +30.5%의 주간 상향 조정을 기록

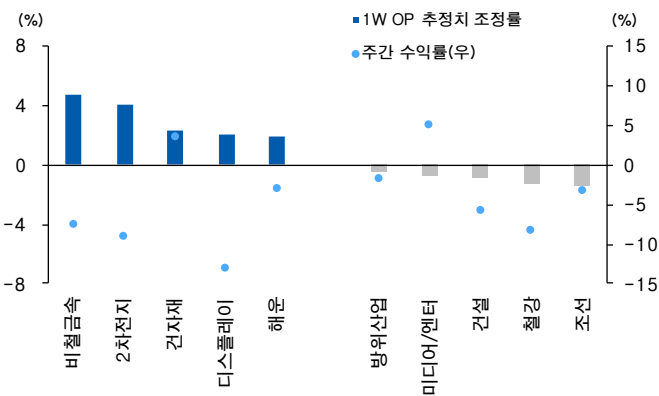
증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익의 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위

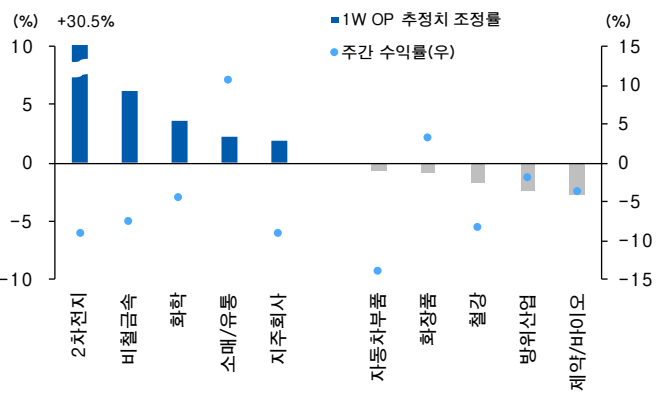


26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	28,371	4.8	-7.7	
2	2차전지	12,761	4.0	-9.1	
3	전자재	1,503	2.4	3.6	
4	디스플레이	11,919	2.0	-13.2	
5	해운	16,418	1.9	-3.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	조선	132,126	-1.4	-3.4	
2	철강	38,658	-1.3	-8.4	
3	건설	38,473	-0.8	-5.8	
4	미디어/엔터	16,461	-0.7	5.0	
5	방위산업	54,615	-0.5	-1.8	

26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위



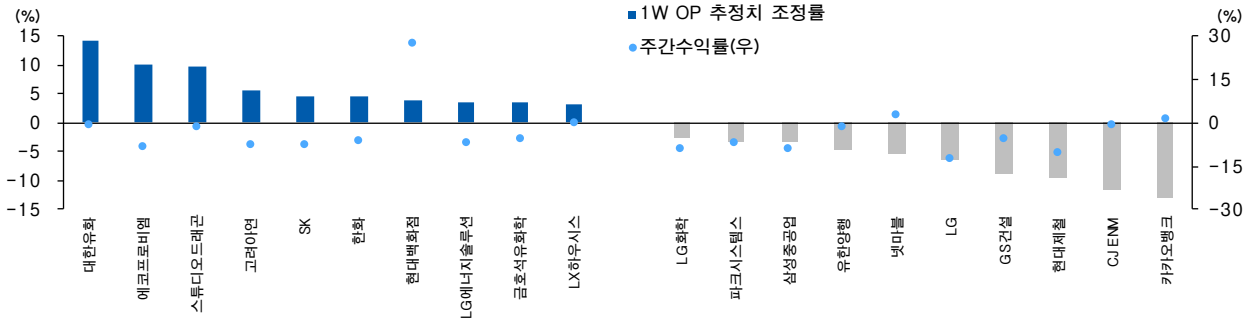
26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	2차전지	1,795	30.5	-9.1	
2	비철금속	6,574	6.2	-7.7	
3	화학	13,444	3.7	-4.4	
4	소매/유통	5,778	2.2	10.7	
5	지주회사	96,405	2.0	-9.2	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	제약/바이오	13,501	-2.8	-3.7	
2	방위산업	12,839	-2.3	-1.8	
3	철강	9,440	-1.6	-8.4	
4	화학품	6,149	-0.8	3.4	
5	자동차부품	18,590	-0.6	-14.0	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
주: 유니버스 200 종목 6/10일 추정치 기준(수익률 6/11일 기준)

'26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위

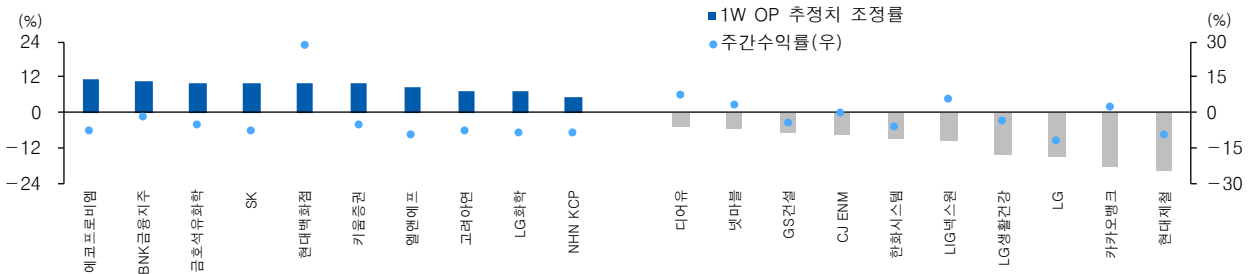


'26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006650	대한유화	화학	2,100	14.1	-1.0	1	A051910	LG화학	화학	16,753	-2.7	-9.3
2	A247540	에코프로비엠	2차전지	1,147	10.3	-8.8	2	A140860	파크시스템스	전자/부품	554	-3.2	-7.0
3	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	547	9.7	-1.2	3	A010140	삼성중공업	조선	14,453	-3.4	-8.8
4	A010130	고려이연	비철금속	24,430	5.6	-8.0	4	A000100	유한양행	제약/바이오	1,213	-4.8	-1.4
5	A034730	SK	지주회사	92,204	4.7	-8.0	5	A251270	넷마블	인터넷/게임	3,468	-5.3	2.5
6	A000880	한화	지주회사	57,012	4.6	-6.1	6	A003550	LG	지주회사	15,098	-6.6	-12.5
7	A069960	현대백화점	소매/유통	4,260	3.7	27.7	7	A006360	GS건설	건설	4,197	-9.0	-5.4
8	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	11,004	3.6	-7.1	8	A004020	현대제철	철강	4,180	-9.7	-10.4
9	A011780	금호석유화학	화학	3,918	3.5	-5.8	9	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	1,386	-11.8	-0.5
10	A108670	LX하우시스	건축재	1,150	3.1	-0.2	10	A323410	카카오뱅크	은행	6,189	-12.9	1.5

'26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

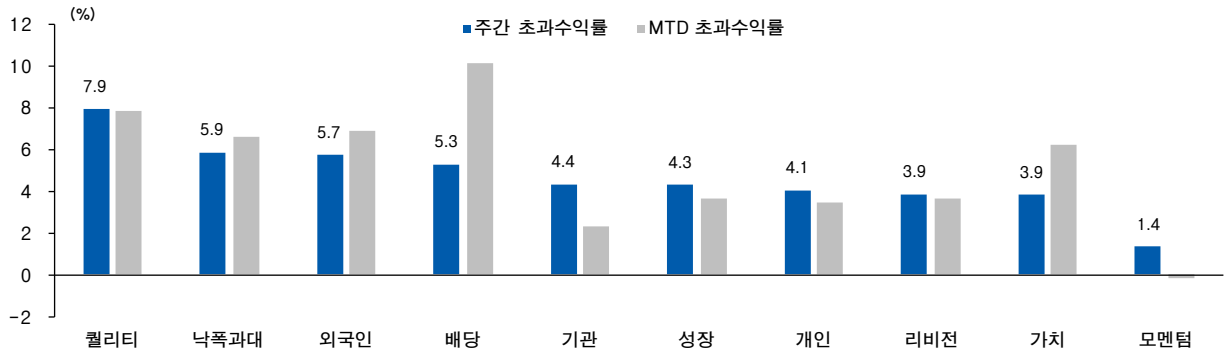
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A247540	에코프로비엠	2차전지	237	11.0	-8.8	1	A376300	디어유	미디어/엔터	99	-5.3	6.5
2	A138930	BNK금융지주	은행	3,525	10.5	-2.4	2	A251270	넷마블	인터넷/게임	942	-5.7	2.5
3	A011780	금호석유화학	화학	1,442	9.9	-5.8	3	A006360	GS건설	건설	1,202	-6.8	-5.4
4	A034730	SK	지주회사	22,806	9.8	-8.0	4	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	309	-7.7	-0.5
5	A069960	현대백화점	소매/유통	837	9.7	27.7	5	A272210	한화시스템	방위산업	491	-8.9	-6.3
6	A039490	키움증권	증권	5,906	9.7	-6.2	6	A079550	LIG넥스원	방위산업	955	-9.8	5.2
7	A066970	엘앤에프	2차전지	697	8.7	-10.1	7	A051900	LG생활건강	화장품	769	-14.8	-3.8
8	A010130	고려이연	비철금속	5,788	7.1	-8.0	8	A003550	LG	지주회사	3,517	-14.9	-12.5
9	A051910	LG화학	화학	5,414	6.9	-9.3	9	A323410	카카오뱅크	은행	1,500	-18.4	1.5
10	A060250	NHN KCP	SW/SI	168	5.0	-9.2	10	A004020	현대제철	철강	920	-20.0	-10.4

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 6/10일 추정치 기준(수익률 6/11일 기준)

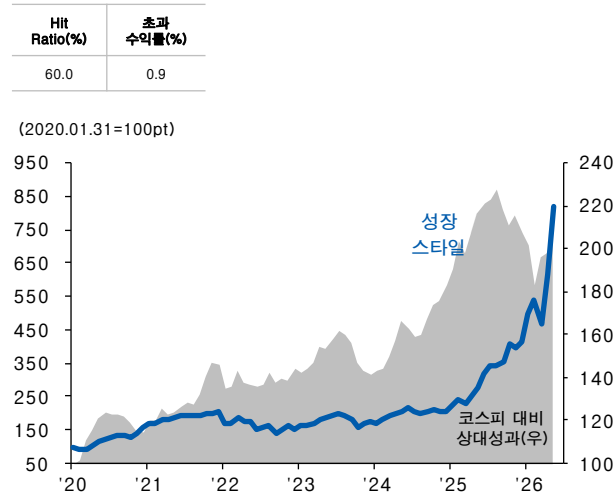
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

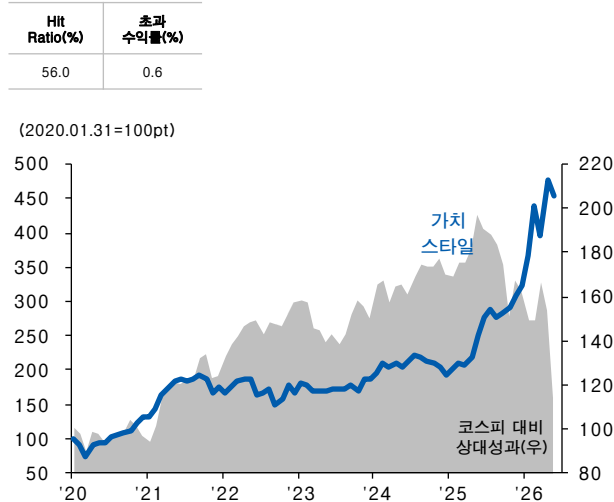


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.8	9.8	9.8	29.4	-9.1
A353200	대덕전자	9.1	9.6	9.5	28.2	-2.7
A267270	HD건설기계	9.0	9.3	9.4	27.7	2.9
A010130	고려아연	8.1	8.3	7.8	24.3	2.7
A298020	효성티앤씨	6.1	8.7	9.4	24.2	-9.6
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	5.5
A298040	효성중공업	7.8	8.1	7.7	23.6	-3.1
A010120	LS ELECTRIC	7.7	7.8	8.0	23.5	-7.6
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.9	5.8	23.4	1.4
A009150	삼성전기	6.8	8.3	7.7	22.8	-9.0

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

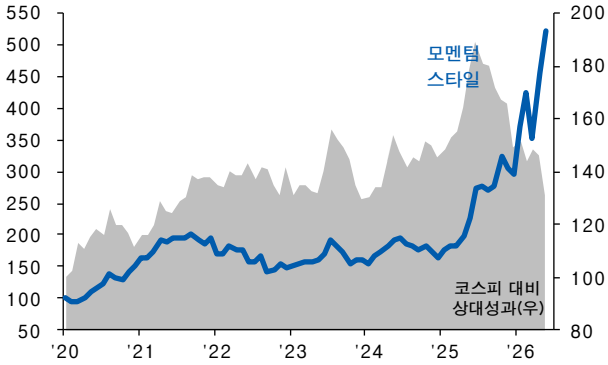
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A108670	LX하우시스	10.0	9.8	9.9	29.7	4.2
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	-1.9
A001450	현대해상	9.9	9.5	9.9	29.3	-0.2
A088350	한화생명	9.1	9.9	9.9	28.8	-0.7
A011170	롯데케미칼	10.0	9.6	9.1	28.7	5.6
A139130	iM금융지주	9.4	9.4	8.9	27.7	-4.1
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.6	27.6	3.5
A000120	CJ대한통운	8.5	9.4	9.5	27.4	-2.7
A097950	CJ제일제당	8.7	9.0	9.8	27.4	-2.6
A024110	기업은행	9.4	9.4	8.3	27.0	-5.8

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

(2020.01.31=100pt)



모멘텀 스코어 Top 10

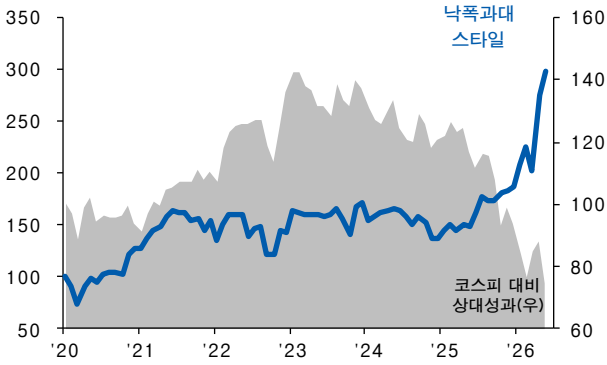
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A047040	대우건설	10.0	10.0	10.0	10.0	39.8	2.7
A009150	삼성전기	9.8	9.8	9.9	9.8	39.2	-7.6
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.9	9.8	9.7	39.1	2.9
A010120	LS ELECTRIC	9.7	9.8	9.8	9.7	38.9	1.5
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.9	9.9	8.8	38.4	16.9
A001440	대한전선	9.9	9.5	9.6	9.4	38.3	-15.1
A011070	LG이노텍	9.7	9.7	9.3	9.1	37.8	-25.4
A353200	대덕전자	8.6	9.2	9.7	9.9	37.4	-15.7
A006400	삼성SDI	9.4	9.3	9.0	8.9	36.6	-8.0
A006260	LS	9.5	9.6	8.9	8.6	36.6	29.4

낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.3	-0.3

(2020.01.31=100pt)



낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A253450	스튜디오드래곤	9.5	9.8	9.7	9.6	38.6	-1.2
A293490	카카오게임즈	9.0	9.9	9.8	9.3	38.0	-0.5
A122870	와이지엔터테인먼트	8.4	9.8	9.9	9.4	37.4	6.5
A067160	SOOP	9.1	9.4	9.2	9.8	37.4	5.0
A000100	유한양행	9.5	8.9	9.6	9.3	37.2	-5.2
A035760	CJ ENM	9.7	9.7	9.6	8.3	37.2	-4.1
A214450	파마리서치	7.3	10.0	10.0	9.0	36.2	7.1
A207940	삼성바이오로직스	9.4	9.0	9.4	8.2	36.0	19.4
A462870	시프트업	8.7	7.9	9.1	10.0	35.7	15.2
A352820	하이브	9.9	9.9	9.5	6.3	35.5	4.1

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

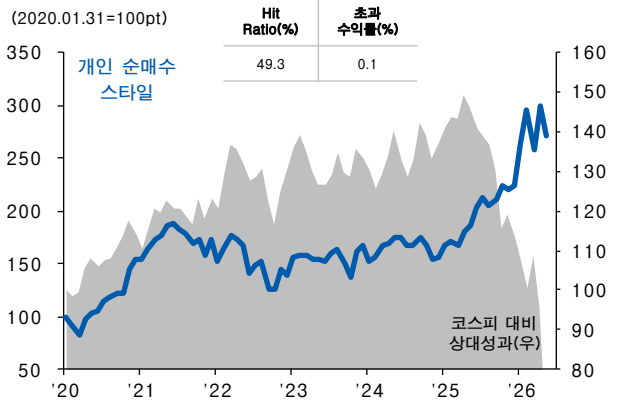
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

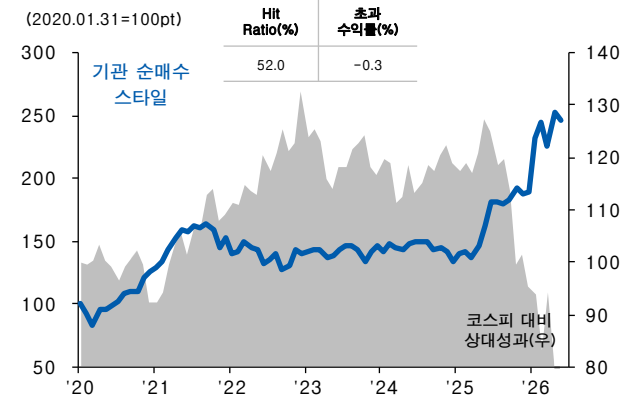


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A103140	풍산	9.3	10.0	9.8	9.9	38.9	-5.4
A214450	파마리서치	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	-5.8
A352820	하이브	10.0	9.8	9.7	9.3	38.8	-2.8
A035420	NAVER	9.4	9.9	9.6	9.9	38.7	-0.5
A006360	GS건설	9.9	9.7	9.4	9.2	38.1	4.1
A122870	와이엔터테인먼트	9.3	9.6	9.9	9.2	37.9	7.1
A204320	HL만도	8.9	8.9	9.9	10.0	37.6	16.9
A028050	삼성E&A	9.8	9.8	9.4	8.3	37.2	-1.6
A047810	한국항공우주	9.7	9.5	9.2	8.7	37.0	-5.7
A067160	SOOP	8.6	9.4	8.9	9.7	36.4	1.1

기관 순매수 스타일 성과 추이

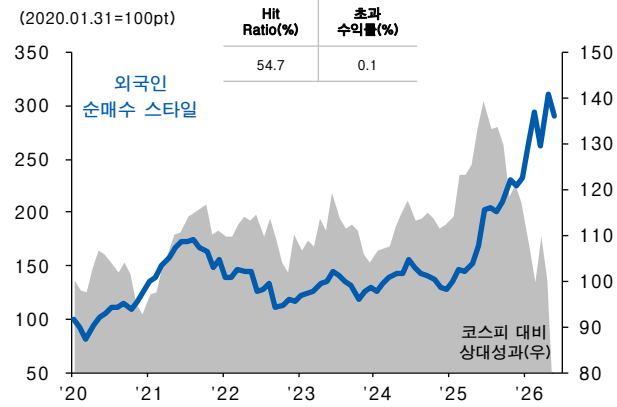


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A120110	코오롱인더	9.8	9.9	9.8	9.7	39.2	0.7
A021240	코웨이	9.5	9.6	9.2	9.6	37.9	16.8
A222800	심텍	9.9	9.5	9.2	9.3	37.9	8.2
A375500	DLI앤씨	10.0	9.8	9.3	8.8	37.8	-5.0
A066970	엘앤에프	9.2	9.7	9.6	8.9	37.4	29.4
A008770	호텔신라	9.9	9.3	8.9	9.4	37.4	3.1
A298020	효성티앤씨	8.9	9.3	9.7	9.5	37.3	2.4
A058470	리노공업	8.2	9.4	9.8	9.8	37.0	2.9
A023530	롯데쇼핑	8.8	9.6	9.5	9.0	36.8	-7.6
A112610	씨에스윈드	9.0	9.8	9.4	8.6	36.8	-15.7

외국인 순매수 스타일 성과 추이



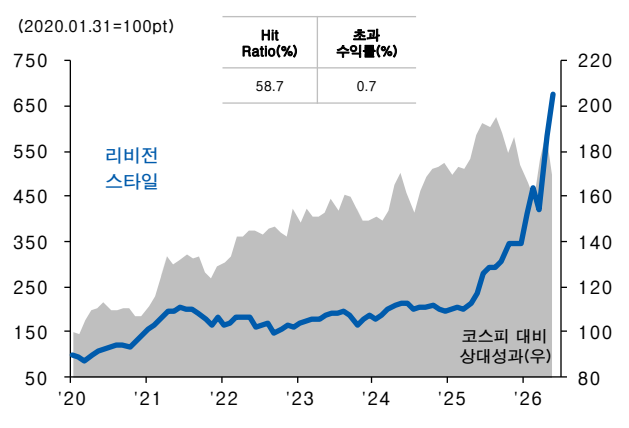
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A278470	에이피알	9.5	10.0	9.9	9.9	39.2	-7.5
A403870	HPSP	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	0.7
A195870	해성디에스	9.6	9.6	9.8	9.6	38.5	-5.8
A008770	호텔신라	10.0	9.9	9.4	8.9	38.1	7.3
A004170	신세계	8.8	9.8	9.7	9.5	37.7	0.3
A241710	코스메카코리아	9.5	9.2	9.4	9.5	37.5	-7.5
A014680	한솔케미칼	9.6	9.3	8.7	9.6	37.2	9.3
A001440	대한전선	9.9	9.7	8.6	8.7	36.9	-15.5
A336260	두산퓨얼셀	9.8	8.9	7.8	9.7	36.1	-1.1
A011780	금호석유화학	8.5	9.1	9.1	9.2	35.8	9.8

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

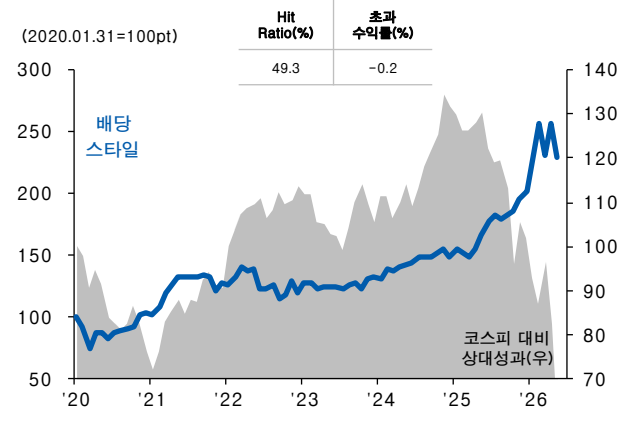


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.3	9.0	27.7	1.4
A010950	S-Oil	9.6	9.5	7.4	26.5	-8.0
A263750	풀어비스	9.2	9.1	7.6	25.9	9.1
A006650	대한유화	9.4	9.6	6.4	25.4	-7.6
A278470	에이피알	9.4	8.6	7.3	25.3	-9.3
A166090	하나머티리얼즈	9.3	8.7	6.2	24.1	-3.2
A078930	GS	8.5	9.1	6.2	23.9	-5.3
A036570	NC	8.7	8.3	6.6	23.6	-5.8
A016360	삼성증권	6.2	8.9	8.4	23.5	-3.1
A000660	SK하이닉스	7.8	7.9	7.7	23.4	29.4

배당 스타일 성과 추이

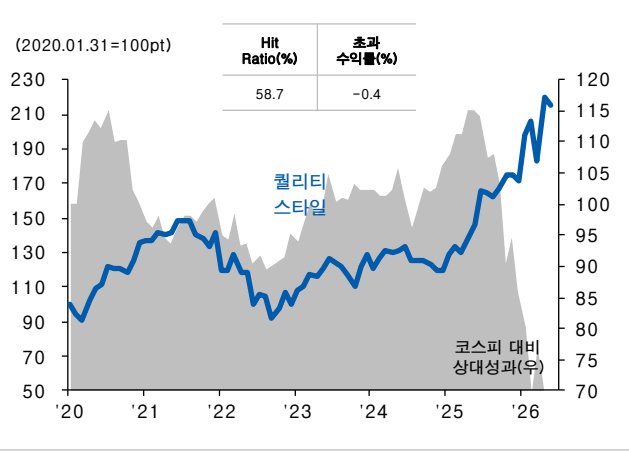


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.6	9.8	9.4	9.9	37.7	5.6
A214320	이노션	7.9	9.7	9.2	9.9	36.7	3.1
A005940	NH투자증권	7.5	9.5	9.8	9.7	36.6	-1.7
A035250	강원랜드	8.5	9.9	8.3	9.8	36.4	3.6
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.2	9.3	36.0	1.1
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.1	9.6	8.9	35.5	0.5
A017670	SK텔레콤	9.3	9.0	9.1	8.1	35.4	-6.0
A032640	LG유플러스	8.1	9.2	8.9	9.1	35.3	1.5
A000080	하이트진로	9.7	8.4	7.9	8.8	34.7	2.0
A016360	삼성증권	6.2	9.3	9.5	9.7	34.6	-3.4

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	9.3	38.2	9.3
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	6.1
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	1.5
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.4	2.8
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.5	36.9	9.3
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.5	0.5
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	-0.2
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.2	35.8	0.7
A207940	삼성바이오로직스	7.7	9.8	9.8	8.5	35.7	6.5
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.8	35.2	12.9

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/11일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

# Quant Weekly Evaluation Report

- 이 자료에 게재된 내용들은 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인함. (작성자:신현웅)
- 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 투자이사결정은 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.