

2Q26 실적발표 전 5일을 위한 Active Quant의 定石

4번째 업데이트 (7.7 ~ 7.14)

Quant Analyst 김경훈 (CAIA, FRM, CFA)
02)2184-2330 / aimhigh2027@daolfn.com



"공시 확정치" 존재시 "시장 예상치" 수치들은 다음분기 전환을 의미 ↓ (억원)

이름	실적발표 예정일	퀀트 예상치(T+1)	미발표 시장 예상치(T+1)	기발표 시장 예상치(T)	공시 확정치(T)	퀀트 예상치 결과		2Q26 예상실적 변화		
						L/S Position	Valuation	현재	1주전	2주전
IT										
삼성전자	7/7	▲ 813,256	▲ 850,494	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
SK하이닉스	7/23	▲ 658,651	▼ 647,967	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
삼성전기	7/30	▲ 4,180	▲ 3,856	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
LG에너지솔루션	5/15	▲ 2,091	▼ 2,034	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
삼성SDI	7/31	▲ 101	▼ -661	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
LG전자	7/7	▲ 15,010	▼ 10,580	미발표	No Position	Overvalued	Positive			
LG이노텍	7/23	▲ 2,039	▼ 1,599	미발표	Long	Overvalued	Positive			
삼성에스디에스	7/24	▲ 2,316	▼ 2,269	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
현대오트모터	5/15	▲ 779	▲ 798	미발표	No Position	Fair	Neutral			
에코프로비엠	5/15	▲ 270	▼ 237	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
이수페타시스	8/14	▼ 738	▲ 739	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
LG씨엔에스	7/23	▲ 1,450	▼ 1,446	미발표	No Position	Fair	Neutral			
대덕전자	5/15	▲ 656	▼ 601	미발표	No Position	Fair	Neutral			
리노공업	8/13	▲ 643	▲ 643	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
LG디스플레이	7/24	▼ -1,453	▼ -952	미발표	No Position	Undervalued	Negative			
시텍	5/15	▲ 465	▲ 435	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
엘앤에프	7/30	▼ 421	▲ 505	미발표	No Position	Undervalued	Negative			
테스	8/14	▼ 240	▲ 259	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
ISC	7/30	▼ 214	▲ 223	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
솔브레인	5/15	▲ 462	▲ 462	미발표	No Position	Fair	Neutral			
롯데에너지머티리얼즈	8/6	▼ -206	▲ -171	미발표	No Position	Fair	Negative			
두산테스나	5/15	▼ 80	▲ 101	미발표	Conviction Short	Overvalued	Negative			
파크시스템스	8/6	▲ 107	▼ 100	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
SK아이이테크놀로지	5/15	▼ -725	▼ -664	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
해성디에스	8/6	▼ 203	▲ 222	미발표	No Position	Fair	Neutral			
NHN	8/12	▲ 471	▲ 400	미발표	No Position	Fair	Positive			
인텔리안테크	8/14	▼ 85	▼ 87	미발표	No Position	Fair	Neutral			
티엘비	5/15	▼ 128	▼ 126	미발표	No Position	Fair	Neutral			
비에이치	8/4	▼ 151	▼ 136	미발표	No Position	Fair	Positive			
Communication Service										
NAVER	8/7	▼ 5,470	▲ 5,727	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
SK텔레콤	8/6	▲ 5,302	▼ 5,271	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
카카오	8/6	▼ 1,726	▲ 2,234	미발표	No Position	Overvalued	Negative			
KT	8/11	▼ 5,379	▲ 6,135	미발표	No Position	Undervalued	Negative			
크래프톤	7/29	▲ 4,332	▲ 3,576	미발표	No Position	Fair	Positive			
하이브	5/15	▲ 1,606	▲ 1,485	미발표	No Position	Fair	Neutral			
LG유플러스	8/10	▼ 2,290	▲ 3,067	미발표	Short	Fair	Negative			
NC	8/12	▲ 1,472	▼ 1,285	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
넷마블	8/7	▼ 979	▲ 1,023	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
필터비스	5/15	▼ 1,361	▲ 1,440	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
제일기획	7/27	▼ 924	▲ 945	미발표	No Position	Fair	Neutral			
시프트업	5/15	▲ 305	▼ 286	미발표	No Position	Fair	Neutral			
JYP Ent.	8/13	▼ 380	▲ 440	미발표	No Position	Undervalued	Negative			
에스엠	8/6	▲ 540	▼ 539	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
더블유게임즈	8/13	▼ 677	▲ 701	미발표	No Position	Fair	Neutral			
와이지엔터테인먼트	8/10	▼ 80	▲ 115	미발표	Short	Undervalued	Negative			
이노션	8/7	▲ 422	▼ 412	미발표	No Position	Fair	Neutral			
CJ ENM	8/7	▼ 347	▼ 344	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
스튜디오드래곤	5/15	▲ 137	▼ 136	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
SOOP	7/29	▼ 260	▲ 273	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
디어유	5/15	▲ 106	▼ 105	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
네오위즈	8/7	▲ 112	▼ 89	미발표	No Position	Fair	Positive			
컴투스	8/12	▲ 90	▲ 90	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
Consumer Discretionary										
현대차	7/24	▼ 31,179	▲ 32,447	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
기아	7/27	▼ 28,458	▼ 27,852	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
현대모비스	7/27	▼ 8,915	▲ 9,160	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
에이피알	8/6	▲ 1,706	▼ 1,674	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
한국타이어엔테크놀로지	8/14	▲ 5,360	▼ 5,242	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
신세계	8/10	▲ 1,573	▼ 1,484	미발표	No Position	Fair	Neutral			
아모레퍼시픽	8/3	▲ 1,073	▼ 966	미발표	No Position	Fair	Positive			
롯데쇼핑	8/7	▼ 431	▲ 436	미발표	No Position	Fair	Neutral			
현대백화점	8/6	▲ 881	▼ 846	미발표	No Position	Fair	Neutral			
한온시스템	8/14	▲ 1,150	▼ 1,093	미발표	Long	Fair	Neutral			
LG생활건강	7/31	▲ 857	▼ 718	미발표	Long	Fair	Positive			
영원무역	8/14	▼ 1,780	▲ 1,826	미발표	No Position	Fair	Neutral			
강원랜드	7/29	▲ 580	▼ 489	미발표	No Position	Fair	Positive			
F&F	5/15	▲ 1,004	▼ 969	미발표	No Position	Fair	Neutral			
달바글로벌	5/15	▼ 414	▲ 422	미발표	No Position	Fair	Neutral			
에스엘	8/14	▲ 1,349	▲ 1,349	미발표	No Position	Fair	Neutral			
한국콜마	8/10	▲ 989	▼ 938	미발표	No Position	Fair	Neutral			
HL만도	7/27	▼ 1,007	▲ 1,046	미발표	No Position	Fair	Neutral			
이마트	8/13	▼ 713	▲ 746	미발표	No Position	Fair	Neutral			
미스토홀딩스	8/14	▲ 2,220	▼ 2,075	미발표	No Position	Fair	Neutral			
실리콘투	5/15	▲ 715	▼ 707	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
BGF리테일	8/7	▲ 783	▼ 736	미발표	No Position	Fair	Neutral			
GS리테일	8/10	▼ 954	▲ 1,013	미발표	No Position	Fair	Neutral			
호텔신라	7/22	▼ 487	▲ 513	미발표	No Position	Fair	Neutral			
코스맥스	8/11	▼ 690	▲ 695	미발표	No Position	Fair	Neutral			
현대위아	7/27	▲ 622	▼ 619	미발표	No Position	Fair	Neutral			
금호타이어	7/30	▲ 1,458	▲ 1,458	미발표	No Position	Fair	Neutral			
파라다이스	8/7	▼ 489	▲ 515	미발표	No Position	Fair	Neutral			
롯데관광개발	8/5	▲ 510	▼ 507	미발표	No Position	Fair	Neutral			
코스메카코리아	5/15	▲ 272	▲ 272	미발표	No Position	Fair	Neutral			
넥센타이어	7/30	▲ 482	▲ 482	미발표	No Position	Fair	Neutral			
GKL	8/7	▼ 240	▼ 195	미발표	No Position	Fair	Positive			
한세실업	8/14	▼ 199	▼ 168	미발표	No Position	Fair	Positive			
Utility										
한국전력	8/12	▼ 18,021	▲ 19,122	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
한전기술	8/7	▼ 155	▼ 141	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
한국가스공사	8/10	▲ 5,115	▲ 4,305	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
한전KPS	8/7	▼ 680	▼ 623	미발표	No Position	Fair	Neutral			

"공시 확정치" 존재시 "시장 예상치" 수치들은 다음분기 전환을 의미 ↓ (억원)

이름	실적발표 예정일	퀀트 예상치(T+1)	미발표 시장 예상치(T+1)	기발표 시장 예상치(T)	공시 확정치(T)	퀀트 예상치 결과		2Q26 예상실적 변화		
						L/S Position	Valuation	현재	1주전	2주전
Industrials										
삼성물산	7/30	▲ 5,400	▼ 5,024	미발표	No Position	Fair	Neutral			
HD현대중공업	5/15	▲ 10,009	▼ 10,003	미발표	No Position	Fair	Neutral			
두산에너지빌리티	7/27	▲ 2,748	▼ 2,659	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
한화에어로스페이스	7/31	▲ 10,224	▲ 10,224	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
LS ELECTRIC	7/24	▲ 1,722	▼ 1,582	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
HD현대일렉트릭	7/22	▲ 2,850	▼ 2,845	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
효성중공업	5/15	▲ 2,903	▼ 2,845	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
한화오션	7/15	▼ 4,719	▲ 4,968	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
HD한국조선해양	7/31	▲ 14,211	▲ 14,211	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
두산	7/27	▲ 4,678	▲ 4,595	미발표	No Position	Fair	Neutral			
삼성중공업	7/24	▼ 3,458	▲ 3,970	미발표	No Position	Undervalued	Negative			
현대로템	8/5	▲ 3,031	▼ 2,778	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
HMM	8/13	▲ 5,580	▼ 3,123	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
LIG디펜스엔에어로스페이	8/7	▲ 1,055	▲ 1,055	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
LG	8/14	▼ 3,030	▲ 4,161	미발표	No Position	Undervalued	Negative			
한국항공우주	7/29	▲ 830	▲ 1,045	미발표	No Position	Fair	Negative			
한화시스템	7/29	▲ 619	▼ 617	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
현대글로벌비스	7/24	▼ 4,770	▲ 5,269	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
현대건설	7/20	▲ 2,230	▼ 2,014	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
LS	8/14	▲ 4,910	▼ 4,406	미발표	No Position	Fair	Positive			
대한항공	8/14	▼ -1,981	▼ -2,290	미발표	No Position	Undervalued	Positive			
HD현대마린솔루션	5/15	▲ 1,129	▼ 1,077	미발표	No Position	Undervalued	Neutral			
삼성E&A	7/24	▲ 2,250	▼ 2,189	미발표	No Position	Fair	Neutral			
포스코인터내셔널	7/31	▼ 3,440	▲ 3,517	미발표	No Position	Overvalued	Neutral			
대우건설	7/28	▲ 1,473	▼ 1,437	미발표	No Position	Fair	Neutral			
산일전기	8/14	▲ 614	▼ 606	미발표	No Position	Fair	Neutral			
대한전선	7/31	▲ 460	▼ 426	미발표	No Position	Fair	Neutral			
팬오션	7/31	▲ 1,610	▼ 1,444	미발표	No Position	Fair	Positive			
DL이앤씨	5/15	▼ 1,031	▲ 1,191	미발표	No Position	Fair	Negative			
GS건설	7/30	▲								

직전 LONG/SHORT Pair 구성종목 및 성과 (6.15 ~ 6.25)

Gross L/S Pair (%)	5.3
Conviction L/S Pair (%)	-0.6

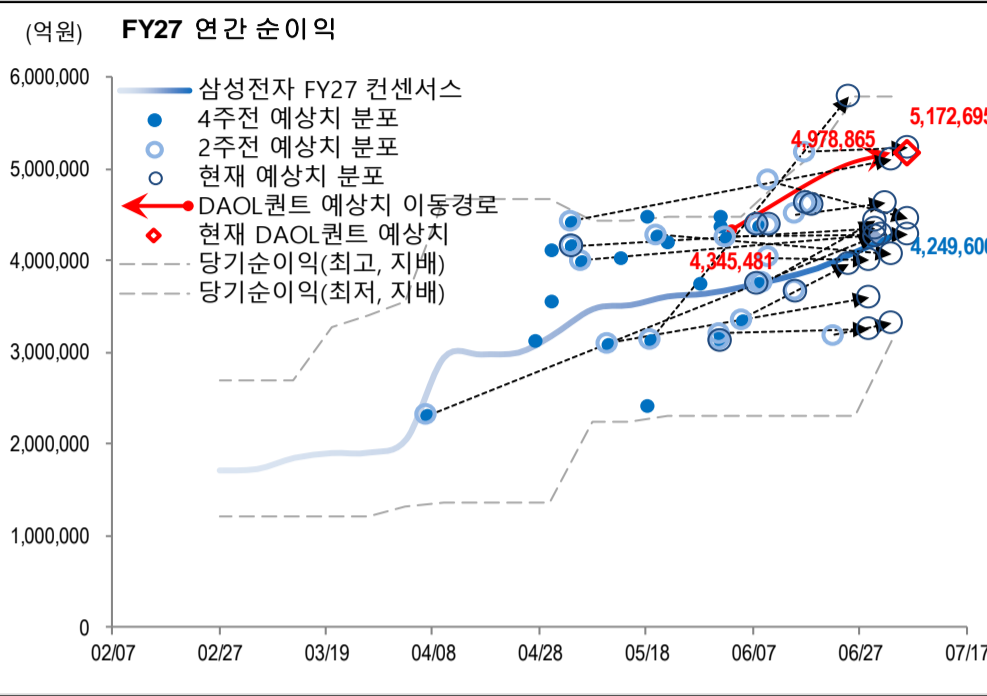
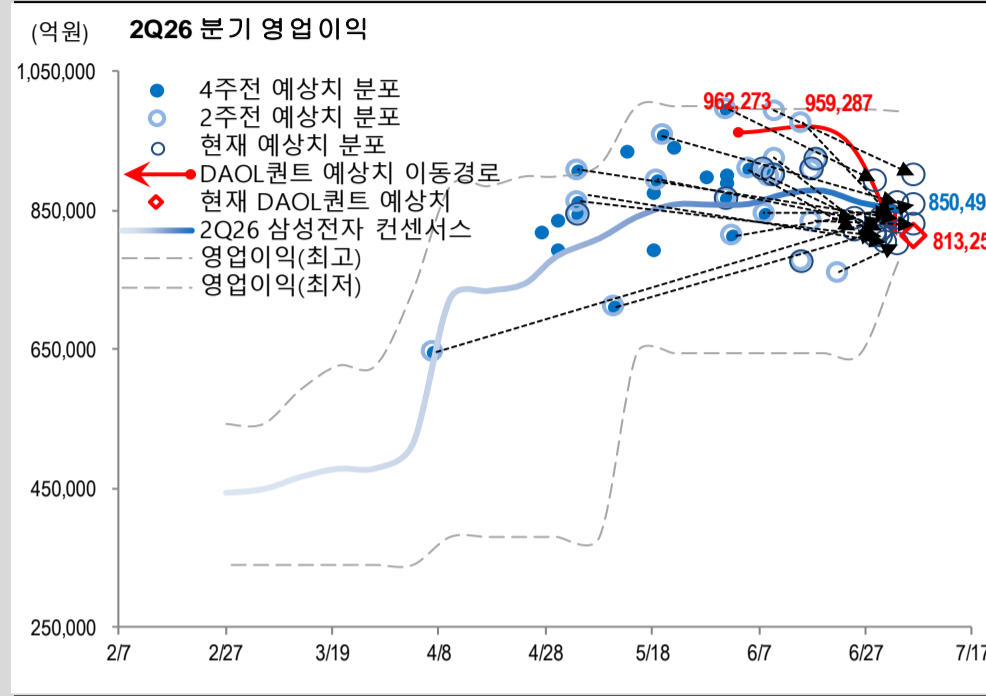
LONG		수익률	-2.9
Code	Name	Position	Returns (%)
A005930	삼성전자	Conviction Long	11.2
A105560	KB금융	Conviction Long	-5.8
A051910	LG화학	Long	-17.2
A011070	LG이노텍	Long	-8.0
A004170	신세계	Long	6.6
A023530	롯데쇼핑	Long	-12.8
A069960	현대백화점	Long	10.3
A257720	실리콘투	Conviction Long	-7.2

SHORT		수익률	-8.2
Code	Name	Position	Returns (%)
A009830	한화솔루션	Short	-5.2
A004020	현대제철	Short	-19.5
A047810	한국항공우주	Short	0.9
A139480	이마트	Short	-9.0

삼성전자

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	850,494	(시정대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased)
최대값	993,000	삼성전자 추가(RHS)
최저값	776,860	삼성전자 12M Fwd 컨센서스(RHS)
실적발표일	2026-07-07	
DAOL퀀트 예상치	813,256	
Beat or Miss	0	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	No Position	

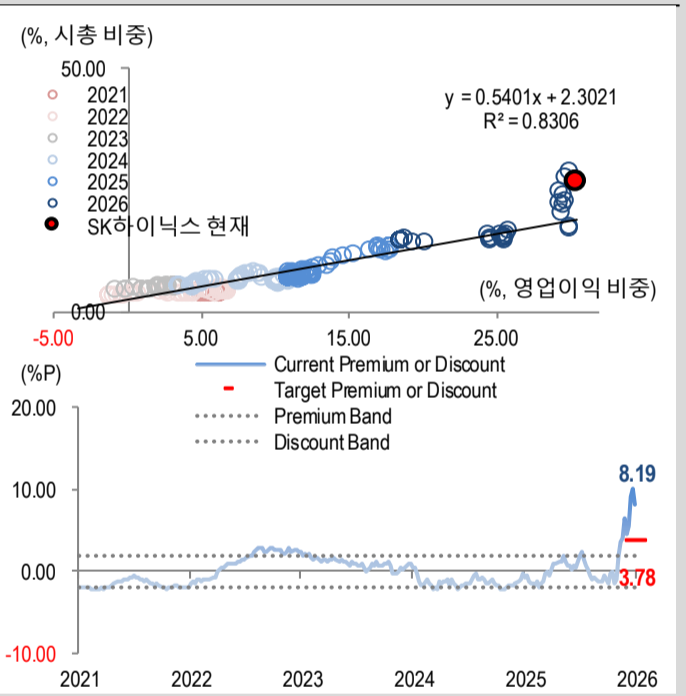
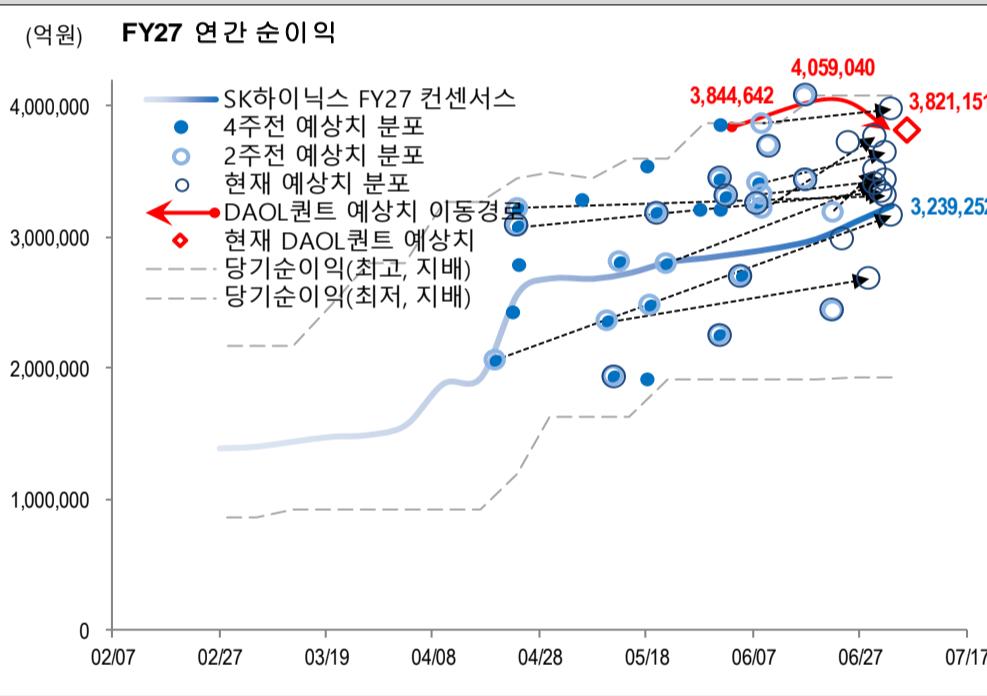
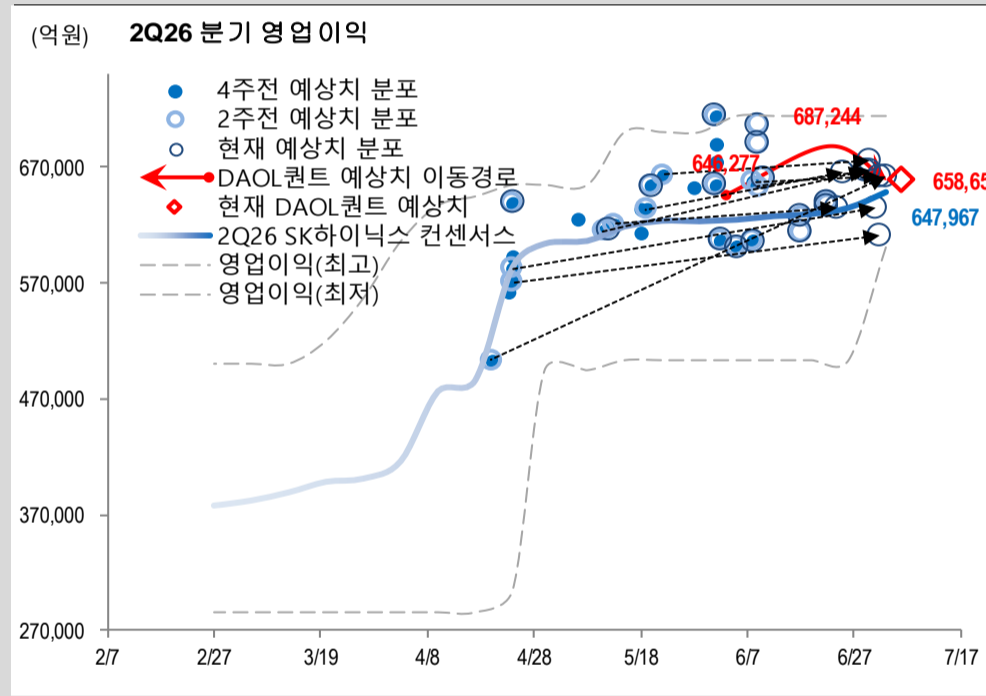
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-06	856,760	이종욱,김경빈	삼성증권
2026-07-06	831,000	손인준	유진투자증권
2026-07-06	901,000	김선우,우서현	메리츠증권
2026-07-03	800,420	송명섭	iM증권
2026-07-03	860,500	채민숙,김연준	한국투자증권



SK하이닉스

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	647,967	(시정대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased)
최대값	714,460	SK하이닉스 추가(RHS)
최저값	601,390	SK하이닉스 12M Fwd 컨센서스(RHS)
실적발표일	2026-07-23	
DAOL퀀트 예상치	658,651	
Beat or Miss	0	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	No Position	

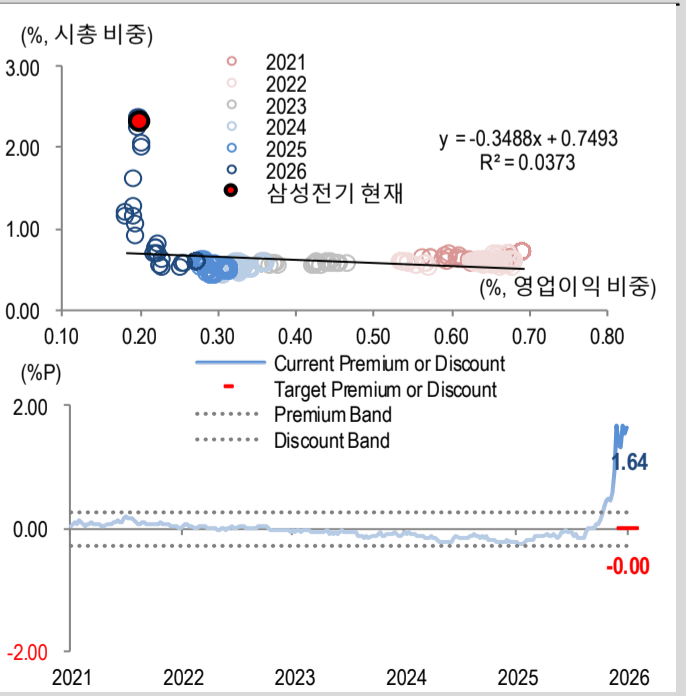
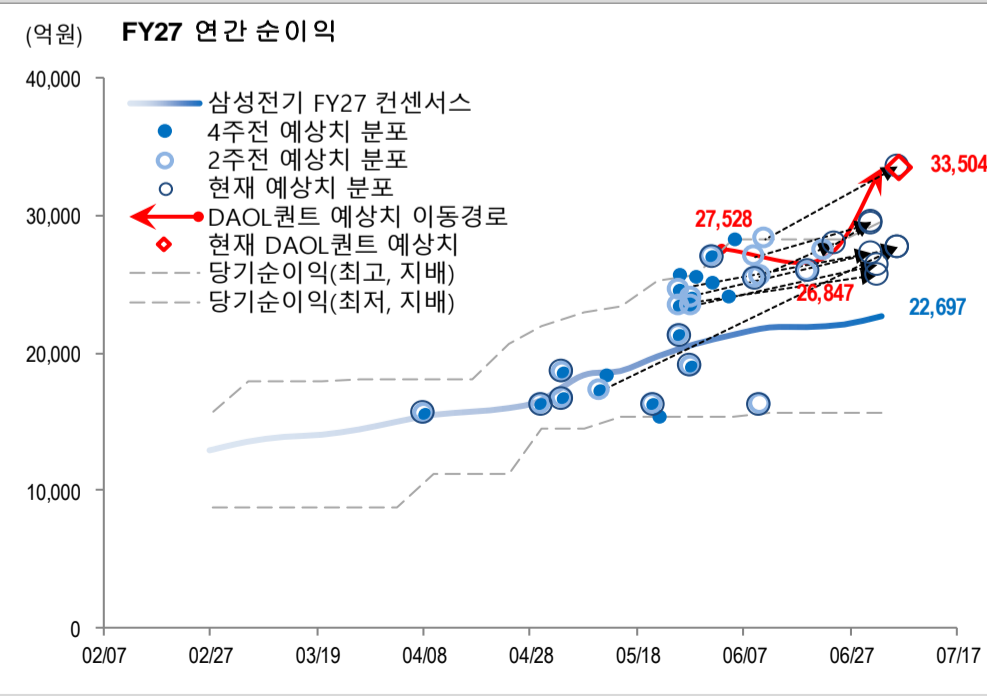
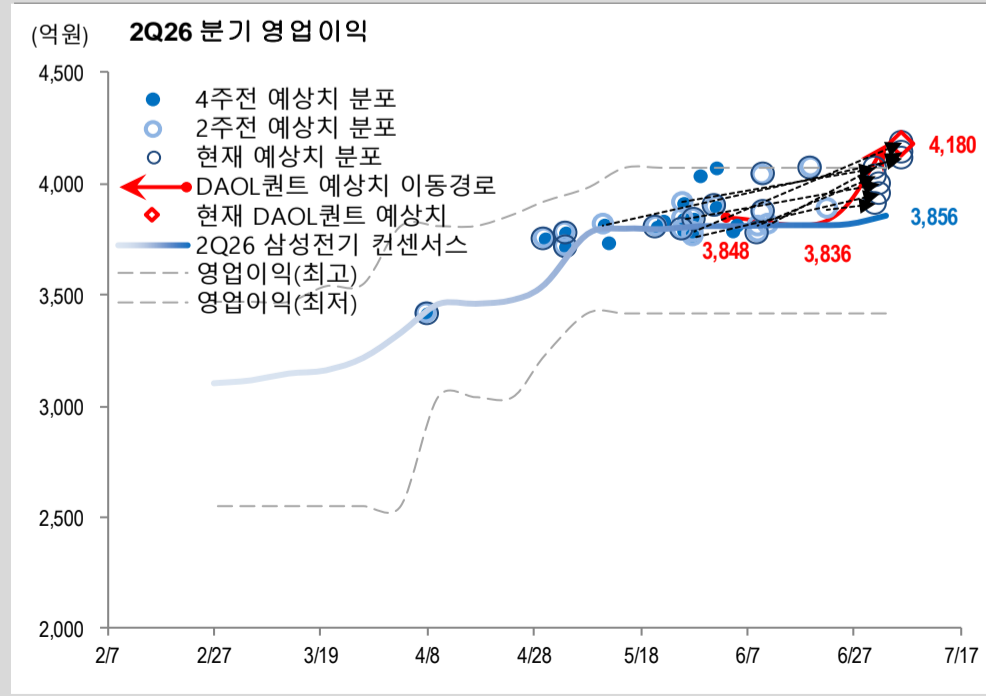
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-03	662,070	정민규	상상인증권
2026-07-02	662,120	류영호,이호승	NH투자증권
2026-07-02	610,350	김운호	IBK투자증권
2026-07-01	634,758	최보영	교보증권
2026-06-30	667,630	김형태,송혜수	신한투자증권



삼성전기

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	3,856	(시정대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased)
최대값	4,070	삼성전기 추가(RHS)
최저값	3,415	삼성전기 12M Fwd 컨센서스(RHS)
실적발표일	2026-07-30	
DAOL퀀트 예상치	4,180	
Beat or Miss	0	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	No Position	

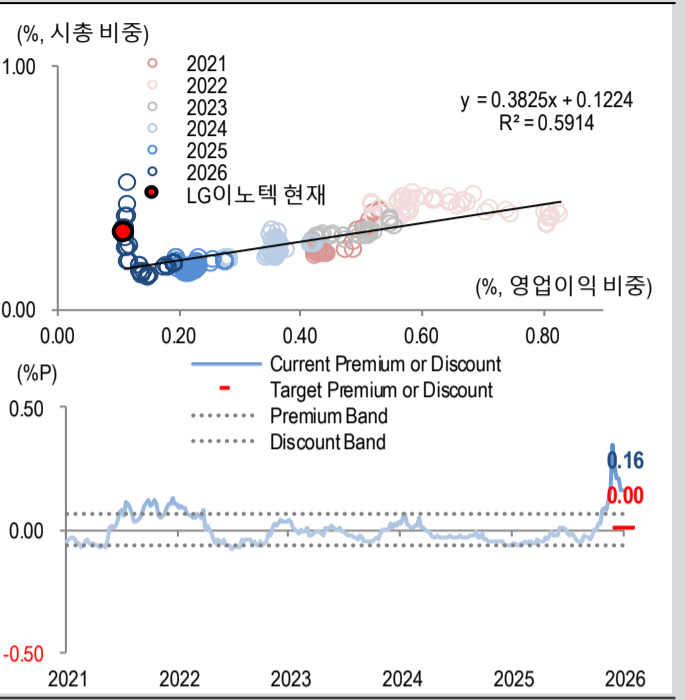
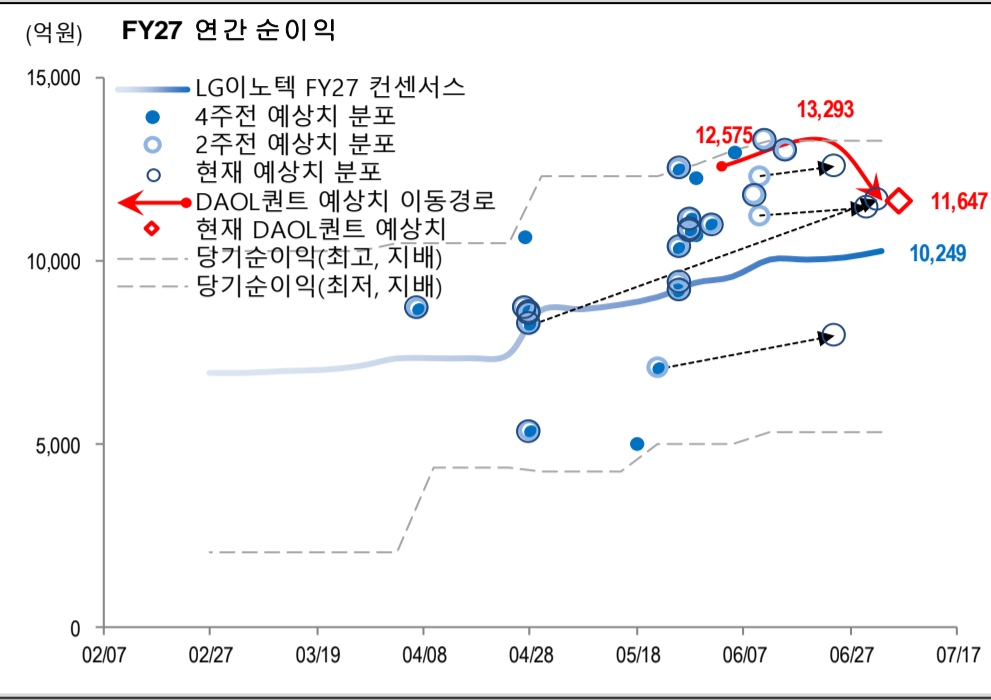
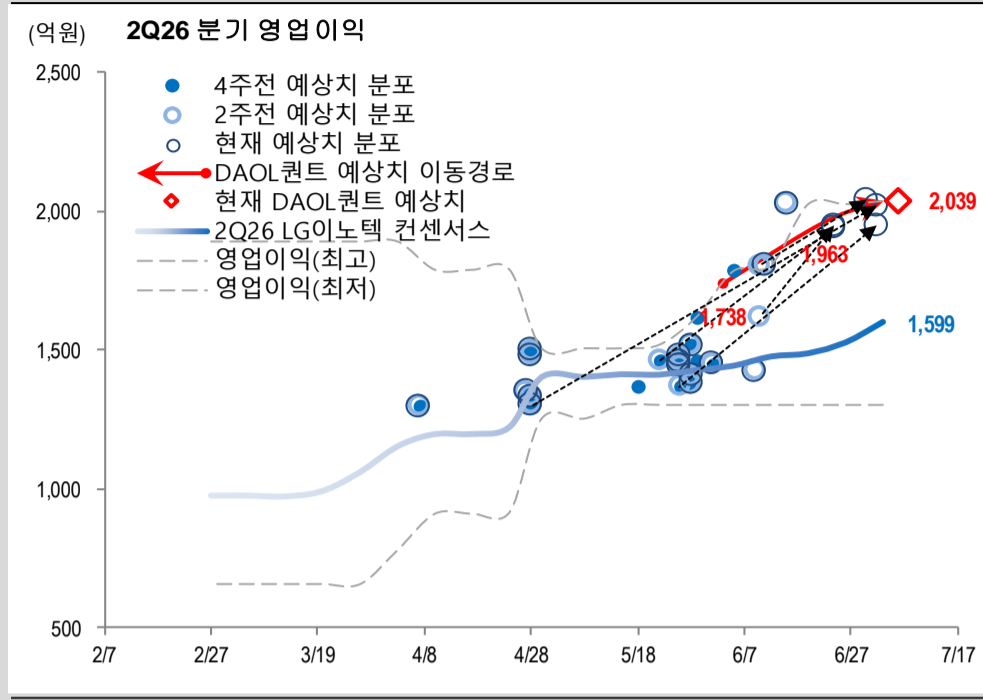
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-06	4,110	최보영	교보증권
2026-07-06	4,143	박준서	미래에셋증권
2026-07-06	4,180	김연미	다음투자증권
2026-07-02	3,952	오강호	신한투자증권
2026-07-02	4,001	황지현	NH투자증권



LG이노텍

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,599	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW (P, Rebased) 기관 OW/UW LG이노텍 주가(RHS) LG이노텍 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	2,039	
최저값	1,300	
실적발표일	2026-07-23	
DAOL퀀트 예상치	2,039	
Beator Miss	0	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	Long	

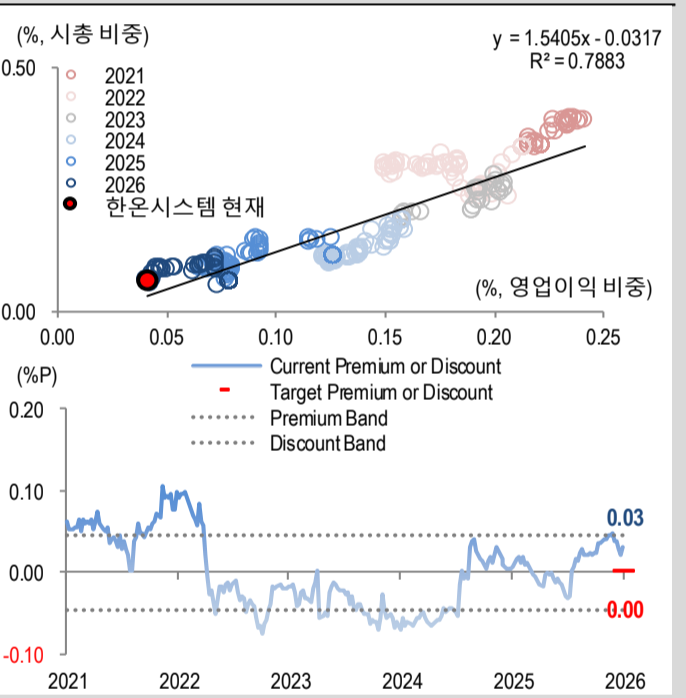
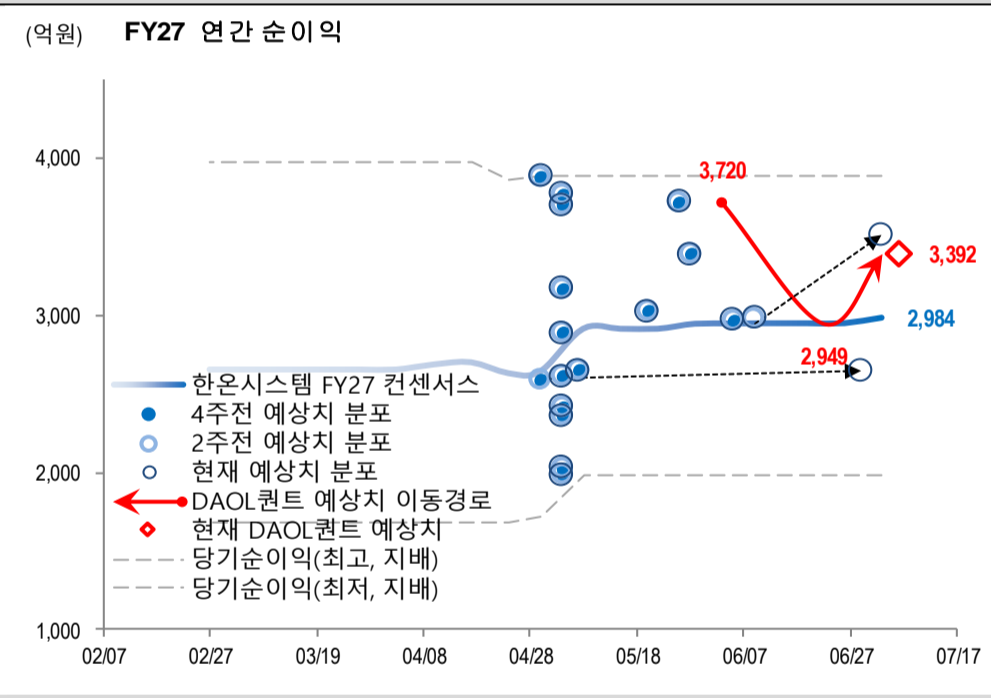
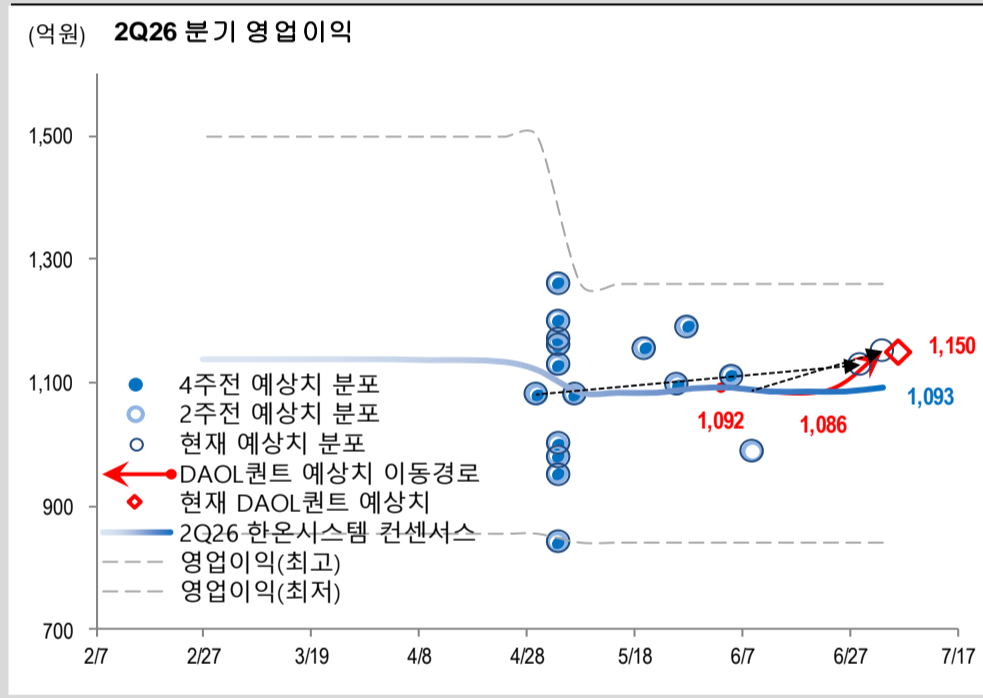
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-02	2,020	최보영	교보증권
2026-07-02	1,949	황지현	NH투자증권
2026-06-30	2,039	양승수	메리츠증권
2026-06-24	1,950	김중배	현대차증권
2026-06-24	1,940	박강호	대신증권



한온시스템

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,093	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW (P, Rebased) 기관 OW/UW 한온시스템 주가(RHS) 한온시스템 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	1,260	
최저값	840	
실적발표일	2026-08-14	
DAOL퀀트 예상치	1,150	
Beator Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S Position	Long	

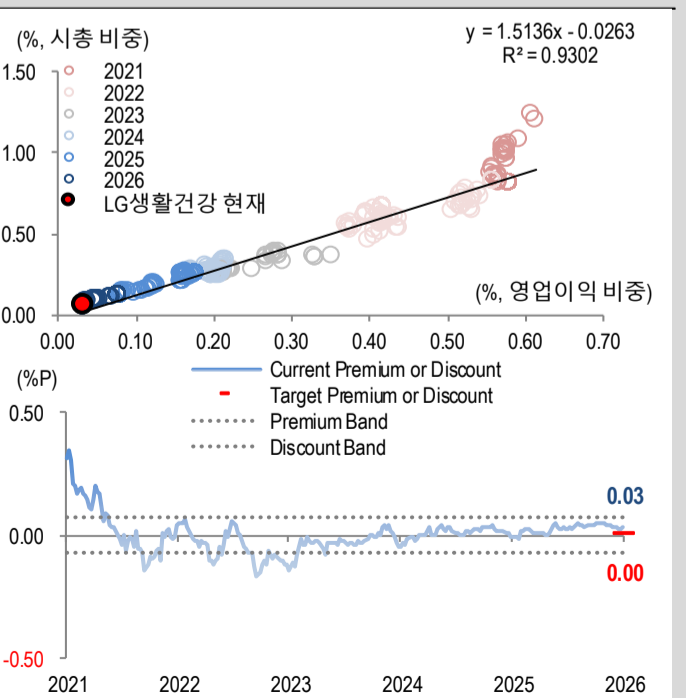
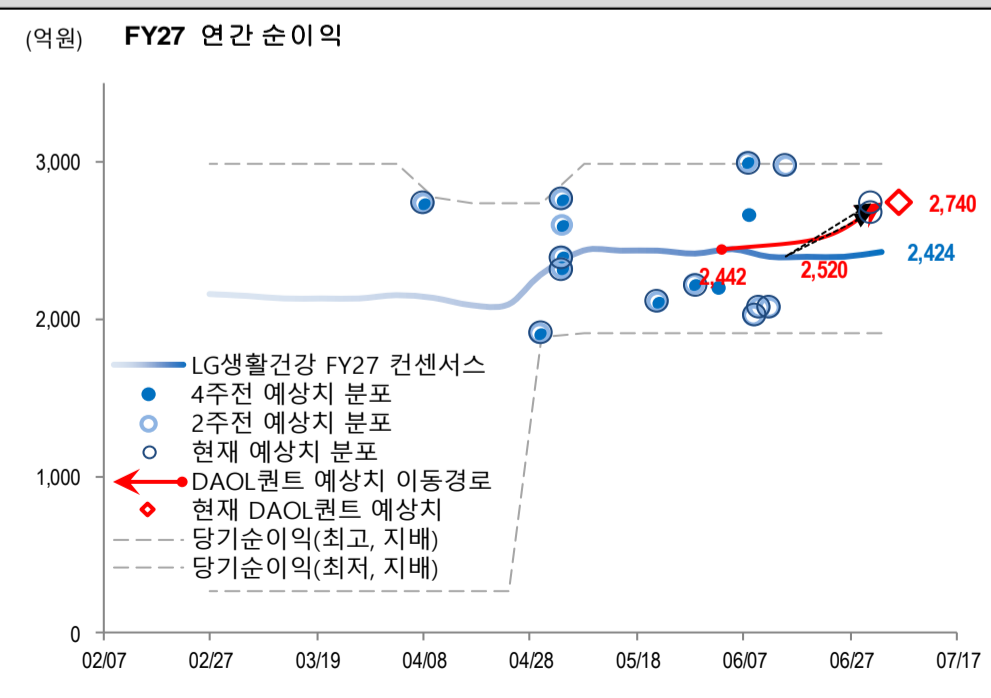
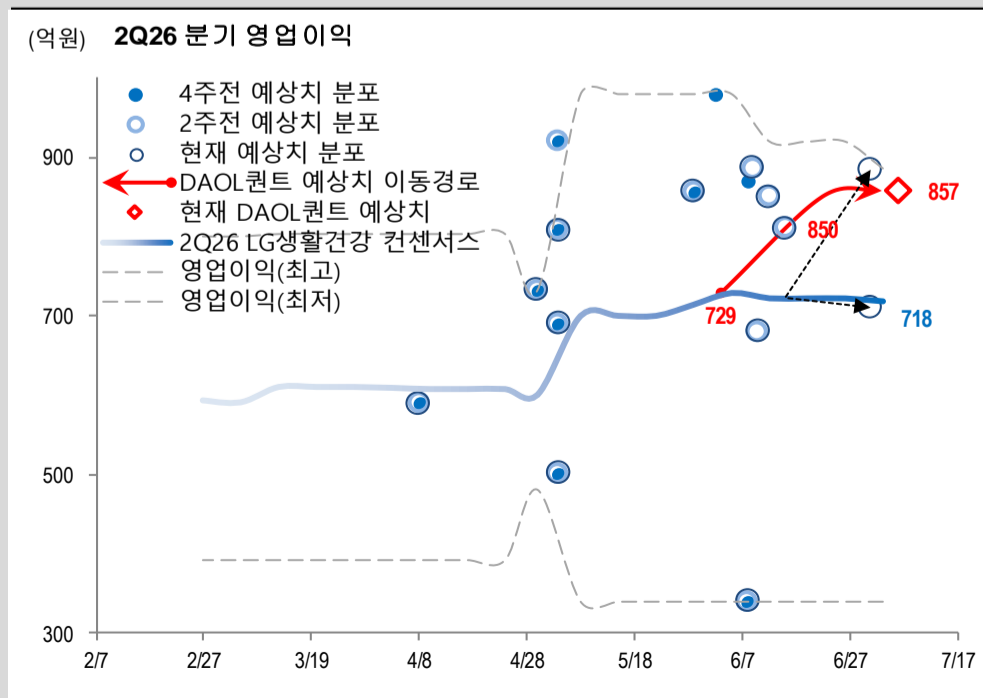
최근 예상치(날짜)	영업 이익	애널리스트	증권사
2026-07-03	1,150	최태용	DS투자증권
2026-06-29	1,130	임은영, 김현지	삼성증권



LG생활건강

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	718	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW (P, Rebased) 기관 OW/UW LG생활건강 주가(RHS) LG생활건강 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	886	
최저값	340	
실적발표일	2026-07-31	
DAOL퀀트 예상치	857	
Beator Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S Position	Long	

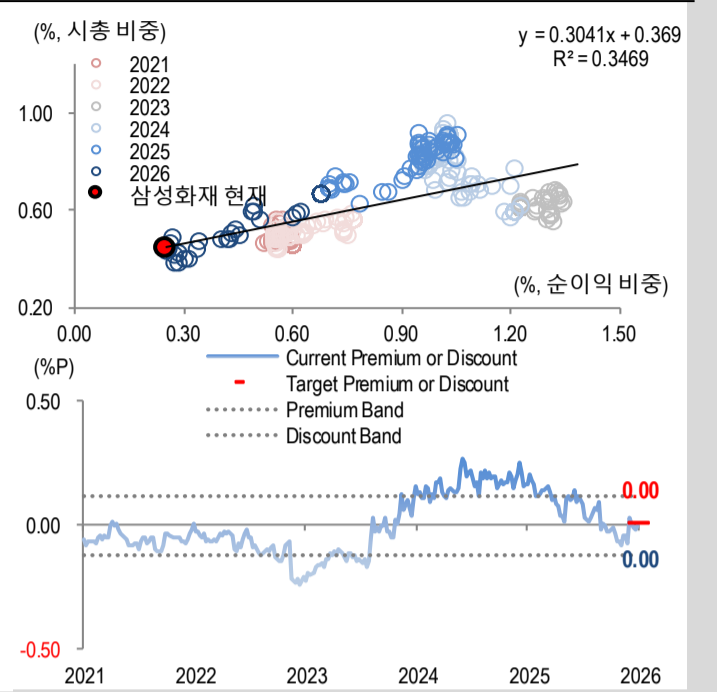
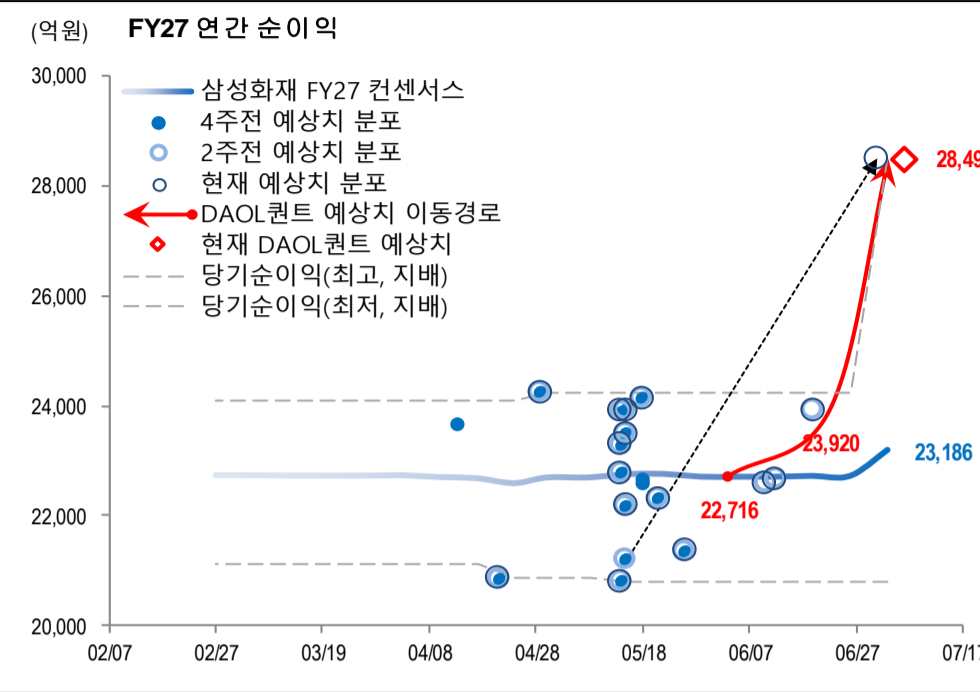
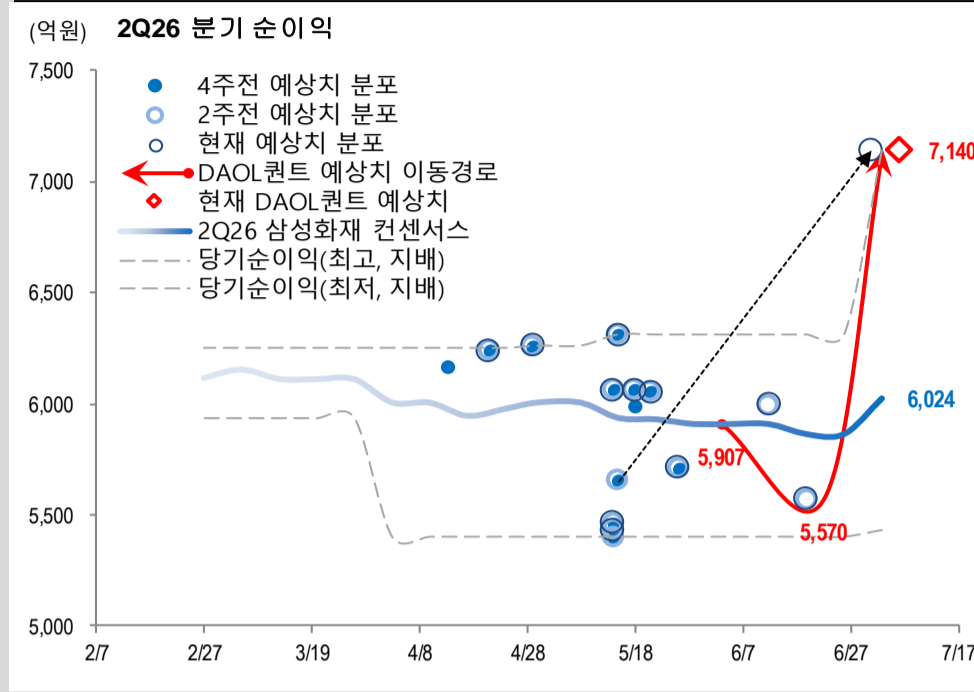
최근 예상치(날짜)	영업 이익	애널리스트	증권사
2026-07-01	883	박종대	하나증권
2026-07-01	710	김지은	BNK투자증권



삼성화재

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	6,024	
최대값	7,140	
최저값	5,430	
실적발표일	2026-08-13	
DAOL퀀트 예상치	7,140	
Beator Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S PosFinanceion	Long	

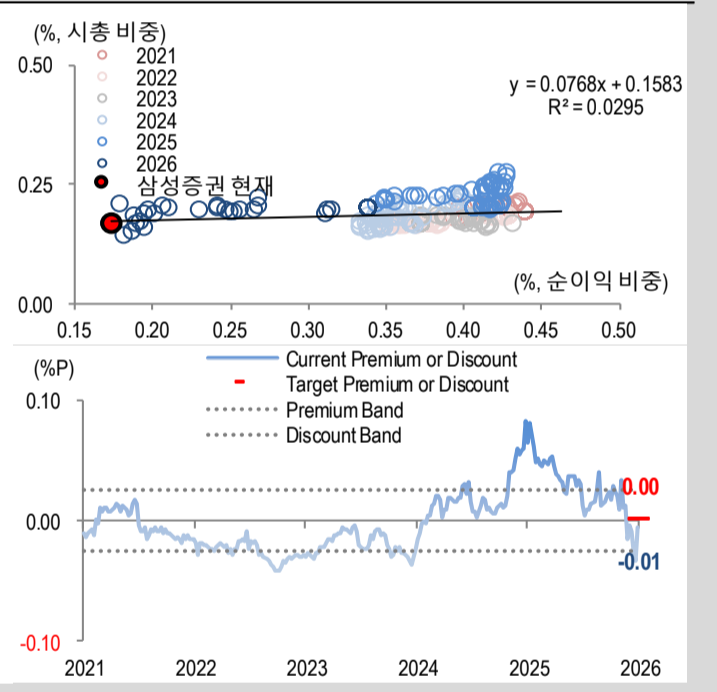
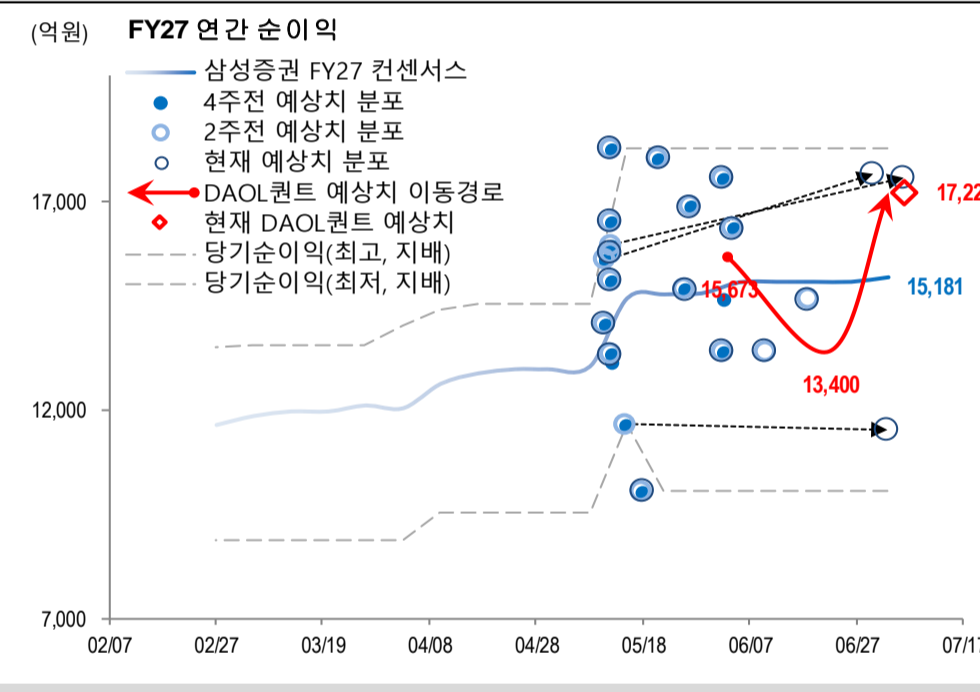
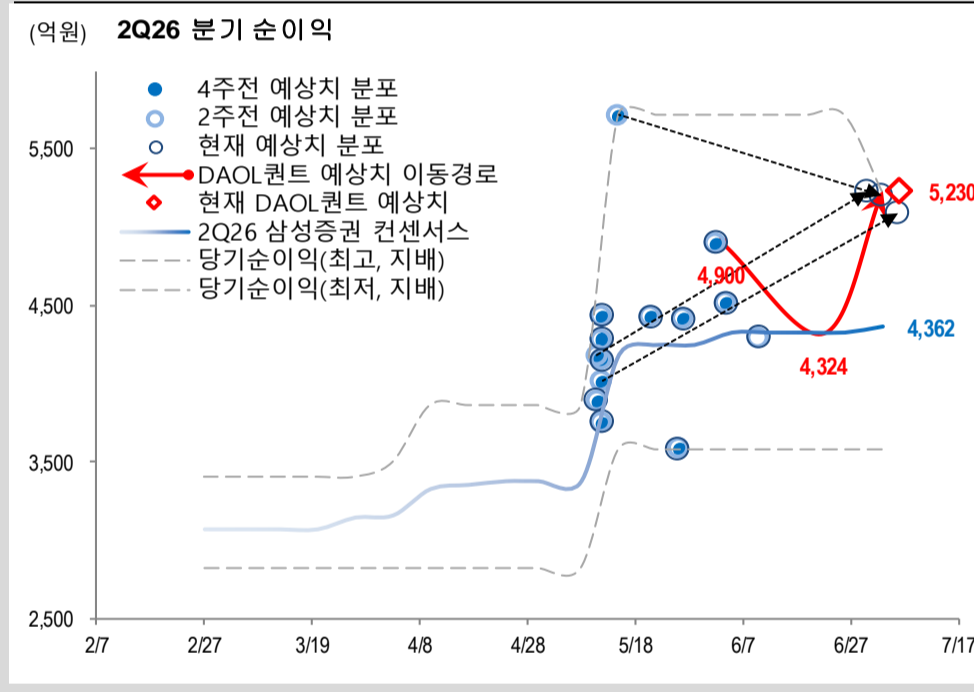
최근 예상치(날짜)	순이익	애널리스트	증권사
2026-07-01	7,140	정준섭	NH투자증권



삼성증권

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	4,362	
최대값	5,230	
최저값	3,580	
실적발표일	2026-08-10	
DAOL퀀트 예상치	5,230	
Beator Miss	Surprise	
Valuation	Fair	
L/S PosFinanceion	Long	

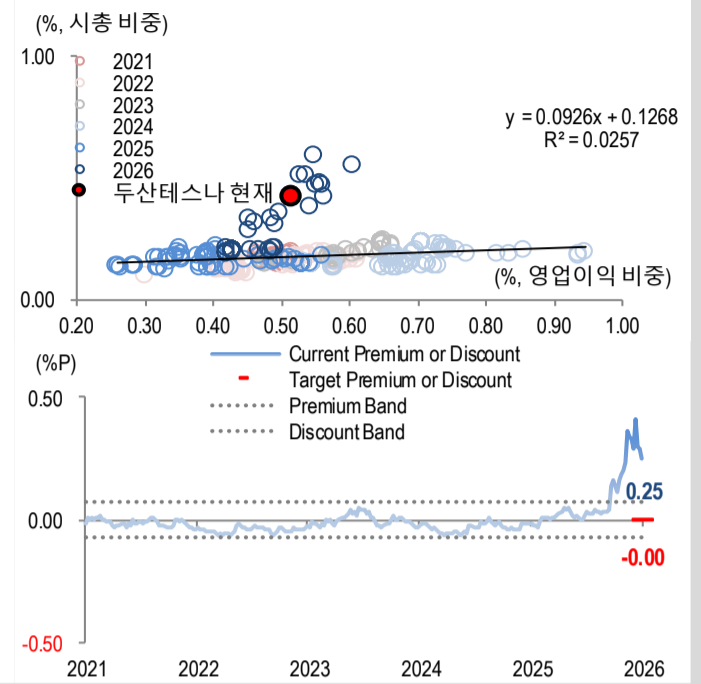
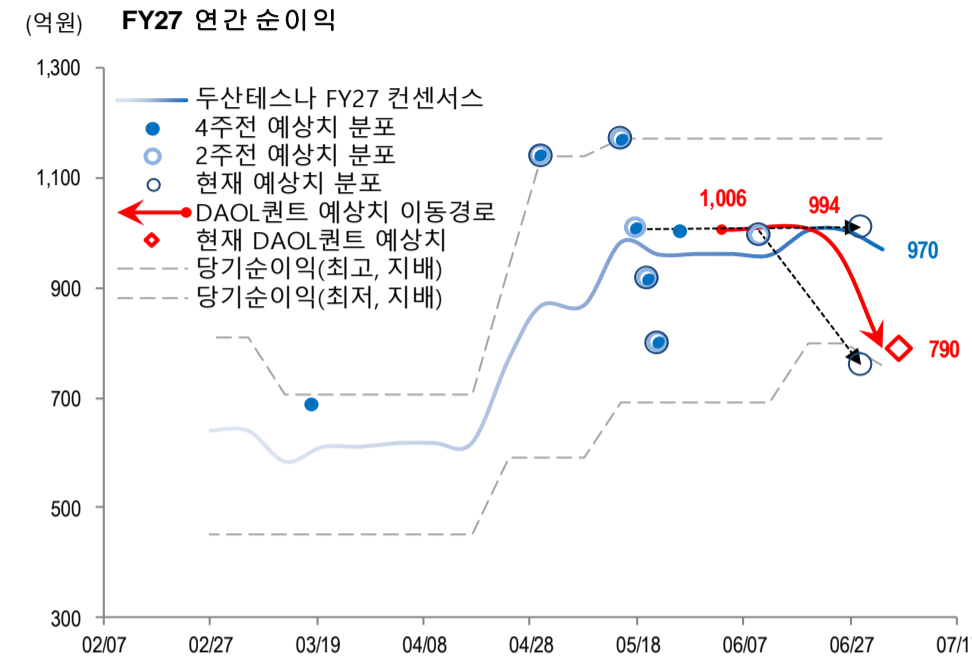
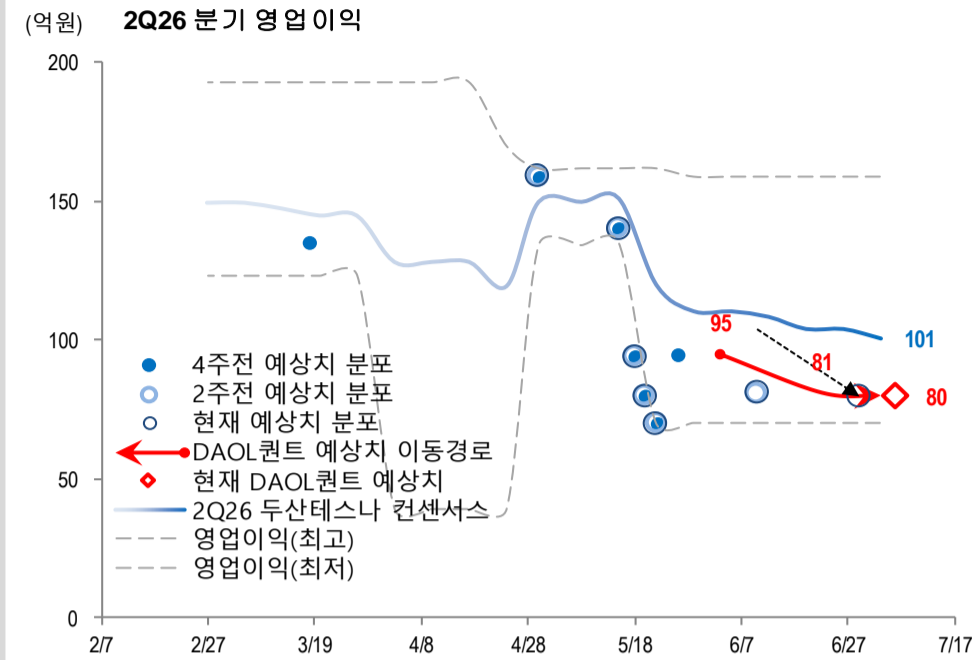
최근 예상치(날짜)	순이익	애널리스트	증권사
2026-07-06	5,093	설용진	IM증권
2026-07-03	5,200	정태준	미래에셋증권
2026-06-30	5,230	강승건, 이광준	KB증권



두산테스나

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	101	(시장대비 수급) 기관 OW/UW (P, Rebased) 외국인 OW/UW 두산테스나 주가(RHS) 두산테스나 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	159	
최저값	70	
실적발표일		
DAOL퀀트 예상치	80	
Beator Miss	0	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	Conviction Short	

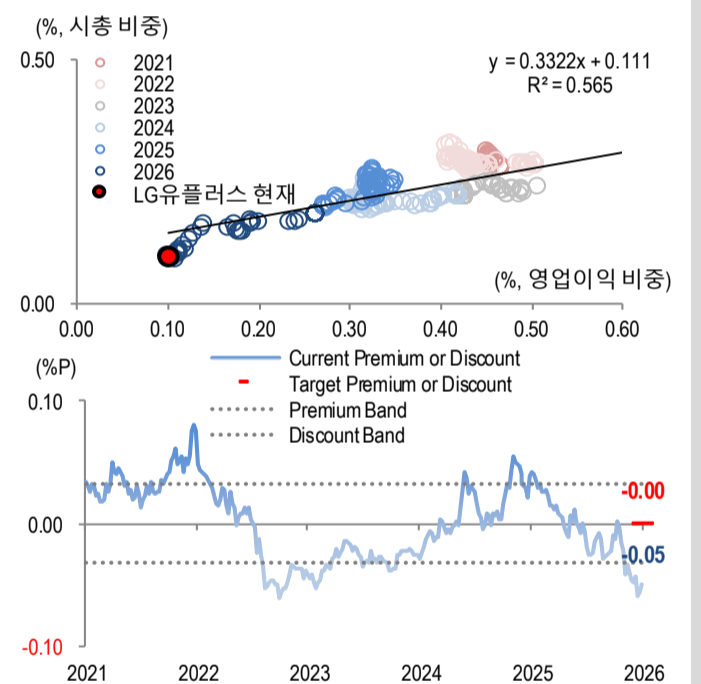
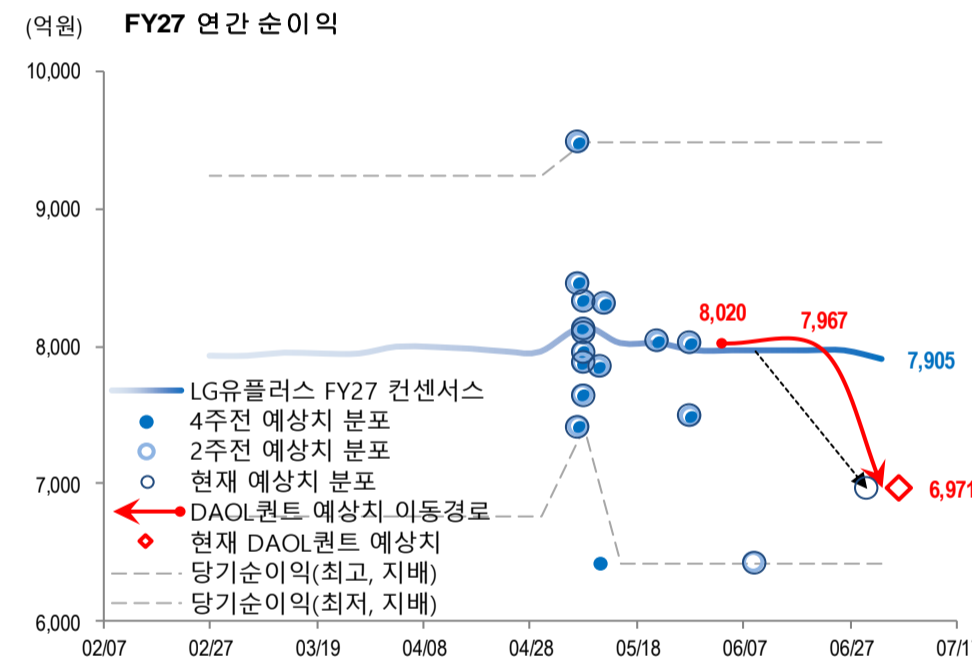
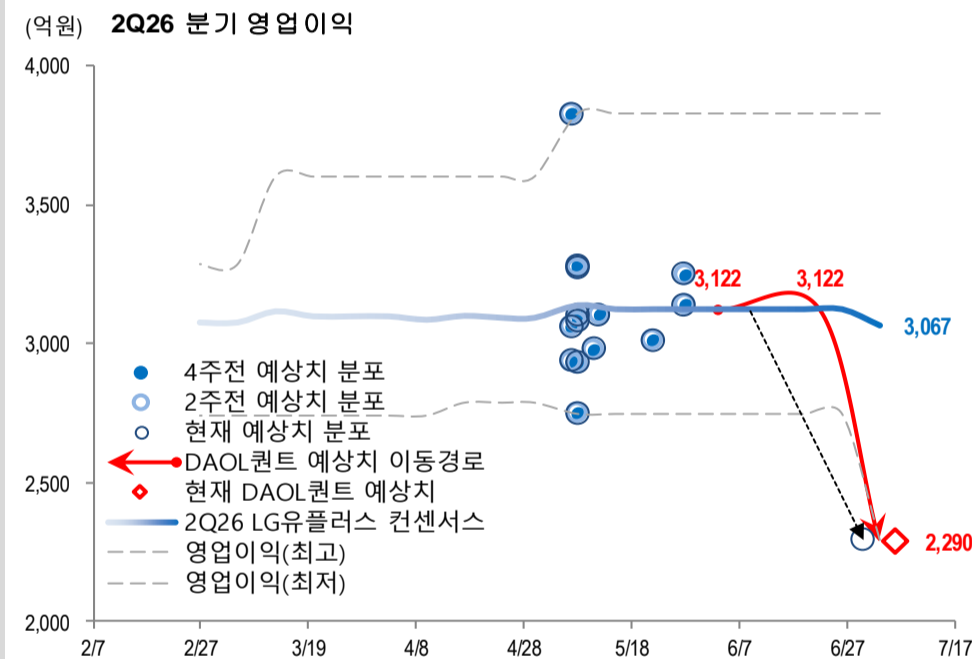
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-06-29	80	서승연	DB증권



LG유플러스

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	3,067	(시장대비 수급) 기관 OW/UW (P, Rebased) 외국인 OW/UW LG유플러스 주가(RHS) LG유플러스 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	3,827	
최저값	2,290	
실적발표일	2026-08-10	
DAOL퀀트 예상치	2,290	
실적 Beat or Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S Position	Short	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-06-30	2,290	이다연	다음투자증권



와이지엔터테인먼트

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	115	(시장대비 수급) 기관 OW/UW (P, Rebased) 외국인 OW/UW 와이지엔터테인먼트 주가(RHS) 와이지엔터테인먼트 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	239	
최저값	47	
실적발표일	2026-08-10	
DAOL퀀트 예상치	80	
실적 Beat or Miss	Shock	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Short	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-02	80	이기훈, 김현수	하나증권

