

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

7월 1주차 실적시즌 특수 스크리닝

CONTENTS

I 주간 스크리닝

실적시준 특수 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

실적시즌 특수 스크리닝 (참고 자료: [숫 감마가 일으킨 강풍주의보](#))

- 1) 지수의 강세와 높은 변동성이 지속되는 상황 속, 한국 증시의 중심 축인 삼성전자와 SK하이닉스의 단일종목 레버리지 ETF 상장 이후 변동성의 진폭은 더욱 확대. 다만, 2분기 실적시즌이 시작되는 7월 어닝 서프라이즈 종목군의 성과가 부각되는 "실적시즌 특수"는 지속될 전망. 결국 높은 변동성을 감내할 수 있을 만큼의 명확한 펀더멘털 근거가 확립된 종목이 실적시즌 어닝 서프라이즈를 기록하며 견조한 주가 흐름을 나타낼 것으로 전망
- 2) 1) 최고 추정치보다 최저 추정치의 조정률이 높을수록, 2) 최고/최저 추정치 괴리율이 낮을수록, 3) 괴리율이 축소될수록 어닝 서프라이즈 확률이 높은 것으로 확인. 즉, 보수적인 추정치가 낙관적인 추정치의 방향으로 수렴하고 있는 종목일수록 어닝 서프라이즈를 기록할 확률이 높은 것으로 확인
- 3) 이에 따라, 월간 추정치 조정률, 최저 추정치 조정률, 최고/최저 추정치 괴리율 변화 등 어닝 서프라이즈 확률이 높은 종목을 스크리닝

[7월 1주차] 1) 월간 추정치 조정률 2) 최저 추정치 조정률 3) 최저/최고 괴리율 스코어 상위 30% 중 괴리율 축소 종목 스크리닝

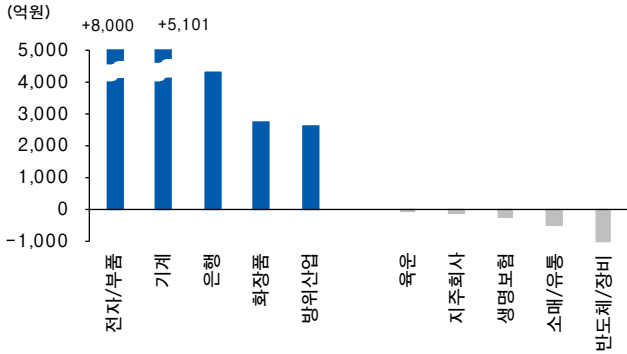
종목명	업종	시가총액 (억원)	2Q26 영업이익 추정치(억원)		2Q26 최저 영업이익 추정치(억원)		최고/최저 추정치 괴리율(%)	
			6/1일 기준	7/1일 기준	6/1일 기준	7/1일 기준	6/1일 기준	7/1일 기준
삼성전기	IT하드웨어	1,646,996	3,835	3,954	3,715	3,780	9.6	7.7
삼성바이오로직스	건강관리	646,222	5,880	6,066	5,650	6,060	8.1	0.2
SK	에너지	553,196	20,763	25,830	10,240	21,770	396.1	37.3
삼성화재	보험	278,154	8,113	8,309	7,460	8,010	15.4	7.5
HMM	운송	176,008	2,734	4,287	1,840	3,100	87.0	80.0
LIG디펜스엔에어로스페이스	상사,자본재	169,400	1,059	1,112	797	960	64.4	36.5
대덕전자	IT하드웨어	76,300	589	616	560	584	16.1	8.7
신세계	소매(유통)	73,295	1,375	1,547	1,020	1,184	63.3	44.4
피에스케이	반도체	61,265	425	500	356	487	36.8	4.9
심텍	IT하드웨어	58,931	448	458	402	450	22.4	3.3
NC	소프트웨어	55,045	1,292	1,475	1,050	1,435	61.3	5.2
롯데쇼핑	소매(유통)	52,334	1,024	1,129	630	1,000	111.1	34.0
파마리서치	건강관리	38,078	657	665	610	640	13.1	7.0
F&F	화장품,의류,완구	29,650	961	987	920	969	8.7	3.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -15.1 조원 순매도, 기관은 약 +1.2 조원 순매수. 외국인의 반도체 집약적 순매도 지속
- 기관과 외국인의 수급 방향성이 일치한 주간. 반도체 업종의 경우 두 수급 주체의 강한 순매도(기관 -2.7조원, 외국인 -13.3조원) 나타난 반면, 전자/부품 업종의 기관 +8,000억원, 외국인 +1,430억원 동시 순매수

기관 주간 순매수 상/하위 업종

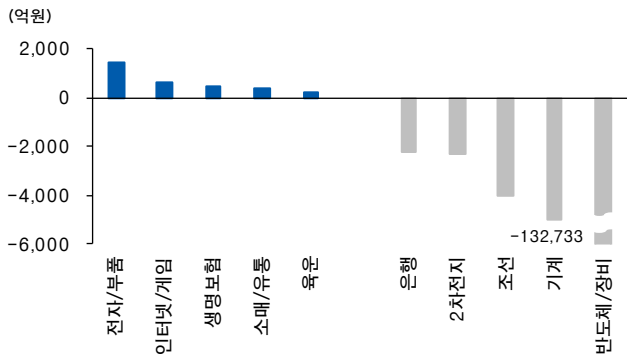


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	8,000	929	12,290	▲▲▲▲
2	기계	5,101	4,565	936	▲▲▲
3	은행	4,299	4,812	6,800	▲▲
4	화학제품	2,716	2,587	-1,027	▲
5	방위산업	2,579	4,278	-1,705	▲
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-27,395	-34,672	134,918	▼▼▼▼
2	소매/유통	-505	-1,770	-920	▼▼
3	생명보험	-266	497	3,523	▼
4	지주회사	-130	-4,315	-4,697	▼
5	육운	-51	-678	307	▼

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

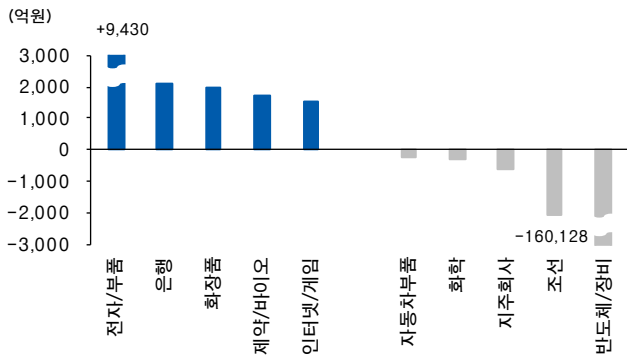


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	1,430	9,486	-28,054	▲▲▲
2	인터넷/게임	607	1,271	-11,801	▲▲
3	생명보험	452	832	325	▲
4	소매/유통	370	1,539	3,753	▲
5	육운	225	878	-4,380	▲
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-132,733	-370,933	-779,977	▼▼▼▼
2	기계	-5,028	-8,391	-17,775	▼▼
3	조선	-4,044	-4,978	-19,657	▼
4	2차전지	-2,310	2,862	17,697	▼
5	은행	-2,219	304	-3,107	▼

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	전자/부품	9,430	10,415	-15,764	▲▲▲
2	은행	2,081	5,116	3,693	▲▲
3	화학제품	1,965	1,065	1,600	▲
4	제약/바이오	1,724	1,906	-8,613	▲
5	인터넷/게임	1,564	6,446	-7,425	▲
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-160,128	-405,605	-645,059	▼▼▼▼
2	조선	-2,069	-2,681	-9,687	▼▼
3	지주회사	-616	-2,816	3,765	▼
4	화학	-276	-977	2,930	▼
5	자동차부품	-235	-3,765	-23,955	▼

자료:에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/2일 기준

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	105,745	5,517	1.40
A007660	이수페타시스	전자/부품	87,944	4,672	1.33
A214450	파마리서치	의료기기	37,455	1,071	0.72
A241710	코스메카코리아	화장품	9,003	163	0.50
A161890	한국콜마	화장품	26,839	493	0.50
A090430	아모레퍼시픽	화장품	69,840	943	0.36
A237690	에스티팜	제약/바이오	27,065	369	0.33
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	37,069	444	0.30
A222800	심텍	전자/부품	46,718	599	0.29
A071970	HD현대마린엔진	기계	21,506	195	0.23

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A058470	리노공업	반도체/장비	57,235	2,464	0.99
A403870	HPSP	반도체/장비	35,965	1,213	0.73
A240810	원익IPS	반도체/장비	64,594	1,170	0.38
A042700	한미반도체	반도체/장비	209,210	1,273	0.14
A011070	LG이노텍	전자/부품	206,851	1,135	0.13
A001120	LX인터내셔널	상사	14,438	74	0.13
A069960	현대백화점	소매/유통	40,175	170	0.10
A375500	DLI앤씨	건설	24,841	96	0.10
A004370	농심	음식료	22,019	73	0.09
A195870	해성디에스	반도체/장비	10,506	38	0.08

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	105,745	4,617	1.2
A007660	이수페타시스	전자/부품	87,944	2,067	0.6
A161890	한국콜마	화장품	26,839	482	0.5
A214450	파마리서치	의료기기	37,455	585	0.4
A241710	코스메카코리아	화장품	9,003	106	0.3
A090430	아모레퍼시픽	화장품	69,840	720	0.3
A006360	GS건설	건설	25,375	245	0.3
A112610	씨에스윈드	기계	18,450	156	0.2
A375500	DLI앤씨	건설	24,841	194	0.2
A222800	심텍	전자/부품	46,718	337	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005380	현대차	자동차	986,932	38.8	-21,657	-36,230
A066570	LG전자	전자/부품	313,227	354.6	-9,388	-23,952
A034020	두산에너빌리티	기계	550,883	682.3	-3,113	-202
A247540	에코프로비엠	2차전지	122,777	395.4	-1,376	-2,151
A017670	SK텔레콤	통신서비스	187,727	53.3	-1,667	-4,074
A047040	대우건설	건설	75,402	126.2	-1,388	-723
A000150	두산	지주회사	234,325	254.7	-978	1,050
A005490	POSCO홀딩스	철강	251,592	51.3	-1,097	5,135
A112610	씨에스윈드	기계	18,450	155.6	-657	-424
A278470	에이피알	화장품	150,501	386.8	-260	1,509

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/2일 기준

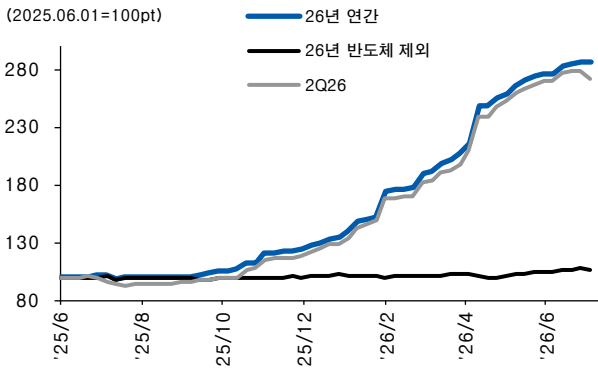
업종별

종목별

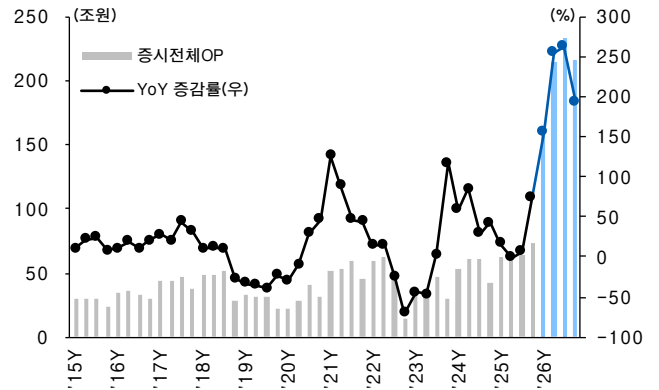
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.1% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.3% 하향 조정
- 최근 삼성전자 실적발표(7/7일)를 앞두고 총당금에 대한 우려가 추정치에 반영되기 시작. 삼성전자의 올해 2분기 1M 평균 컨센서스는 지난 6월 최고 90.5조원에서 현재 84.8조원으로 하향조정이 진행

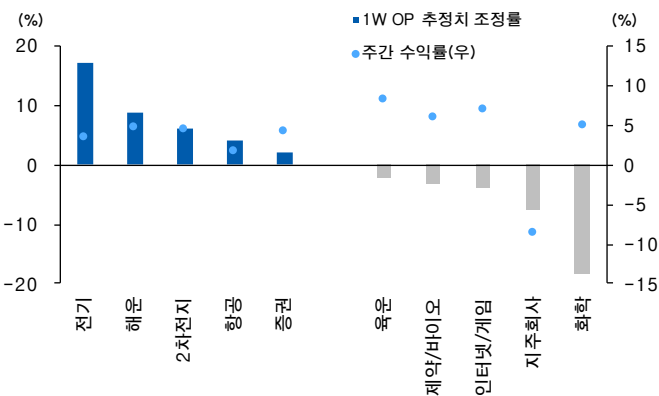
증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감을 추이



26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

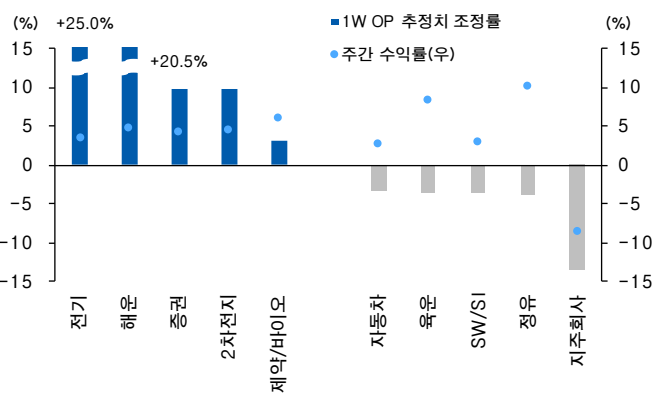


26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	116,221	17.1	3.6	
2	해운	18,133	9.0	4.8	
3	2차전지	12,590	6.0	4.5	
4	항공	8,301	4.3	1.7	
5	증권	149,049	2.1	4.3	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	33,558	-18.5	5.0	
2	지주회사	397,629	-7.6	-8.7	
3	인터넷/게임	64,641	-3.8	7.0	
4	제약/바이오	56,078	-3.2	6.1	
5	육운	26,678	-2.2	8.3	

26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



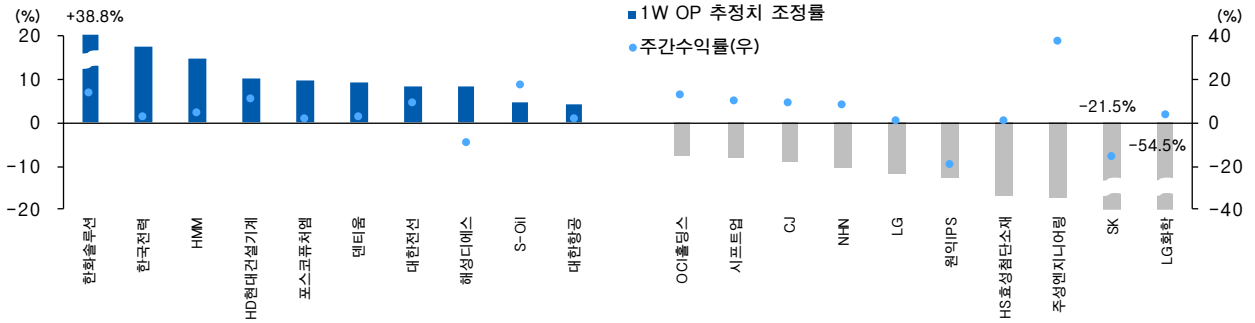
26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	23,206	25.0	3.6	
2	해운	5,820	20.5	4.8	
3	증권	48,400	9.9	4.3	
4	2차전지	1,564	9.8	4.5	
5	제약/바이오	13,903	3.2	6.1	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	지주회사	98,846	-13.6	-8.7	
2	정유	26,523	-3.8	10.1	
3	SW/SI	3,917	-3.6	3.0	
4	육운	6,095	-3.5	8.3	
5	자동차	59,444	-3.2	2.8	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 7/1일 추정치 기준(수익률 7/2일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

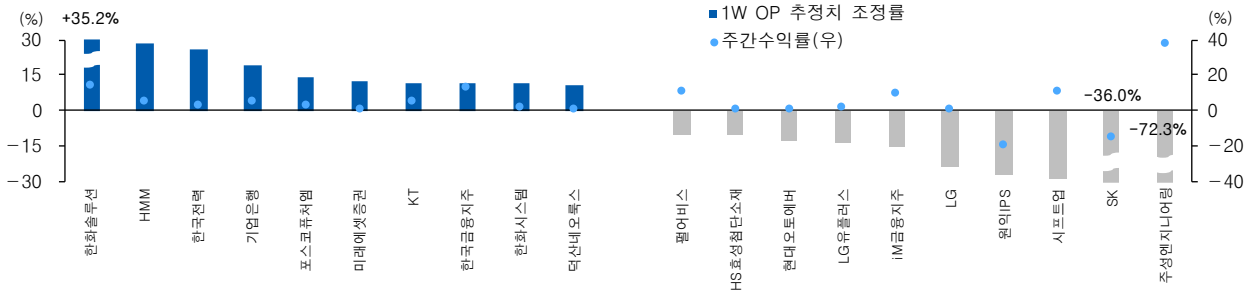


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A009830	한화솔루션	화학	7,565	38.8	13.9	1	A051910	LG화학	화학	7,622	-54.5	3.9
2	A015760	한국전력	전기	113,625	17.6	2.8	2	A034730	SK	지주회사	104,365	-21.5	-16.2
3	A011200	HMM	해운	12,303	14.7	4.3	3	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	559	-17.5	37.4
4	A267270	HD현대건설기계	기계	6,813	10.1	10.4	4	A298050	HS효성첨단소재	화학	1,950	-16.7	0.3
5	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	1,111	9.8	1.9	5	A240810	원익IPS	반도체/장비	1,625	-12.7	-19.7
6	A145720	덴티움	의료기기	864	9.1	2.6	6	A003550	LG	지주회사	13,100	-11.6	0.4
7	A001440	대한전선	기계	2,058	8.6	8.7	7	A181710	NHN	SW/SI	1,573	-10.4	8.0
8	A195870	해성디에스	반도체/장비	973	8.6	-9.8	8	A001040	CJ	지주회사	25,720	-9.2	8.9
9	A010950	S-Oil	정유	36,878	4.6	17.2	9	A462870	시프트업	인터넷/게임	1,037	-8.2	10.2
10	A003490	대한항공	항공	8,542	4.4	1.8	10	A010060	OCI홀딩스	화학	3,498	-7.7	12.9

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

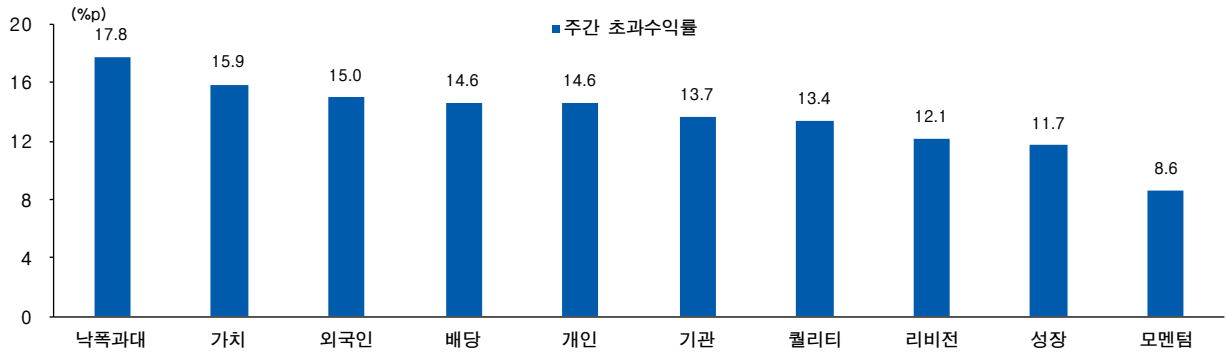
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A009830	한화솔루션	화학	1,860	35.2	13.9	1	A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	23	-72.3	37.4
2	A011200	HMM	해운	4,287	28.5	4.3	2	A034730	SK	지주회사	25,830	-36.0	-16.2
3	A015760	한국전력	전기	22,400	26.1	2.8	3	A462870	시프트업	인터넷/게임	249	-28.9	10.2
4	A024110	기업은행	은행	9,820	19.0	4.8	4	A240810	원익IPS	반도체/장비	210	-27.7	-19.7
5	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	351	14.0	1.9	5	A003550	LG	지주회사	3,030	-24.1	0.4
6	A006800	미래에셋증권	증권	18,555	12.4	-0.2	6	A139130	iM금융지주	은행	1,820	-15.7	9.3
7	A030200	KT	통신서비스	6,255	11.3	4.0	7	A032640	LG유플러스	통신서비스	2,715	-13.5	0.8
8	A071050	한국금융지주	증권	10,613	11.2	12.8	8	A307950	현대오토에버	SW/SI	690	-13.1	0.4
9	A272210	한화시스템	방위산업	598	11.1	0.7	9	A298050	HS효성첨단소재	화학	610	-10.8	0.3
10	A213420	덕산네오룩스	디스플레이	191	10.7	0.0	10	A263750	풀어비스	인터넷/게임	1,361	-10.6	9.8

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 7/1일 추정치 기준(수익률 7/2일 기준)

업종별

종목별

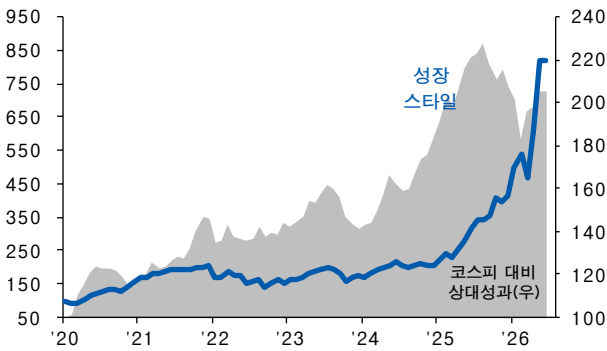
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
60.0	0.9

(2020.01.31=100pt)



성장 스코어 Top 10

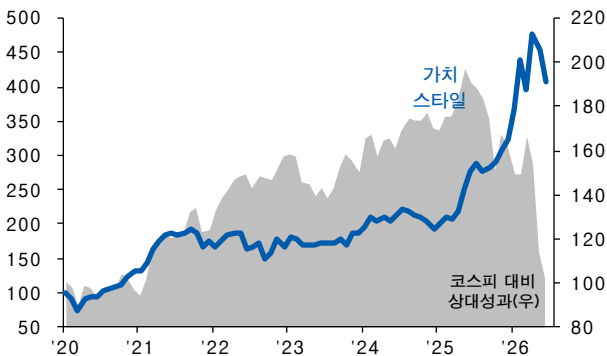
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.8	9.8	9.7	29.2	-15.8
A353200	대덕전자	8.1	9.5	9.0	26.6	-1.7
A009150	삼성전기	7.7	8.8	8.5	25.0	-3.4
A267270	HD건설기계	8.3	8.2	7.8	24.3	10.4
A298040	효성중공업	7.7	8.1	8.2	24.0	10.6
A010120	LS ELECTRIC	7.9	7.8	7.8	23.6	16.5
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.7	5.4	23.0	-4.3
A278470	에이피알	9.6	8.4	4.8	22.7	10.7
A006260	LS	7.4	7.4	7.9	22.7	14.1
A000660	SK하이닉스	9.8	6.4	6.4	22.5	-18.2

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
56.0	0.6

(2020.01.31=100pt)



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A000370	한화손해보험	10.0	9.6	9.9	29.5	4.5
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.5	29.3	1.0
A108670	LX하우시스	9.8	9.5	9.8	29.1	10.5
A088350	한화생명	9.1	9.8	9.8	28.7	-0.5
A036460	한국가스공사	8.8	9.8	10.0	28.5	3.1
A001450	현대해상	9.8	8.7	9.6	28.1	4.7
A097950	CJ제일제당	8.8	9.3	9.8	27.9	10.6
A000120	CJ대한통운	8.7	9.5	9.5	27.8	6.0
A139130	iM금융지주	9.2	9.2	9.1	27.6	9.3
A078930	GS	9.6	9.3	8.5	27.4	23.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 7/2일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

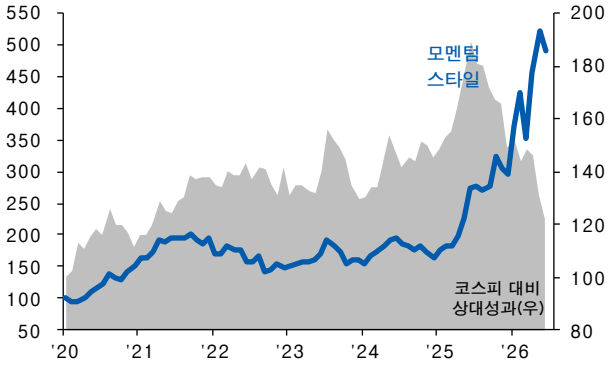
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

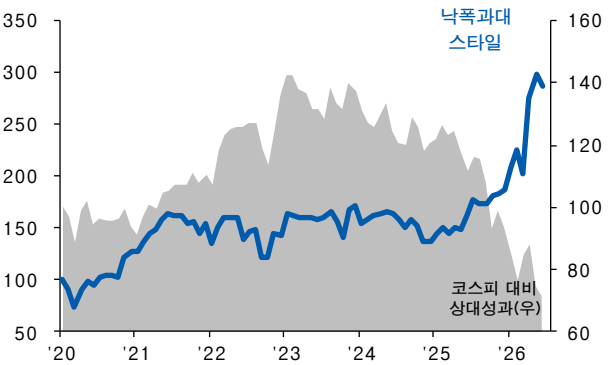
(2020.01.31=100pt)



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.3	-0.3

(2020.01.31=100pt)



모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A000660	SK하이닉스	9.5	9.8	9.8	9.9	39.0	-18.2
A222800	심텍	9.8	9.8	9.6	9.7	38.8	-0.1
A034730	SK	9.8	9.7	9.7	9.5	38.6	-16.2
A004170	신세계	9.9	9.7	9.6	9.5	38.6	-1.1
A009150	삼성전기	8.7	10.0	10.0	10.0	38.5	-3.4
A240810	원익IPS	9.9	9.1	9.4	9.7	38.0	-19.7
A036930	주성엔지니어링	8.4	9.9	9.9	9.8	37.9	37.4
A069960	현대백화점	10.0	9.6	9.2	9.0	37.7	-7.1
A005930	삼성전자	9.0	9.5	9.5	9.6	37.6	-15.8
A032830	삼성생명	8.8	9.4	9.4	9.3	36.8	-14.3

낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A253450	스튜디오드래곤	7.6	9.8	9.9	9.8	37.1	9.1
A035760	CJ ENM	7.7	9.9	10.0	9.6	37.1	3.8
A293490	카카오게임즈	7.4	9.7	9.9	9.7	36.7	12.8
A376300	디어유	6.1	9.4	9.8	10.0	35.2	16.5
A000100	유한양행	7.0	9.1	9.4	8.8	34.4	5.6
A039130	하나투어	6.9	8.4	9.4	9.3	34.0	2.6
A352820	하이브	5.5	9.7	9.7	8.8	33.6	20.1
A035720	카카오	7.2	8.8	9.7	7.9	33.6	6.3
A361610	SK아이이테크놀로지	6.6	8.8	9.3	8.2	32.9	11.4
A069620	대웅제약	5.8	9.4	9.3	8.3	32.8	16.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 7/2일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

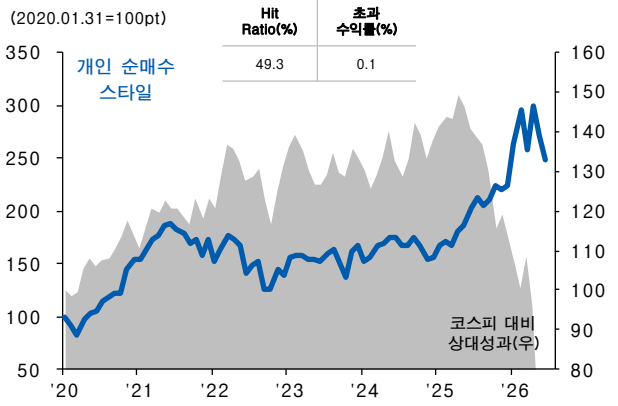
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

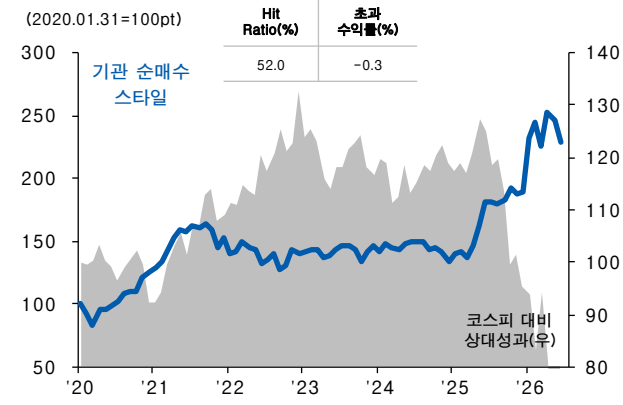


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A039130	하나투어	9.4	9.9	9.7	9.9	38.8	2.6
A005380	현대차	9.7	8.8	9.9	9.6	37.9	0.3
A066570	LG전자	10.0	9.8	9.4	8.7	37.9	-1.8
A011790	SKC	9.6	9.6	9.0	9.1	37.2	-4.9
A006360	GS건설	7.3	9.9	9.9	9.8	36.9	27.3
A035760	CJ ENM	7.9	10.0	9.4	9.4	36.5	3.8
A011070	LG이노텍	9.8	9.7	9.1	7.9	36.5	-6.1
A012330	현대모비스	9.2	9.4	9.3	8.5	36.3	1.1
A010140	삼성중공업	9.2	9.6	8.6	8.4	35.8	-0.2
A036930	주성엔지니어링	8.6	9.3	8.9	8.7	35.4	37.4

기관 순매수 스타일 성과 추이

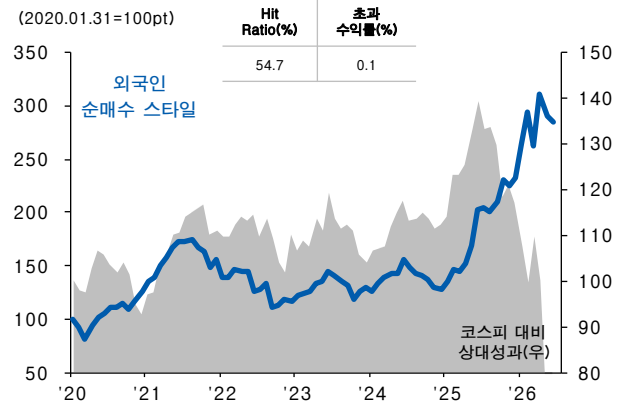


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A403870	HPSP	9.9	9.5	9.9	9.9	39.2	-17.1
A222800	심택	9.9	9.9	9.7	9.5	39.0	-0.1
A008770	호텔신라	9.3	10.0	9.8	9.7	38.7	9.5
A030000	제일기획	10.0	9.8	8.5	8.4	36.5	4.0
A161890	한국콜마	9.8	9.9	9.9	6.8	36.3	25.4
A336260	두산퓨얼셀	8.0	9.6	9.3	9.4	36.2	9.3
A240810	원익IPS	9.8	6.9	9.7	9.7	36.0	-19.7
A138930	BNK금융지주	9.6	8.9	8.0	9.4	35.9	14.2
A007660	이슈페타시스	9.6	9.4	9.0	7.2	35.2	11.1
A214320	이노션	8.3	9.7	8.8	8.3	35.1	5.3

외국인 순매수 스타일 성과 추이



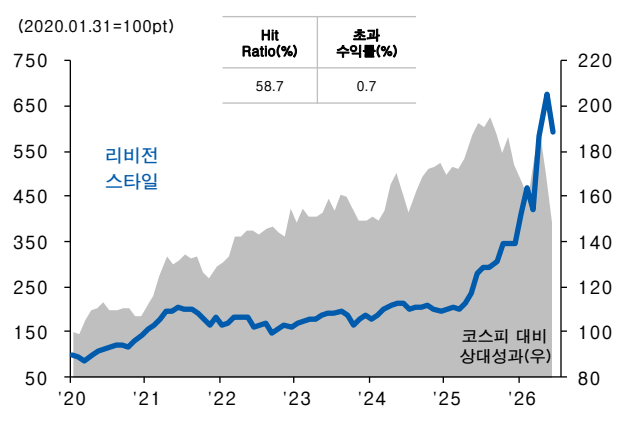
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A282330	BGF리테일	9.8	9.3	9.9	9.9	38.8	3.3
A120110	코오롱인더	9.7	9.9	9.5	9.3	38.3	6.2
A001120	LX인터내셔널	9.6	9.6	9.7	9.1	37.9	9.6
A241710	코스메카코리아	8.6	9.8	9.0	9.8	37.2	27.5
A183300	코미코	9.9	9.4	9.1	8.7	37.0	-10.7
A298020	효성티앤씨	9.6	9.8	9.5	8.0	36.9	7.4
A003490	대한항공	9.5	8.9	9.6	8.8	36.7	1.8
A195870	해성디에스	9.7	8.1	9.0	9.5	36.2	-9.8
A066970	엘앤에프	9.1	8.7	9.1	9.3	36.1	7.9
A001430	세아베스틸지주	9.8	8.5	9.3	8.4	36.0	-1.7

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 7/2일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

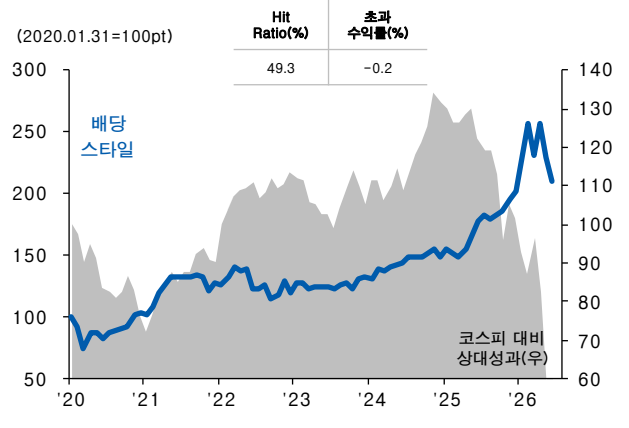


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.0	9.6	8.6	27.2	4.3
A010130	고려이연	8.5	8.9	9.4	26.9	2.7
A004170	신세계	8.2	9.2	9.3	26.7	-1.1
A000660	SK하이닉스	9.1	8.2	8.3	25.6	-18.2
A003490	대한항공	8.8	9.5	6.9	25.1	1.8
A006260	LS	8.4	8.7	7.7	24.8	14.1
A005940	NH투자증권	6.6	9.0	8.9	24.4	4.5
A069960	현대백화점	6.3	8.8	8.9	24.0	-7.1
A006800	미래에셋증권	6.5	9.3	8.0	23.8	-0.2
A039490	키움증권	6.6	8.8	8.4	23.8	5.2

배당 스타일 성과 추이

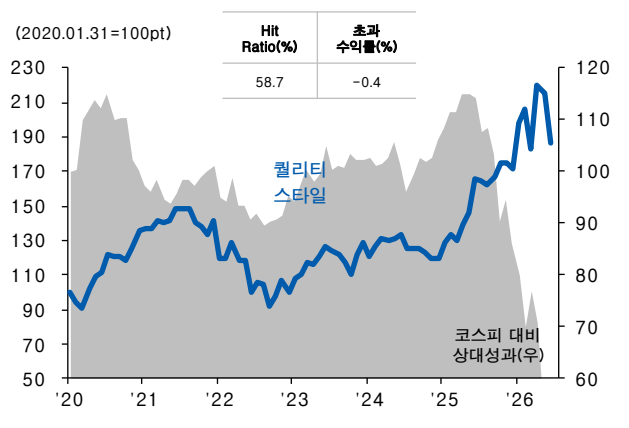


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.8	9.8	9.4	9.9	37.9	4.0
A214320	이노션	8.3	9.8	9.3	9.8	37.2	5.3
A035250	강원랜드	8.7	9.9	8.5	9.8	36.9	4.4
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.4	9.6	9.7	36.9	9.6
A005940	NH투자증권	8.0	9.2	9.9	9.6	36.6	4.5
A032640	LG유플러스	8.4	9.5	8.9	8.9	35.8	0.8
A017670	SK텔레콤	9.4	9.0	9.1	7.8	35.3	-3.5
A000080	하이트진로	9.7	8.5	8.1	8.9	35.1	6.0
A024110	기업은행	6.0	9.7	9.9	9.4	35.0	4.8
A298020	효성티앤씨	9.9	7.8	9.3	7.9	34.9	7.4

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.1	9.9	9.9	9.4	38.3	-17.1
A058470	리노공업	9.8	9.8	9.7	8.9	38.1	-10.9
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	37.9	-18.2
A042700	한미반도체	9.6	8.7	9.5	9.6	37.4	-14.8
A214150	클래시스	8.3	9.7	9.6	9.2	36.8	6.0
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.6	9.6	36.6	4.5
A145020	휴젤	9.9	9.5	9.3	7.5	36.3	6.9
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.1	35.7	11.3
A376300	디어유	9.7	9.5	9.4	7.0	35.6	16.5
A383220	F&F	8.2	9.1	9.1	8.7	35.1	8.7

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 7/2일 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.