

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

6월 4주차 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 (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 건조한 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 건조한 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 건조한 종목의 성과가 우수한 것으로 해석

[6월 4주차] 12MF 순이익 월간 조정률, 3개월 주가 모멘텀 상위 30% 종목 중 1M/3M 평균 추정치 괴리 확대 종목 스크리닝

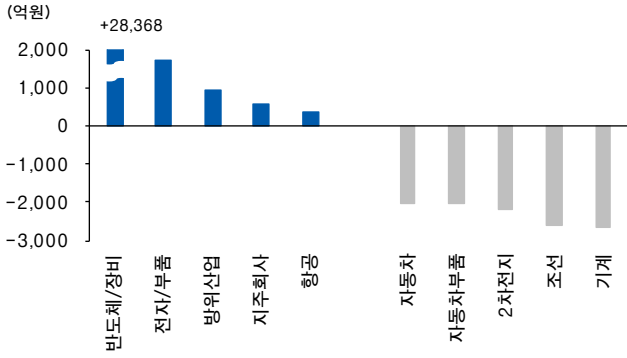
종목명	업종	시가총액 (억원)	1M 평균 12MF 순이익 추정치(억원, %)			1M/3M 평균 추정치 괴리(%)	3M 수익률 (%)
			5/24 기준	6/24 기준	조정률		
SK하이닉스	반도체	20,789,528	2,429,599	2,775,254	14.2	4.7	193.2
SK스퀘어	반도체	2,505,890	416,485	480,772	15.4	15.3	213.9
삼성전기	IT하드웨어	1,491,633	16,237	18,990	17.0	6.3	339.4
LS ELECTRIC	기계	328,500	5,857	6,296	7.5	5.4	29.7
LG전자	IT가전	330,656	26,689	41,520	55.6	65.2	77.0
효성중공업	기계	305,845	9,477	10,418	9.9	6.0	9.7
두산	상사,자본재	244,203	9,657	11,946	23.7	20.7	20.6
LG이노텍	IT하드웨어	225,548	8,212	9,886	20.4	8.1	204.5
LG화학	화학	201,541	12,674	18,661	47.2	34.7	-10.2
포스코퓨처엠	화학	151,386	488	650	33.4	19.9	-16.0
삼성에스디에스	소프트웨어	147,482	7,887	8,450	7.1	5.3	19.5
HD현대마린솔루션	조선	101,548	3,914	4,210	7.6	4.2	24.9
대한전선	기계	65,168	1,258	1,800	43.1	32.6	9.7
신세계	소매(유통)	69,989	4,636	5,175	11.6	4.8	119.9
롯데쇼핑	소매(유통)	48,261	4,070	4,533	11.4	6.6	53.3
한국가스공사	유틸리티	29,632	9,496	10,777	13.5	10.3	-10.8
HL만도	자동차	22,986	2,455	2,939	19.7	18.5	-6.6
현대백화점	소매(유통)	42,159	2,742	3,225	17.6	7.9	125.2
녹십자	건강관리	14,456	489	1,432	192.6	40.5	-17.0
해성디에스	반도체	11,883	815	915	12.3	6.8	15.9

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

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -9.9 조원 순매도, 기관은 약 +1.1 조원 순매수. 외국인은 지난주 약 9주만에 순매수 전환 이후 이번주 재차 순매도 전환.
- 기관과 외국인의 수급 방향성이 엇갈린 주간. 특히 반도체/장비 업종의 경우 기관은 약 +2.8 조원 순매수하였지만, 외국인은 약 -10.1 조원 순매도

기관 주간 순매수 상/하위 업종

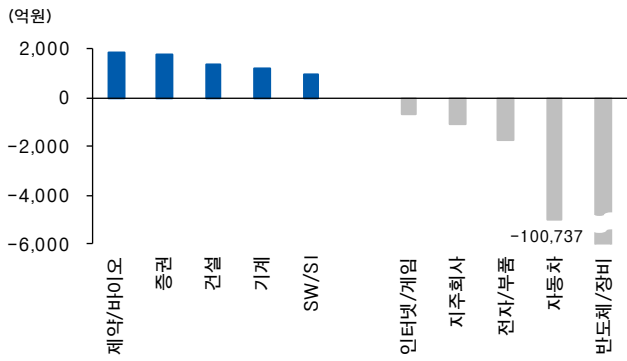


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	28,368	95,089	223,893	■ ■ ■ ■ ■
2	전자/부품	1,719	-15,229	3,415	■ ■ ■ ■ ■
3	방위산업	940	257	-1,808	■ ■ ■ ■ ■
4	지주회사	573	-7,317	-5,628	■ ■ ■ ■ ■
5	항공	366	1,288	601	■ ■ ■ ■ ■
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	기계	-2,645	-6,877	243	■ ■ ■ ■ ■
2	조선	-2,629	-141	11,658	■ ■ ■ ■ ■
3	2차전지	-2,207	-6,684	2,513	■ ■ ■ ■ ■
4	자동차부품	-2,024	2,626	6,121	■ ■ ■ ■ ■
5	자동차	-2,021	-9,589	-5,949	■ ■ ■ ■ ■

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

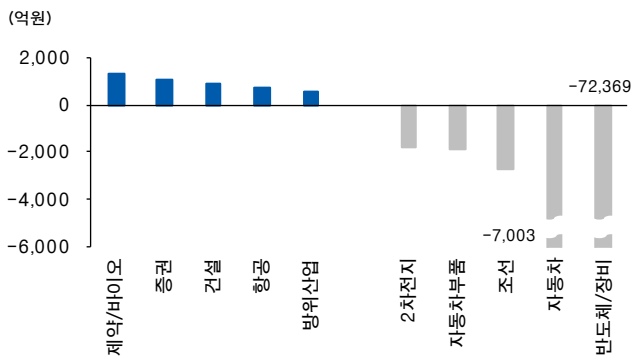


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	1,815	3,379	646	■ ■ ■ ■ ■
2	증권	1,783	4,256	-4,226	■ ■ ■ ■ ■
3	건설	1,332	871	-7,046	■ ■ ■ ■ ■
4	기계	1,192	-1,850	-12,607	■ ■ ■ ■ ■
5	SW/SI	936	-1,642	-4,603	■ ■ ■ ■ ■
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-100,737	-308,259	-652,239	■ ■ ■ ■ ■
2	자동차	-4,982	-16,855	-35,209	■ ■ ■ ■ ■
3	전자/부품	-1,772	-14,075	-29,143	■ ■ ■ ■ ■
4	지주회사	-1,121	5,775	10,337	■ ■ ■ ■ ■
5	인터넷/게임	-717	-7,253	-13,581	■ ■ ■ ■ ■

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	제약/바이오	1,288	193	-10,041	■ ■ ■ ■ ■
2	증권	1,022	-306	-12,345	■ ■ ■ ■ ■
3	건설	934	-1,747	-12,537	■ ■ ■ ■ ■
4	항공	691	3,627	4,195	■ ■ ■ ■ ■
5	방위산업	517	4,868	2,300	■ ■ ■ ■ ■
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-72,369	-213,171	-428,346	■ ■ ■ ■ ■
2	자동차	-7,003	-26,444	-41,157	■ ■ ■ ■ ■
3	조선	-2,740	-3,497	-9,804	■ ■ ■ ■ ■
4	자동차부품	-1,933	-11,236	-23,838	■ ■ ■ ■ ■
5	2차전지	-1,816	-845	22,038	■ ■ ■ ■ ■

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 6/25일 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

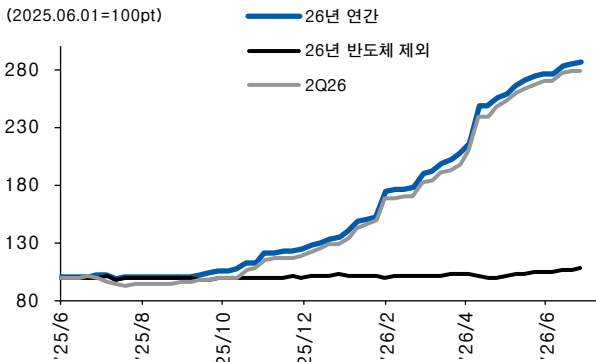
업종별

종목별

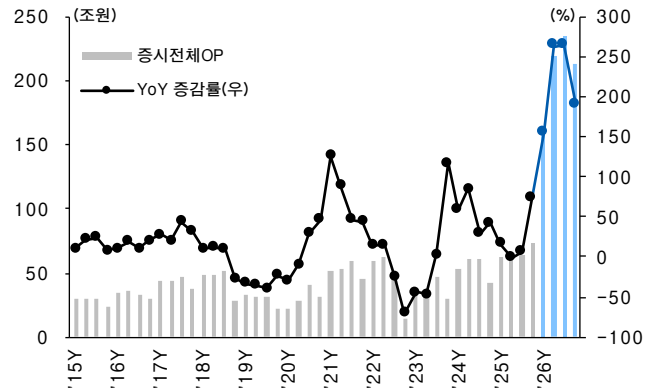
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.7% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 +1.0% 상향 조정
- '26년 연간 영업이익 기준 항공(+7.4%), 전자/부품(+5.5%), 해운(+2.4%) 등의 업종이 주간 조정률 상위에 스크리닝. 한편, 전자/부품 및 해운 업종의 경우 2Q26 영업이익 추정치 기준 각 +29.5%, +10.5%의 주간 상향 조정 확인되며 2분기 실적 기대감 확대

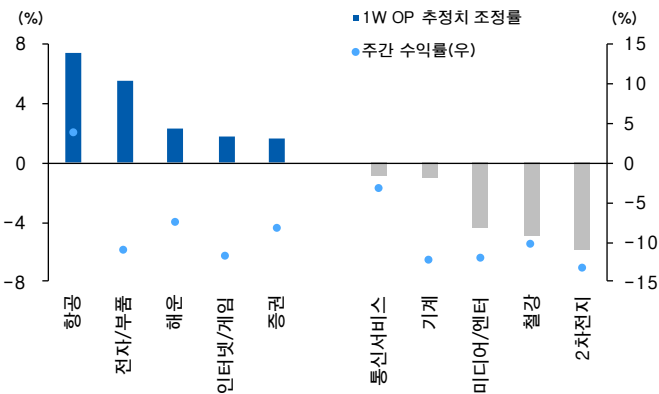
증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익의 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

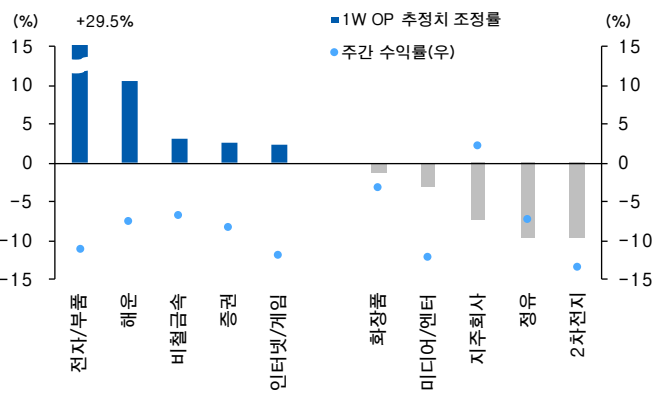


26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	항공	8,364	7.4	3.7	
2	전자/부품	81,664	5.5	-11.0	
3	해운	16,663	2.4	-7.6	
4	인터넷/게임	66,664	1.7	-12.0	
5	증권	146,397	1.6	-8.3	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	통신서비스	49,965	-0.8	-3.4	
2	기계	73,121	-1.0	-12.5	
3	미디어/엔터	15,746	-4.4	-12.2	
4	철강	35,028	-4.9	-10.3	
5	2차전지	12,353	-5.9	-13.5	

26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



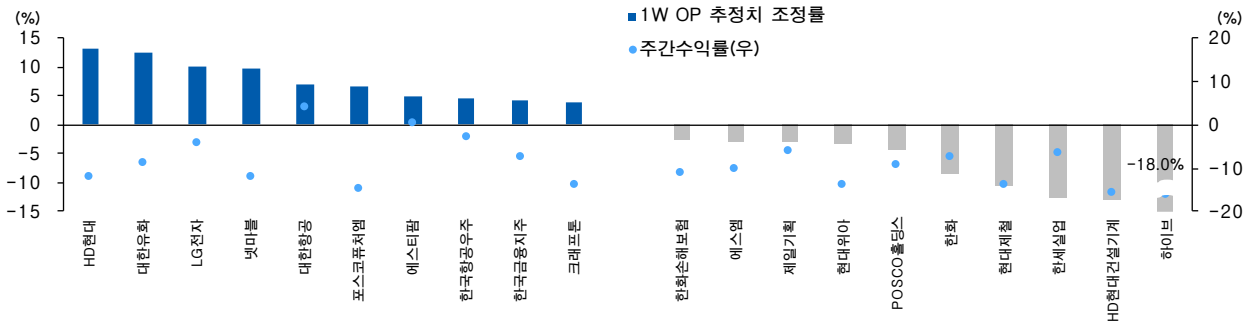
26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전자/부품	22,476	29.5	-11.0	
2	해운	4,830	10.5	-7.6	
3	비철금속	6,956	3.1	-6.9	
4	증권	44,040	2.6	-8.3	
5	인터넷/게임	16,599	2.4	-12.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학품	6,026	-1.3	-3.1	
2	미디어/엔터	4,566	-3.0	-12.2	
3	지주회사	115,427	-7.5	2.3	
4	정유	26,202	-9.6	-7.4	
5	2차전지	1,447	-9.7	-13.5	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주: 유니버스 200 종목 6/24일 추정치 기준(수익률 6/25일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

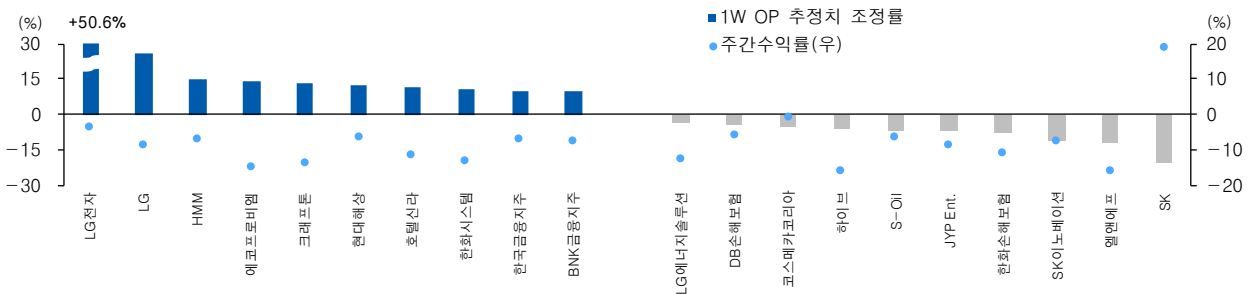


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A267250	HD현대	지주회사	77,830	13.3	-12.1	1	A352820	하이브	미디어/엔터	2,486	-18.0	-16.0
2	A006650	대한유화	화학	2,360	12.4	-8.8	2	A267270	HD현대건설기계	기계	6,185	-12.9	-15.7
3	A066570	LG전자	전자/부품	45,420	10.0	-4.0	3	A105630	한세실업	섬유/의복	873	-12.5	-6.5
4	A251270	넷마블	인터넷/게임	4,350	9.9	-11.9	4	A004020	현대제철	철강	3,730	-10.8	-14.0
5	A003490	대한항공	항공	8,734	7.1	4.1	5	A000880	한화	지주회사	52,340	-8.4	-7.3
6	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	980	6.5	-14.7	6	A005490	POSCO홀딩스	철강	29,745	-4.4	-9.4
7	A237690	에스티팜	제약/바이오	837	4.9	0.6	7	A011210	현대위아	자동차부품	2,160	-3.4	-13.7
8	A047810	한국항공우주	방위산업	4,751	4.7	-2.9	8	A030000	제일기획	미디어/엔터	3,279	-3.1	-6.1
9	A071050	한국금융지주	증권	35,281	4.1	-7.4	9	A041510	에스엠	미디어/엔터	2,022	-3.0	-10.3
10	A259960	크래프톤	인터넷/게임	15,370	3.9	-13.9	10	A000370	한화손해보험	손해보험	5,030	-2.5	-11.3

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

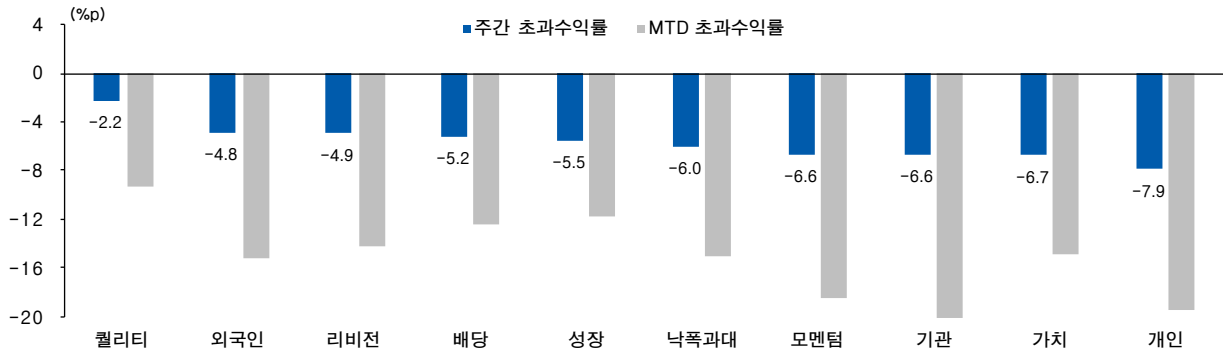
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A066570	LG전자	전자/부품	15,010	50.6	-4.0	1	A034730	SK	지주회사	40,345	-20.6	18.5
2	A003550	LG	지주회사	4,958	25.4	-8.7	2	A066970	엘앤에프	2차전지	599	-11.8	-16.2
3	A011200	HMM	해운	3,337	14.5	-7.4	3	A096770	SK이노베이션	정유	16,237	-11.1	-7.8
4	A247540	에코프로비엠	2차전지	270	13.9	-15.0	4	A000370	한화손해보험	손해보험	1,449	-8.3	-11.3
5	A259960	크래프톤	인터넷/게임	3,992	13.2	-13.9	5	A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	442	-7.2	-9.0
6	A001450	현대해상	손해보험	3,768	12.3	-6.5	6	A010950	S-Oil	정유	9,965	-7.1	-6.7
7	A008770	호텔신라	호텔/레저	600	11.4	-12.0	7	A352820	하이브	미디어/엔터	1,361	-6.2	-16.0
8	A272210	한화시스템	방위산업	552	10.2	-13.3	8	A241710	코스메카코리아	화장품	256	-5.2	-1.2
9	A071050	한국금융지주	증권	9,546	9.7	-7.4	9	A005830	DB손해보험	손해보험	6,129	-4.3	-6.1
10	A138930	BNK금융지주	은행	3,860	9.5	-8.1	10	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	1,779	-3.7	-13.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 6/24일 추정치 기준(수익률 6/25일 기준)

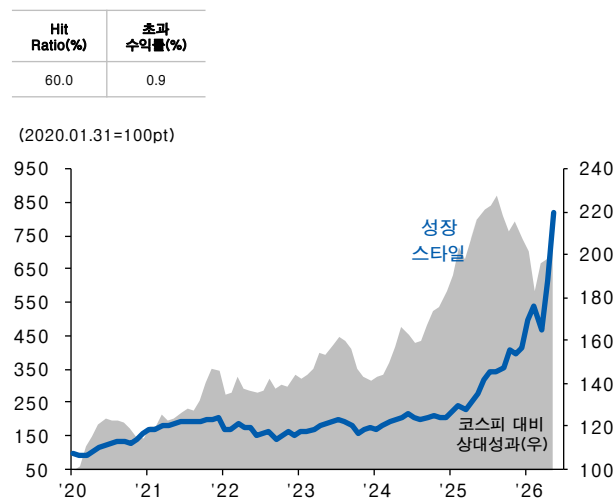
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



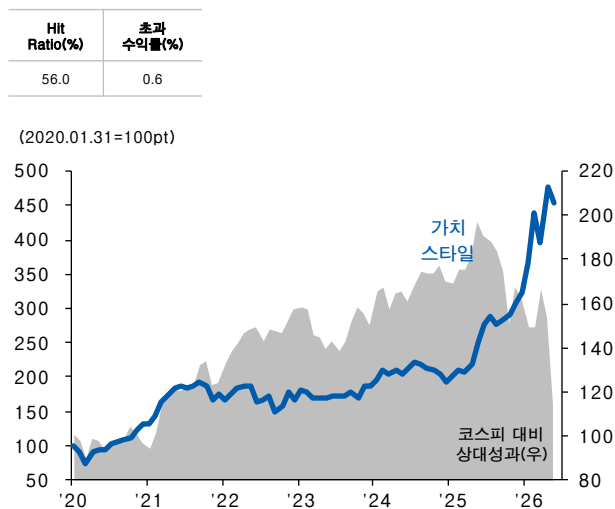
성장 스타일 성과 추이



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	1.3
A353200	대덕전자	9.1	9.6	9.5	28.2	-12.7
A267270	HD건설기계	9.0	9.3	9.4	27.7	-14.4
A010130	고려아연	8.1	8.3	7.8	24.3	-12.0
A298020	효성티앤씨	6.1	8.7	9.4	24.2	-12.1
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	-1.2
A298040	효성중공업	7.8	8.1	7.7	23.6	-15.7
A010120	LS ELECTRIC	7.7	7.8	8.0	23.5	-15.3
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.9	5.8	23.4	-5.6
A009150	삼성전기	6.8	8.3	7.7	22.8	-12.3

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10 (단위: %)

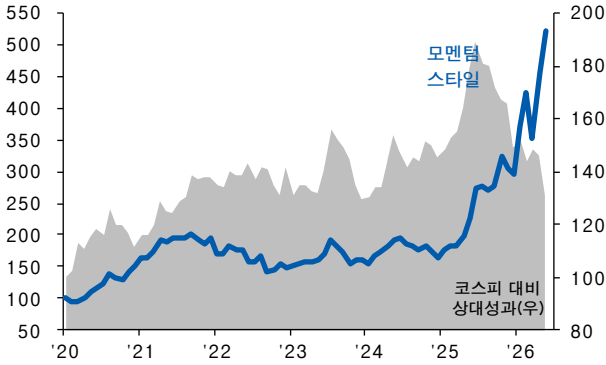
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A108670	LX하우시스	10.0	9.8	9.9	29.7	-11.3
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	-12.1
A001450	현대해상	9.9	9.5	9.9	29.3	-8.1
A088350	한화생명	9.1	9.9	9.9	28.8	-10.2
A011170	롯데케미칼	10.0	9.6	9.1	28.7	-6.5
A139130	iM금융지주	9.4	9.4	8.9	27.7	-6.5
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.6	27.6	-6.3
A000120	CJ대한통운	8.5	9.4	9.5	27.4	-7.1
A097950	CJ제일제당	8.7	9.0	9.8	27.4	-7.7
A024110	기업은행	9.4	9.4	8.3	27.0	2.4

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 6/25일 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

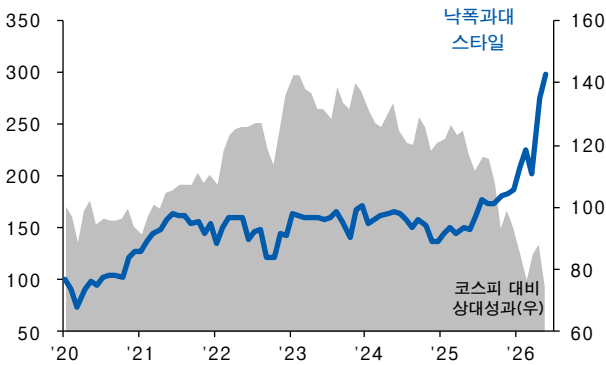
(단위: %)

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	-12.0
A009150	삼성전기	9.8	9.8	9.9	9.8	39.2	-16.8
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.9	9.8	9.7	39.1	-14.4
A010120	LS ELECTRIC	9.7	9.8	9.8	9.7	38.9	5.5
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.9	9.9	8.8	38.4	-13.6
A001440	대한전선	9.9	9.5	9.6	9.4	38.3	-17.5
A011070	LG이노텍	9.7	9.7	9.3	9.1	37.8	-4.0
A353200	대덕전자	8.6	9.2	9.7	9.9	37.4	-11.4
A006400	삼성SDI	9.4	9.3	9.0	8.9	36.6	18.5
A006260	LS	9.5	9.6	8.9	8.6	36.6	1.5

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	-12.8
A293490	카카오게임즈	9.0	9.9	9.8	9.3	38.0	-12.7
A122870	와이지엔터테인먼트	8.4	9.8	9.9	9.4	37.4	-11.6
A067160	SOOP	9.1	9.4	9.2	9.8	37.4	-2.6
A000100	유한양행	9.5	8.9	9.6	9.3	37.2	-13.2
A035760	CJ ENM	9.7	9.7	9.6	8.3	37.2	-6.5
A214450	파마리서치	7.3	10.0	10.0	9.0	36.2	-9.8
A207940	삼성바이오로직스	9.4	9.0	9.4	8.2	36.0	-10.3
A462870	시프트업	8.7	7.9	9.1	10.0	35.7	-18.2
A352820	하이브	9.9	9.9	9.5	6.3	35.5	-16.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 6/25일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

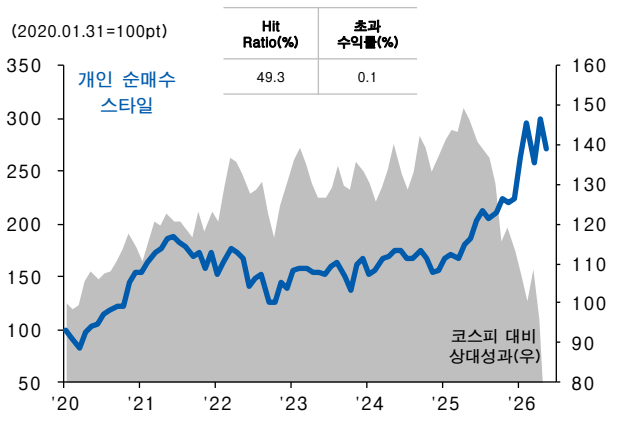
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

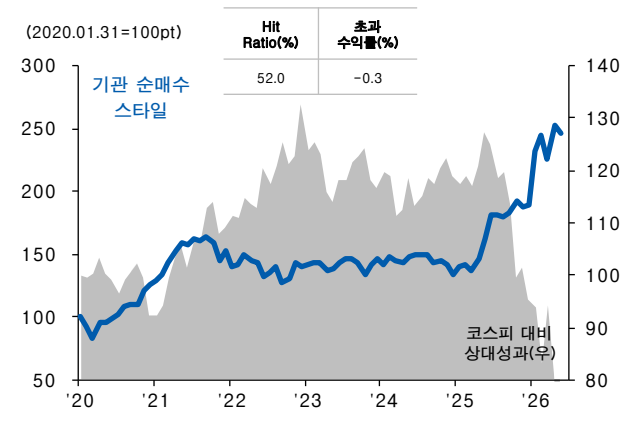


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	-8.5
A214450	파마리서치	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	-11.2
A352820	하이브	10.0	9.8	9.7	9.3	38.8	-7.3
A035420	NAVER	9.4	9.9	9.6	9.9	38.7	-12.7
A006360	GS건설	9.9	9.7	9.4	9.2	38.1	-16.0
A122870	와이엔터테인먼트	9.3	9.6	9.9	9.2	37.9	-9.8
A204320	HL만도	8.9	8.9	9.9	10.0	37.6	-13.6
A028050	삼성E&A	9.8	9.8	9.4	8.3	37.2	-8.9
A047810	한국항공우주	9.7	9.5	9.2	8.7	37.0	-0.5
A067160	SOOP	8.6	9.4	8.9	9.7	36.4	-15.4

기관 순매수 스타일 성과 추이

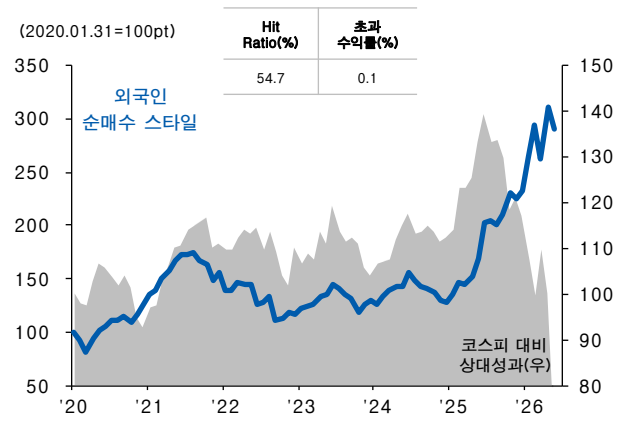


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-12.0
A021240	코웨이	9.5	9.6	9.2	9.6	37.9	-5.2
A222800	심텍	9.9	9.5	9.2	9.3	37.9	-4.6
A375500	DLI앤씨	10.0	9.8	9.3	8.8	37.8	-17.7
A066970	엘앤에프	9.2	9.7	9.6	8.9	37.4	1.5
A008770	호텔신라	9.9	9.3	8.9	9.4	37.4	-5.5
A298020	효성티앤씨	8.9	9.3	9.7	9.5	37.3	-12.1
A058470	리노공업	8.2	9.4	9.8	9.8	37.0	-14.4
A023530	롯데쇼핑	8.8	9.6	9.5	9.0	36.8	-15.3
A112610	씨에스윈드	9.0	9.8	9.4	8.6	36.8	-11.4

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	-1.8
A403870	HPSP	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	-12.0
A195870	해성디에스	9.6	9.6	9.8	9.6	38.5	-7.0
A008770	호텔신라	10.0	9.9	9.4	8.9	38.1	-7.6
A004170	신세계	8.8	9.8	9.7	9.5	37.7	-1.2
A241710	코스메카코리아	9.5	9.2	9.4	9.5	37.5	-13.1
A014680	한솔케미칼	9.6	9.3	8.7	9.6	37.2	-9.9
A001440	대한전선	9.9	9.7	8.6	8.7	36.9	-10.8
A336260	두산퓨얼셀	9.8	8.9	7.8	9.7	36.1	2.9
A011780	금호석유화학	8.5	9.1	9.1	9.2	35.8	4.2

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 6/25일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

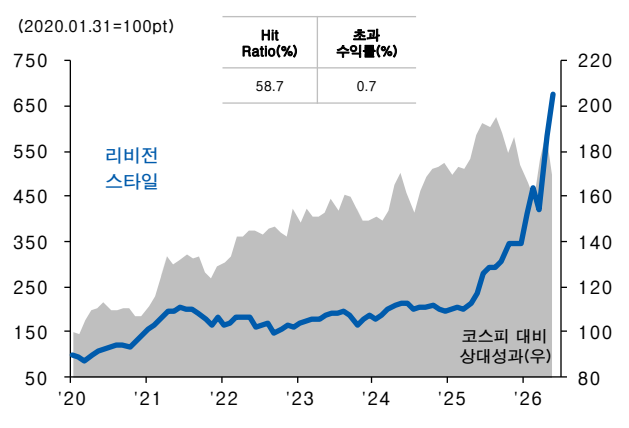
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

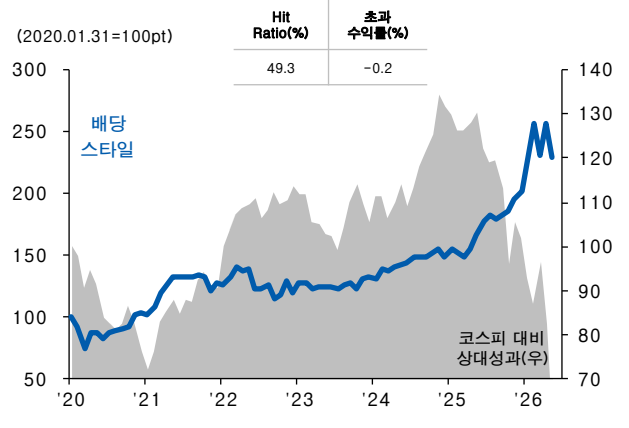


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.3	9.0	27.7	-5.6
A010950	S-Oil	9.6	9.5	7.4	26.5	18.5
A263750	풀어비스	9.2	9.1	7.6	25.9	-3.5
A006650	대한유화	9.4	9.6	6.4	25.4	-15.3
A278470	에이피알	9.4	8.6	7.3	25.3	-15.5
A166090	하나머티리얼즈	9.3	8.7	6.2	24.1	-8.3
A078930	GS	8.5	9.1	6.2	23.9	-16.6
A036570	NC	8.7	8.3	6.6	23.6	-7.0
A016360	삼성증권	6.2	8.9	8.4	23.5	-7.4
A000660	SK하이닉스	7.8	7.9	7.7	23.4	1.5

배당 스타일 성과 추이

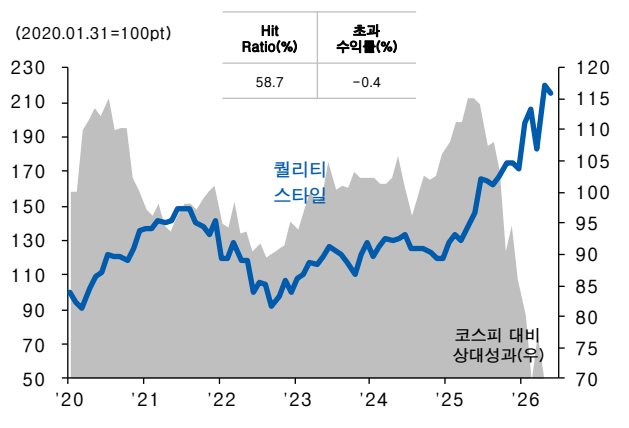


배당 스코어 Top 10

(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	-5.5
A005940	NH투자증권	7.5	9.5	9.8	9.7	36.6	-9.1
A035250	강원랜드	8.5	9.9	8.3	9.8	36.4	-7.3
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.2	9.3	36.0	-5.9
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.1	9.6	8.9	35.5	-4.8
A017670	SK텔레콤	9.3	9.0	9.1	8.1	35.4	-3.7
A032640	LG유플러스	8.1	9.2	8.9	9.1	35.3	-7.0
A000080	하이트진로	9.7	8.4	7.9	8.8	34.7	-7.3
A016360	삼성증권	6.2	9.3	9.5	9.7	34.6	-6.4

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	-9.9
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	-4.2
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	5.5
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.4	-7.5
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.5	36.9	-0.3
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.5	1.8
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	5.0
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.2	35.8	9.7
A207940	삼성바이오로직스	7.7	9.8	9.8	8.5	35.7	-11.6
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.8	35.2	-8.6

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 6/25일 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.