

* 애널리스트 커버리지 7명 이상 유니버스

2Q26 실적발표 전 5일을 위한 Active Quant의 定石

6번째 업데이트 (7.27 ~ 7.31)

"공시 확정치" 존재시 "시장 예상치" 수치는 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	▲ 1,082,014	▲ 1,136,818	▼ 848,367	▼ 894,000	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
SK하이닉스	7/29	▼ 604,220	▲ 642,327	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
삼성전기	7/30	▲ 4,390	▼ 4,061	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
LG에너지솔루션	5/15	▼ 2,230	▲ 4,600	▼ 1,883	▼ 1,133	Short	Undervalued	Negative	Negative	Neutral
삼성SDI	7/31	▲ 950	▼ -356	미발표		No Position	Fair	Positive	Positive	Positive
LG전자	7/7	▼ 10,551	▼ 9,252	▼ 10,580	▲ 15,788	No Position	Overvalued	Positive	Positive	Positive
LG이노텍	7/23	▼ 2,449	▼ 1,823	미발표		No Position	Overvalued	Positive	Positive	Positive
삼성에스디에스	7/24	▲ 2,418	▼ 2,368	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
현대오트티브	5/15	▼ 700	▲ 764	미발표		No Position	Fair	Neutral	Negative	Neutral
에코프로비엠	5/15	▲ 280	▼ 239	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Neutral	Positive
이수퍼타시스	8/14	▼ 776	▼ 751	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
LG씨엔에스	7/23	▼ 1,220	▲ 1,377	미발표		No Position	Fair	Negative	Negative	Neutral
대덕전자	5/15	▲ 683	▼ 640	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
리노공업	8/13	▲ 702	▼ 660	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
LG디스플레이	7/24	▲ 4,170	▲ 4,509	▼ -952	▼ -1,077	No Position	Undervalued	Neutral	Negative	Negative
심텍	5/15	▲ 504	▼ 473	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Positive	Neutral
엘앤에프	7/30	▼ 280	▲ 468	미발표		No Position	Overvalued	Negative	Negative	Negative
테스	8/14	▼ 261	▲ 264	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
ISC	7/30	▼ 216	▲ 217	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
솔브레인	5/15	▲ 460	▼ 444	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
롯데에너지머티리얼즈	8/6	▼ -201	▼ -176	미발표		No Position	Fair	Negative	Negative	Negative
두산테스나	5/15	▼ 78	▲ 100	미발표		No Position	Overvalued	Negative	Neutral	Negative
파크시스템스	8/6	▲ 107	▼ 91	미발표		No Position	Overvalued	Positive	Neutral	Neutral
SK아이이테크놀로지	5/15	▼ -725	▲ -664	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Positive	Positive
해성디에스	8/6	▼ 203	▲ 225	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
NHN	8/12	▲ 464	▲ 429	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
인텔리안테크	8/14	▼ 83	▼ 82	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
티엘비	5/15	▼ 147	▼ 128	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Neutral	Neutral
비에이치	8/4	▼ 137	▼ 134	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
Communication Service										
NAVER	8/7	▼ 5,550	▲ 5,660	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
SK텔레콤	8/6	▲ 5,512	▼ 5,470	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
카카오	8/6	▲ 2,450	▼ 2,263	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Negative
KT	8/11	▼ 5,260	▲ 6,035	미발표		No Position	Fair	Negative	Negative	Negative
크래프톤	7/29	▲ 4,700	▼ 3,750	미발표		Long	Fair	Positive	Positive	Positive
하이브	5/15	▼ 1,478	▲ 1,551	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
LG유플러스	8/10	▲ 3,252	▼ 3,103	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Negative
NC	8/12	▼ 1,285	▲ 1,319	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Positive
넷마블	8/7	▼ 768	▲ 889	미발표		Short	Undervalued	Negative	Negative	Neutral
펄어비스	5/15	▼ 1,054	▲ 1,423	미발표		No Position	Undervalued	Negative	Neutral	Neutral
제일기획	7/27	▲ 1,009	▲ 1,038	▼ 936	▼ 927	No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
시프트업	5/15	▼ 272	▼ 277	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
JYP Ent.	8/13	▼ 332	▲ 383	미발표		Short	Undervalued	Negative	Negative	Negative
에스엠	8/6	▲ 553	▼ 524	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
더블유게임즈	8/13	▼ 689	▲ 700	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
와이즈엔터테인먼트	8/10	▼ 71	▲ 88	미발표		No Position	Undervalued	Negative	Negative	Negative
이노션	8/7	▲ 437	▼ 419	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
CJ ENM	8/7	▼ 279	▼ 311	미발표		No Position	Undervalued	Negative	Negative	Neutral
스튜디오드래곤	5/15	▲ 167	▼ 148	미발표		No Position	Fair	Positive	Positive	Neutral
SOOP	7/29	▼ 238	▲ 256	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Negative	Neutral
디어유	5/15	▼ 96	▲ 103	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
네오위즈	8/7	▼ 89	▼ 95	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
컴투스	8/12	▼ 22	▲ 69	미발표		No Position	Undervalued	Negative	Negative	Neutral
Consumer Discretionary										
현대차	7/24	▲ 30,355	▲ 31,659	▲ 29,940	▼ 28,509	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
기아	7/27	▼ 26,820	▲ 27,935	▲ 27,935	▼ 26,286	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
현대모비스	7/27	▼ 8,951	▲ 9,647	▼ 9,075	▲ 9,752	No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
에이피알	8/6	▲ 1,830	▼ 1,781	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Positive	Neutral
한국타이어앤테크놀로지	8/14	▲ 5,553	▼ 5,323	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
신세계	8/10	▲ 1,639	▼ 1,528	미발표		Long	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
아모레퍼시픽	8/3	▲ 988	▼ 983	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
롯데쇼핑	8/7	▼ 299	▲ 448	미발표		No Position	Fair	Negative	Neutral	Neutral
현대백화점	8/6	▲ 866	▼ 857	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
한온시스템	8/14	▼ 1,032	▲ 1,131	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
LG생활건강	7/31	▼ 460	▼ 752	미발표		No Position	Fair	Negative	Negative	Positive
영원무역	8/14	▲ 1,990	▼ 1,854	미발표		Long	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
강원랜드	7/29	▲ 508	▼ 491	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
F&F	5/15	▲ 1,033	▼ 983	미발표		Long	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
달바글로벌	5/15	▼ 390	▲ 408	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
에스엘	8/14	▼ 1,330	▲ 1,344	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
한국콜마	8/10	▼ 914	▲ 951	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
HL만도	7/27	▼ 950	▲ 1,022	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
이마트	8/13	▼ 170	▲ 563	미발표		No Position	Fair	Negative	Negative	Neutral
미스트홀딩스	8/14	▲ 2,310	▼ 2,162	미발표		Long	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
실리콘투	5/15	▲ 722	▼ 713	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
BGF리테일	8/7	▲ 776	▼ 760	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
GS리테일	8/10	▼ 1,009	▲ 1,013	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
호텔신라	7/22	▲ 648	▼ 580	미발표		No Position	Fair	Positive	Neutral	Neutral
코스맥스	8/11	▲ 710	▼ 694	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
현대위아	7/27	▼ 404	▲ 530	▲ 530	▲ 504	No Position	Fair	Negative	Negative	Neutral
금호타이어	7/30	▼ 1,410	▲ 1,481	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
파라다이스	8/7	▼ 387	▼ 472	미발표		No Position	Fair	Negative	Negative	Neutral
롯데관광개발	8/5	▲ 520	▼ 510	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
코스메카코리아	5/15	▲ 282	▼ 277	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
넥센타이어	7/30	▲ 414	▲ 471	미발표		No Position	Fair	Negative	Neutral	Neutral
GKL	8/7	▼ 252	▼ 226	미발표		Long	Fair	Positive	Positive	Positive
한세실업	8/14	▼ 200	▼ 184	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
Utility										
한국전력	8/12	▼ 19,041	▲ 19,612	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
한전기술	8/7	▼ 149	▼ 141	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
한국가스공사	8/10	▲ 5,115	▲ 4,305	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Positive	Positive
한전KPS	8/7	▼ 675	▼ 623	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral

* "공시 확정치" 수치가 뜬 종목들은 이번분기 실적을 공시했다는 의미로 다음분기 추정치 변화를 모델링

Quant Analyst 김 경 훈 (CAIA, FRM, CFA)						DAOL 다올투자증권				
02)2184-2330 / aimhigh2027@daolfn.com										
"공시 확정치" 존재시 "시장 예상치" 수치는 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	▼ 4,810	▲ 4,963	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
HD현대중공업	5/15	▼ 9,846	▲ 9,910	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
두산에너지빌리티	7/27	▼ 2,520	▲ 2,629	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
한화에어로스페이스	7/31	▼ 9,477	▲ 9,970	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
LS ELECTRIC	7/24	▲ 1,890	▲ 1,799	▼ 1,640	▲ 1,785	No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
HD현대일렉트릭	7/22	▲ 3,532	▼ 3,214	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
효성중공업	5/15	▲ 2,851	▼ 2,812	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
한화오션	7/15	▲ 5,818	▼ 5,335	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Positive	Neutral
HD한국조선해양	7/31	▼ 14,608	▲ 14,693	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
두산	7/27	▲ 4,590	▼ 4,572	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
삼성중공업	7/24	▲ 3,196	▲ 3,744	▲ 3,744	▼ 2,243	No Position	Fair	Negative	Neutral	Negative
현대로템	8/5	▲ 3,130	▲ 3,098	▲ 2,706	▼ 2,324	No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
HMM	8/13	▲ 4,180	▼ 3,788	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Positive	Positive
LIG디펜스엔에어로스페이스	8/7	▲ 1,259	▼ 1,090	미발표		Long	Overvalued	Positive	Neutral	Neutral
LG	8/14	▲ 4,161	▲ 4,161	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Negative	Negative
한국항공우주	7/29	▼ 513	▲ 901	미발표		No Position	Overvalued	Negative	Negative	Negative
한화시스템	7/29	▼ 573	▲ 588	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
현대글로벌비스	7/24	▼ 5,203	▲ 5,773	▼ 5,079	▼ 4,951	No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
현대건설	7/20	▲ 2,398	▼ 2,105	미발표		No Position	Fair	Positive	Positive	Positive
LS	8/14	▲ 4,406	▲ 4,406	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
대한항공	8/14	▲ -1,260	▼ -2,377	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Positive	Positive
HD현대마린솔루션	5/15	▼ 1,000	▲ 1,035	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
삼성E&A	7/24	▼ 2,122	▼ 2,251	▼ 2,188	▲ 2,731	No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
포스코인더내셔널	7/31	▲ 3,969	▼ 3,642	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
대우건설	7/28	▲ 1,853	▼ 1,600	미발표		No Position	Fair	Positive	Neutral	Neutral
산일전기	8/14	▼ 597	▲ 602	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
대한전선	7/31	▼ 393	▲ 423	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
팬오션	7/31	▲ 1,615	▼ 1,557	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
DL이앤씨	5/15	▲ 1,497	▼ 1,238	미발표		No Position	Fair	Positive	Neutral	Negative
GS건설	7/30	▲ 1,079	▲ 1,207	미발표		Short	Fair	Negative	Negative	Neutral
CJ대한통운	8/7	▲ 1,059	▲ 1,104	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
IPARK현대산업개발	7/27	▲ 1,667	▲ 1,452	▲ 1,275	▲ 1,227	No Position	Fair	Positive	Neutral	Neutral
롯데렌탈	8/6	▲ 843	▲ 872	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
제주항공	8/14	▼ -490	▼ -556	미발표		No Position	Fair	Positive	Positive	Positive
진에어	8/14	▼ -479	▼ -707	미발표		No Position	Fair	Positive	Positive	Positive
Materials										
POSCO홀딩스	7/31	▲ 7,432	▼ 7,299	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
LG화학	8/7	▲ 4,172	▼ 3,849	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
포스코퓨처엠	7/20	▲ 400	▼ 266	미발표		No Position	Undervalued	Positive	Positive	Positive
OCI홀딩스	7/24	▼ 1,108	▲ 1,175	▲ 1,218	▼ 1,081	No Position	Fair	Neutral	Neutral	Negative
현대제철	8/3	▲ 662	▲ 833	미발표		Short	Undervalued	Negative	Negative	Negative
한솔케미칼	8/14	▲ 502	▼ 499	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
금호석유화학	8/3	▲ 2,084	▼ 1,470	미발표		Conviction Long	Undervalued	Positive	Positive	Positive
롯데케미칼	8/10	▼ 669	▲ 1,356	미발표		No Position	Undervalued	Negative	Negative	Neutral
풍산	8/3	▲ 888	▲ 830	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
세아베스틸지주	7/31	▼ 544	▼ 539	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
Energy										
SK	8/14	▼ 20,339	▲ 24,551	미발표		No Position	Overvalued	Negative	Negative	Positive
SK이노베이션	7/31	▲ 18,192	▼ 15,582	미발표		Conviction Long	Undervalued	Positive	Neutral	Positive
S-Oil	7/27	▼ 9,129	▲ 9,551	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
한화솔루션	7/30	▲ 417	▲ 675	미발표		No Position	Undervalued	Negative	Positive	Neutral
씨에스월드	8/10	▲ 481	▲ 495	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
SK오션플랜트	8/14	▼ 108	▼ 108	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
Health Care										
셀트리온	7/20	▲ 4,526	▲ 4,744	▼ 4,007	▲ 4,300	No Position	Undervalued	Neutral	Positive	Neutral
SK바이오팜	5/15	▲ 880	▼ 854	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
유한양행	7/30	▲ 638	▼ 582	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
한미약품	7/27	▲ 1,402	▼ 1,107	미발표		No Position	Fair	Positive	Positive	Neutral
파라리서치	5/15	▲ 698	▼ 675	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
휴젤	8/6	▼ 502	▲ 512	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
클래시스	5/15	▼ 470	▲ 510	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
에스티팜	5/15	▲ 231	▼ 199	미발표		No Position	Overvalued	Positive	Positive	Neutral
엘앤씨바이오	10/10	▲ 111	▼ 103	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Neutral
씨어스	5/15	▼ 148	▲ 157	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
녹십자	8/3	▼ 29	▼ 88	미발표		No Position	Fair	Negative	Neutral	Neutral
HK이노엔	7/30	▲ 280	▲ 299	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
Finance										
삼성생명	8/13	▼ 7,737	▲ 7,875	미발표		No Position	Overvalued	Neutral	Neutral	Negative
KB금융	7/24	▼ 18,159	▼ 17,912	▲ 19,140	▲ 19,922	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
신한지주	7/27	▲ 16,912	▼ 15,718	▲ 16,861	▲ 18,201	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
하나금융지주	7/27	▲ 12,304	▲ 12,455	▲ 12,455	▼ 11,928	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
삼성화재	8/13	▼ 7,170	▼ 6,526	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
미래에셋증권	8/7	▼ 14,826	▲ 15,054	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
우리금융지주	5/15	▼ 9,180	▼ 9,322	▼ 9,322	▲ 10,046	No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
기업은행	7/24	▼ 6,547	▼ 6,936	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Positive
한국금융지주	8/6	▲ 8,820	▼ 8,346	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
NH투자증권	7/31	▲ 5,117	▼ 4,188	▲ 4,788	▲ 4,896	Long	Fair	Positive	Positive	Positive
카카오뱅크	5/15	▼ 1,322	▲ 1,353	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
삼성증권	8/10	▲ 5,204	▼ 5,032	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Positive
키움증권	7/29	▲ 5,070	▲ 5,109	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Positive
DB손해보험	8/14	▲ 5,215	▼ 4,868	미발표		No Position	Fair	Neutral	Positive	Neutral
BNK금융지주	7/31	▼ 2,196	▲ 2,494	미발표		No Position	Fair	Negative	Neutral	Neutral
JB금융지주	7/24	▼ 2,072	▼ 2,197	▲ 2,126	▲ 2,196	No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
한화생명	8/13	▲ 1,938	▼ 1,562	미발표		Long	Fair	Positive	Positive	Neutral
현대해상	8/13	▲ 3,140	▼ 2,669	미발표		Long	Fair	Positive	Positive	Positive
IM금융지주	7/28	▼ 1,431	▲ 1,487	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Negative
Consumer Staples										
KT&G	8/7	▲ 4,051	▼ 3,967	미발표		No Position	Undervalued	Neutral	Neutral	Neutral
삼양식품	8/14	▲ 1,776	▼ 1,773	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
오리온	8/14	▼ 1,320	▲ 1,359	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
CJ제일제당	8/12	▼ 2,667	▲ 2,751	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
농심	8/14	▲ 577	▼ 502	미발표		No Position	Fair	Positive	Neutral	Neutral
하이트진로	8/13	▲ 634	▼ 613	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral
롯데칠성	8/4	▼ 550	▲ 631	미발표		No Position	Fair	Negative	Neutral	Neutral
롯데웰푸드	8/5	▲ 492	▼ 477	미발표		No Position	Fair	Neutral	Neutral	Neutral

직전 LONG/SHORT Pair 구성종목 및 성과 (7.15 ~ 7.23)

Gross L/S Pair (%)	-9.1
Conviction L/S Pair (%)	-5.0

LONG		수익률	-0.0
Code	Name	Position	Returns (%)
A006800	미래에셋증권	Long	-6.1
A010950	S-Oil	Long	6.7
A000810	삼성화재	Long	-3.5
A042660	한화오션	Conviction Long	9.6
A039490	키움증권	Long	-5.0
A016360	삼성증권	Long	-5.6
A005940	NH투자증권	Long	-3.5
A011070	LG이노텍	Long	-1.3
A128940	한미약품	Long	1.2
A006400	삼성SDI	Conviction Long	2.9
A008770	호텔신라	Long	0.2
A114090	GKL	Long	4.1

[illegible]

삼성전자

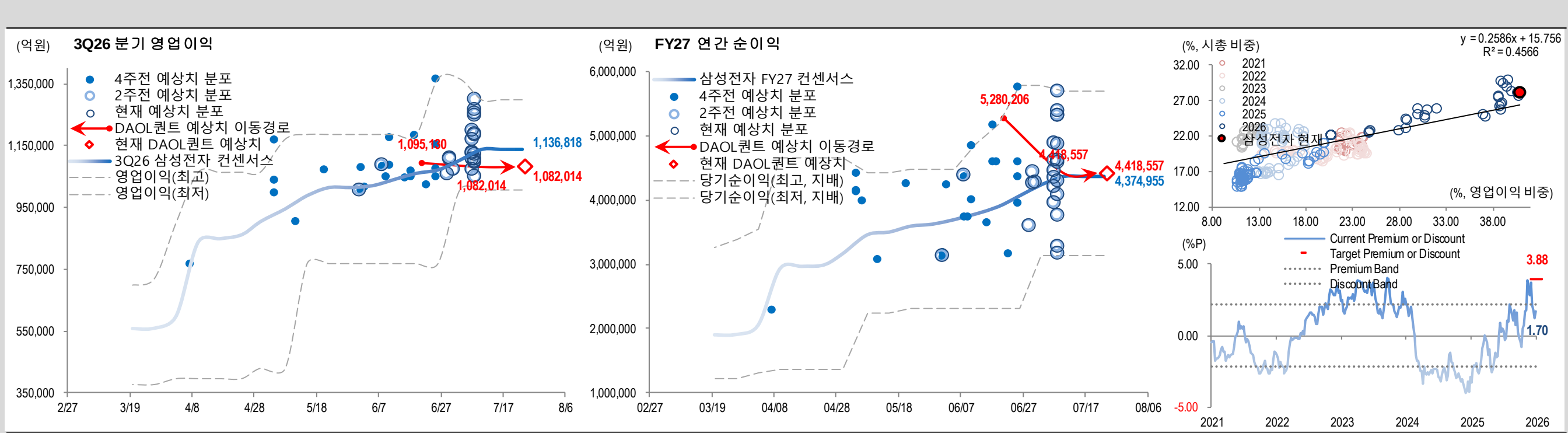
구분	3Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,136,818	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW 삼성전자 추가(RHS) 삼성전자 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	1,300,360	(P, Rebased)
최저값	1,007,530	
실적발표일	기발표	
DAOL퀀트 예상치	1,082,014	
Beat or Miss	0	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	No Position	

최근 예상치(날짜)

영업이익

애널리스트

증권사



SK하이닉스

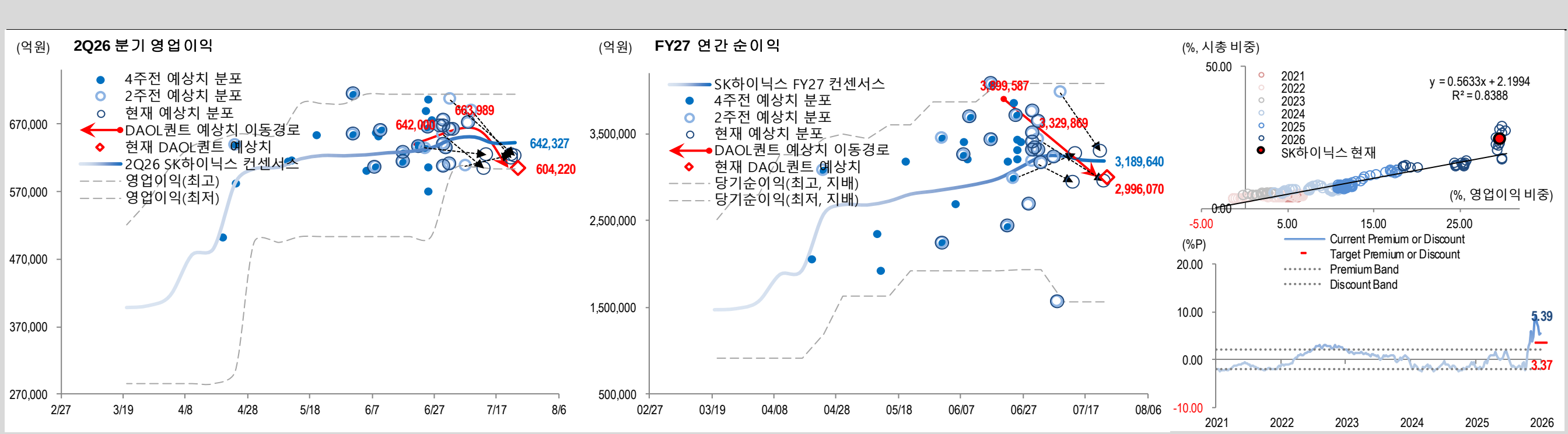
구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	642,327	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW SK하이닉스 추가(RHS) SK하이닉스 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	714,460	(P, Rebased)
최저값	604,220	
실적발표일	2026-07-29	
DAOL퀀트 예상치	604,220	
Beat or Miss	0	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	No Position	

최근 예상치(날짜)

영업이익

애널리스트

증권사



삼성전기

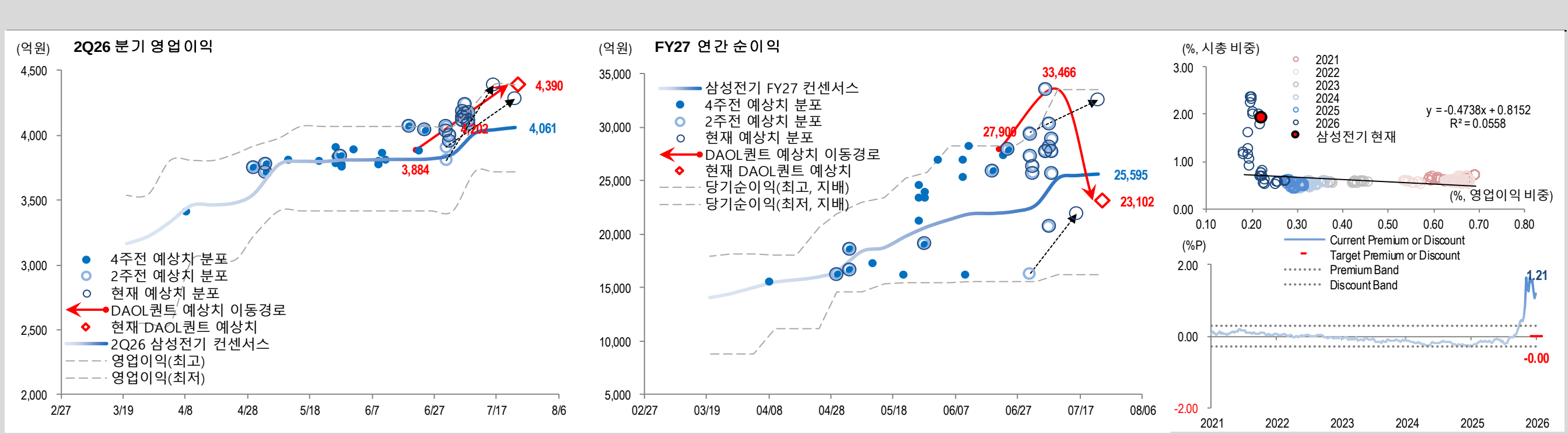
구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	4,061	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW 삼성전기 추가(RHS) 삼성전기 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	4,390	(P, Rebased)
최저값	3,715	
실적발표일	2026-07-30	
DAOL퀀트 예상치	4,390	
Beat or Miss	0	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	No Position	

최근 예상치(날짜)

영업이익

애널리스트

증권사



2Q26 실적발표 전 5일을 위한 Active Quant의 定石 : Long Positions (1 of 4)



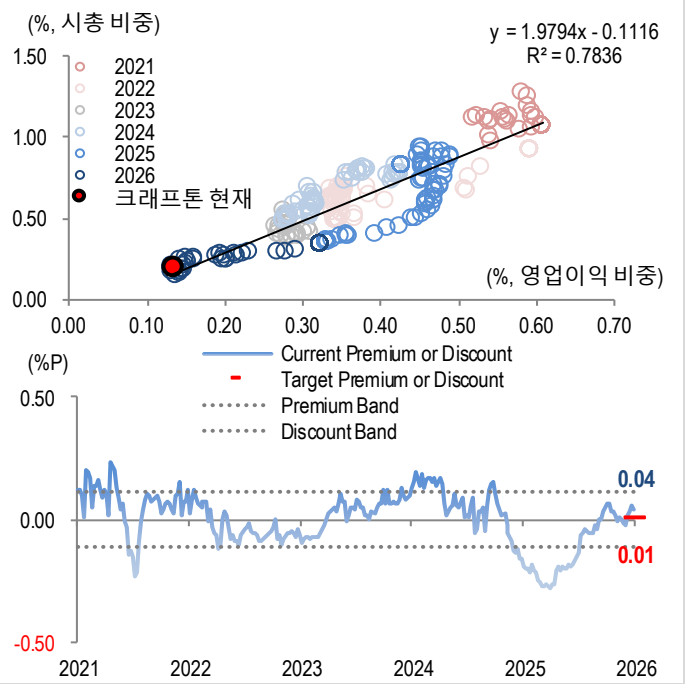
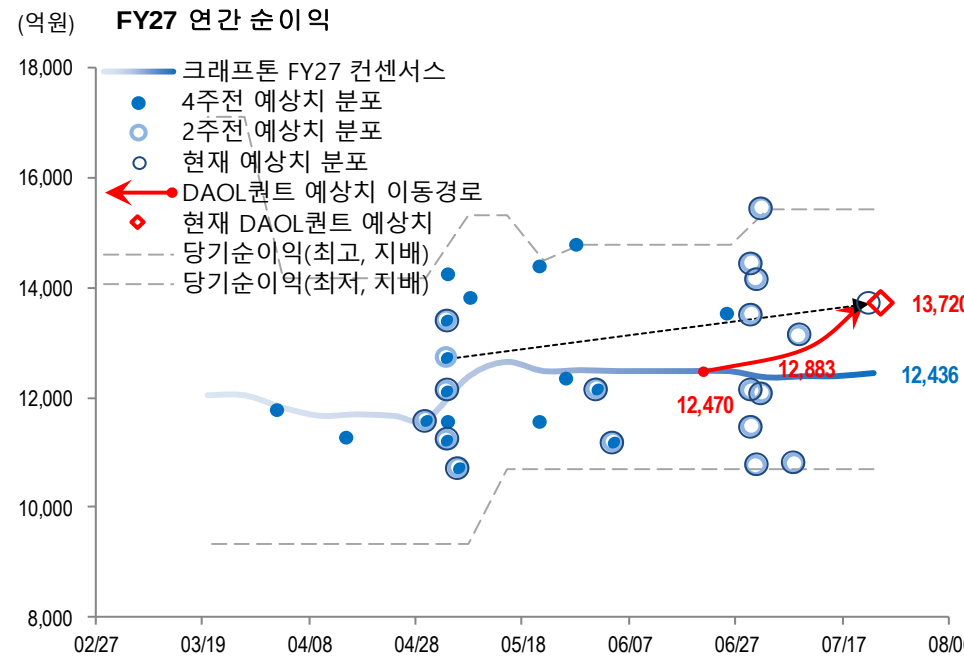
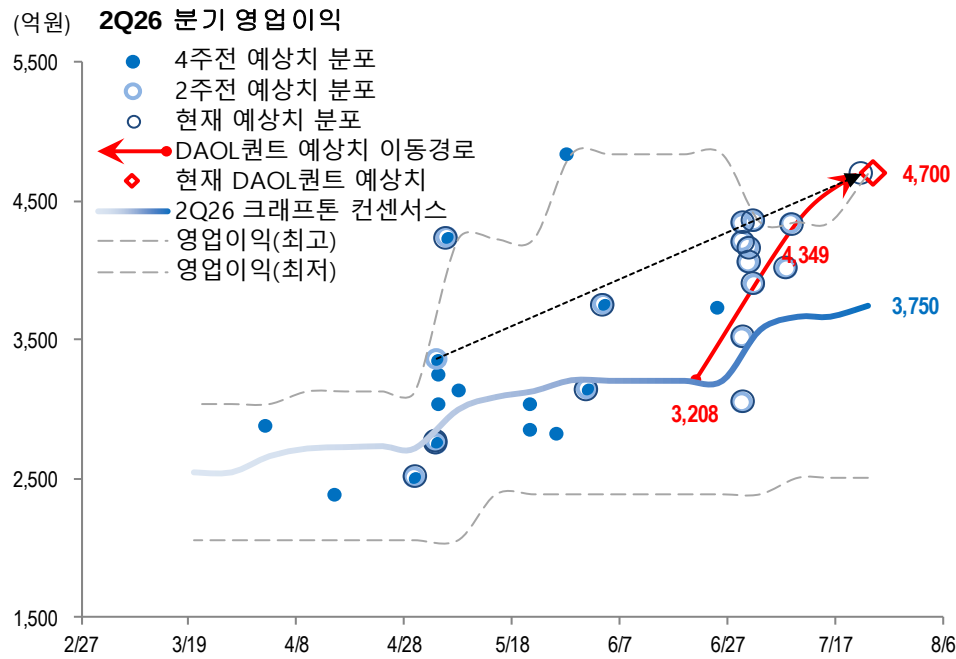
Quant Analyst 김 경 훈 (CAIA, FRM, CFA)
aimhigh2027@daolfn.com

DAOL 다올투자증권

크래프톤

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	3,750	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	4,700	기관 OW/UW
최저값	2,510	크래프톤 추가(RHS)
실적발표일	2026-07-29	크래프톤 12M Fwd 컨센서스(RHS)
DAOL퀀트 예상치	4,700	
실적 Beat or Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S Position	Long	

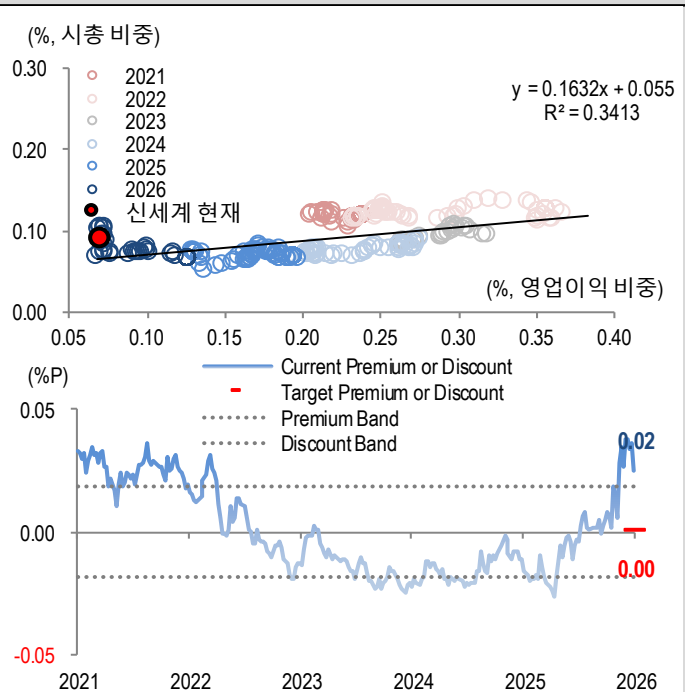
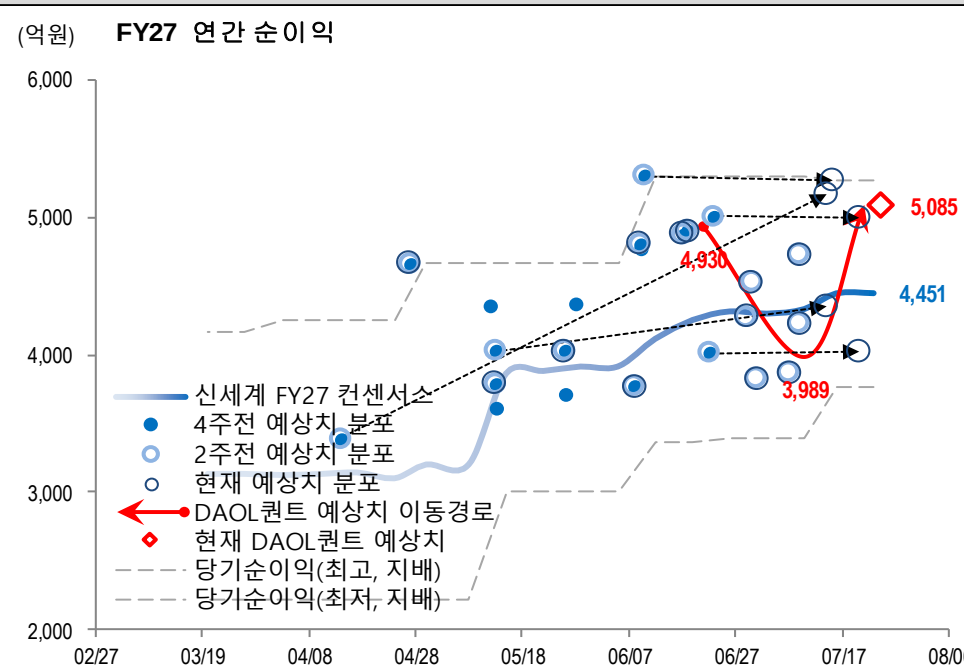
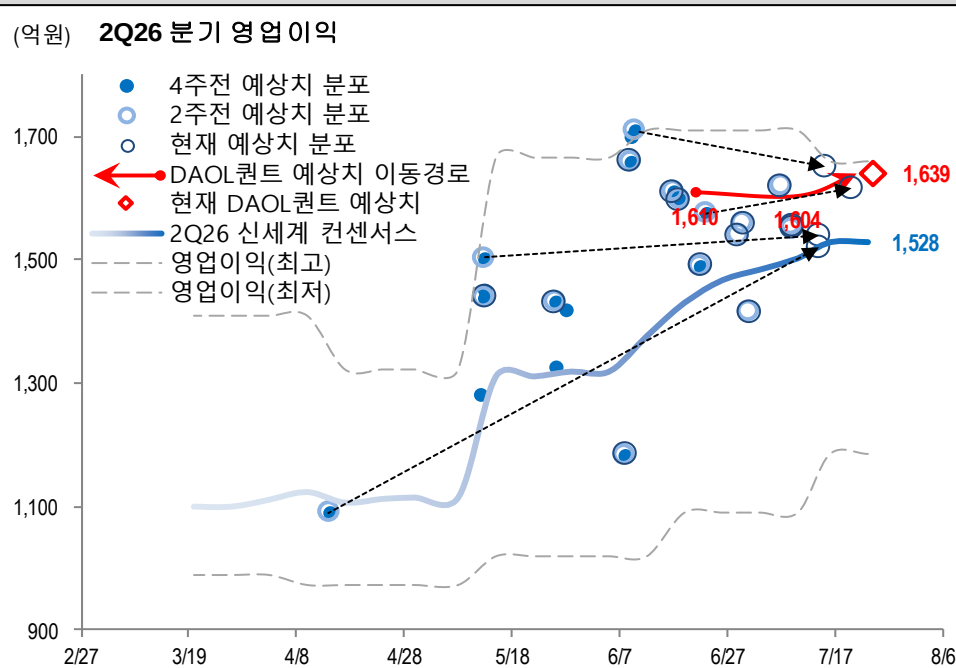
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-22	4,700	오동환,유혜림	삼성증권



신세계

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,528	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	1,660	기관 OW/UW
최저값	1,184	신세계 추가(RHS)
실적발표일	2026-08-10	신세계 12M Fwd 컨센서스(RHS)
DAOL퀀트 예상치	1,639	
Beat or Miss	↑ In-line	
Valuation	Fair	
L/S Position	Long	

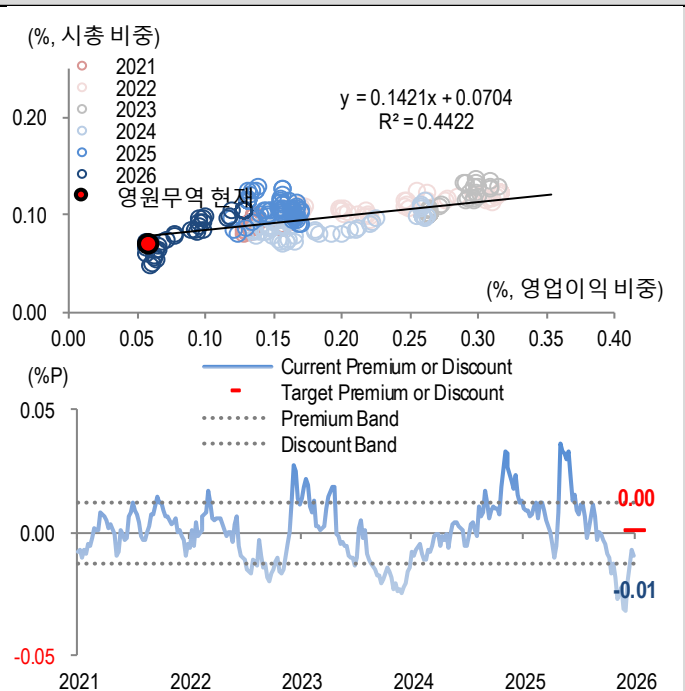
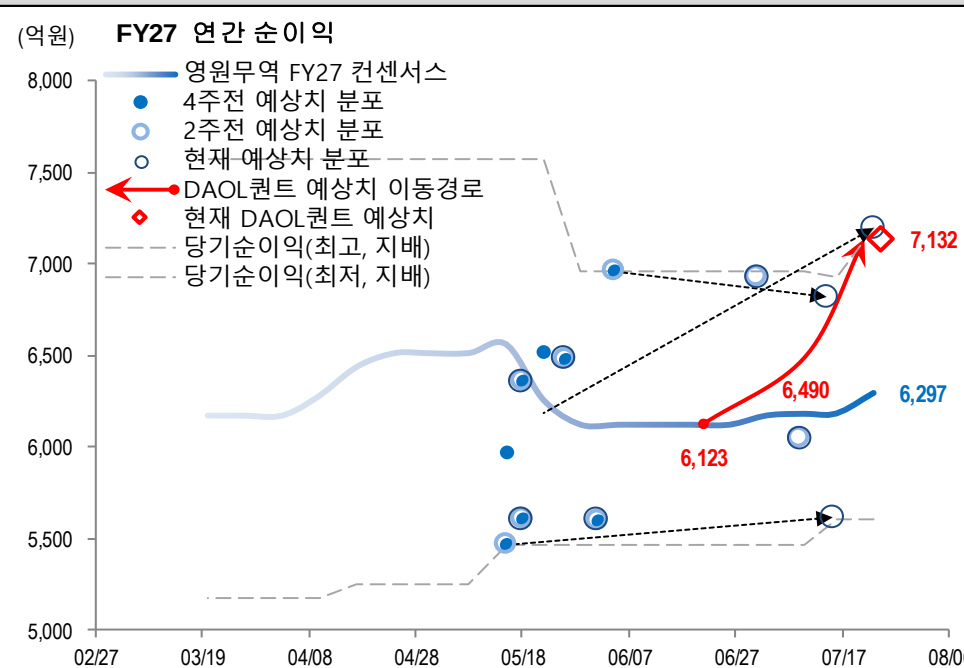
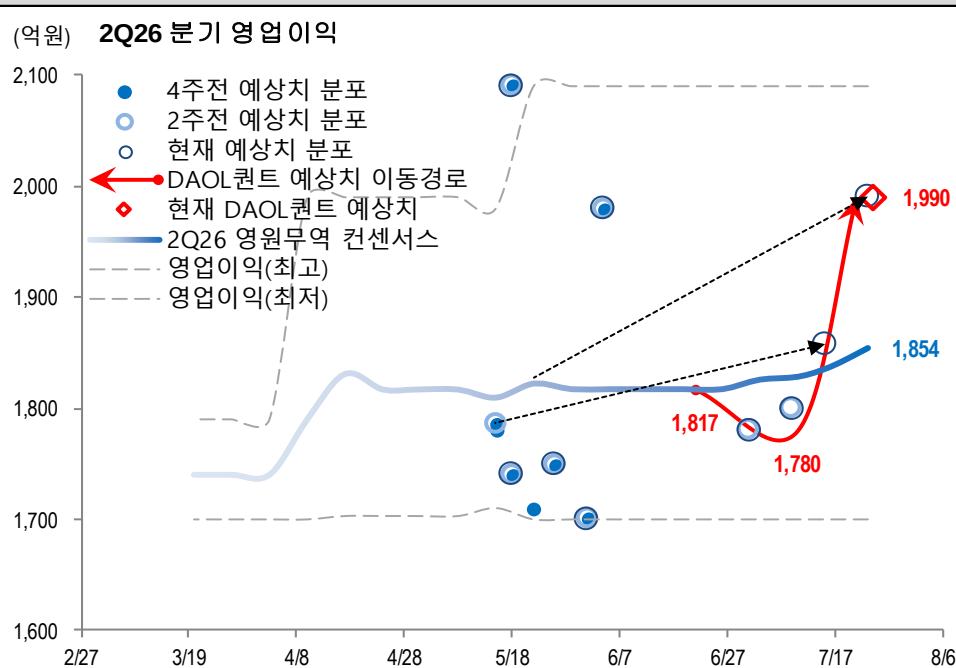
최근 예상치(날짜)	영업 이익	애널리스트	증권사
2026-07-20	1,616	김정옥	메리츠증권
2026-07-15	1,650	박상준,권용일	키움증권
2026-07-14	1,539	장민지	교보증권
2026-07-14	1,520	오린아	LS증권



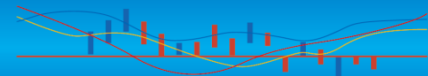
영원무역

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,854	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	2,090	기관 OW/UW
최저값	1,700	영원무역 추가(RHS)
실적발표일	2026-08-14	영원무역 12M Fwd 컨센서스(RHS)
DAOL퀀트 예상치	1,990	
Beat or Miss	↑ In-line	
Valuation	Fair	
L/S Position	Long	

최근 예상치(날짜)	영업 이익	애널리스트	증권사
2026-07-23	1,990	박현진	신한투자증권
2026-07-15	1,858	정지윤	NH투자증권



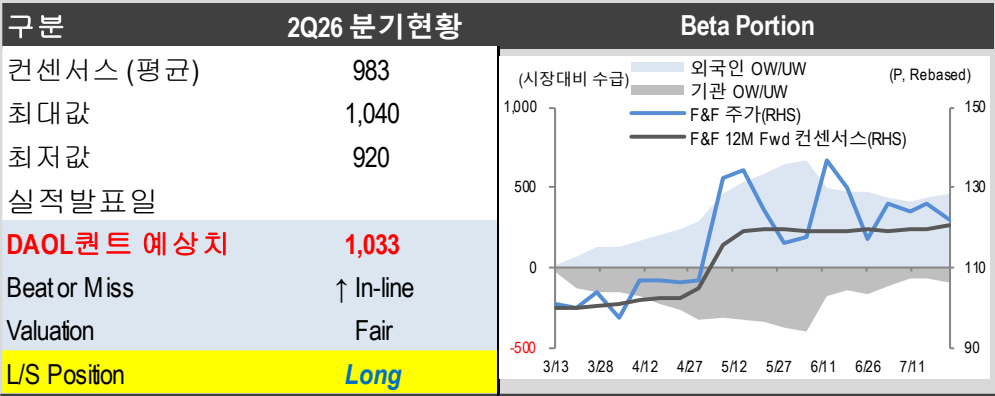
2Q26 실적발표 전 5일을 위한 Active Quant의 定石 : Long Positions (2 of 4)



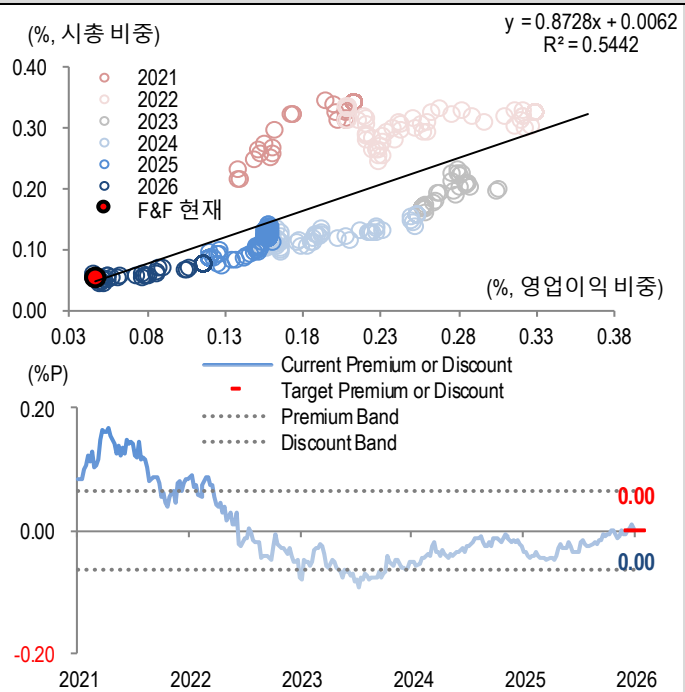
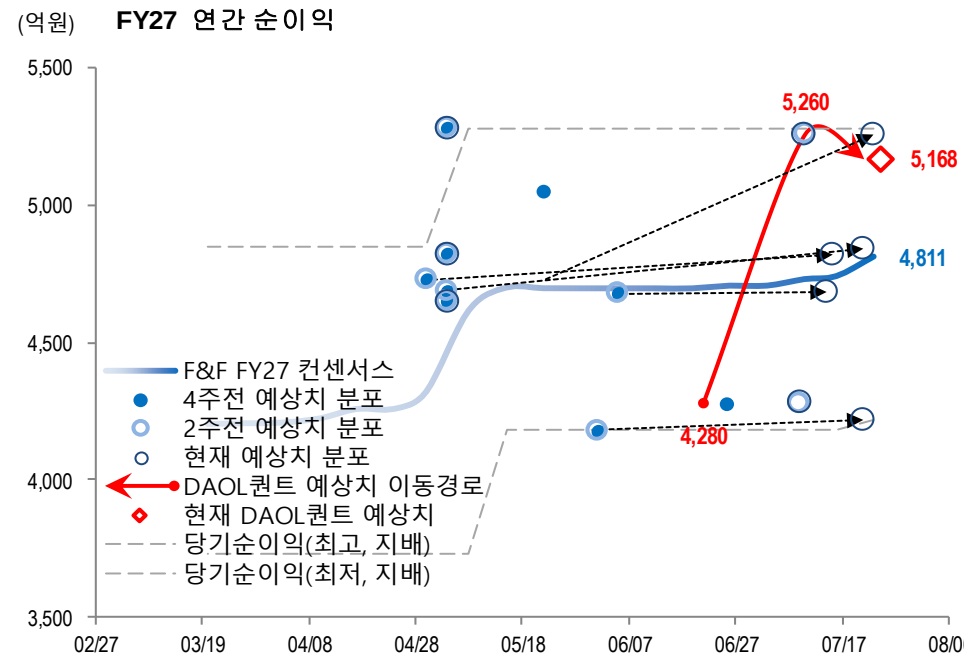
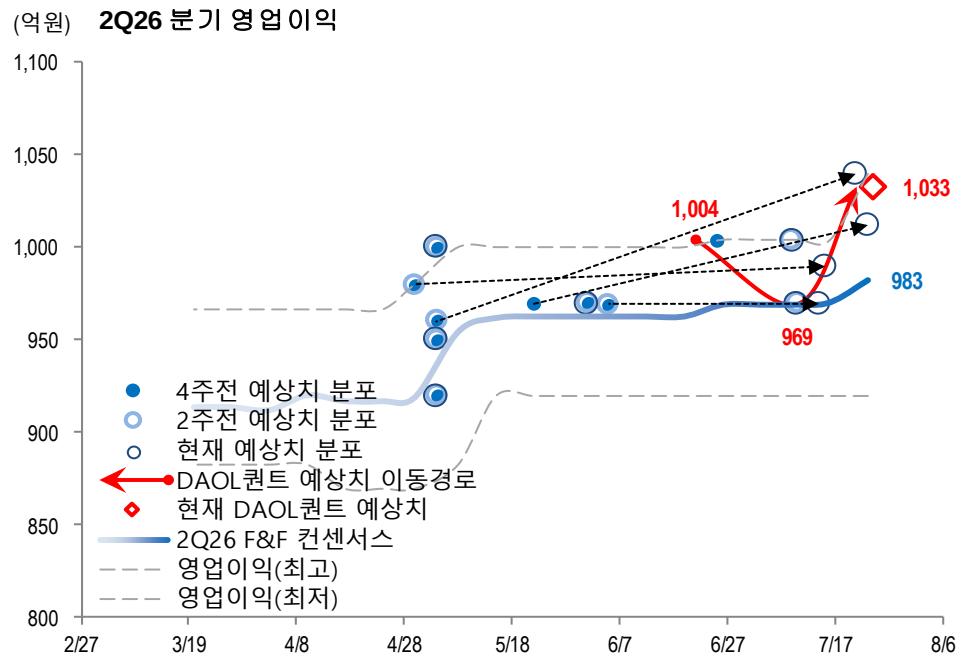
Quant Analyst 김 경 훈 (CAIA, FRM, CFA)
aimhigh2027@daolfn.com

DAOL 다올투자증권

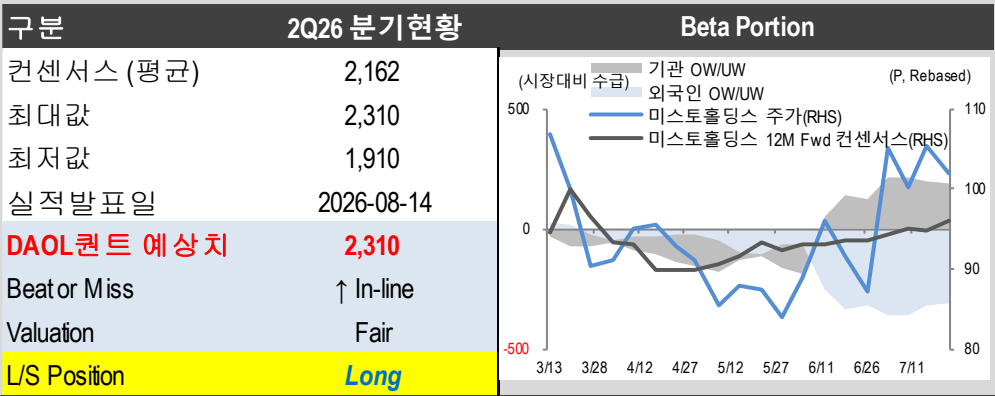
F&F



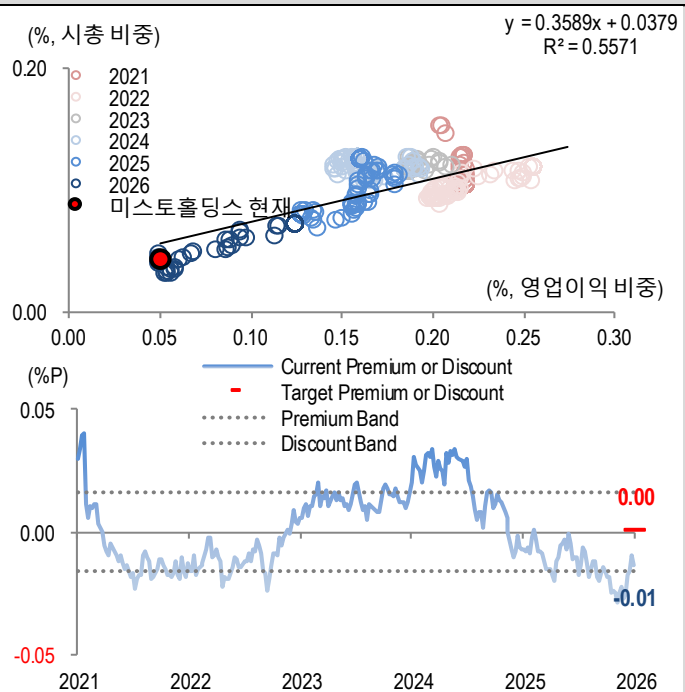
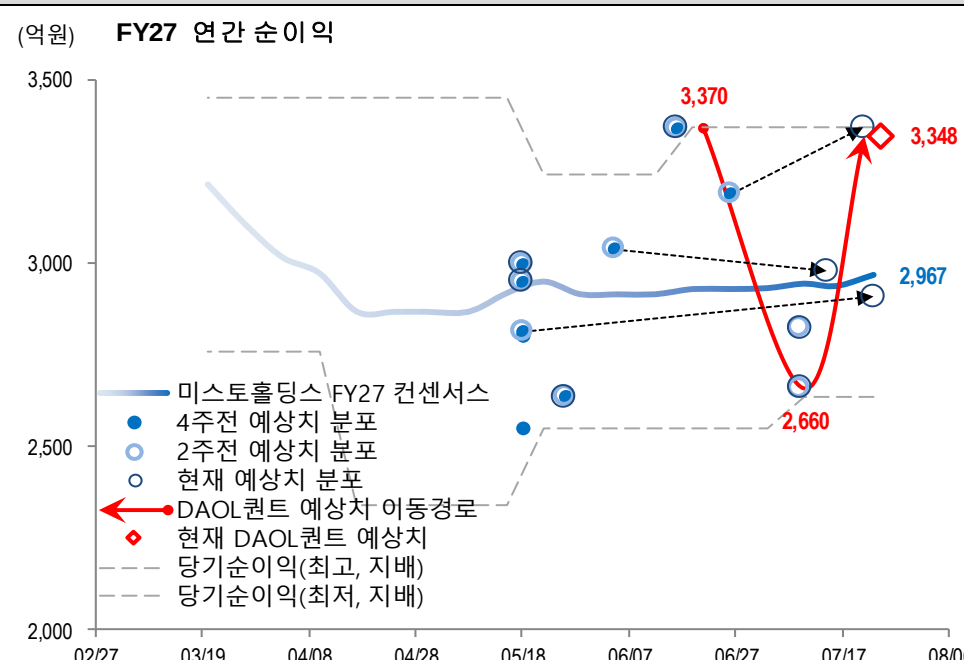
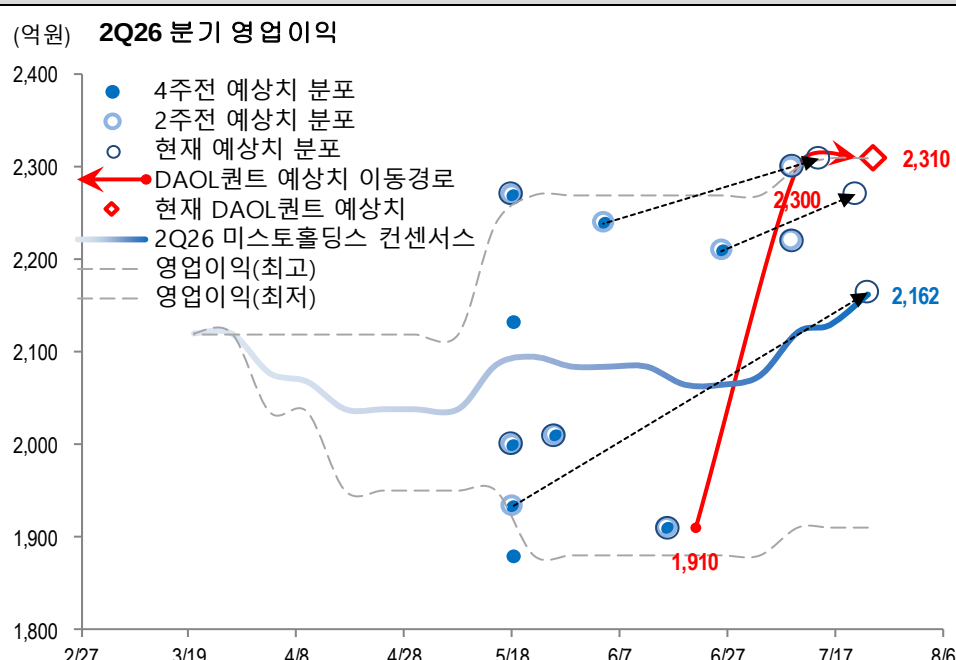
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-23	1,012	박현진	신한투자증권
2026-07-21	1,040	형권훈	SK증권
2026-07-15	990	류은애	KB증권
2026-07-14	970	이해니	유진투자증권



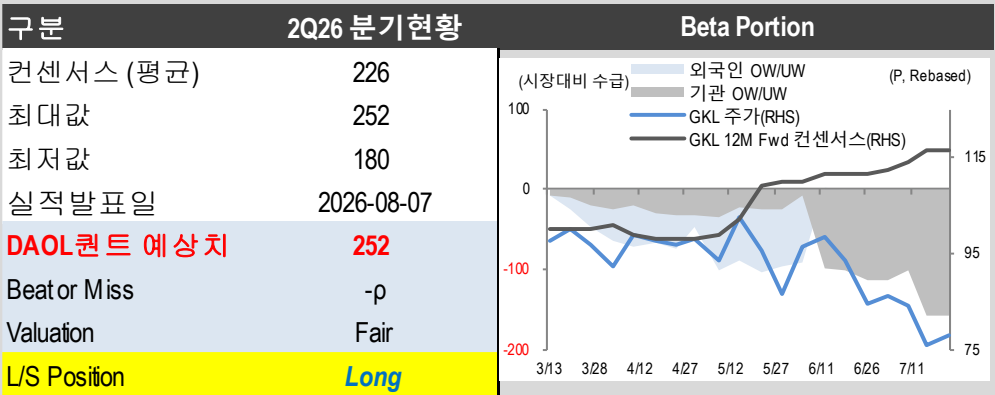
미스토홀딩스



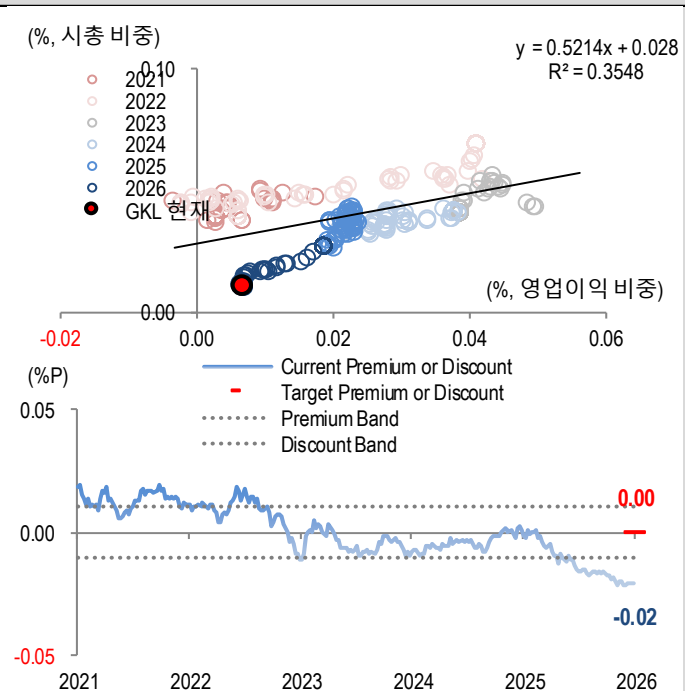
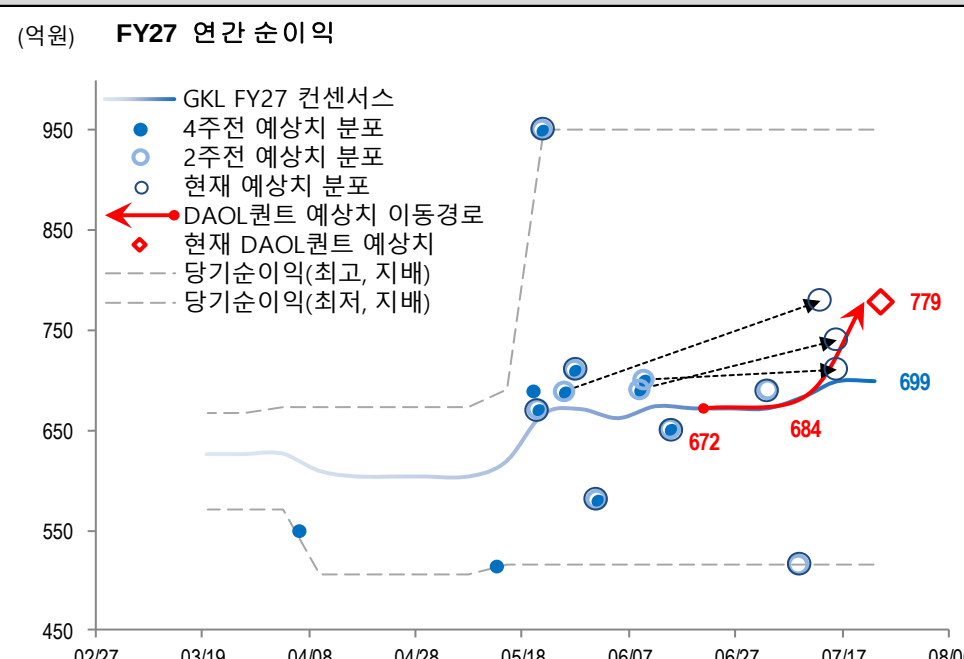
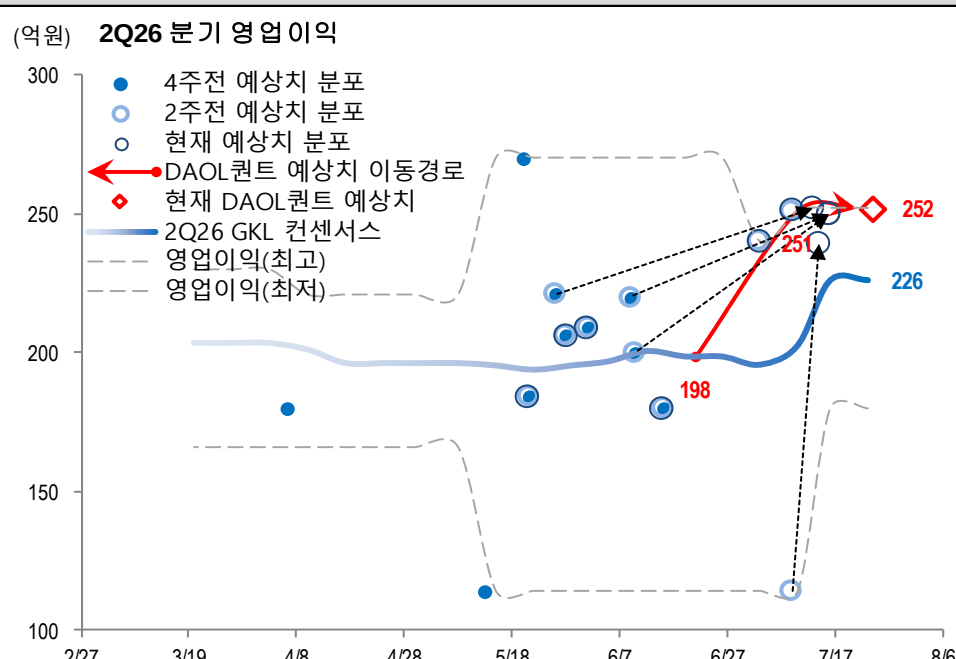
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-23	2,165	이해니	유진투자증권
2026-07-21	2,270	이진협	한화투자증권
2026-07-14	2,310	류은애	KB증권



GKL



최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-16	250	이현지,고수영	유진투자증권
2026-07-16	250	황지원	이증권
2026-07-14	239	이화정	NH투자증권
2026-07-13	252	임수진,박정현	키움증권



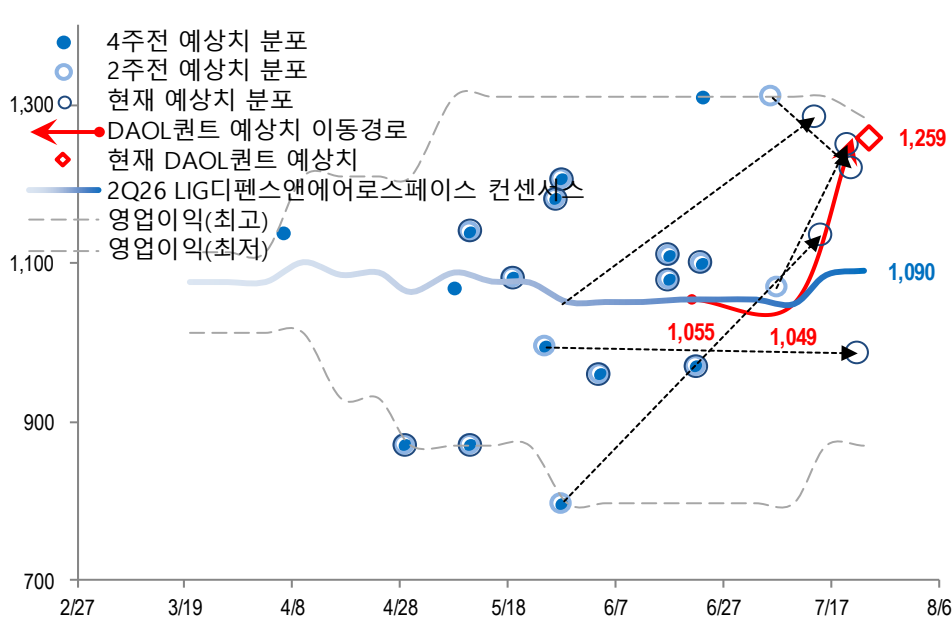


LIG디펜스앤에어

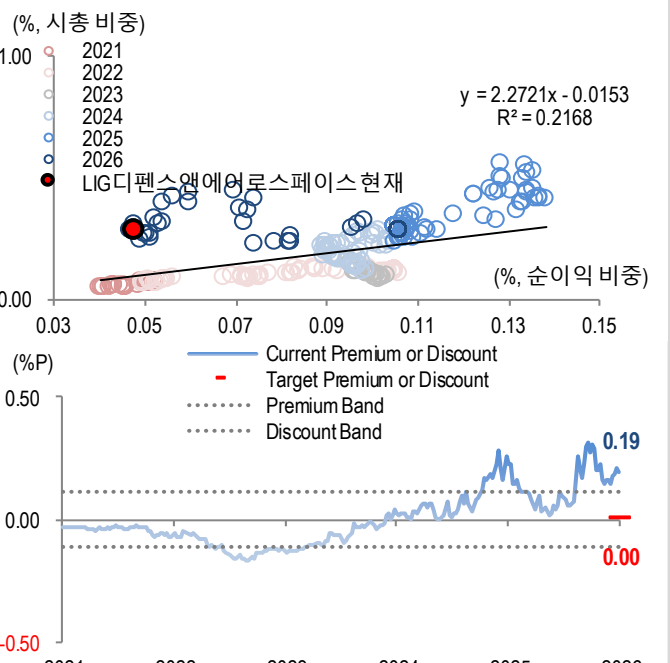
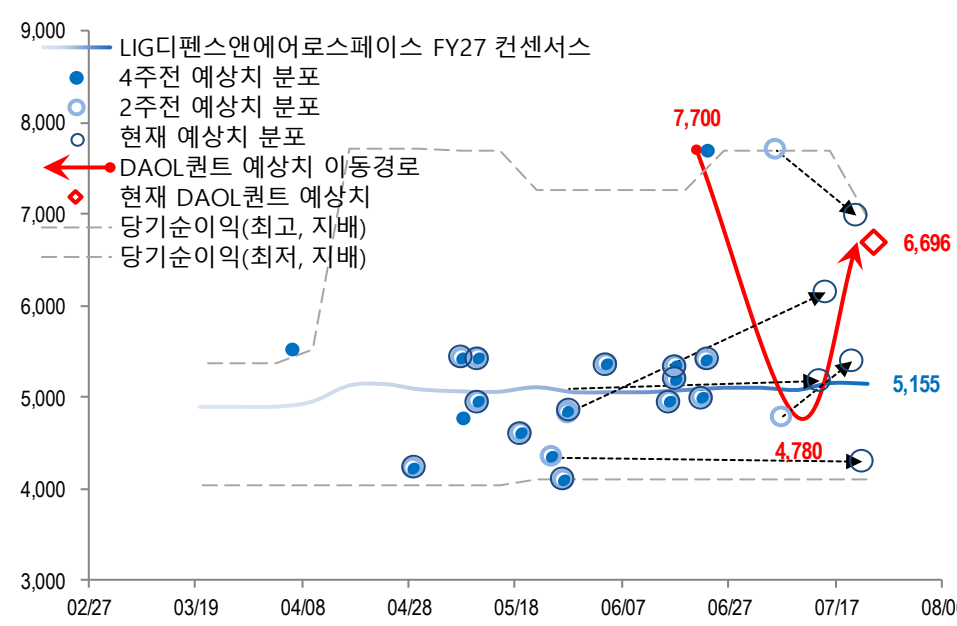
구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,090	(시장대비 추급) 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	1,284	외국인 OW/UW
최저값	870	LIG디펜스앤에어로스페이스 추가(RHS)
실적발표일	2026-08-07	LIG디펜스앤에어로스페이스 12M Fwd 컨센서스(RHS)
DAOL퀀트 예상치	1,259	
실적 Beator Miss	Surprise	
Valuation	Overvalued	
L/S Position	Long	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-22	987	최광식,이준범	다올투자증권
2026-07-21	1,220	최정환	대신증권
2026-07-20	1,250	장남현	한국투자증권
2026-07-15	1,136	강태호	DS투자증권
2026-07-14	1,284	백종민,신승우	유안타증권

(억원) 2Q26 분기 영업 이익



(억원) FY27 연간 순이익

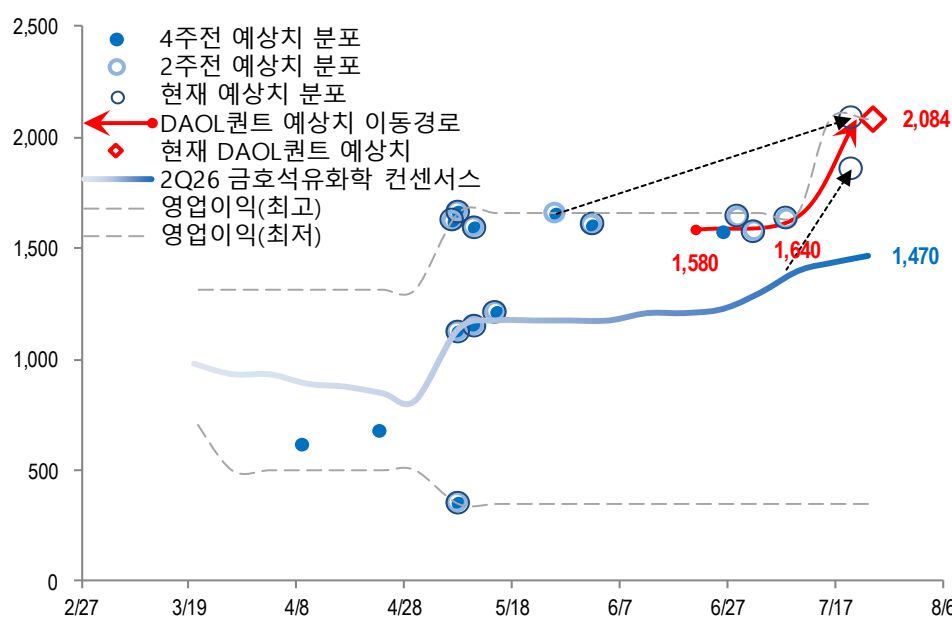


금호석유화학

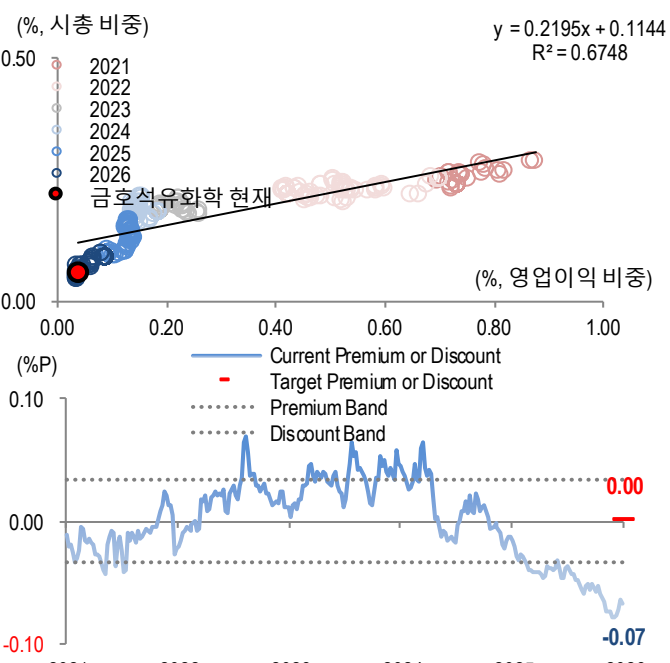
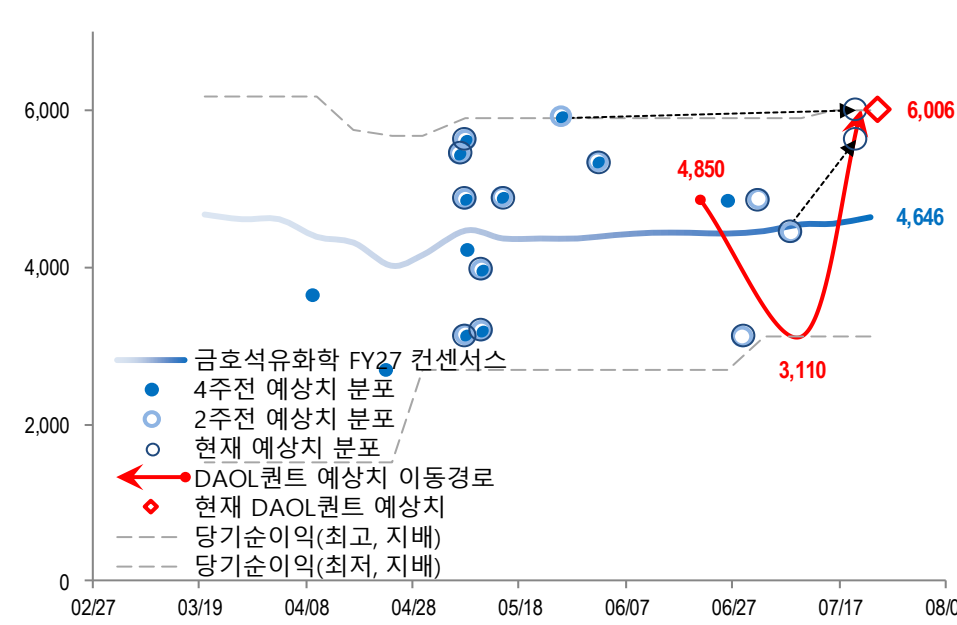
구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,470	(시장대비 추급) 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	2,084	외국인 OW/UW
최저값	350	금호석유화학 추가(RHS)
실적발표일	2026-08-03	금호석유화학 12M Fwd 컨센서스(RHS)
DAOL퀀트 예상치	2,084	
Beator Miss	-p	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Conviction Long	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-20	1,859	한승재	DB증권
2026-07-20	2,084	윤재성,김형준	하나증권

(억원) 2Q26 분기 영업 이익



(억원) FY27 연간 순이익

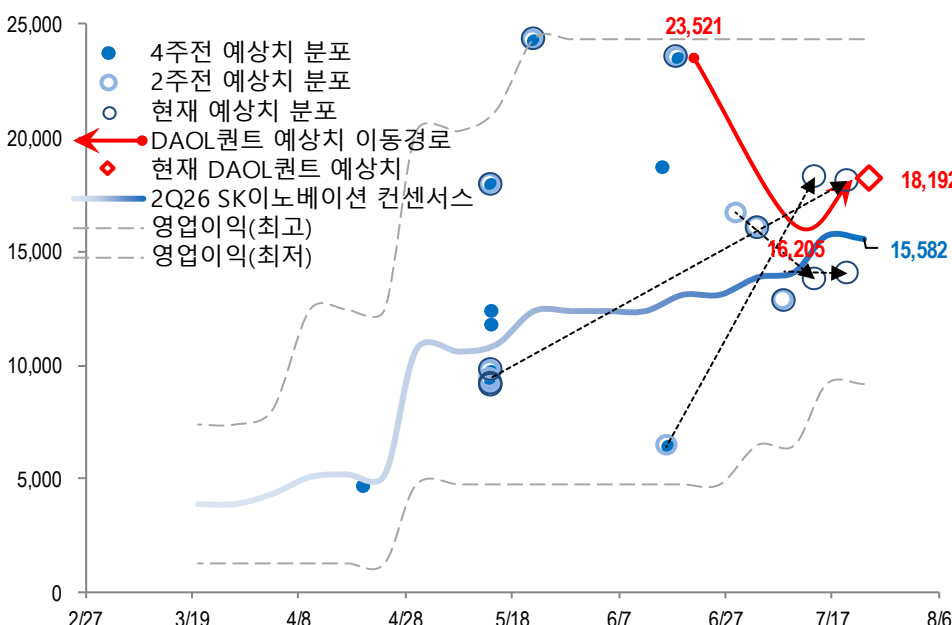


SK이노베이션

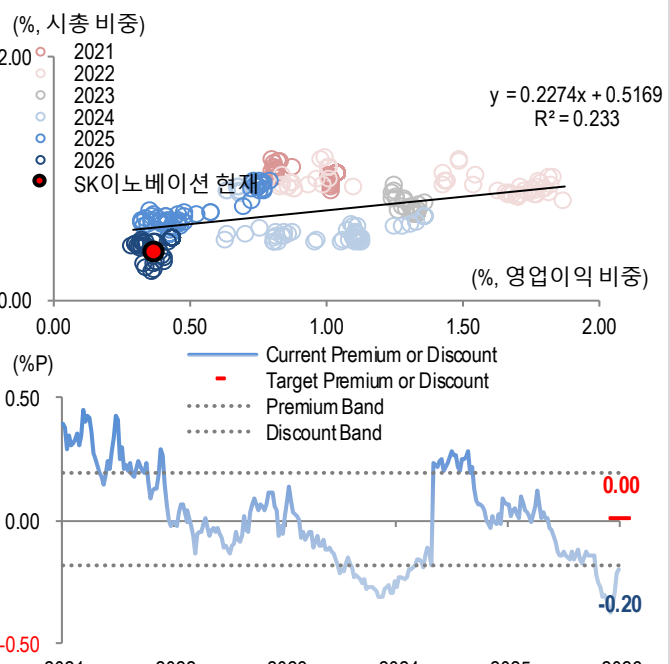
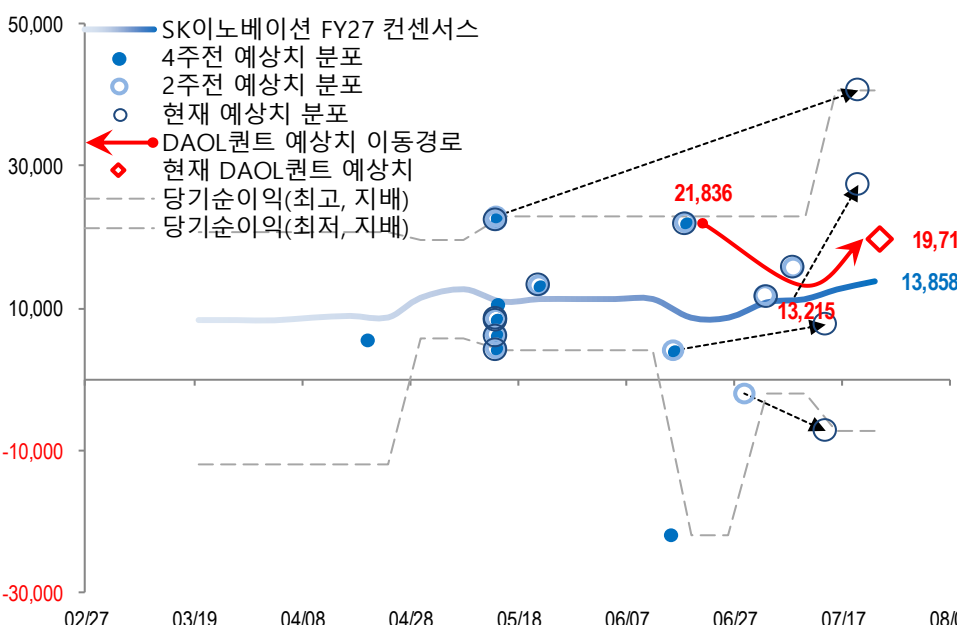
구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	15,582	(시장대비 추급) 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	24,313	외국인 OW/UW
최저값	9,130	SK이노베이션 추가(RHS)
실적발표일	2026-07-31	SK이노베이션 12M Fwd 컨센서스(RHS)
DAOL퀀트 예상치	18,192	
Beator Miss	-p	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Conviction Long	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-20	13,990	한승재	DB증권
2026-07-20	18,091	윤재성,김형준	하나증권
2026-07-14	18,310	전유진,장호	IM증권
2026-07-14	13,790	정경희	LS증권

(억원) 2Q26 분기 영업 이익



(억원) FY27 연간 순이익

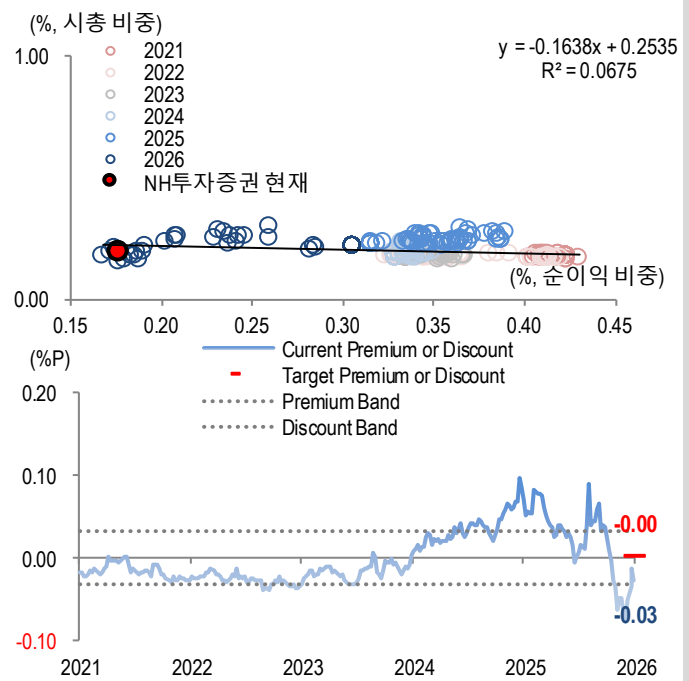
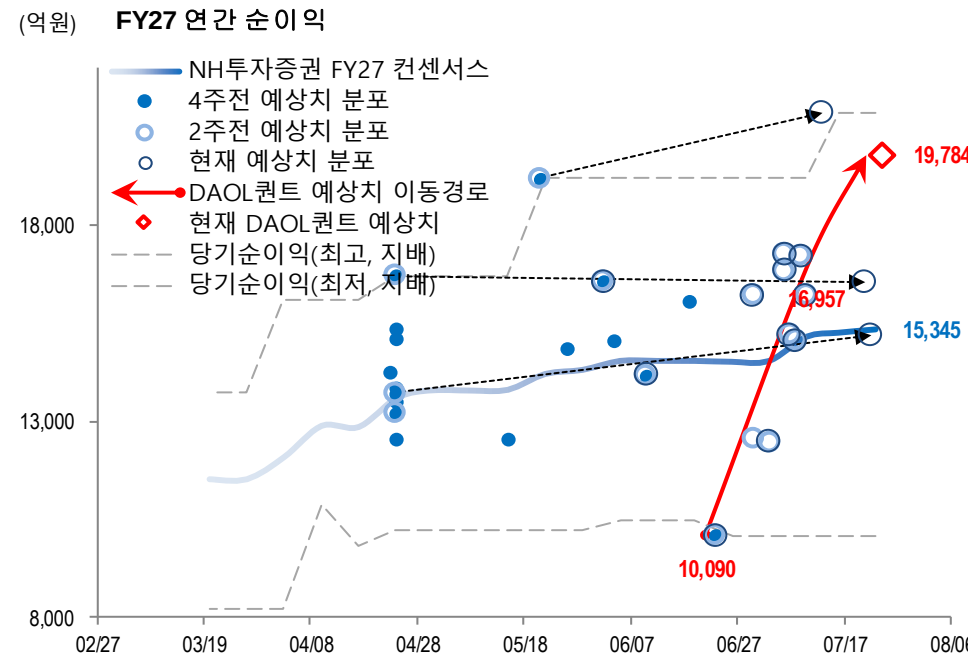
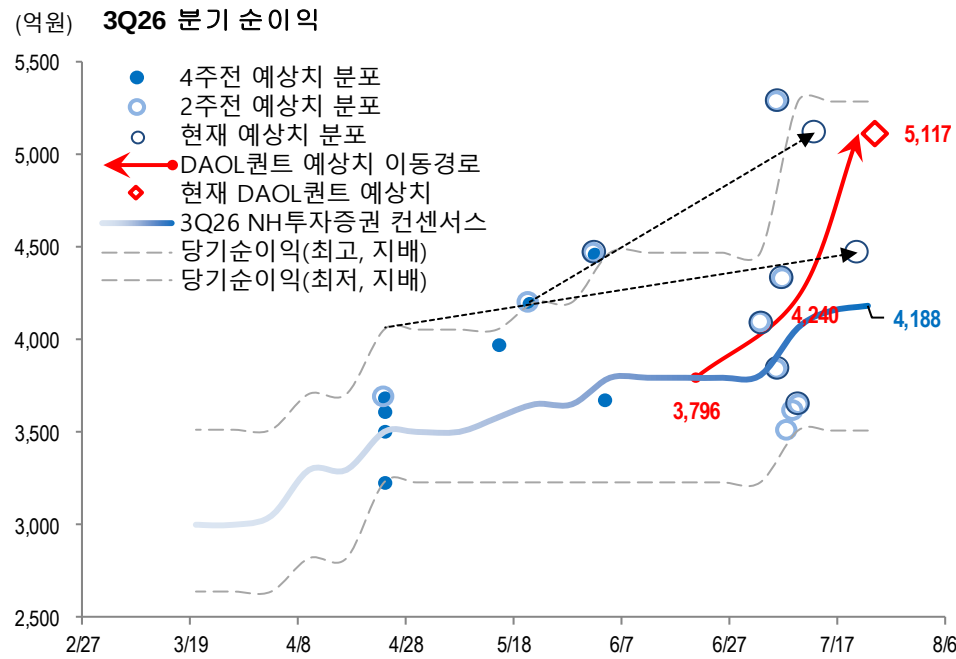




NH투자증권

구분	3Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	4,188	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased) NH투자증권 주가(RHS) NH투자증권 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	5,290	
최저값	3,510	
실적발표일	기발표	
DAOL퀀트 예상치	5,117	
Beator Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S PosFinanceion	Long	

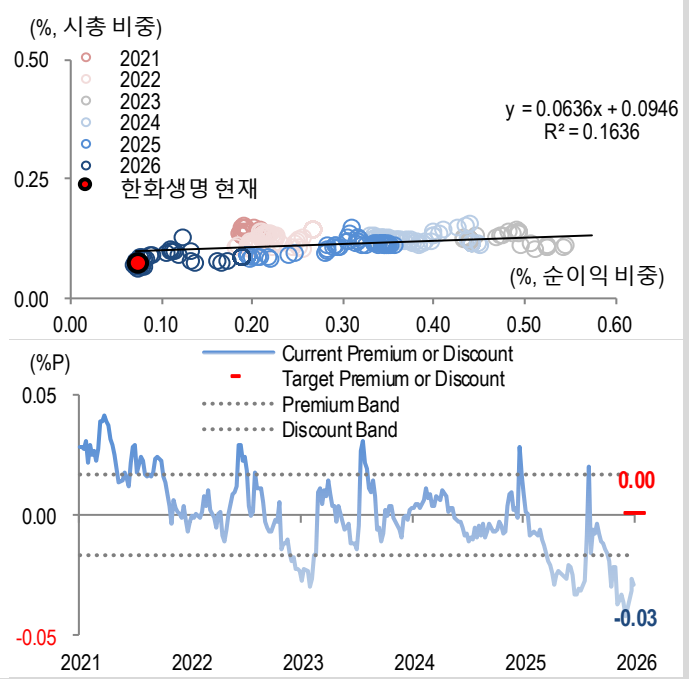
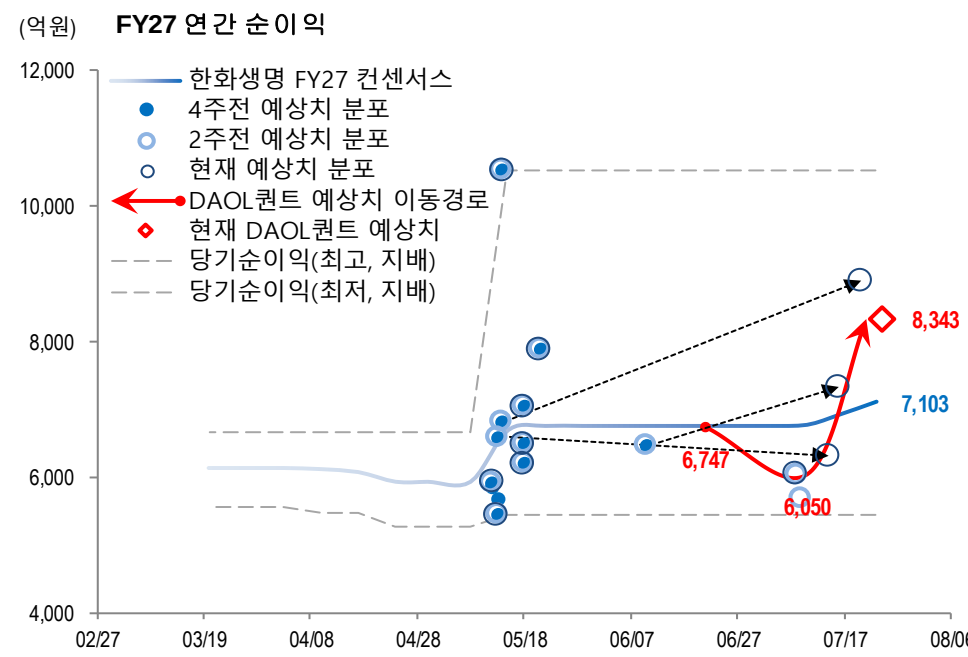
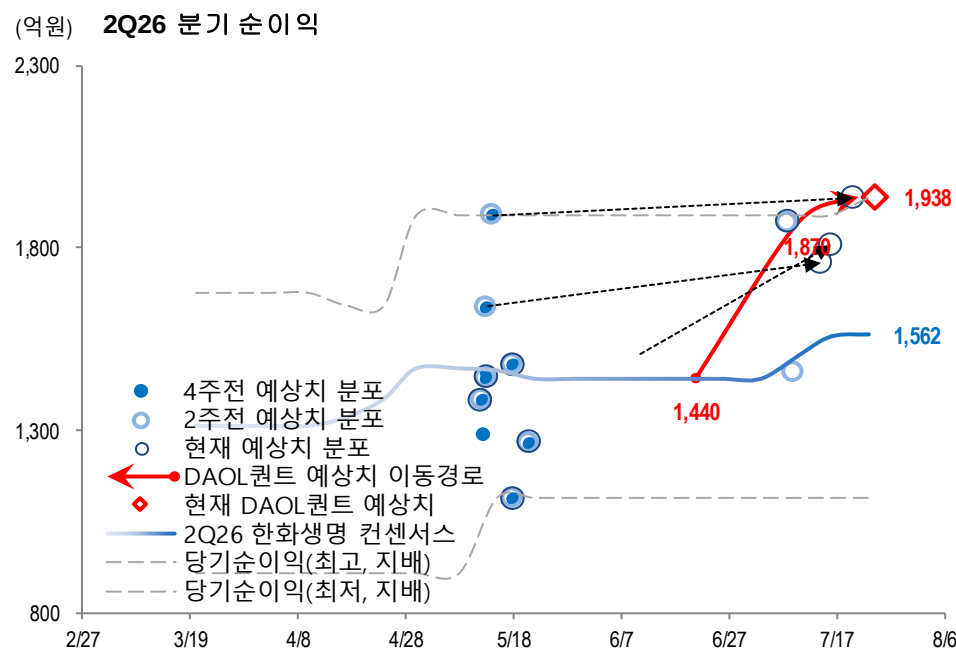
최근 예상치(날짜)	순이익	애널리스트	증권사
2026-07-21	4,470	김현수	상상인증권
2026-07-13	5,117	안영준	키움증권



한화생명

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,562	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased) 한화생명 주가(RHS) 한화생명 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	1,938	
최저값	1,113	
실적발표일	2026-08-13	
DAOL퀀트 예상치	1,938	
Beator Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S PosFinanceion	Long	

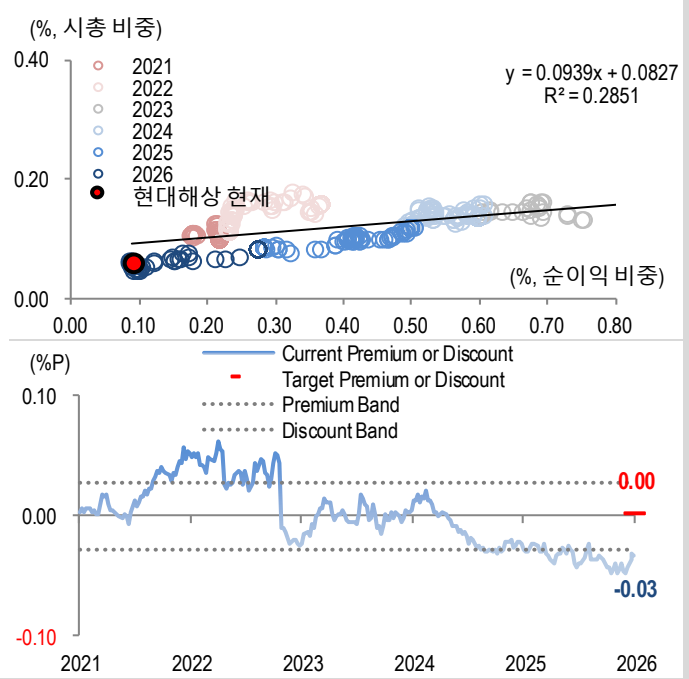
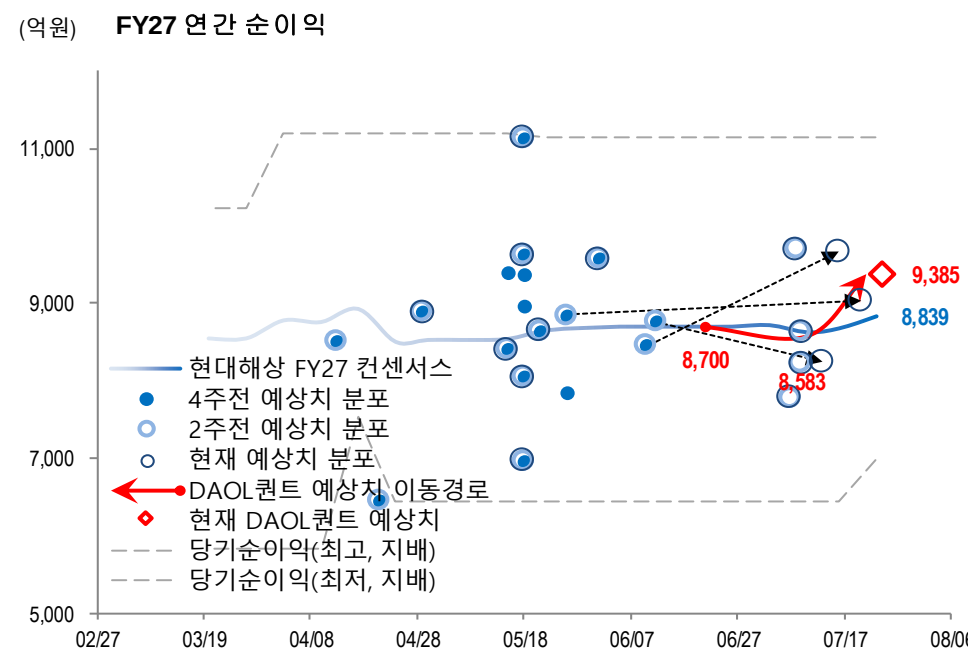
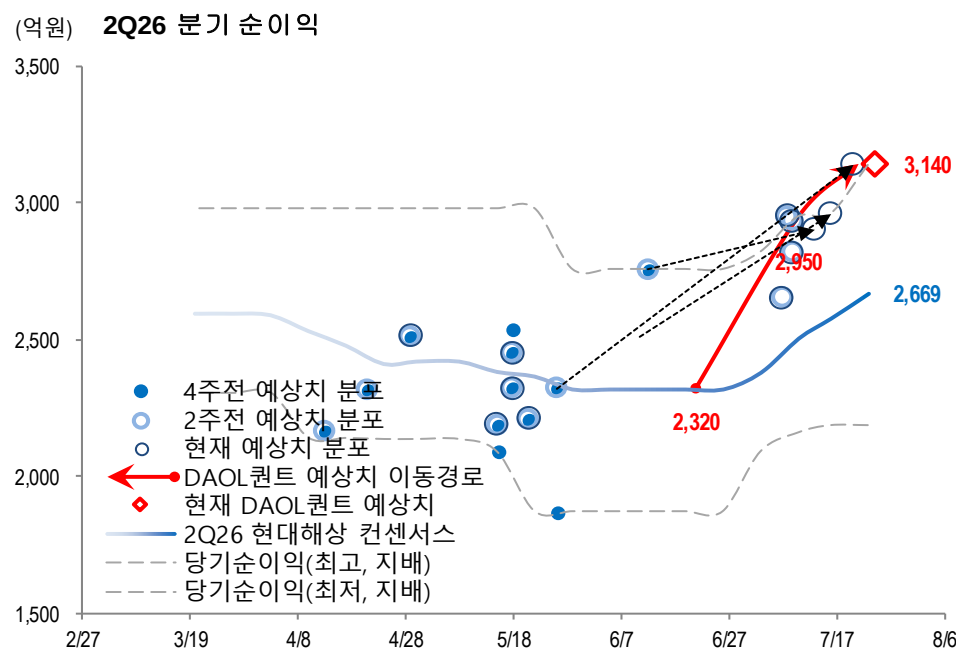
최근 예상치(날짜)	순이익	애널리스트	증권사
2026-07-20	1,938	고연수	하나증권
2026-07-16	1,810	전배승	LS증권
2026-07-14	1,760	김도하	한화투자증권



현대해상

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	2,669	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased) 현대해상 주가(RHS) 현대해상 12M Fwd 컨센서스(RHS)
최대값	3,140	
최저값	2,187	
실적발표일	2026-08-13	
DAOL퀀트 예상치	3,140	
Beator Miss	-p	
Valuation	Fair	
L/S PosFinanceion	Long	

최근 예상치(날짜)	순이익	애널리스트	증권사
2026-07-20	3,140	김인	BNK투자증권
2026-07-16	2,960	전배승	LS증권
2026-07-13	2,901	임희연,이지연	신한투자증권

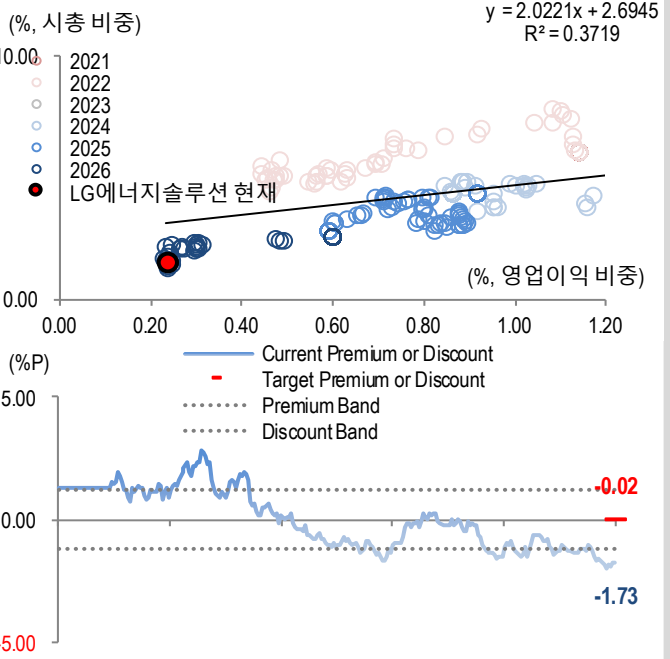
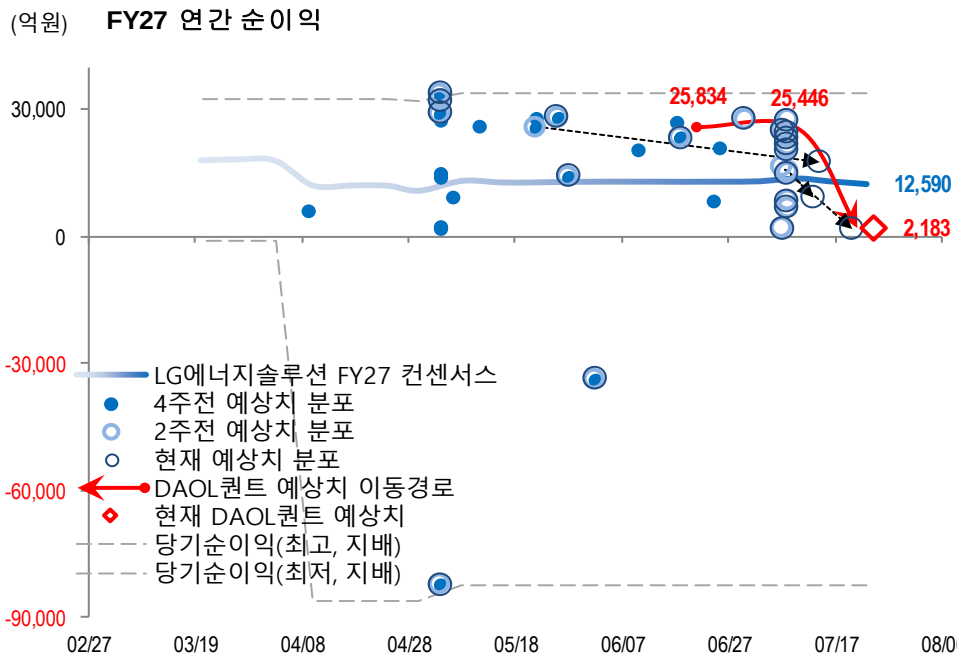
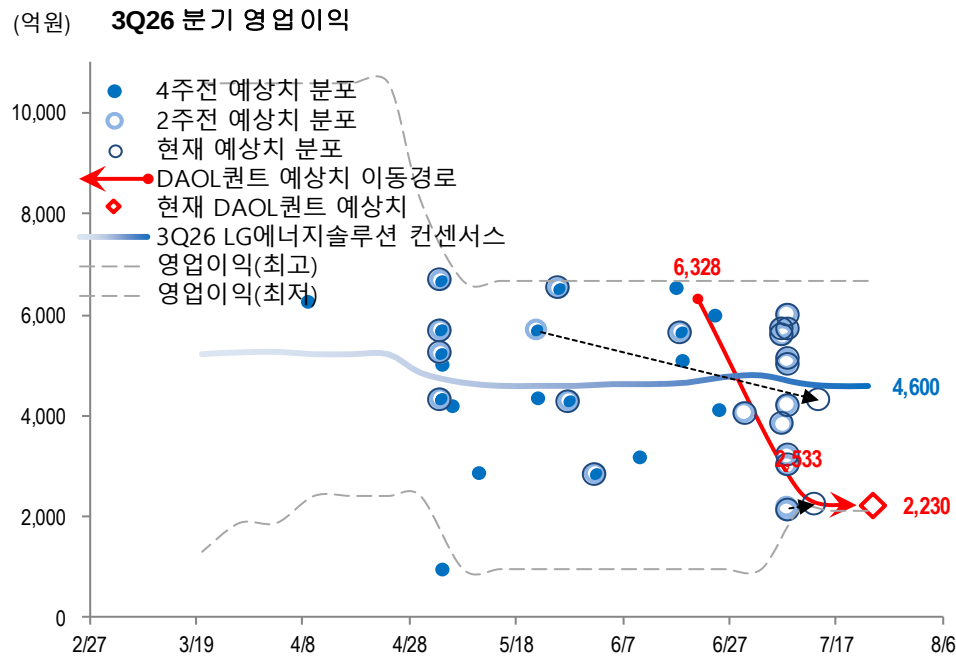




LG에너지솔루션

구분	3Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	4,600	(시장대비 수급) 기관 OW/UW 외국인 OW/UW LG에너지솔루션 주가(RHS) LG에너지솔루션 12M Fwd 컨센서스(RHS) (P, Rebased)
최대값	6,678	
최저값	2,110	
실적발표일	기발표	
DAOL퀀트 예상치	2,230	
Beat or Miss	0	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Short	

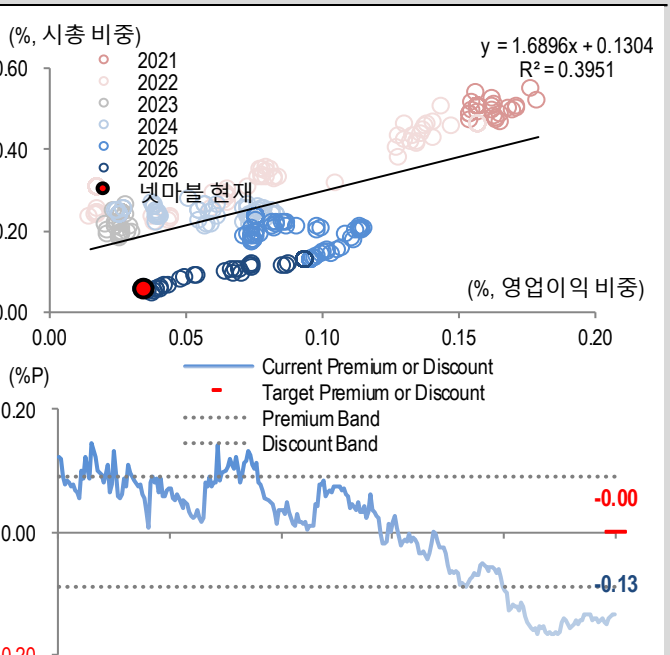
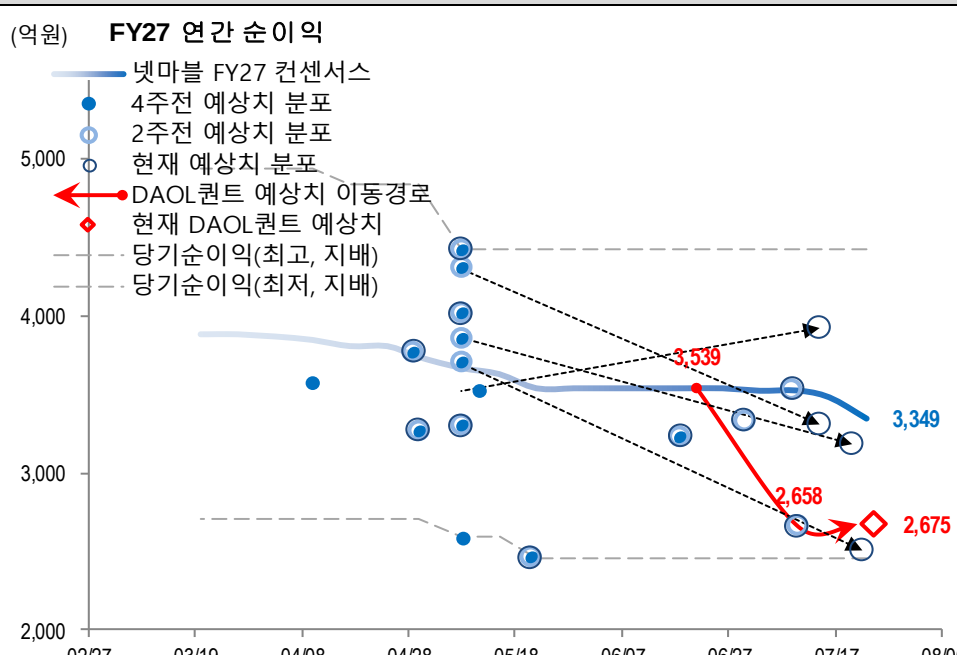
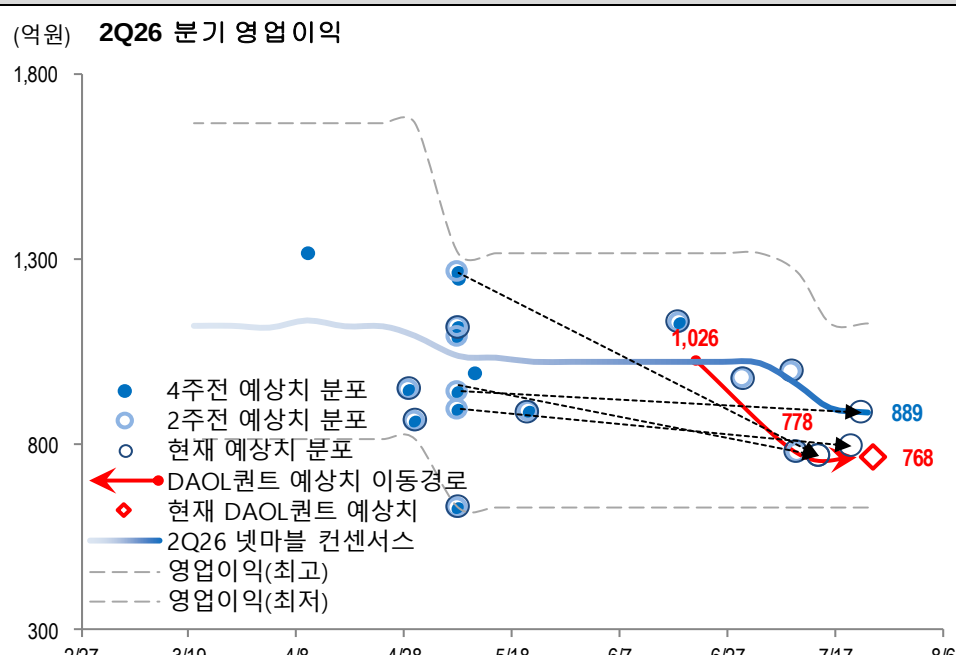
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-14	4,318	김귀연, 박서영	대신증권
2026-07-13	2,230	안희수	DB증권



넷마블

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	889	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW 넷마블 주가(RHS) 넷마블 12M Fwd 컨센서스(RHS) (P, Rebased)
최대값	1,130	
최저값	630	
실적발표일	2026-08-07	
DAOL퀀트 예상치	768	
실적 Beat or Miss	Shock	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Short	

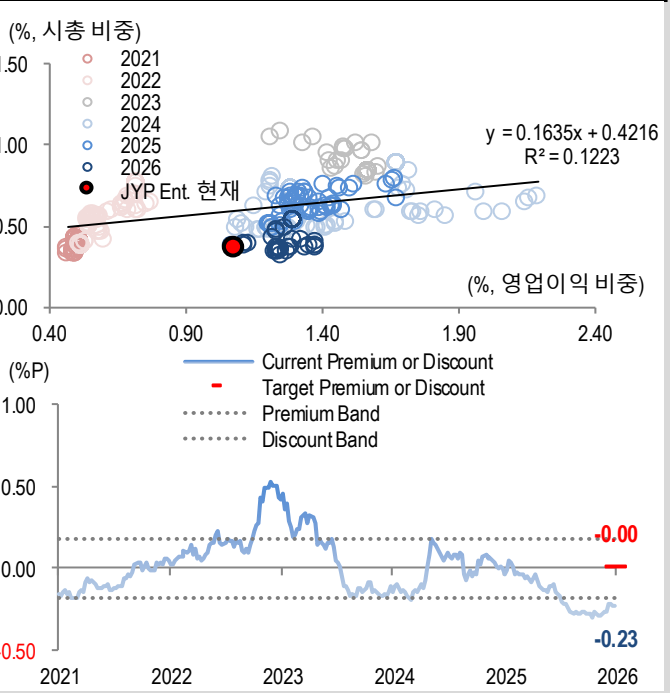
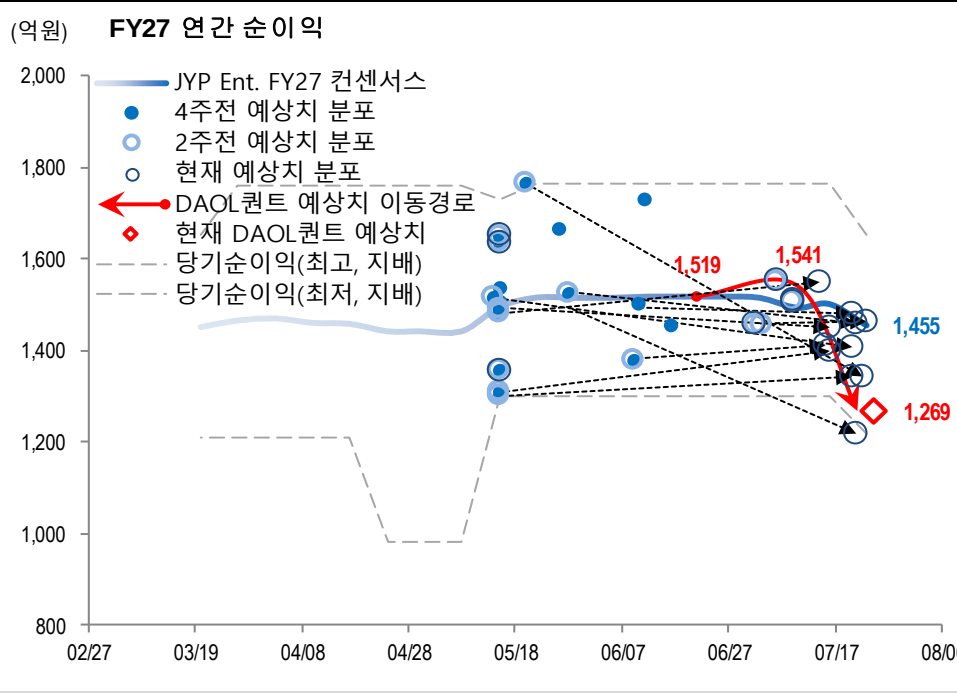
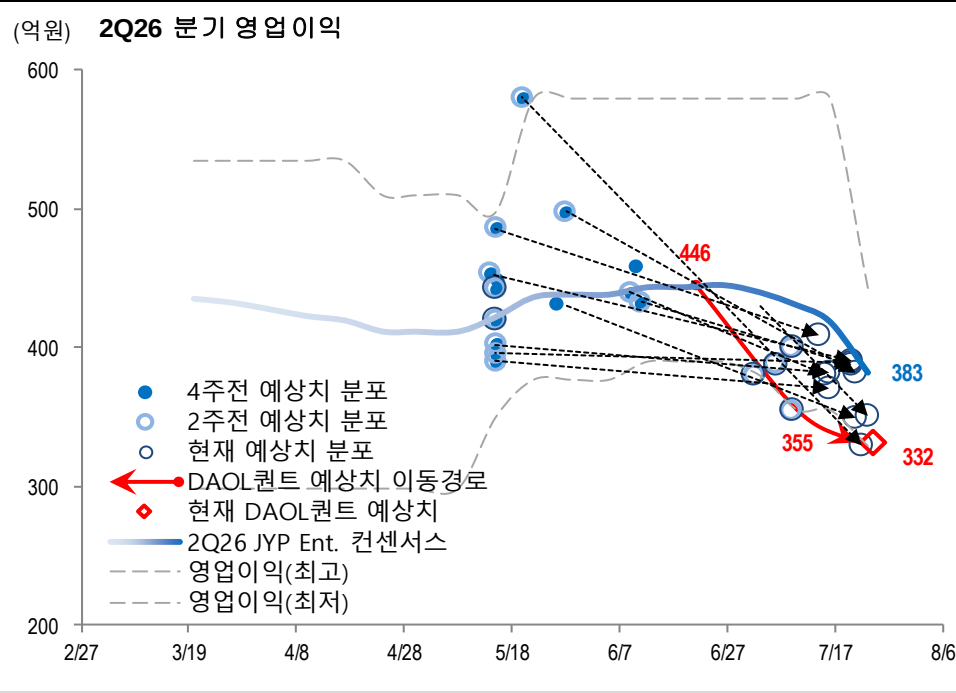
최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-22	887	오동환, 유혜림	삼성증권
2026-07-20	797	이효진, 김수민	메리츠증권
2026-07-14	772	김동우	교보증권
2026-07-14	768	김혜영	다올투자증권



JYP Ent.

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	383	(시장대비 수급) 기관 OW/UW 외국인 OW/UW JYP Ent. 주가(RHS) JYP Ent. 12M Fwd 컨센서스(RHS) (P, Rebased)
최대값	443	
최저값	329	
실적발표일	2026-08-13	
DAOL퀀트 예상치	332	
실적 Beat or Miss	Shock	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Short	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-23	351	지인해	신한투자증권
2026-07-22	329	김지현	신영증권
2026-07-21	382	박준형	SK증권
2026-07-21	350	장지혜	DS투자증권
2026-07-20	387	이환욱	유안타증권





GS건설

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	1,207	(시장대비 수급) 외국인 OW/UW 기관 OW/UW (P, Rebased)
최대값	1,470	GS건설 추가(RHS)
최저값	1,040	GS건설 12M Fwd 컨센서스(RHS)
실적 발표일	2026-07-30	
DAOL퀀트 예상치	1,079	
실적 Beator Miss	Shock	
Valuation	Fair	
L/S Position	Short	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-21	1,128	장문준,강민창	KB증권
2026-07-15	1,079	김진범	상상인증권
2026-07-14	1,170	이상호	교보증권
2026-07-13	1,151	김선미	신한투자증권
2026-07-13	1,110	신동현	현대차증권

현대제철

구분	2Q26 분기현황	Beta Portion
컨센서스 (평균)	833	(시장대비 수급) 기관 OW/UW 외국인 OW/UW (P, Rebased)
최대값	1,270	현대제철 추가(RHS)
최저값	660	현대제철 12M Fwd 컨센서스(RHS)
실적 발표일	2026-08-03	
DAOL퀀트 예상치	662	
Beator Miss	Shock	
Valuation	Undervalued	
L/S Position	Short	

최근 예상치(날짜)	영업이익	애널리스트	증권사
2026-07-20	660	김진범	상상인증권
2026-07-14	717	이정우	다올투자증권
2026-07-14	1,035	강민아	대신증권
2026-07-14	670	김기룡	미래에셋증권
2026-07-13	687	장재혁,김아현	메리츠증권

