

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

7월 4주차 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) 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 4주차] 1) 월간 추정치 조정률 2) 최저 추정치 조정률 3) 최저/최고 괴리율 스코어 상위 30% 중 괴리율 축소 종목 스크리닝

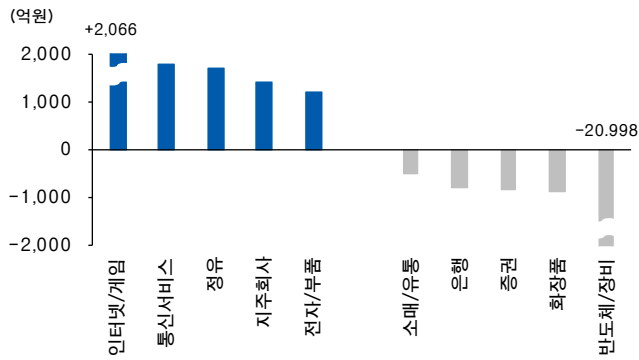
종목명	업종	시가총액 (억원)	2Q26 영업이익의 추정치(억원)		2Q26 최저 영업이익의 추정치(억원)		최고/최저 추정치 괴리율(%)	
			6/22일 기준	7/22일 기준	6/22일 기준	7/22일 기준	6/22일 기준	7/22일 기준
LG이노텍	IT하드웨어	153,126	1,586	2045.9	1,410.0	1,912	43.8	28.1
GKL	호텔, 레저서비스	5,678	203	247.0	180.0	239	22.8	5.4
심텍	IT하드웨어	36,565	456	477.8	420.0	455	17.1	10.8
대덕전자	IT하드웨어	58,806	610	658.5	570.0	615	14.0	11.1
한국전력	유틸리티	217,626	17,766	19714.4	6,240.0	18,100	535.6	29.9
에스티팜	건강관리	23,590	179	217.0	155.0	207	30.3	14.0
신세계	소매(유통)	51,665	1,538	1559.8	1,184.0	1,416	44.4	17.2
한화솔루션	에너지	46,669	1,571	2281.5	408.0	2,256	478.4	2.3
LIG디펜스엔에어로스페이스	상사, 자본재	146,740	1,030	1175.4	797.0	987	64.4	30.1
삼성물산	상사, 자본재	574,073	8,611	8689.0	8,120.0	8,370	13.0	9.6
NHN	소프트웨어	11,824	429	435.0	370.0	413	36.2	14.0
휴젤	건강관리	27,253	501	510.6	486.0	501	7.0	5.6
롯데쇼핑	소매(유통)	38,020	1,139	1172.2	1,000.0	1,050	34.0	27.6
한국콜마	화장품, 의류, 완구	23,204	938	952.1	880.0	903	14.8	10.3
오리온	필수소비재	50,834	1,339	1342.4	1,287.0	1,320	7.2	5.3
솔브레인	반도체	21,508	438	454.7	403.0	444	16.6	3.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +5.3 조원 순매수, 기관은 약 -1.3 조원 순매도를 기록
- 올해 지속되던 개인 매수 / 외국인+기관 매도 흐름이 반전되었으며 외국인이 반도체/장비 업종을 중심으로 강한 매수세로 전환. 다만, 기관의 경우 이번주 반도체/장비 업종을 약 -2.1조원 순매도

기관 주간 순매수 상/하위 업종

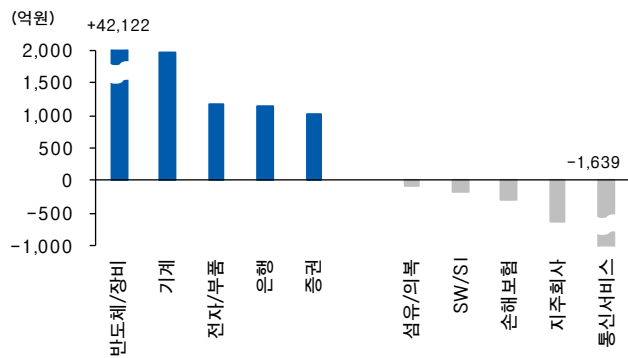


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	2,066	3,022	7,159	
2	통신서비스	1,788	2,341	19	
3	정유	1,687	6,096	3,893	
4	지주회사	1,420	3,314	-4,207	
5	전자/부품	1,198	-369	-1,494	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-20,998	-6,947	134,569	
2	화장품	-914	2,958	800	
3	증권	-835	3,196	-6,021	
4	은행	-805	11,396	11,156	
5	소매/유통	-531	-2,686	-2,653	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

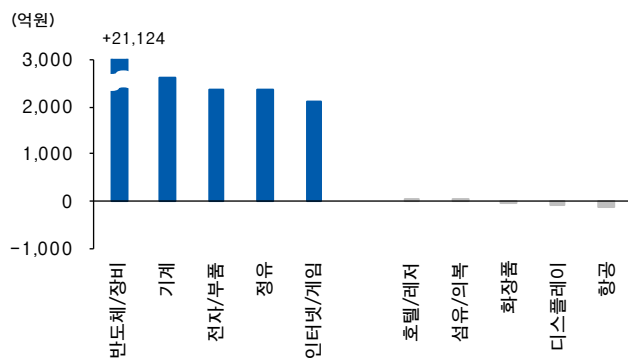


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	42,122	-267,794	-862,514	
2	기계	1,957	-2,915	-26,100	
3	전자/부품	1,174	11,220	-22,356	
4	은행	1,140	-5,753	-2,880	
5	증권	1,027	768	320	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	통신서비스	-1,639	-372	-4,258	
2	지주회사	-633	-761	6,948	
3	손해보험	-297	-2,130	1,532	
4	SW/SI	-184	414	-3,153	
5	섬유/의복	-81	-108	503	

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	21,124	-274,742	-727,945	
2	기계	2,610	-1,835	-30,120	
3	전자/부품	2,372	10,851	-23,851	
4	정유	2,350	6,415	8,838	
5	인터넷/게임	2,102	5,531	13	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	항공	-123	1,788	5,608	
2	디스플레이	-106	-896	-143	
3	화장품	-37	3,445	825	
4	섬유/의복	4	222	439	
5	호텔/레저	10	-599	286	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/23일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	29,440	433	0.44
A017670	SK텔레콤	통신서비스	213,716	1,683	0.22
A035420	NAVER	인터넷/게임	345,277	2,064	0.17
A071970	HD현대마린엔진	기계	22,965	130	0.16
A096770	SK이노베이션	정유	223,488	1,283	0.16
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	13,935	83	0.16
A214450	파마리서치	의료기기	37,403	187	0.13
A047810	한국항공우주	방위산업	159,957	706	0.12
A010060	OCI홀딩스	화학	46,115	157	0.10
A005830	DB손해보험	손해보험	108,338	357	0.08

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	29,440	286	0.29
A161890	한국콜마	화장품	24,172	258	0.27
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	36,266	276	0.19
A034230	파라다이스	호텔/레저	9,430	67	0.18
A069960	현대백화점	소매/유통	30,105	210	0.18
A073240	금호타이어	자동차부품	18,500	120	0.17
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,129	60	0.16
A375500	DL이앤씨	건설	25,460	133	0.14
A120110	코오롱인더	화학	16,830	77	0.12
A047040	대우건설	건설	67,142	283	0.11

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	29,440	719	0.7
A096770	SK이노베이션	정유	223,488	1,896	0.2
A214450	파마리서치	의료기기	37,403	298	0.2
A073240	금호타이어	자동차부품	18,500	125	0.2
A375500	DL이앤씨	건설	25,460	146	0.2
A112610	씨에스원드	기계	18,787	101	0.1
A035420	NAVER	인터넷/게임	345,277	1,714	0.1
A204320	HL만도	자동차부품	22,187	114	0.1
A047040	대우건설	건설	67,142	309	0.1
A120110	코오롱인더	화학	16,830	74	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	13,676,758	11,570.5	-175,469	-406,053
A005930	삼성전자	반도체/장비	15,784,952	13,328.5	-94,727	-314,212
A042660	한화오션	조선	275,466	428.3	-3,630	-4,988
A010120	LS ELECTRIC	기계	335,250	770.7	-1,213	-12,829
A298040	효성중공업	기계	267,242	233.7	-1,184	-5,616
A009830	한화솔루션	화학	51,568	120.8	-1,161	-542
A028260	삼성물산	지주회사	583,803	308.3	-513	559
A073240	금호타이어	자동차부품	18,500	124.6	-651	-935
A267260	HD현대일렉트릭	기계	313,250	342.0	-393	-4,595
A373220	LG에너지솔루션	2차전지	814,320	202.4	-347	2,345

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/23일 기준

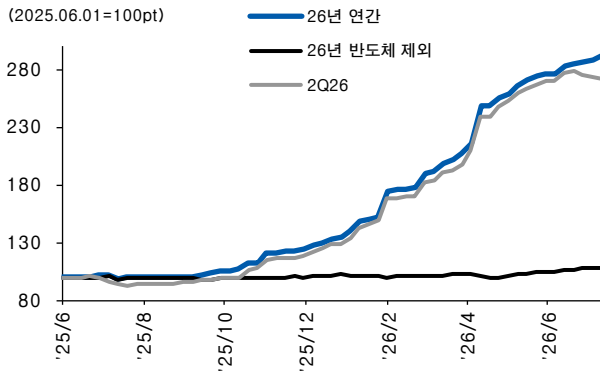
업종별

종목별

주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.1% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 +0.2% 상향 조정
- '26년 2분기 추정치는 7월 이후 우하향 추세를 나타내는 상황 속 손해보험(+8.8%), 증권(+6.4%), 상사(+6.2%), 2차전지(+4.0%), 제약/바이오(+3.8%) 등의 업종은 추정치 상향 조정 진행

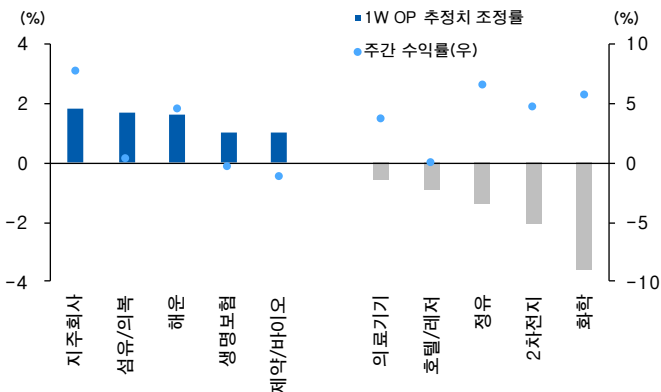
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

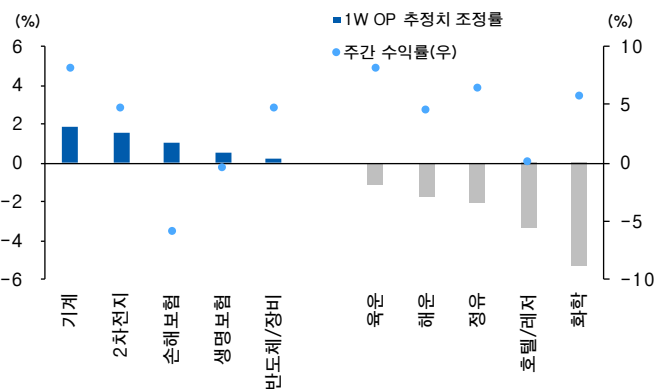


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	지주회사	402,251	1.8	7.7	
2	섬유/의복	23,269	1.7	0.4	
3	해운	20,876	1.6	4.5	
4	생명보험	44,090	1.0	-0.4	
5	제약/바이오	59,480	1.0	-1.2	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	39,431	-3.6	5.7	
2	2차전지	12,332	-2.1	4.7	
3	정유	94,351	-1.4	6.5	
4	호텔/레저	9,234	-0.9	0.0	
5	의료기기	5,662	-0.6	3.6	

26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

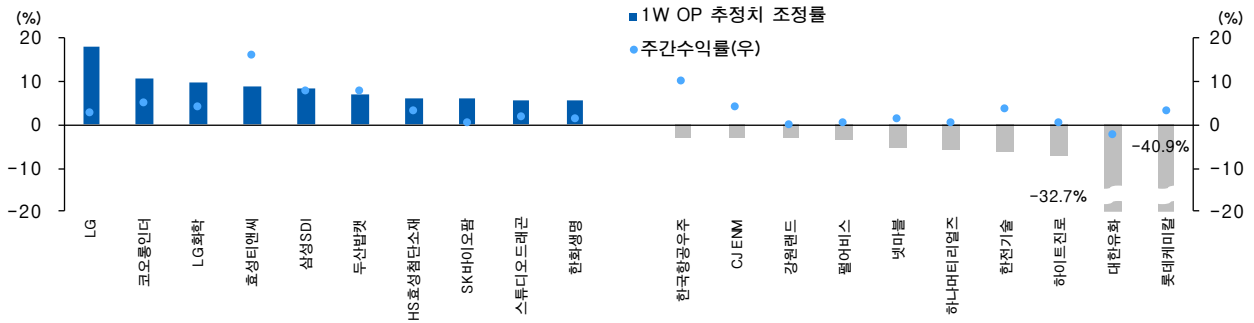
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	기계	18,525	1.9	8.1	
2	2차전지	1,715	1.6	4.7	
3	손해보험	21,401	1.0	-5.8	
4	생명보험	11,655	0.5	-0.4	
5	반도체/장비	1,494,434	0.3	4.8	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	12,305	-5.3	5.7	
2	호텔/레저	2,165	-3.4	0.0	
3	정유	26,449	-2.0	6.5	
4	해운	5,818	-1.8	4.5	
5	육운	5,921	-1.1	8.2	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 7/22일 추정치 기준(수익률 7/23일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

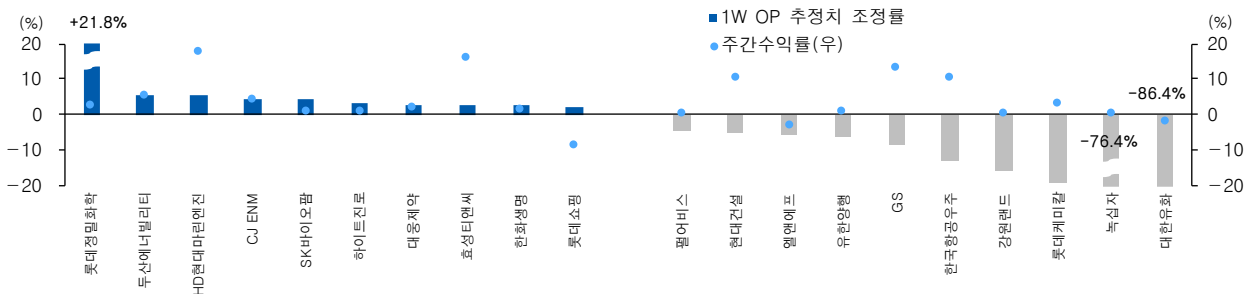


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A003550	LG	지주회사	15,440	17.9	2.8	1	A011170	롯데케미칼	화학	3,086	-40.9	3.0
2	A120110	코오롱인더	화학	2,469	10.6	4.9	2	A006650	대한유화	화학	1,588	-32.7	-2.3
3	A051910	LG화학	화학	11,239	9.8	4.2	3	A000080	하이트진로	음식료	1,899	-7.3	0.5
4	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	4,887	9.1	15.8	4	A052690	한전기술	전기	680	-6.2	3.7
5	A006400	삼성SDI	2차전지	1,146	8.5	7.5	5	A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	944	-5.8	0.2
6	A241560	두산밥캣	기계	8,565	7.2	7.8	6	A251270	넷마블	인터넷/게임	3,403	-5.4	1.4
7	A298050	HS효성첨단소재	화학	2,071	6.2	3.3	7	A263750	풀어비스	인터넷/게임	4,691	-3.7	0.3
8	A326030	SK하이오파	제약/바이오	3,455	6.1	0.4	8	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,439	-3.3	-0.1
9	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	490	5.7	2.0	9	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	1,339	-3.1	3.9
10	A088350	한화생명	생명보험	8,600	5.6	1.2	10	A047810	한국항공우주	방위산업	3,729	-3.0	10.0

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

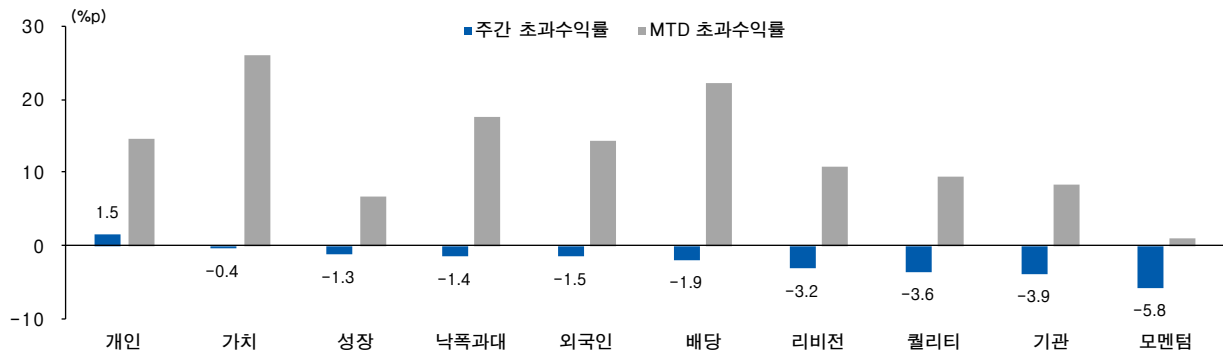
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A004000	롯데정밀화학	화학	481	21.8	2.5	1	A006650	대한유화	화학	93	-86.4	-2.3
2	A034020	두산에너빌리티	기계	2,774	5.3	5.0	2	A006280	녹십자	제약/바이오	47	-76.4	0.2
3	A071970	HD현대마린엔진	기계	379	5.1	17.5	3	A011170	롯데케미칼	화학	885	-19.6	3.0
4	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	310	4.1	3.9	4	A035250	강원랜드	호텔/레저	360	-16.3	-0.1
5	A326030	SK하이오파	제약/바이오	859	4.1	0.4	5	A047810	한국항공우주	방위산업	607	-13.4	10.0
6	A000080	하이트진로	음식료	606	3.3	0.5	6	A078930	GS	지주회사	11,590	-8.4	13.0
7	A069620	대웅제약	제약/바이오	688	2.7	1.6	7	A000100	유한양행	제약/바이오	623	-6.4	0.8
8	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	1,579	2.5	15.8	8	A066970	엘앤에프	2차전지	401	-5.9	-3.2
9	A088350	한화생명	생명보험	2,490	2.5	1.2	9	A000720	현대건설	건설	2,142	-5.4	10.0
10	A023530	롯데쇼핑	소매/유통	1,172	2.2	-8.9	10	A263750	풀어비스	인터넷/게임	1,243	-4.8	0.3

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 7/22일 추정치 기준(수익률 7/23일 기준)

업종별

종목별

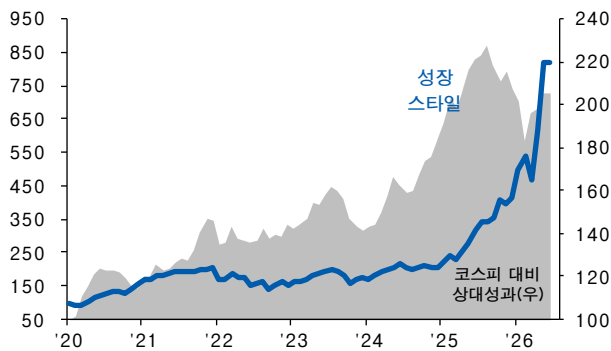
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
60.0	0.9

(2020.01.31=100pt)



성장 스코어 Top 10

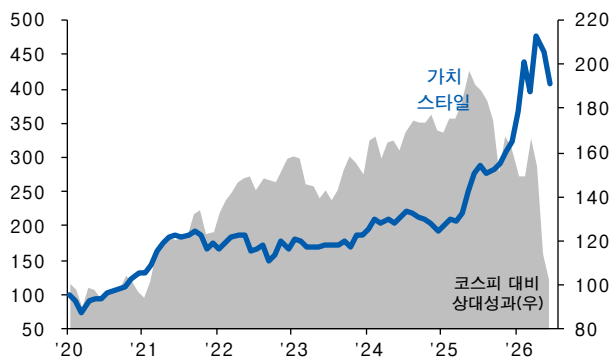
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.8	9.8	9.7	29.2	5.9
A353200	대덕전자	8.1	9.5	9.0	26.6	-10.7
A009150	삼성전기	7.7	8.8	8.5	25.0	13.4
A267270	HD건설기계	8.3	8.2	7.8	24.3	7.7
A298040	효성중공업	7.7	8.1	8.2	24.0	2.8
A010120	LS ELECTRIC	7.9	7.8	7.8	23.6	17.6
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.7	5.4	23.0	0.2
A278470	에이피알	9.6	8.4	4.8	22.7	-5.9
A006260	LS	7.4	7.4	7.9	22.7	11.6
A000660	SK하이닉스	9.8	6.4	6.4	22.5	4.2

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	-5.3
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.5	29.3	3.0
A108670	LX하우시스	9.8	9.5	9.8	29.1	4.0
A088350	한화생명	9.1	9.8	9.8	28.7	1.2
A036460	한국가스공사	8.8	9.8	10.0	28.5	6.2
A001450	현대해상	9.8	8.7	9.6	28.1	0.8
A097950	CJ제일제당	8.8	9.3	9.8	27.9	2.9
A000120	CJ대한통운	8.7	9.5	9.5	27.8	5.8
A139130	iM금융지주	9.2	9.2	9.1	27.6	-2.6
A078930	GS	9.6	9.3	8.5	27.4	13.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

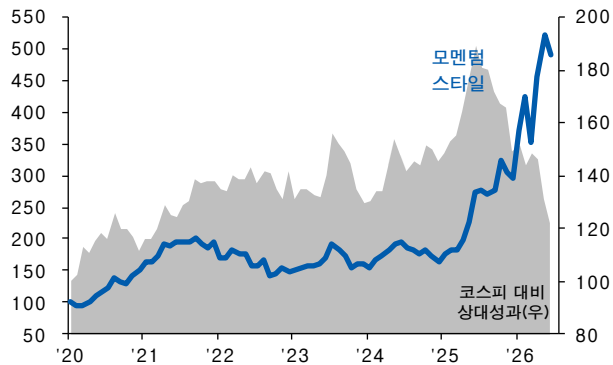
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

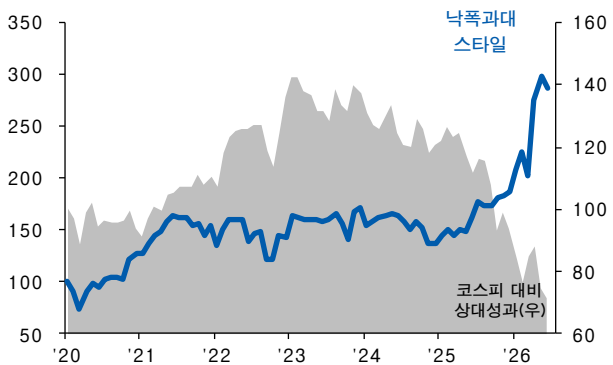
(2020.01.31=100pt)



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	4.2
A222800	심텍	9.8	9.8	9.6	9.7	38.8	-8.5
A034730	SK	9.8	9.7	9.7	9.5	38.6	12.9
A004170	신세계	9.9	9.7	9.6	9.5	38.6	-7.6
A009150	삼성전기	8.7	10.0	10.0	10.0	38.5	13.4
A240810	원익IPS	9.9	9.1	9.4	9.7	38.0	-19.5
A036930	주성엔지니어링	8.4	9.9	9.9	9.8	37.9	-12.8
A069960	현대백화점	10.0	9.6	9.2	9.0	37.7	-11.3
A005930	삼성전자	9.0	9.5	9.5	9.6	37.6	5.9
A032830	삼성생명	8.8	9.4	9.4	9.3	36.8	-0.5

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	2.0
A035760	CJ ENM	7.7	9.9	10.0	9.6	37.1	3.9
A293490	카카오게임즈	7.4	9.7	9.9	9.7	36.7	-0.8
A376300	디어유	6.1	9.4	9.8	10.0	35.2	2.0
A000100	유한양행	7.0	9.1	9.4	8.8	34.4	0.8
A039130	하나투어	6.9	8.4	9.4	9.3	34.0	2.3
A352820	하이브	5.5	9.7	9.7	8.8	33.6	1.2
A035720	카카오	7.2	8.8	9.7	7.9	33.6	3.5
A361610	SK아이이테크놀로지	6.6	8.8	9.3	8.2	32.9	3.0
A069620	대웅제약	5.8	9.4	9.3	8.3	32.8	1.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

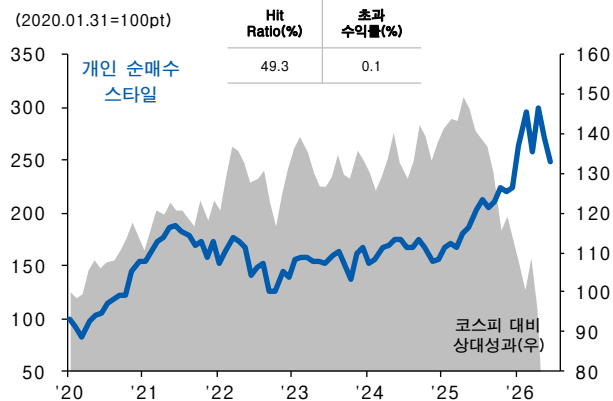
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

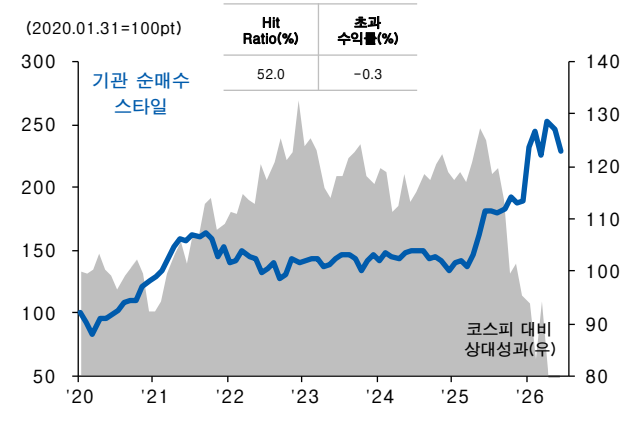


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	2.3
A005380	현대차	9.7	8.8	9.9	9.6	37.9	1.6
A066570	LG전자	10.0	9.8	9.4	8.7	37.9	4.7
A011790	SKC	9.6	9.6	9.0	9.1	37.2	3.1
A006360	GS건설	7.3	9.9	9.9	9.8	36.9	26.0
A035760	CJ ENM	7.9	10.0	9.4	9.4	36.5	3.9
A011070	LG이노텍	9.8	9.7	9.1	7.9	36.5	1.6
A012330	현대모비스	9.2	9.4	9.3	8.5	36.3	8.7
A010140	삼성중공업	9.2	9.6	8.6	8.4	35.8	6.1
A036930	주성엔지니어링	8.6	9.3	8.9	8.7	35.4	-12.8

기관 순매수 스타일 성과 추이

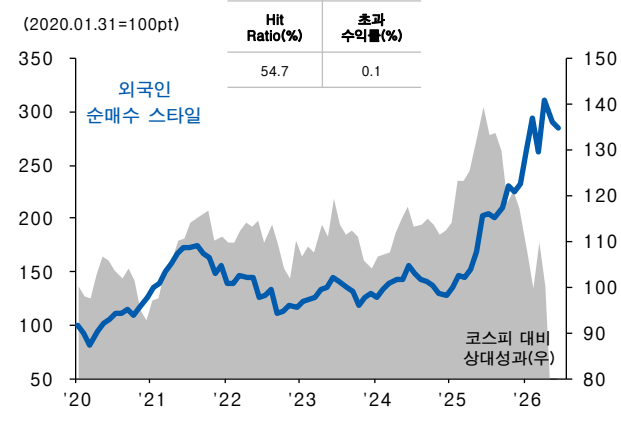


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A403870	HPSP	9.9	9.5	9.9	9.9	39.2	-6.7
A222800	심택	9.9	9.9	9.7	9.5	39.0	-8.5
A008770	호텔신라	9.3	10.0	9.8	9.7	38.7	-1.0
A030000	제일기획	10.0	9.8	8.5	8.4	36.5	1.0
A161890	한국콜마	9.8	9.9	9.9	6.8	36.3	-4.8
A336260	두산퓨얼셀	8.0	9.6	9.3	9.4	36.2	3.1
A240810	원익IPS	9.8	6.9	9.7	9.7	36.0	-19.5
A138930	BNK금융지주	9.6	8.9	8.0	9.4	35.9	-3.1
A007660	이수페타시스	9.6	9.4	9.0	7.2	35.2	1.5
A214320	이노션	8.3	9.7	8.8	8.3	35.1	4.4

외국인 순매수 스타일 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A282330	BGF리테일	9.8	9.3	9.9	9.9	38.8	-6.4
A120110	코오롱인더	9.7	9.9	9.5	9.3	38.3	4.9
A001120	LX인터내셔널	9.6	9.6	9.7	9.1	37.9	7.9
A241710	코스메카코리아	8.6	9.8	9.0	9.8	37.2	-1.7
A183300	코미코	9.9	9.4	9.1	8.7	37.0	-4.9
A298020	효성티앤씨	9.6	9.8	9.5	8.0	36.9	15.8
A003490	대한항공	9.5	8.9	9.6	8.8	36.7	-2.8
A195870	해성디에스	9.7	8.1	9.0	9.5	36.2	-5.5
A066970	엘앤에프	9.1	8.7	9.1	9.3	36.1	-3.2
A001430	세아베스틸지주	9.8	8.5	9.3	8.4	36.0	12.8

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

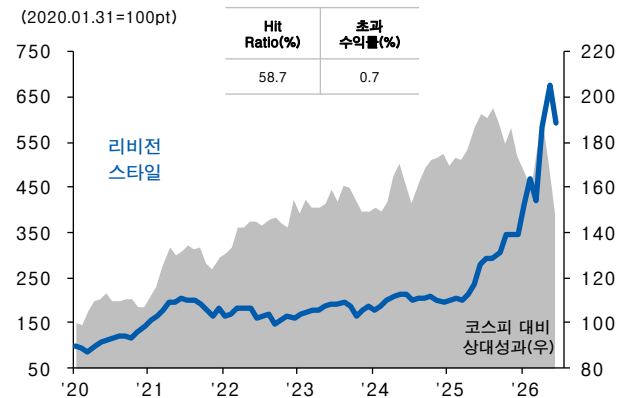
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

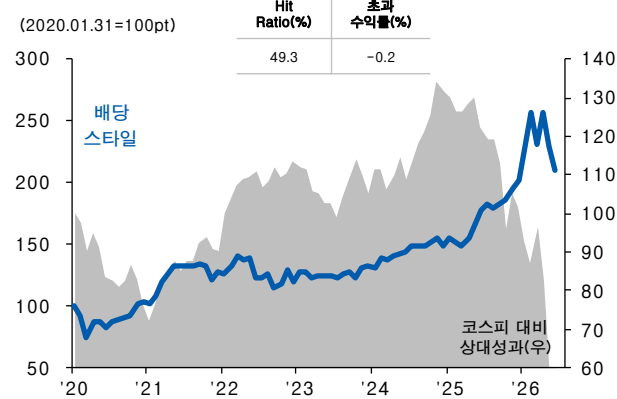


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.0	9.6	8.6	27.2	4.7
A010130	고려아연	8.5	8.9	9.4	26.9	1.4
A004170	신세계	8.2	9.2	9.3	26.7	-7.6
A000660	SK하이닉스	9.1	8.2	8.3	25.6	4.2
A003490	대한항공	8.8	9.5	6.9	25.1	-2.8
A006260	LS	8.4	8.7	7.7	24.8	11.6
A005940	NH투자증권	6.6	9.0	8.9	24.4	-3.2
A069960	현대백화점	6.3	8.8	8.9	24.0	-11.3
A006800	미래에셋증권	6.5	9.3	8.0	23.8	-2.1
A039490	키움증권	6.6	8.8	8.4	23.8	-2.3

배당 스타일 성과 추이

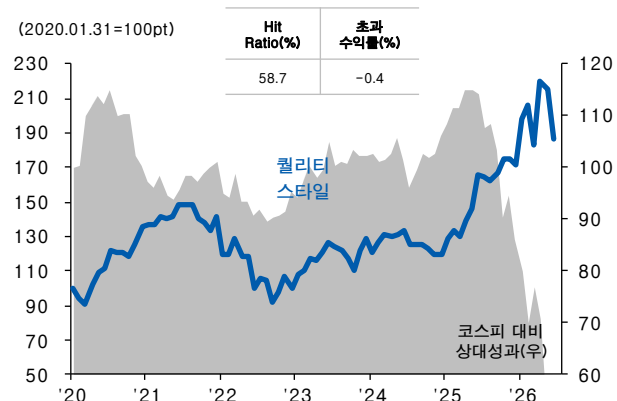


배당 스코어 Top 10

(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	1.0
A214320	이노션	8.3	9.8	9.3	9.8	37.2	4.4
A035250	강원랜드	8.7	9.9	8.5	9.8	36.9	-0.1
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.4	9.6	9.7	36.9	7.9
A005940	NH투자증권	8.0	9.2	9.9	9.6	36.6	-3.2
A032640	LG유플러스	8.4	9.5	8.9	8.9	35.8	1.2
A017670	SK텔레콤	9.4	9.0	9.1	7.8	35.3	10.9
A000080	하이트진로	9.7	8.5	8.1	8.9	35.1	0.5
A024110	기업은행	6.0	9.7	9.9	9.4	35.0	-2.5
A298020	효성티앤씨	9.9	7.8	9.3	7.9	34.9	15.8

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	-6.7
A058470	리노공업	9.8	9.8	9.7	8.9	38.1	2.2
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	37.9	4.2
A042700	한미반도체	9.6	8.7	9.5	9.6	37.4	-10.9
A214150	클래시스	8.3	9.7	9.6	9.2	36.8	0.3
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.6	9.6	36.6	0.4
A145020	휴젤	9.9	9.5	9.3	7.5	36.3	0.8
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.1	35.7	7.0
A376300	디어유	9.7	9.5	9.4	7.0	35.6	2.0
A383220	F&F	8.2	9.1	9.1	8.7	35.1	-3.3

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/23일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

수급

기타

Quant Weekly Evaluation Report

- 이 자료에 게재된 내용들은 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인함. (작성자: 신현용)
- 당사는 동 자료를 전문투자자 및 제3자에게 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 투자사결정은 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.