

Y U A N T A

# Quant Weekly Evaluation Report

6월 3주차 KOSDAQ 프리미엄 예상 종목

# CONTENTS

## I 주간 스크리닝

KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목 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

## KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목 스크리닝

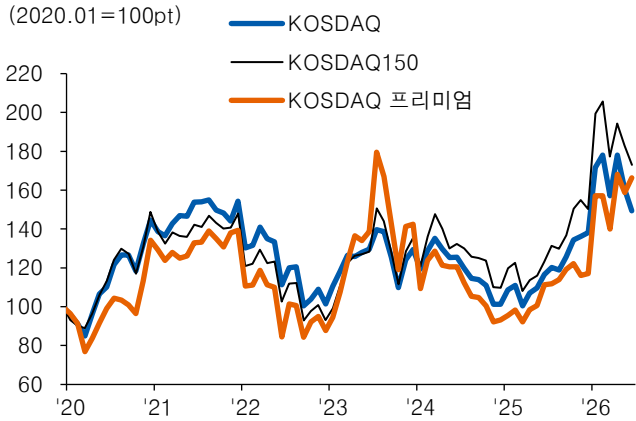
- 지난 6월 16일 한국거래소가 KOSDAQ 세그먼트 자문단을 구성하고 첫 회의를 개최하며 KOSDAQ 승강제 도입 논의는 정부 차원의 정책 구상 단계에서 거래소 중심의 실무 설계 및 의견수렴 단계로 진입. 프리미엄·스탠다드·관리군으로 구분되는 세그먼트 체계의 구체적인 편입 기준과 유지 요건, 연계 상품화 방안 등이 향후 핵심 논의 대상이 될 전망
- 한편, 최상위 세그먼트인 KOSDAQ 프리미엄의 구성종목 수가 80~170개 기업으로 제시되었으나 패시브 자금 유입 효과의 확대와 상품화 가능성을 고려해 구성 종목 수를 더욱 압축할 가능성 또한 제기. KOSDAQ150 지수와 차별화를 나타내기 위해 KOSDAQ 대표 종목을 넓게 포함하기보다, 유동성, 재무건전성 등의 기준을 통한 선별적 우량주 지수의 성격을 강화하는 것이 적합할 것으로 판단
- 최근 언론보도에 따르면 7월 1일 KOSDAQ 30주년 행사 전후로 세그먼트 세부 요건이 공개될 가능성이 제기되고 있으며, 이후 시장 의견수렴 절차를 거쳐 이르면 10월 중 시행 가능성 또한 언급
- 시장을 3개의 세그먼트로 분류하고 시가총액, 이익, 지배구조 등을 고려한다는 점에서 일본 TSE의 시장 세그먼트 개편 방식과 유사. 또한, TSE Prime Market의 경우 유동성, 거버넌스, 재무건전성 등을 기준으로 우량기업을 선별한다는 점에서 KOSDAQ 프리미엄 지수 구성의 취지와 방향성이 부합
- 다만, 일본의 경우 전체 상장 종목을 프라임·스탠다드·그로스 3개 시장으로 재분류한 사례인 반면 국내의 경우 KOSDAQ 시장 내부에 한정. 이에 따라 KOSDAQ 시장의 특성을 반영해 일부 기준을 완화하였으며, 유동성, 거버넌스, 재무건전성 등을 중심으로 각 기준별 상위 종목을 선별, 70개 종목의 프리미엄 세그먼트 후보군을 스크리닝
- KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목의 시가총액 규모는 약 2.1조원으로 KOSDAQ150(약 2.3조원) 대비 낮게 형성. 다만, 25년 연간 기준 매출액, 영업이익, 순이익은 모두 KOSDAQ150을 상회.
- KOSDAQ150의 업종별 시가총액 비중의 경우 반도체(28.5%)와 건강관리(28.2%)가 유사한 수준. KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목의 경우 반도체 비중이 약 50.0%로 확대되며 건강관리 업종의 경우 약 23.7% 수준으로 축소

### 일본 TSE Prime Market 요건 및 KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 요건

기준	일본 TSE Prime Market 기준		KOSDAQ 프리미엄 예상 요건	
	편입 요건	상장 유지 요건	편입 요건	금액 기준
유동성	주주 수 800명 이상	동일	유동시가총액 상위 25% (최근 회계연도 결산 기준)	약 1,800억원 이상
	유동주식수 200만 주 이상	동일		
	유동시가총액 100억엔 이상	동일		
	시가총액 250억엔 이상	일평균 거래대금 2,000만엔 이상	6개월 평균거래대금 상위 25%	약 60억원 이상
거버넌스	유동주식비율 35% 이상	유동주식비율 35% 이상	유동주식비율 35% 이상	-
재무건전성	최근 2개년도 순이익 25억엔 이상	-	최근 2개년도 흑자(순이익 기준)	-
	매출 100억엔, 시가총액 1,000억엔 이상	-	매출, 영업이익, 순이익 상위 25% (최근 회계연도 결산 기준)	매출, 1,800억원, 영업이익 100억원, 순이익 90억원 이상
	자기자본 50억엔 이상	0 이상	자본잠식률 50% 이하 (최근 회계연도 결산 기준)	-

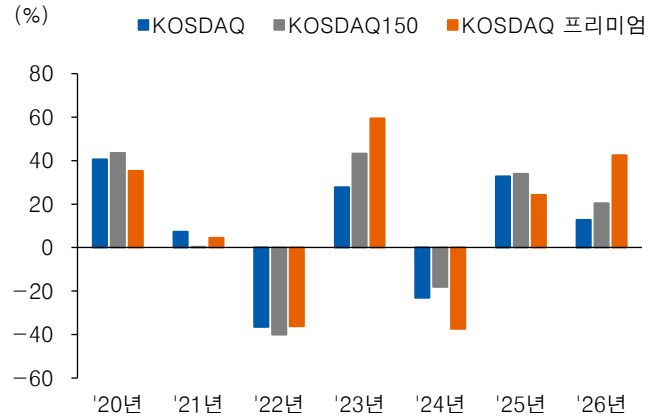
자료: JPX, 유안타증권 리서치센터

예상 KOSDAQ 프리미엄 지수 성과 추이



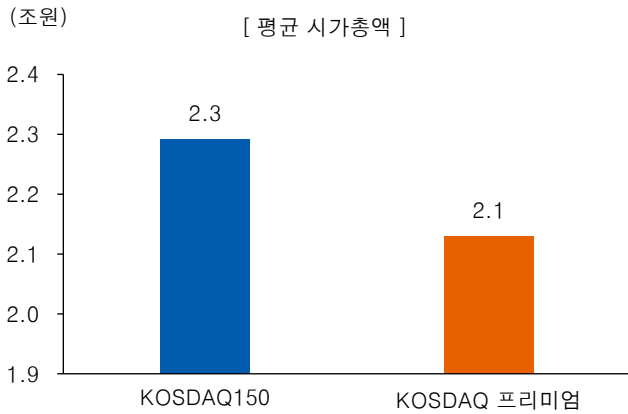
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주: 매년 3월말 전년도 결산 기준 리밸런싱

예상 KOSDAQ 프리미엄 지수 연간 수익률



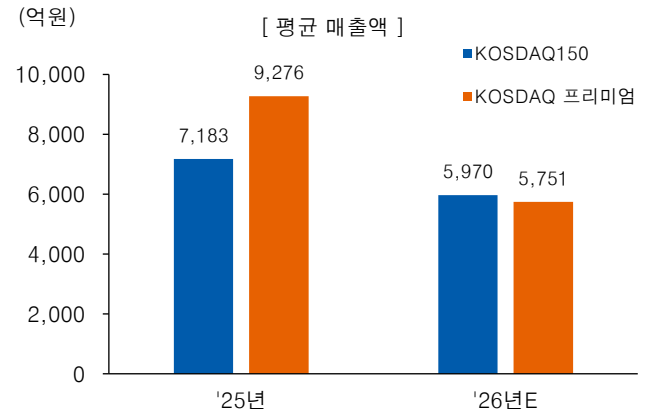
자료: FnGuide, 유안타증권 리서치센터

KOSDAQ150 vs KOSDAQ 프리미엄: 평균 시가총액



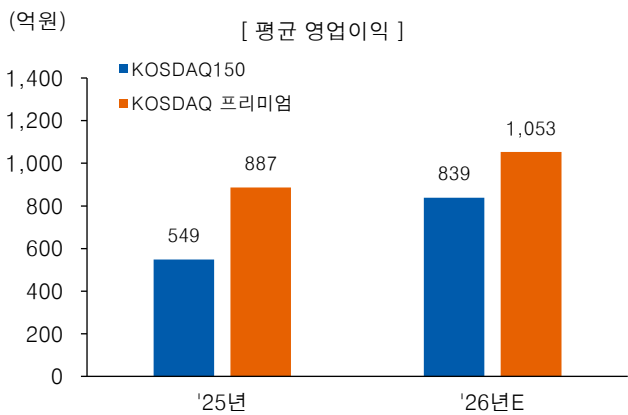
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

KOSDAQ150 vs KOSDAQ 프리미엄: 평균 매출액



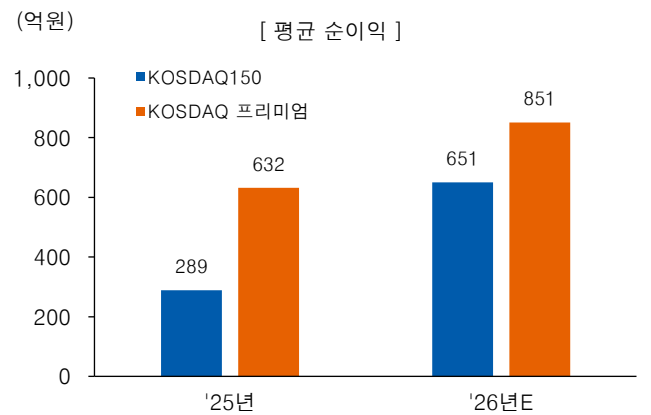
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

KOSDAQ150 vs KOSDAQ 프리미엄: 평균 영업이익



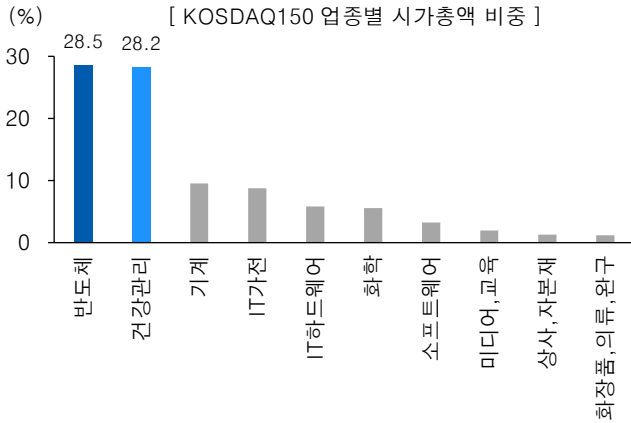
자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

KOSDAQ150 vs KOSDAQ 프리미엄: 평균 순이익

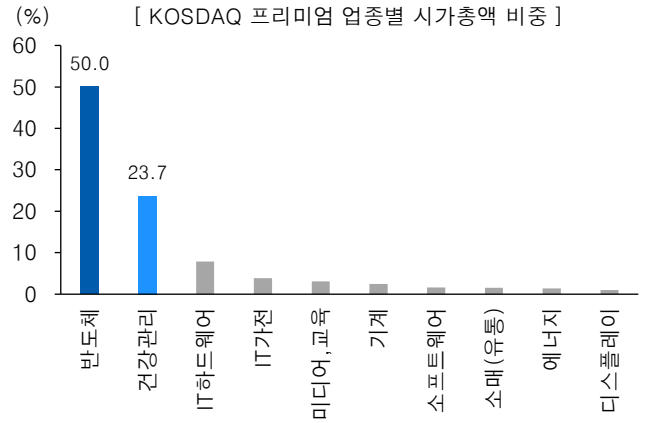


자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

KOSDAQ150의 경우 반도체, 건강관리의 비중이 50% 이상



예상 KOSDAQ 프리미엄은 반도체 업종 비중이 약 50%



자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

자료: FnGuide Quantwise, 유안타증권 리서치센터

KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목 (1)

종목명	업종	시가총액 (억원)	유동 시가총액 (억원)	유동 주식비율 (%)	6개월 평균 일간 거래대금 (억원)	매출액(억원)		영업이익(억원)		순이익(억원)	
						'24	'25	'24	'25	'24	'25
알테오젠	건강관리	199,877	159,162	79.6	2,347	1,029	2,159	254	1,069	623	1,417
주성엔지니어링	반도체	102,258	68,472	67.0	2,516	4,094	3,107	972	313	1,068	357
원익IPS	반도체	79,369	52,526	66.2	1,010	7,482	9,098	106	738	207	840
리노공업	반도체	72,173	53,487	74.1	1,092	2,782	3,725	1,242	1,770	1,133	1,520
이오테크닉스	반도체	62,583	43,107	68.9	594	3,209	3,809	312	808	428	572
피에스케이	반도체	47,042	31,542	67.1	397	3,981	4,572	839	885	791	785
ISC	반도체	41,271	21,098	51.1	574	1,745	2,202	448	601	547	561
유진테크	반도체	40,126	24,982	62.3	348	3,381	3,503	612	517	633	425
제주반도체	반도체	38,404	33,062	86.1	2,170	1,624	3,022	96	359	195	395
동진세미캠	반도체	32,876	21,422	65.2	480	11,128	11,941	1,754	1,724	1,548	991
테스	반도체	32,796	20,379	62.1	400	2,401	3,511	385	578	427	569
휴젤	건강관리	31,744	14,028	44.2	186	3,730	4,251	1,662	2,009	1,358	1,409
솔브레인	반도체	31,659	17,010	53.7	259	8,634	9,234	1,679	1,336	1,184	791
티씨케이	반도체	31,526	14,934	47.4	213	2,757	3,013	807	839	720	699
파마리서치	건강관리	31,377	20,407	65.0	502	3,501	5,363	1,261	2,144	920	1,651
클래시스	건강관리	30,171	12,147	40.3	222	2,429	3,368	1,224	1,706	979	1,319
티에스이	반도체	27,930	10,812	38.7	154	3,481	4,289	399	492	425	382
에스티팜	건강관리	27,753	17,243	62.1	271	2,738	3,317	277	549	347	550
고영	IT하드웨어	24,372	18,484	75.8	1,289	2,025	2,326	33	173	210	148
실리콘투	소매(유통)	22,984	12,968	56.4	336	6,915	11,163	1,376	2,054	1,207	1,686

자료: FnGuide Quantwise, 유안타 리서치센터

## KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목 (2)

종목명	업종	시가총액 (억원)	유동 시가총액 (억원)	유동 주식비율 (%)	6개월 평균 일간 거래대금 (억원)	매출액(억원)		영업이익(억원)		순이익(억원)	
						'24	'25	'24	'25	'24	'25
코미코	반도체	21,963	11,915	54.3	204	5,071	6,041	1,125	1,110	559	499
에스피지	IT가전	21,423	13,289	62.0	872	3,885	3,417	123	179	131	91
비에이치아이	에너지	20,949	14,218	67.9	520	4,047	7,741	219	755	196	652
RFHIC	IT하드웨어	20,712	12,872	62.2	427	1,149	1,858	15	309	257	287
JYP Ent.	미디어,교육	20,254	15,656	77.3	208	6,018	8,219	1,283	1,552	978	1,606
비츠로셀	IT가전	19,859	12,249	61.7	265	2,108	2,431	519	693	513	569
셀트리온제약	건강관리	19,781	8,826	44.6	85	4,778	5,364	372	561	220	388
에스엠	미디어,교육	18,819	10,962	58.3	169	9,897	11,749	873	1,830	183	3,472
대주전자재료	IT하드웨어	18,629	13,167	70.7	449	2,193	2,546	294	207	369	207
파크시스템스	IT하드웨어	17,821	11,842	66.5	136	1,751	2,056	385	422	428	345
에스에이엠티	IT하드웨어	15,749	7,501	47.6	129	28,895	37,566	674	1,139	544	758
하나머티리얼즈	반도체	14,240	7,577	53.2	164	2,516	2,735	434	501	318	384
에스앤에스텍	반도체	13,484	10,204	75.7	287	1,760	2,437	295	504	305	583
와이씨	반도체	12,799	6,085	47.5	221	2,112	2,726	106	170	110	193
셋트렉아이	상사,자본재	12,616	7,760	61.5	381	1,713	2,069	-31	102	79	153
하림지주	필수소비재	12,421	5,192	41.8	283	122,730	132,149	7,655	8,874	264	2,297
HK이노엔	건강관리	12,253	6,434	52.5	108	8,971	10,632	882	1,109	616	757
GST	반도체	10,763	7,926	73.6	181	3,334	3,472	586	592	454	453
원익QnC	반도체	10,581	6,283	59.4	149	8,915	9,436	906	596	508	225
피엔티	IT가전	10,140	8,319	82.0	128	10,350	7,449	1,640	956	1,420	743
덕산네오룩스	디스플레이	9,436	5,179	54.9	106	2,123	3,443	525	607	458	532
티엘비	반도체	9,046	7,650	69.8	218	1,800	2,585	34	260	36	190
성광밴드	기계	9,043	5,761	63.7	110	2,277	2,457	420	420	410	344
와이지엔터테인먼트	미디어,교육	9,028	6,498	72.0	146	3,649	5,454	-186	522	185	369
제룡전기	기계	8,963	5,993	66.9	241	2,627	2,240	978	670	799	587

자료: FnGuide Quantwise, 유안타 리서치센터

## KOSDAQ 프리미엄 예상 편입 종목 (3)

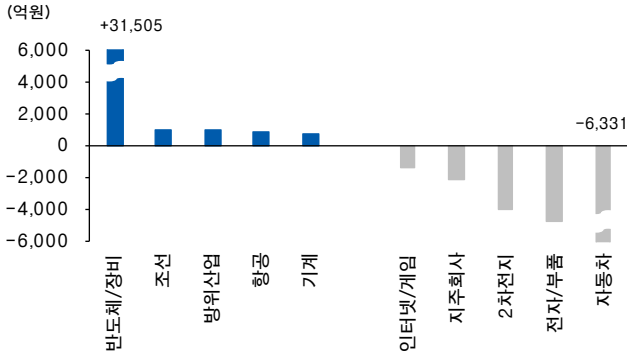
종목명	업종	시가총액 (억원)	유동 시가총액 (억원)	유동 주식비율 (%)	6개월 평균 일간 거래대금 (억원)	매출액(억원)		영업이익(억원)		순이익(억원)	
						'24	'25	'24	'25	'24	'25
동국제약	건강관리	8,910	4,960	55.7	113	8,122	9,269	804	966	612	660
태광	기계	8,769	4,669	53.3	142	2,668	2,970	399	387	449	639
아이티셀글로벌	소프트웨어	8,435	6,332	75.1	219	49,618	88,708	586	2,799	43	467
씨아이에스	IT가전	8,424	5,601	66.5	550	5,085	4,072	593	335	562	287
솔리드	IT하드웨어	7,795	6,864	88.1	935	3,311	2,948	351	333	461	364
이엔에프테크놀로지	반도체	7,644	4,932	64.5	76	5,824	6,709	593	781	311	519
와이지-원	기계	7,550	5,207	69.0	129	5,750	6,394	558	665	167	253
코스메카코리아	화장품, 의류, 완구	7,487	4,494	60.0	82	5,243	6,409	604	835	428	454
서부T&D	호텔, 레저서비스	7,324	3,562	48.6	137	1,809	2,483	481	703	344	791
코나아이	소프트웨어	7,034	4,114	58.5	92	2,363	3,092	334	889	303	746
미코	반도체	6,884	4,991	72.5	117	5,405	9,770	946	1,010	181	295
삼지전자	IT하드웨어	6,642	2,703	40.7	102	33,597	42,911	1,156	1,624	615	757
NHN KCP	소프트웨어	6,217	3,151	50.7	231	11,053	12,349	438	547	452	453
동성화인텍	화학	6,058	3,750	61.9	71	5,974	7,422	540	726	393	559
이녹스첨단소재	디스플레이	5,792	3,545	61.2	139	4,228	4,396	868	819	707	580
성우하이텍	자동차	5,696	3,139	55.1	108	42,451	43,827	2,059	2,427	1,401	1,688
현대힘스	조선	5,302	3,372	63.6	84	2,232	2,482	215	288	166	214
캠트로닉스	IT하드웨어	5,140	4,004	77.9	117	5,752	6,375	373	232	206	103
에스티아이	반도체	4,838	3,448	71.3	107	3,340	3,281	273	197	271	154
디케이티	IT하드웨어	4,640	2,296	49.5	109	4,034	4,258	231	216	269	232
한솔아이원스	반도체	4,382	2,636	60.2	72	1,571	1,988	231	333	311	284
지엔씨에너지	기계	4,005	2,593	64.7	83	2,263	2,626	317	494	385	399
한양디지텍	반도체	3,864	1,786	46.2	97	5,952	6,511	350	239	255	150
티이엠씨	반도체	3,676	2,374	64.6	274	3,102	2,797	197	248	129	160
헥토파이낸셜	소프트웨어	3,346	1,928	57.6	350	1,593	1,874	133	156	97	93

자료: FnGuide Quantwise, 유안타 리서치센터

### 주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +3.2 조원 순매수, 기관은 약 +8,513.3 억원 순매수. 외국인은 약 9주 연속 순매도 이후 이번주 순매수 전환
- 기관과 외국인 모두 반도체/장비, 조선 업종이 순매수 상위에 위치. 기관+외국인 합산 기준 반도체/장비 및 전자/부품 업종이 순매수 상위 1, 2위 기록

#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

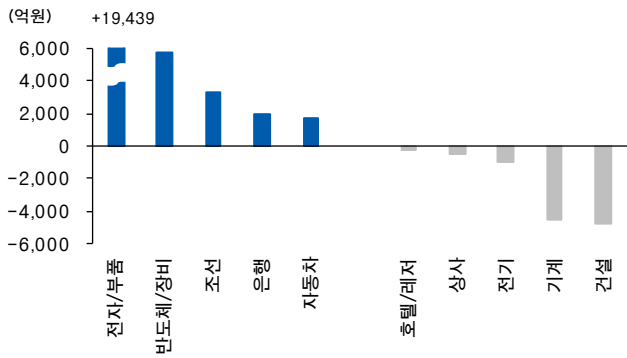


#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	31,505	122,900	194,110	■ ■ ■ ■ ■
2	조선	999	7,645	14,482	■ ■ ■ ■ ■
3	방위산업	975	2,130	-528	■ ■ ■ ■ ■
4	항공	875	1,105	70	■ ■ ■ ■ ■
5	기계	743	-3,699	3,480	■ ■ ■ ■ ■
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	자동차	-6,331	-5,279	-3,392	■ ■ ■ ■ ■
2	전자/부품	-4,782	-13,020	3,996	■ ■ ■ ■ ■
3	2차전지	-4,011	-2,830	8,378	■ ■ ■ ■ ■
4	지주회사	-2,136	-7,169	-6,328	■ ■ ■ ■ ■
5	인터넷/게임	-1,401	8,559	4,916	■ ■ ■ ■ ■

#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

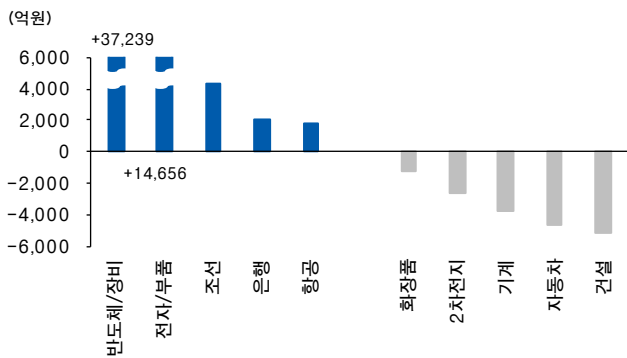


#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	19,439	-24,643	-32,288	■ ■ ■ ■ ■
2	반도체/장비	5,733	-274,896	-645,135	■ ■ ■ ■ ■
3	조선	3,280	-6,582	-26,464	■ ■ ■ ■ ■
4	은행	1,946	2,748	-9,136	■ ■ ■ ■ ■
5	자동차	1,709	-17,646	-39,293	■ ■ ■ ■ ■
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	건설	-4,778	-942	-13,875	■ ■ ■ ■ ■
2	기계	-4,502	-11,954	-20,833	■ ■ ■ ■ ■
3	전기	-1,019	-1,100	-3,916	■ ■ ■ ■ ■
4	상사	-460	544	1,692	■ ■ ■ ■ ■
5	호텔/레저	-279	-435	146	■ ■ ■ ■ ■

#### 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	37,239	-151,997	-451,025	■ ■ ■ ■ ■
2	전자/부품	14,656	-37,664	-28,291	■ ■ ■ ■ ■
3	조선	4,280	1,063	-11,982	■ ■ ■ ■ ■
4	은행	2,082	6,953	3,125	■ ■ ■ ■ ■
5	항공	1,865	3,110	3,036	■ ■ ■ ■ ■
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	건설	-5,112	-3,279	-19,972	■ ■ ■ ■ ■
2	자동차	-4,622	-22,925	-42,685	■ ■ ■ ■ ■
3	기계	-3,759	-15,653	-17,353	■ ■ ■ ■ ■
4	2차전지	-2,641	1,725	29,480	■ ■ ■ ■ ■
5	화학품	-1,220	-1,660	261	■ ■ ■ ■ ■

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 6/18일 기준

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A403870	HPSP	반도체/장비	48,886	3,041	1.36
A030000	제일기획	미디어/엔터	22,088	442	0.47
A204320	HL만도	자동차부품	32,307	479	0.35
A035250	강원랜드	호텔/레저	32,733	355	0.26
A003490	대한항공	항공	106,232	861	0.20
A067160	SOOP	미디어/엔터	5,500	44	0.20
A138930	BNK금융지주	은행	55,021	383	0.17
A006650	대한유화	화학	8,392	54	0.15
A175330	JB금융지주	은행	50,075	316	0.15
A039490	키움증권	증권	91,930	592	0.15

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A282330	BGF리테일	소매/유통	20,309	545	0.64
A009150	삼성전기	전자/부품	1,643,261	21,263	0.34
A018880	한온시스템	자동차부품	47,619	504	0.24
A003490	대한항공	항공	106,232	988	0.23
A204320	HL만도	자동차부품	32,307	305	0.22
A183300	코미코	반도체/장비	22,004	190	0.21
A003550	LG	지주회사	166,160	1,403	0.20
A195870	해성디에스	반도체/장비	13,498	102	0.18
A139130	iM금융지주	은행	27,788	198	0.17
A042660	한화오션	조선	383,323	2,539	0.16

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A204320	HL만도	자동차부품	32,307	784	0.6
A003490	대한항공	항공	106,232	1,849	0.4
A009150	삼성전기	전자/부품	1,643,261	17,322	0.3
A030000	제일기획	미디어/엔터	22,088	194	0.2
A018880	한온시스템	자동차부품	47,619	434	0.2
A079550	LIG넥스원	방위산업	194,480	1,506	0.2
A042660	한화오션	조선	383,323	2,800	0.2
A088350	한화생명	생명보험	47,248	271	0.1
A001450	현대해상	손해보험	33,886	176	0.1
A000370	한화손해보험	손해보험	8,020	41	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005930	삼성전자	반도체/장비	21,192,760	11,234.4	-99,099	-262,943
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	19,136,059	34,178.4	-48,494	-188,385
A010120	LS ELECTRIC	기계	363,000	180.2	-2,624	-18,620
A298040	효성중공업	기계	344,356	245.3	-1,986	-5,889
A018260	삼성에스디에스	SW/SI	171,005	28.3	-2,029	-5,186
A003550	LG	지주회사	166,160	117.5	-1,840	-3,098
A086280	현대글로비스	육운	159,000	17.5	-1,366	-3,838
A207940	삼성바이오로직스	제약/바이오	661,961	322.9	-412	-6,965
A014680	한솔케미칼	화학	32,763	50.4	-607	-1,555
A000880	한화	지주회사	85,244	109.5	-401	891

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 6/18일 기준

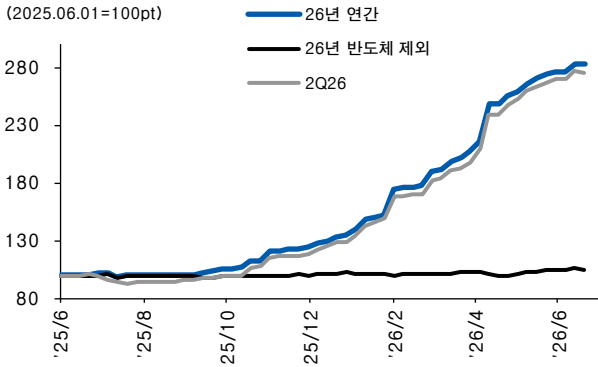
업종별

종목별

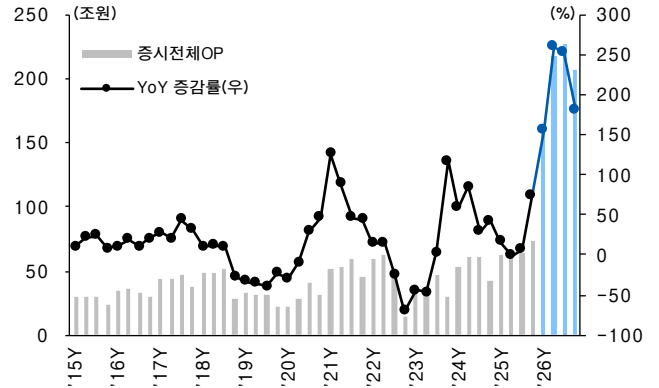
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.1% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.7% 하향 조정
- '26년 연간 영업이익 기준 전자/부품(+2.2%), 디스플레이(+1.8%), 손해보험(+1.5%) 등의 업종은 주간 조정을 상위에 스크리닝. 한편, 정유 업종의 경우 2Q26 영업이익 추정치 기준 약 +14.0%의 주간 상향 조정되며 2분기 실적 기대감 확대

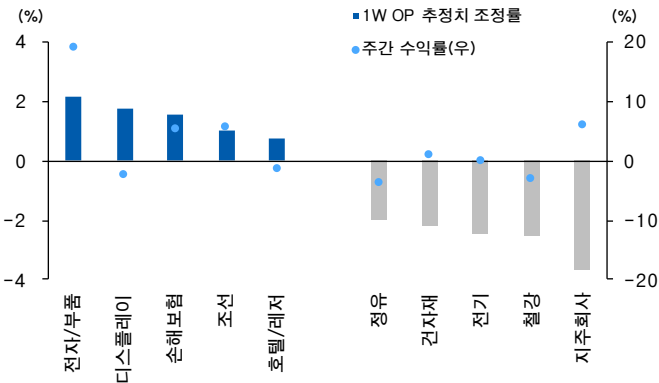
증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익의 및 증감을 추이



26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

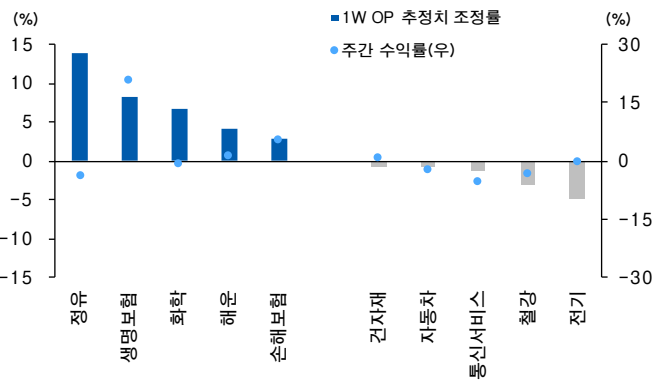


26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전자/부품	77,387	2.2	19.1	
2	디스플레이	11,833	1.8	-2.3	
3	손해보험	67,499	1.5	5.2	
4	조선	132,933	1.0	5.6	
5	호텔/레저	9,402	0.7	-1.5	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	지주회사	380,312	-3.7	6.0	
2	철강	37,687	-2.5	-3.2	
3	전기	97,271	-2.5	-0.1	
4	건자재	1,470	-2.2	1.1	
5	정유	82,649	-2.0	-3.8	

26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



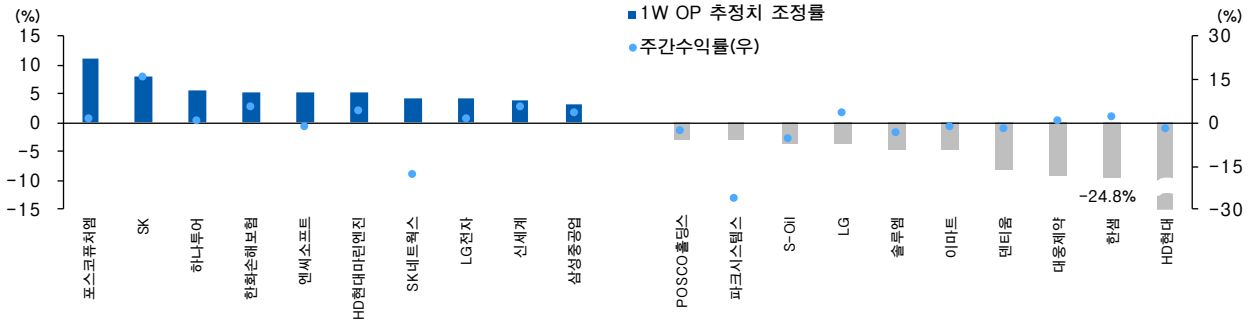
26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	정유	27,228	14.0	-3.8	
2	생명보험	13,258	8.3	21.0	
3	화학	15,134	6.8	-0.8	
4	해운	4,395	4.2	1.6	
5	손해보험	19,266	2.8	5.2	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	18,779	-4.9	-0.1	
2	철강	9,162	-2.9	-3.2	
3	통신서비스	14,289	-1.3	-5.3	
4	자동차	61,469	-0.8	-2.3	
5	건자재	400	-0.7	1.1	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주: 유니버스 200 종목 6/17일 추정치 기준(수익률 6/18일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

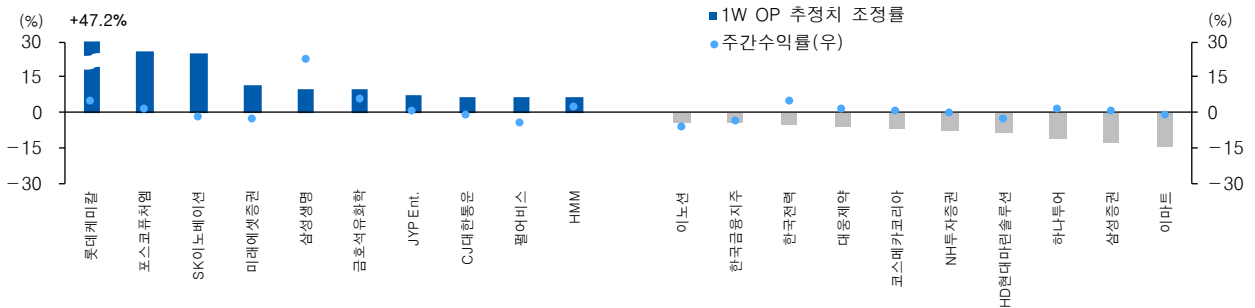


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	958	11.1	1.3	1	A267250	HD현대	지주회사	68,670	-24.8	-2.3
2	A034730	SK	지주회사	102,170	8.2	15.9	2	A009240	한샘	건자재	320	-9.5	2.0
3	A039130	하나투어	호텔/레저	600	5.5	0.8	3	A069620	대웅제약	제약/바이오	1,800	-9.2	0.8
4	A000370	한화손해보험	손해보험	5,296	5.4	5.7	4	A145720	덴티움	의료기기	792	-8.1	-2.4
5	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	5,322	5.3	-1.7	5	A139480	이마트	소매/유통	5,473	-4.8	-1.2
6	A071970	HD현대마린엔진	기계	1,574	5.2	4.2	6	A248070	솔루엠	전자/부품	860	-4.6	-3.5
7	A001740	SK네트웍스	상사	1,280	4.3	-17.8	7	A003550	LG	지주회사	14,893	-3.7	3.2
8	A066570	LG전자	전자/부품	41,300	4.2	1.3	8	A010950	S-Oil	정유	33,338	-3.7	-5.7
9	A004170	신세계	소매/유통	7,741	3.8	5.0	9	A140860	파크시스템스	전자/부품	537	-3.0	-26.7
10	A010140	삼성중공업	조선	14,724	3.3	3.0	10	A005490	POSCO홀딩스	철강	31,954	-3.0	-2.7

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

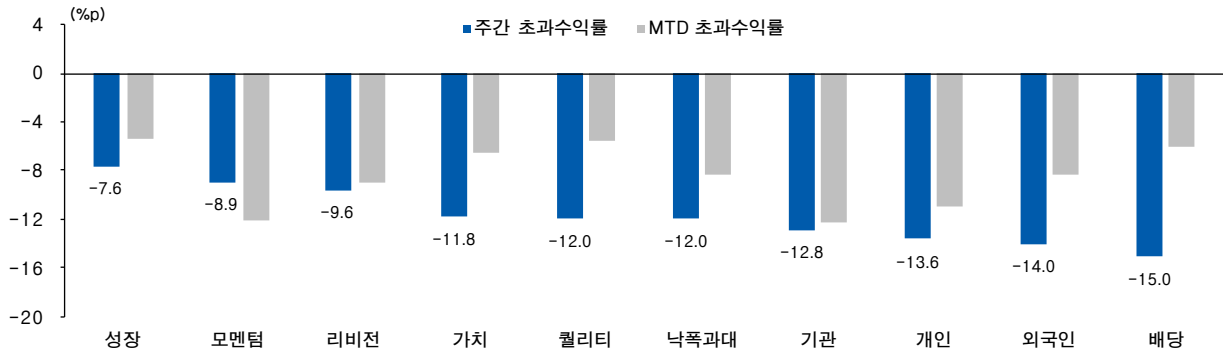
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A011170	롯데케미칼	화학	2,559	47.2	3.9	1	A139480	이마트	소매/유통	630	-14.9	-1.2
2	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	239	25.9	1.3	2	A016360	삼성증권	증권	6,047	-13.0	0.3
3	A096770	SK이노베이션	정유	16,501	24.5	-2.5	3	A039130	하나투어	호텔/레저	80	-11.1	0.8
4	A006800	미래에셋증권	증권	16,513	11.7	-3.1	4	A443060	HD현대마린솔루션	조선	976	-8.8	-3.4
5	A032830	삼성생명	생명보험	11,514	9.9	21.7	5	A005940	NH투자증권	증권	5,752	-7.8	-0.9
6	A011780	금호석유화학	화학	1,630	9.4	4.7	6	A241710	코스메카코리아	화장품	270	-6.9	0.3
7	A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	477	6.9	0.0	7	A069620	대웅제약	제약/바이오	461	-6.5	0.8
8	A000120	CJ대한통운	육운	1,215	6.7	-1.6	8	A015760	한국전력	전기	17,998	-5.2	4.5
9	A263750	필어비스	인터넷/게임	1,523	6.5	-5.2	9	A071050	한국금융지주	증권	8,699	-4.5	-4.2
10	A011200	HMM	해운	2,950	6.5	2.0	10	A214320	이노션	미디어/엔터	396	-4.4	-7.1

자료: 에프엔가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 6/17일 추정치 기준(수익률 6/18일 기준)

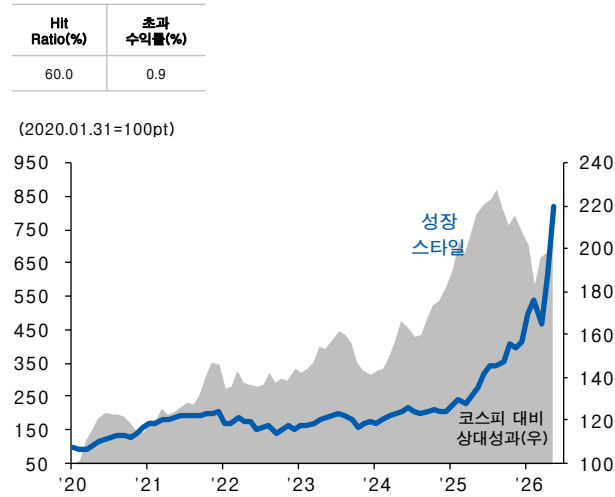
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

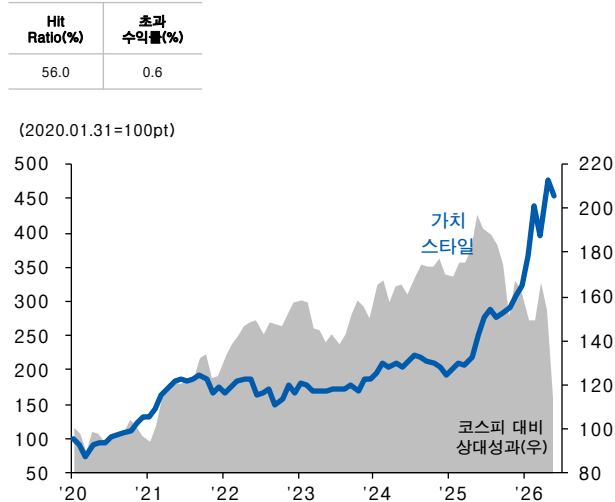


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.8	9.8	9.8	29.4	12.4
A353200	대덕전자	9.1	9.6	9.5	28.2	5.2
A267270	HD건설기계	9.0	9.3	9.4	27.7	1.5
A010130	고려아연	8.1	8.3	7.8	24.3	28.4
A298020	효성티앤씨	6.1	8.7	9.4	24.2	-2.3
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	-4.1
A298040	효성중공업	7.8	8.1	7.7	23.6	1.5
A010120	LS ELECTRIC	7.7	7.8	8.0	23.5	-1.7
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.9	5.8	23.4	-2.7
A009150	삼성전기	6.8	8.3	7.7	22.8	8.0

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

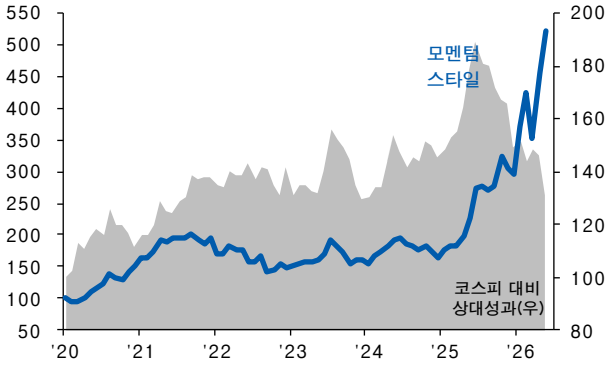
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A108670	LX하우시스	10.0	9.8	9.9	29.7	5.7
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	3.9
A001450	현대해상	9.9	9.5	9.9	29.3	-1.2
A088350	한화생명	9.1	9.9	9.9	28.8	9.5
A011170	롯데케미칼	10.0	9.6	9.1	28.7	1.3
A139130	iM금융지주	9.4	9.4	8.9	27.7	-0.5
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.6	27.6	-2.3
A000120	CJ대한통운	8.5	9.4	9.5	27.4	-2.9
A097950	CJ제일제당	8.7	9.0	9.8	27.4	-1.6
A024110	기업은행	9.4	9.4	8.3	27.0	4.5

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/18일 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

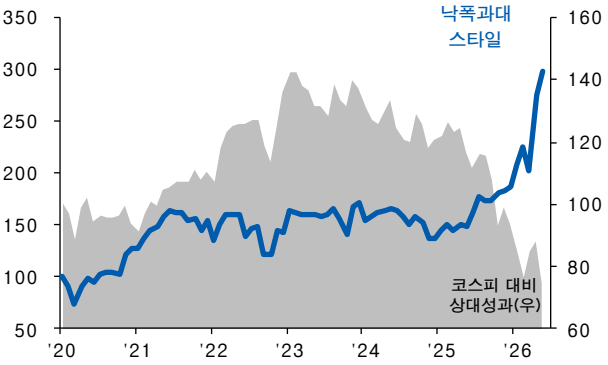
(단위: %)

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	28.4
A009150	삼성전기	9.8	9.8	9.9	9.8	39.2	23.8
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.9	9.8	9.7	39.1	1.5
A010120	LS ELECTRIC	9.7	9.8	9.8	9.7	38.9	24.9
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.9	9.9	8.8	38.4	-8.0
A001440	대한전선	9.9	9.5	9.6	9.4	38.3	-2.3
A011070	LG이노텍	9.7	9.7	9.3	9.1	37.8	1.3
A353200	대덕전자	8.6	9.2	9.7	9.9	37.4	-12.0
A006400	삼성SDI	9.4	9.3	9.0	8.9	36.6	15.9
A006260	LS	9.5	9.6	8.9	8.6	36.6	-2.0

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	-4.6
A293490	카카오게임즈	9.0	9.9	9.8	9.3	38.0	-3.5
A122870	와이지엔터테인먼트	8.4	9.8	9.9	9.4	37.4	-2.1
A067160	SOOP	9.1	9.4	9.2	9.8	37.4	2.0
A000100	유한양행	9.5	8.9	9.6	9.3	37.2	-0.3
A035760	CJ ENM	9.7	9.7	9.6	8.3	37.2	-0.5
A214450	파마리서치	7.3	10.0	10.0	9.0	36.2	1.5
A207940	삼성바이오로직스	9.4	9.0	9.4	8.2	36.0	-5.1
A462870	시프트업	8.7	7.9	9.1	10.0	35.7	-1.5
A352820	하이브	9.9	9.9	9.5	6.3	35.5	1.3

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/18일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

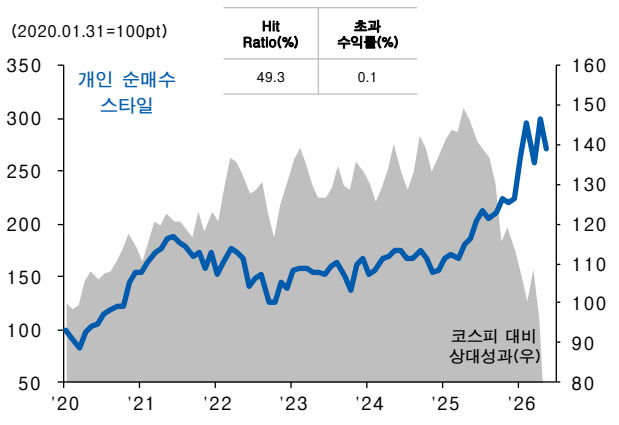
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

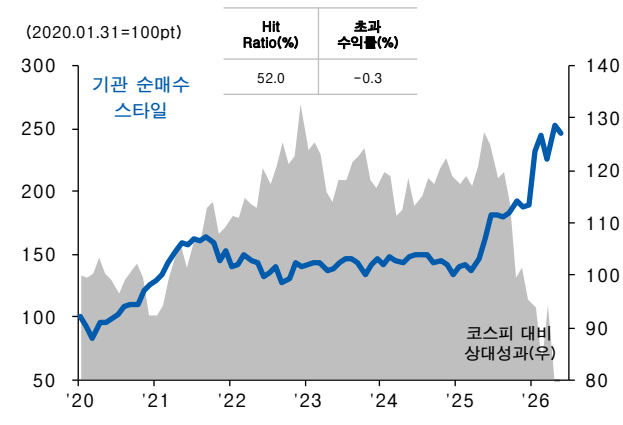


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	-3.8
A214450	파마리서치	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	4.4
A352820	하이브	10.0	9.8	9.7	9.3	38.8	0.8
A035420	NAVER	9.4	9.9	9.6	9.9	38.7	-3.5
A006360	GS건설	9.9	9.7	9.4	9.2	38.1	1.3
A122870	와이엔터테인먼트	9.3	9.6	9.9	9.2	37.9	1.5
A204320	HL만도	8.9	8.9	9.9	10.0	37.6	-8.0
A028050	삼성E&A	9.8	9.8	9.4	8.3	37.2	-10.5
A047810	한국항공우주	9.7	9.5	9.2	8.7	37.0	0.7
A067160	SOOP	8.6	9.4	8.9	9.7	36.4	8.8

기관 순매수 스타일 성과 추이

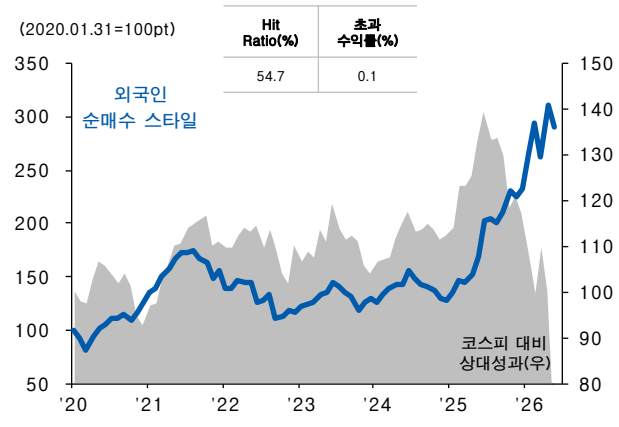


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	3.8
A021240	코웨이	9.5	9.6	9.2	9.6	37.9	-3.5
A222800	심텍	9.9	9.5	9.2	9.3	37.9	1.1
A375500	DLI앤씨	10.0	9.8	9.3	8.8	37.8	-9.5
A066970	엘앤에프	9.2	9.7	9.6	8.9	37.4	-2.0
A008770	호텔신라	9.9	9.3	8.9	9.4	37.4	-7.1
A298020	효성티앤씨	8.9	9.3	9.7	9.5	37.3	-3.5
A058470	리노공업	8.2	9.4	9.8	9.8	37.0	1.5
A023530	롯데쇼핑	8.8	9.6	9.5	9.0	36.8	-1.7
A112610	씨에스윈드	9.0	9.8	9.4	8.6	36.8	-12.0

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	10.0	9.9	9.9	39.2	7.5
A403870	HPSP	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	3.8
A195870	해성디에스	9.6	9.6	9.8	9.6	38.5	4.7
A008770	호텔신라	10.0	9.9	9.4	8.9	38.1	-5.6
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	4.4
A014680	한솔케미칼	9.6	9.3	8.7	9.6	37.2	-16.9
A001440	대한전선	9.9	9.7	8.6	8.7	36.9	-2.7
A336260	두산퓨얼셀	9.8	8.9	7.8	9.7	36.1	-9.1
A011780	금호석유화학	8.5	9.1	9.1	9.2	35.8	5.0

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/18일 기준, 세부기준 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

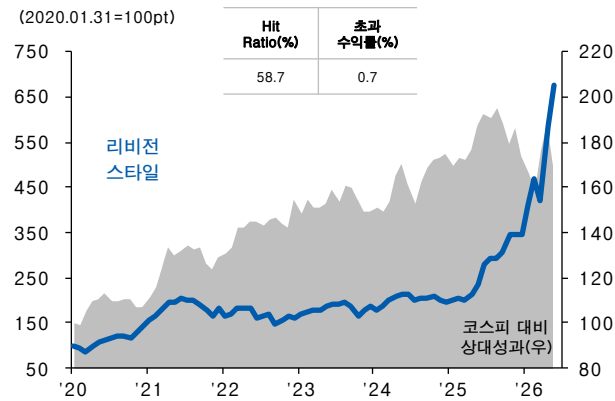
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

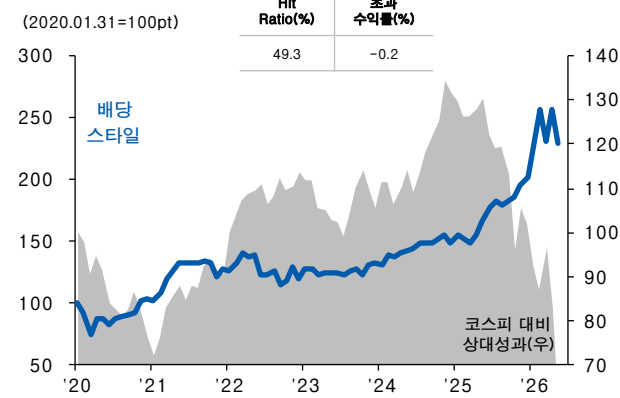


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.3	9.0	27.7	-2.7
A010950	S-Oil	9.6	9.5	7.4	26.5	15.9
A263750	풀어비스	9.2	9.1	7.6	25.9	-10.2
A006650	대한유화	9.4	9.6	6.4	25.4	-1.7
A278470	에이피알	9.4	8.6	7.3	25.3	-0.7
A166090	하나머티리얼즈	9.3	8.7	6.2	24.1	-1.7
A078930	GS	8.5	9.1	6.2	23.9	-9.6
A036570	NC	8.7	8.3	6.6	23.6	4.7
A016360	삼성증권	6.2	8.9	8.4	23.5	2.0
A000660	SK하이닉스	7.8	7.9	7.7	23.4	-2.0

배당 스타일 성과 추이

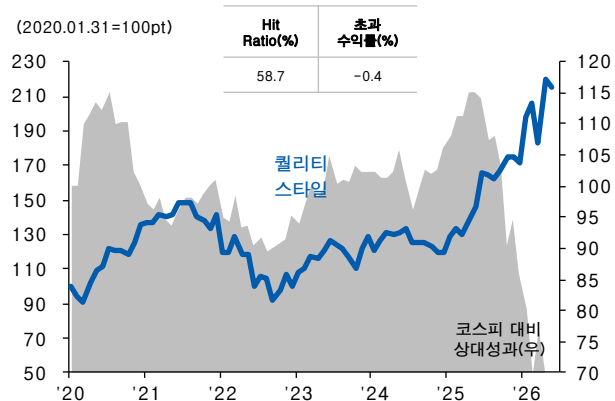


배당 스코어 Top 10

(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	-6.1
A214320	이노션	7.9	9.7	9.2	9.9	36.7	-7.1
A005940	NH투자증권	7.5	9.5	9.8	9.7	36.6	-0.9
A035250	강원랜드	8.5	9.9	8.3	9.8	36.4	-2.5
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.2	9.3	36.0	-5.1
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.1	9.6	8.9	35.5	-5.9
A017670	SK텔레콤	9.3	9.0	9.1	8.1	35.4	-6.9
A032640	LG유플러스	8.1	9.2	8.9	9.1	35.3	0.2
A000080	하이트진로	9.7	8.4	7.9	8.8	34.7	-4.3
A016360	삼성증권	6.2	9.3	9.5	9.7	34.6	1.3

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	-16.9
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	-11.7
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	24.9
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.4	-12.6
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.5	36.9	4.6
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.5	0.9
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	2.7
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.2	35.8	3.1
A207940	삼성바이오로직스	7.7	9.8	9.8	8.5	35.7	-2.1
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.8	35.2	-6.4

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 6/18일 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.