

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

7월 5주차 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) 역사적인 MDD 수준을 기록하며 높은 변동성이 나타나고 있지만, 2분기 실적시즌 기간 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 5주차] 1) 월간 추정치 조정률 2) 최저 추정치 조정률 3) 최저/최고 괴리율 스코어 상위 30% 중 괴리율 축소 종목 스크리닝

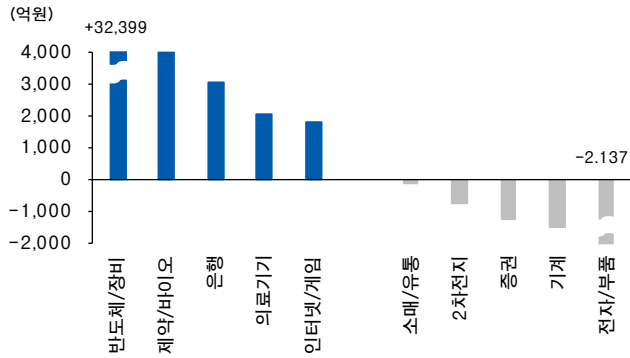
종목명	업종	시가총액 (억원)	2Q26 영업이익의 추정치(억원)		2Q26 최저 영업이익의 추정치(억원)		최고/최저 추정치 괴리율(%)	
			6/30일 기준	7/30일 기준	6/30일 기준	7/30일 기준	6/30일 기준	7/30일 기준
GKL	호텔,레저서비스	5,722	196	244.6	180.0	230	16.1	9.6
테스	반도체	22,128	256	273.5	240.0	257	12.9	12.8
KCC	건설,건축관련	30,290	1,093	1201.5	1,026.0	1,143	13.1	10.2
한전KPS	유틸리티	19,013	649	675.0	618.0	670	10.0	1.5
휴젤	건강관리	28,722	503	509.7	486.0	501	7.0	5.6
롯데쇼핑	소매(유통)	33,154	1,139	1142.2	1,000.0	1,050	34.0	17.1
한국콜마	화장품,의류,완구	22,991	944	952.3	862.0	903	17.2	10.3
코스메카코리아	화장품,의류,완구	8,800	261	274.9	242.0	263	11.6	8.4
NHN	소프트웨어	10,989	445	445.5	385.0	413	30.9	20.6
LIG디펜스엔에어로스페이스	상사,자본재	136,400	1,112	1175.4	960.0	987	36.5	30.1

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -7.8 조원 순매도, 기관은 약 +5.0 조원 순매수를 기록. 역사적인 수준의 MDD를 기록하며 외국인의 강도 높은 순매도 재출현
- 업종단에서는 기관과 외국인이 동시 순매수/매도한 업종이 확인되지 않았지만, 종목단에서는 LG생활건강은 두 수급 주체 모두 순매수 상위에 위치

기관 주간 순매수 상/하위 업종

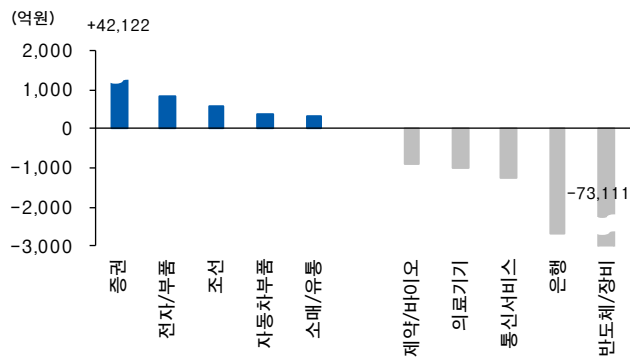


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	32,399	-38,224	130,218	
2	제약/바이오	3,950	8,718	3,194	
3	은행	3,017	14,248	13,776	
4	의료기기	2,033	3,324	4,739	
5	인터넷/게임	1,800	4,815	10,224	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	-2,137	-10,505	-5,795	
2	기계	-1,556	113	-12,721	
3	증권	-1,305	-990	-7,021	
4	2차전지	-774	-772	-13,341	
5	소매/유통	-135	-2,578	-3,259	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

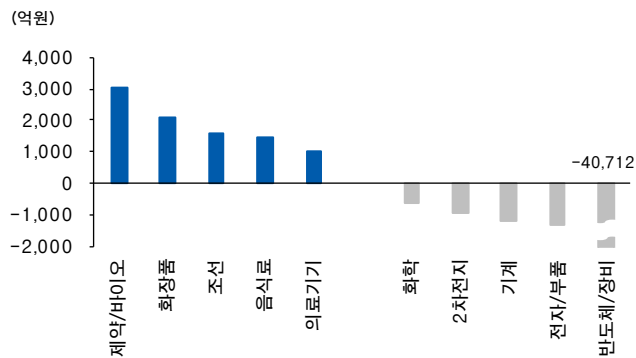


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	증권	1,495	3,364	2,945	
2	전자/부품	805	4,091	-23,260	
3	조선	566	-1,375	-12,831	
4	자동차부품	347	2,006	-28,338	
5	소매/유통	329	3,212	5,540	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-73,111	-181,417	-953,665	
2	은행	-2,702	-6,919	-4,247	
3	통신서비스	-1,263	-2,941	-6,311	
4	의료기기	-995	-1,386	-1,901	
5	제약/바이오	-901	447	3,966	

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	3,049	9,165	7,160	
2	화장품	2,065	4,727	3,196	
3	조선	1,583	34	-10,894	
4	음식료	1,452	3,174	2,984	
5	의료기기	1,038	1,938	2,837	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-40,712	-219,641	-823,447	
2	전자/부품	-1,332	-6,414	-29,055	
3	기계	-1,236	-2,317	-33,797	
4	2차전지	-980	-124	-593	
5	화학	-640	-1,888	-5,907	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/30일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A214450	파마리서치	의료기기	36,156	1,981	1.28
A192820	코스맥스	화장품	21,099	330	0.39
A241710	코스메카코리아	화장품	8,544	112	0.32
A051900	LG생활건강	화장품	43,729	491	0.31
A004370	농심	음식료	23,540	216	0.23
A090430	아모레퍼시픽	화장품	78,380	630	0.22
A010060	OCI홀딩스	화학	32,748	251	0.18
A001450	현대해상	손해보험	33,034	232	0.18
A003230	삼양식품	음식료	93,635	543	0.15
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	9,001	53	0.15

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A353200	대덕전자	전자/부품	36,816	1,191	0.68
A240810	원익IPS	반도체/장비	37,451	705	0.40
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	45,691	905	0.39
A222800	심텍	전자/부품	23,902	392	0.35
A051900	LG생활건강	화장품	43,729	382	0.24
A014680	한솔케미칼	화학	20,584	147	0.17
A183300	코미코	반도체/장비	11,177	76	0.16
A403870	HPSP	반도체/장비	23,497	168	0.16
A058470	리노공업	반도체/장비	42,069	248	0.13
A069960	현대백화점	소매/유통	24,433	136	0.13

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A214450	파마리서치	의료기기	36,156	997	0.6
A051900	LG생활건강	화장품	43,729	873	0.5
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	45,691	841	0.4
A004370	농심	음식료	23,540	235	0.3
A003230	삼양식품	음식료	93,635	888	0.2
A090430	아모레퍼시픽	화장품	78,380	622	0.2
A222800	심텍	전자/부품	23,902	207	0.2
A240810	원익IPS	반도체/장비	37,451	317	0.2
A192820	코스맥스	화장품	21,099	141	0.2
A060250	NHN KCP	SW/SI	4,530	28	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A042660	한화오션	조선	242,986	640.7	-2,306	-4,712
A403870	HPSP	반도체/장비	23,497	145.0	-2,332	-1,718
A240810	원익IPS	반도체/장비	37,451	317.2	-1,667	-783
A042700	한미반도체	반도체/장비	159,743	579.2	-466	-11,618
A066970	엘앤에프	2차전지	27,258	18.5	-412	-2,824
A073240	금호타이어	자동차부품	17,465	36.3	-297	-795
A034230	파라다이스	호텔/레저	8,753	19.3	-284	-177
A353200	대덕전자	전자/부품	36,816	182.1	-86	349
A222800	심텍	전자/부품	23,902	207.1	-20	2,113
A058470	리노공업	반도체/장비	42,069	176.7	-14	3,479

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 7/30일 기준

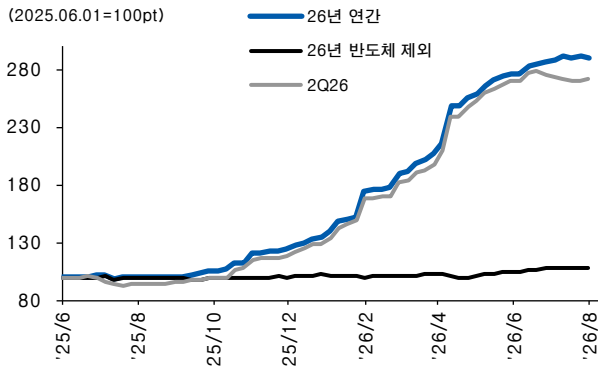
업종별

종목별

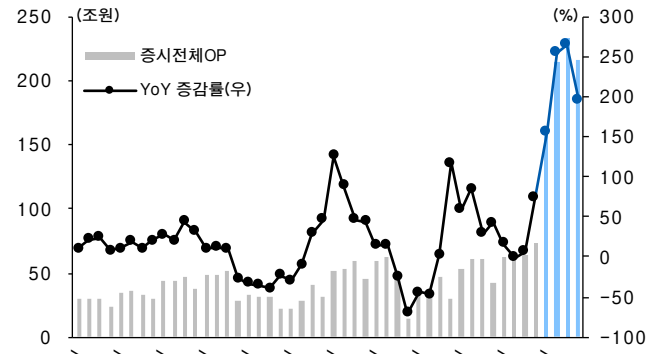
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 -0.3% 하향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.9% 하향 조정
- '26년 연간 영업이익 추정치 전반적으로 상향 조정 추세가 둔화되는 상황. 반면, 화학(+9.1%) 업종의 경우 이번주 강도 높은 상향 조정이 나타났으며, 항공(+1.3%), 조선(+1.3%), 미디어/엔터(+1.2%), 전기(+1.1%) 등의 업종은 소폭 상향 조정 진행

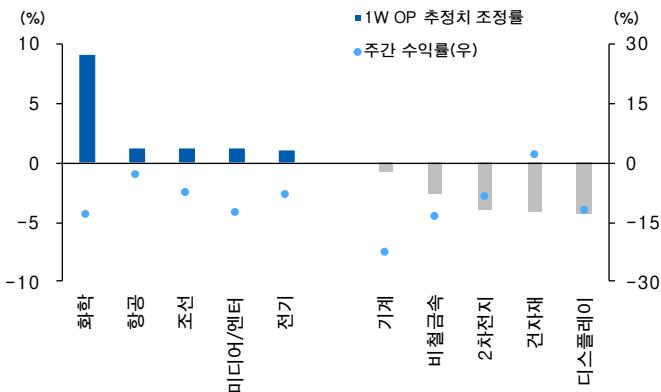
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

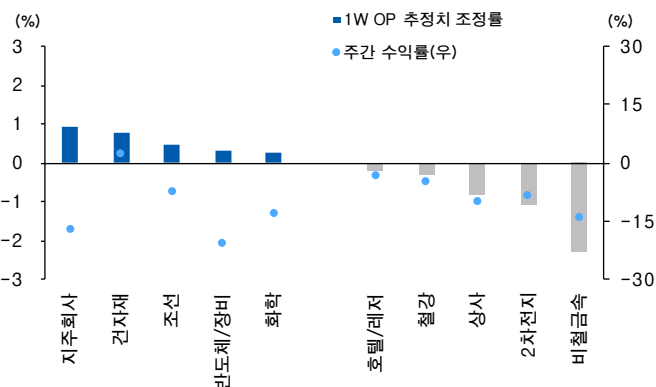


26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	43,195	9.1	-13.0	
2	항공	11,696	1.3	-3.1	
3	조선	136,409	1.3	-7.6	
4	미디어/엔터	15,622	1.2	-12.7	
5	전기	89,892	1.1	-8.4	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	디스플레이	10,260	-4.3	-12.4	
2	전자재	1,590	-4.2	2.1	
3	2차전지	11,463	-3.9	-8.6	
4	비철금속	26,544	-2.6	-13.8	
5	기계	76,015	-0.8	-22.8	

26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 2분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

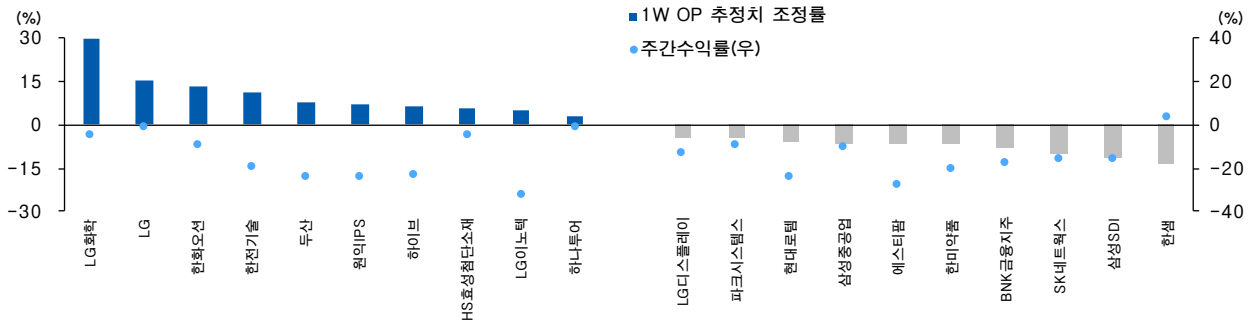
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	지주회사	97,724	0.9	-17.2	
2	전자재	397	0.8	2.1	
3	조선	34,681	0.5	-7.6	
4	반도체/장비	1,498,931	0.3	-20.7	
5	화학	12,394	0.2	-13.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	6,667	-2.3	-13.8	
2	2차전지	1,664	-1.0	-8.6	
3	상사	5,134	-0.8	-10.0	
4	철강	8,490	-0.3	-4.9	
5	호텔/레저	2,147	-0.2	-3.1	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 7/29일 추정치 기준(수익률 7/30일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

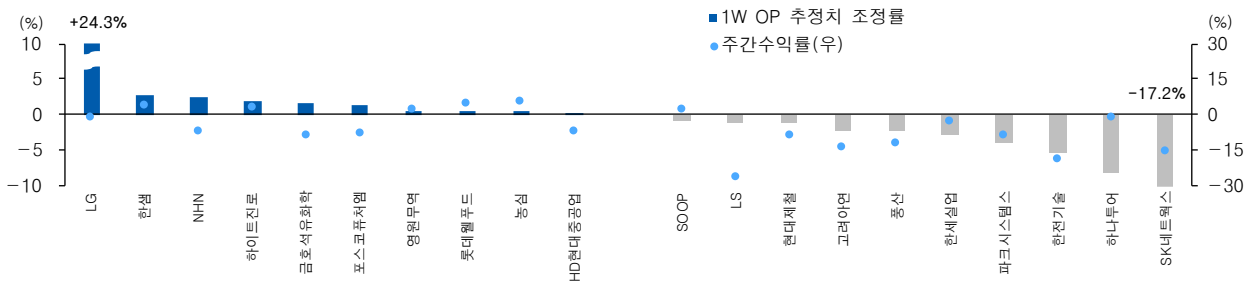


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A051910	LG화학	화학	15,297	29.6	-5.2	1	A009240	한샘	건자재	440	-13.7	3.0
2	A003550	LG	지주회사	17,780	15.2	-1.5	2	A006400	삼성SDI	2차전지	1,010	-11.8	-16.2
3	A042660	한화오션	조선	22,395	13.1	-9.8	3	A001740	SK네트웍스	상사	1,106	-9.9	-16.0
4	A052690	한전기술	전기	754	10.9	-19.4	4	A138930	BNK금융지주	은행	9,992	-7.8	-18.0
5	A000150	두산	지주회사	18,131	7.6	-24.4	5	A128940	한미약품	제약/바이오	3,019	-7.0	-20.5
6	A240810	원익IPS	반도체/장비	2,041	7.3	-24.1	6	A237690	에스티팜	제약/바이오	756	-6.8	-27.4
7	A352820	하이브	미디어/엔터	2,833	6.5	-23.1	7	A010140	삼성중공업	조선	13,703	-6.5	-10.3
8	A298050	HS효성첨단소재	화학	2,191	5.8	-5.1	8	A064350	현대로템	기계	10,997	-6.3	-23.9
9	A011070	LG이노텍	전자/부품	12,734	4.8	-32.2	9	A140860	파크시스템스	전자/부품	511	-4.9	-9.0
10	A039130	하나투어	호텔/레저	537	3.1	-1.3	10	A034220	LG디스플레이	디스플레이	9,282	-4.7	-12.9

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

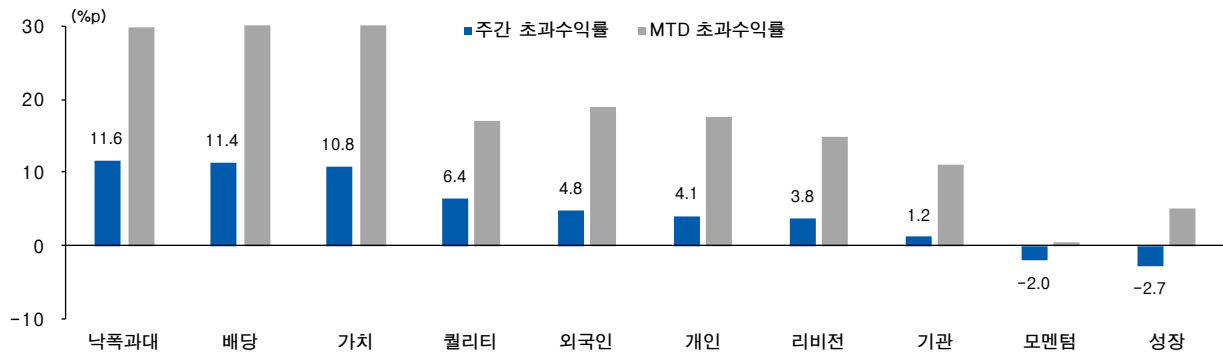
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A003550	LG	지주회사	4,980	24.3	-1.5	1	A001740	SK네트웍스	상사	205	-17.2	-16.0
2	A009240	한샘	건자재	117	2.6	3.0	2	A039130	하나투어	호텔/레저	40	-8.4	-1.3
3	A181710	NHN	SW/SI	446	2.4	-7.1	3	A052690	한전기술	전기	141	-5.4	-19.4
4	A000080	하이트진로	음식료	617	1.8	2.8	4	A140860	파크시스템스	전자/부품	103	-4.0	-9.0
5	A011780	금호석유화학	화학	1,787	1.7	-9.2	5	A105630	한세실업	섬유/의복	187	-2.8	-2.9
6	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	315	1.2	-8.1	6	A103140	풍산	비철금속	860	-2.5	-12.3
7	A111770	영원무역	섬유/의복	1,891	0.5	1.6	7	A010130	고려아연	비철금속	5,807	-2.3	-14.0
8	A280360	롯데웰푸드	음식료	492	0.5	3.9	8	A004020	현대제철	철강	748	-1.4	-9.4
9	A004370	농심	음식료	521	0.5	5.3	9	A006260	LS	지주회사	4,728	-1.2	-27.2
10	A329180	HD현대중공업	조선	9,767	0.2	-7.7	10	A067160	SOOP	미디어/엔터	249	-1.1	1.7

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 7/29일 추정치 기준(수익률 7/30일 기준)

업종별

종목별

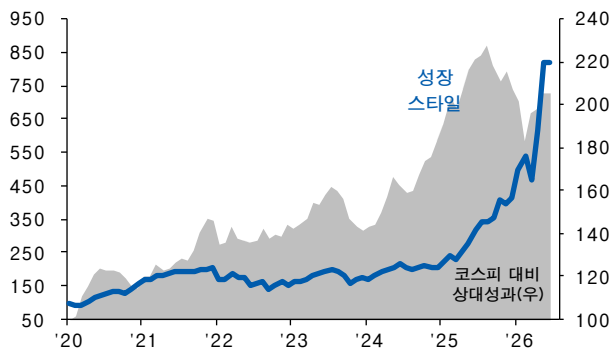
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
60.0	0.9

(2020.01.31=100pt)



성장 스코어 Top 10

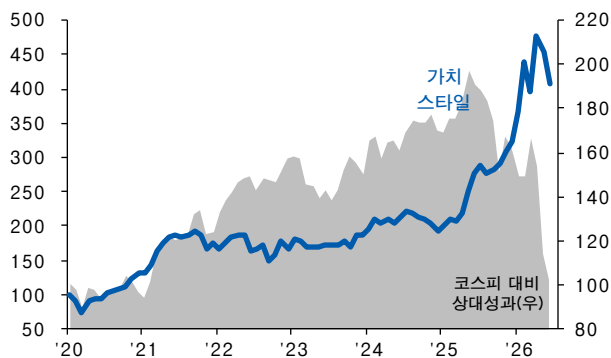
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.8	9.8	9.7	29.2	-17.0
A353200	대덕전자	8.1	9.5	9.0	26.6	-32.0
A009150	삼성전기	7.7	8.8	8.5	25.0	-33.7
A267270	HD건설기계	8.3	8.2	7.8	24.3	-13.9
A298040	효성중공업	7.7	8.1	8.2	24.0	-29.4
A010120	LS ELECTRIC	7.9	7.8	7.8	23.6	-25.6
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.7	5.4	23.0	-21.1
A278470	에이피알	9.6	8.4	4.8	22.7	-11.0
A006260	LS	7.4	7.4	7.9	22.7	-27.2
A000660	SK하이닉스	9.8	6.4	6.4	22.5	-24.8

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	-4.7
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.5	29.3	-10.1
A108670	LX하우시스	9.8	9.5	9.8	29.1	-0.6
A088350	한화생명	9.1	9.8	9.8	28.7	-8.4
A036460	한국가스공사	8.8	9.8	10.0	28.5	-1.4
A001450	현대해상	9.8	8.7	9.6	28.1	-4.0
A097950	CJ제일제당	8.8	9.3	9.8	27.9	-2.5
A000120	CJ대한통운	8.7	9.5	9.5	27.8	-5.0
A139130	iM금융지주	9.2	9.2	9.1	27.6	-9.5
A078930	GS	9.6	9.3	8.5	27.4	-9.2

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

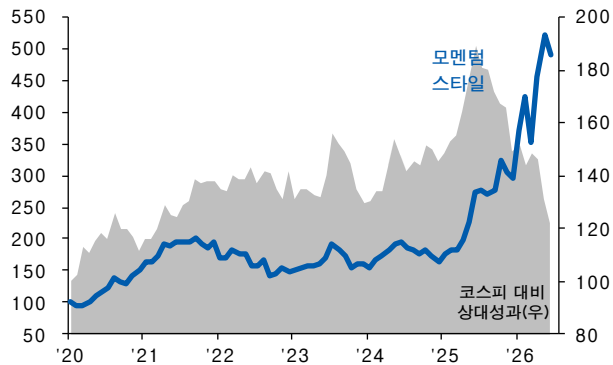
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

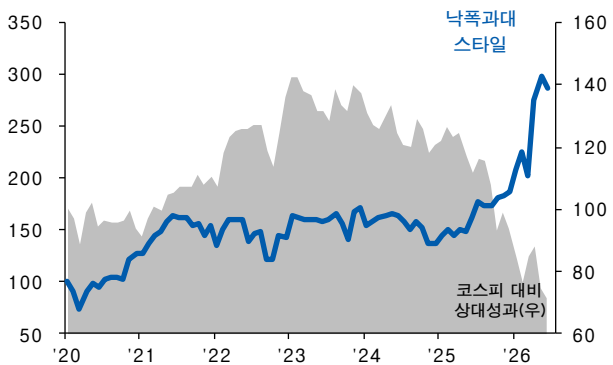
(2020.01.31=100pt)



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	-24.8
A222800	심텍	9.8	9.8	9.6	9.7	38.8	-27.9
A034730	SK	9.8	9.7	9.7	9.5	38.6	-25.6
A004170	신세계	9.9	9.7	9.6	9.5	38.6	-21.4
A009150	삼성전기	8.7	10.0	10.0	10.0	38.5	-33.7
A240810	원익IPS	9.9	9.1	9.4	9.7	38.0	-24.1
A036930	주성엔지니어링	8.4	9.9	9.9	9.8	37.9	-30.3
A069960	현대백화점	10.0	9.6	9.2	9.0	37.7	-12.6
A005930	삼성전자	9.0	9.5	9.5	9.6	37.6	-17.0
A032830	삼성생명	8.8	9.4	9.4	9.3	36.8	-17.0

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	2.4
A035760	CJ ENM	7.7	9.9	10.0	9.6	37.1	0.3
A293490	카카오게임즈	7.4	9.7	9.9	9.7	36.7	-2.0
A376300	디어유	6.1	9.4	9.8	10.0	35.2	-5.0
A000100	유한양행	7.0	9.1	9.4	8.8	34.4	-1.2
A039130	하나투어	6.9	8.4	9.4	9.3	34.0	-1.3
A352820	하이브	5.5	9.7	9.7	8.8	33.6	-23.1
A035720	카카오	7.2	8.8	9.7	7.9	33.6	-0.1
A361610	SK아이이테크놀로지	6.6	8.8	9.3	8.2	32.9	-7.5
A069620	대웅제약	5.8	9.4	9.3	8.3	32.8	-1.7

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

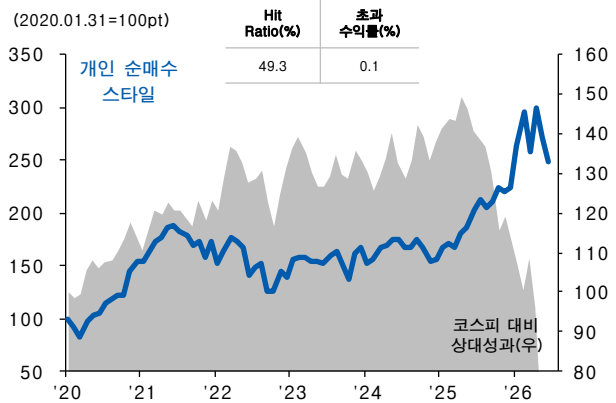
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

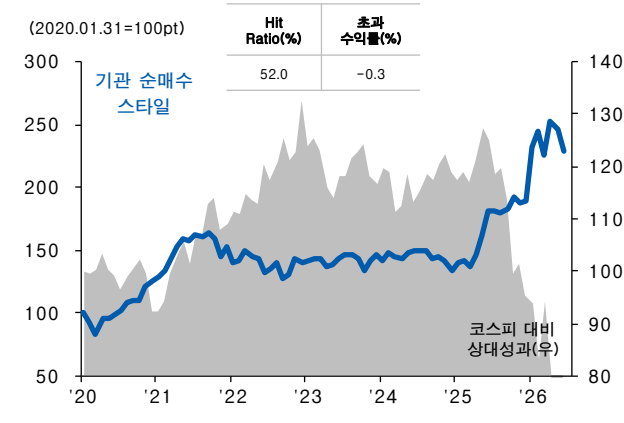


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	-1.3
A005380	현대차	9.7	8.8	9.9	9.6	37.9	-12.5
A066570	LG전자	10.0	9.8	9.4	8.7	37.9	-12.5
A011790	SKC	9.6	9.6	9.0	9.1	37.2	-21.5
A006360	GS건설	7.3	9.9	9.9	9.8	36.9	-26.4
A035760	CJ ENM	7.9	10.0	9.4	9.4	36.5	0.3
A011070	LG이노텍	9.8	9.7	9.1	7.9	36.5	-32.2
A012330	현대모비스	9.2	9.4	9.3	8.5	36.3	-7.7
A010140	삼성중공업	9.2	9.6	8.6	8.4	35.8	-10.3
A036930	주성엔지니어링	8.6	9.3	8.9	8.7	35.4	-30.3

기관 순매수 스타일 성과 추이

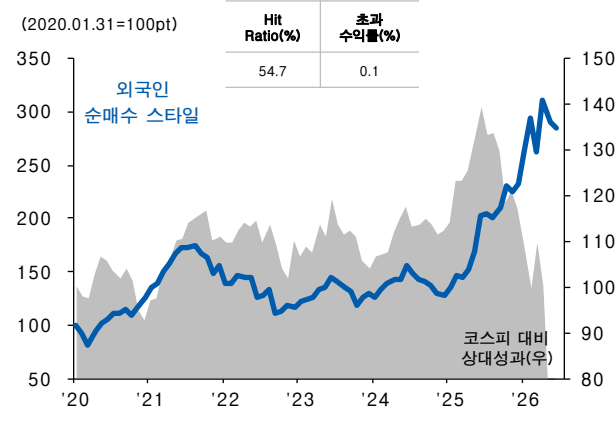


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-19.9
A222800	심택	9.9	9.9	9.7	9.5	39.0	-27.9
A008770	호텔신라	9.3	10.0	9.8	9.7	38.7	-9.0
A030000	제일기획	10.0	9.8	8.5	8.4	36.5	0.3
A161890	한국콜마	9.8	9.9	9.9	6.8	36.3	-7.0
A336260	두산퓨얼셀	8.0	9.6	9.3	9.4	36.2	-55.8
A240810	원익IPS	9.8	6.9	9.7	9.7	36.0	-24.1
A138930	BNK금융지주	9.6	8.9	8.0	9.4	35.9	-18.0
A007660	이슈페타시스	9.6	9.4	9.0	7.2	35.2	-32.0
A214320	이노션	8.3	9.7	8.8	8.3	35.1	-0.1

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	2.4
A120110	코오롱인더	9.7	9.9	9.5	9.3	38.3	-13.9
A001120	LX인터내셔널	9.6	9.6	9.7	9.1	37.9	-9.2
A241710	코스메카코리아	8.6	9.8	9.0	9.8	37.2	-0.9
A183300	코미코	9.9	9.4	9.1	8.7	37.0	-11.4
A298020	효성티앤씨	9.6	9.8	9.5	8.0	36.9	-7.0
A003490	대한항공	9.5	8.9	9.6	8.8	36.7	-3.1
A195870	해성디에스	9.7	8.1	9.0	9.5	36.2	-22.9
A066970	엘앤에프	9.1	8.7	9.1	9.3	36.1	-18.2
A001430	세아베스틸지주	9.8	8.5	9.3	8.4	36.0	-9.1

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/30일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

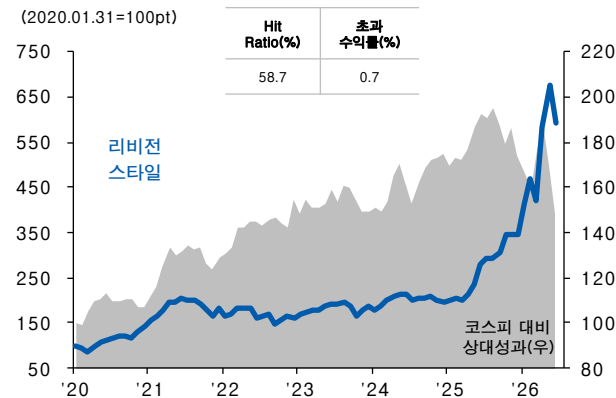
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

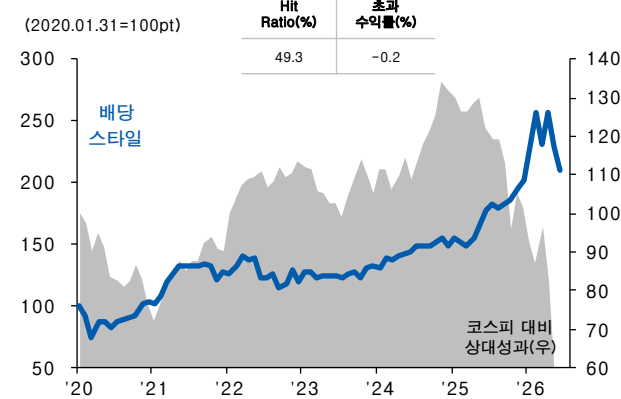


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.0	9.6	8.6	27.2	-4.6
A010130	고려아연	8.5	8.9	9.4	26.9	-14.0
A004170	신세계	8.2	9.2	9.3	26.7	-21.4
A000660	SK하이닉스	9.1	8.2	8.3	25.6	-24.8
A003490	대한항공	8.8	9.5	6.9	25.1	-3.1
A006260	LS	8.4	8.7	7.7	24.8	-27.2
A005940	NH투자증권	6.6	9.0	8.9	24.4	-8.4
A069960	현대백화점	6.3	8.8	8.9	24.0	-12.6
A006800	미래에셋증권	6.5	9.3	8.0	23.8	-18.2
A039490	키움증권	6.6	8.8	8.4	23.8	-13.4

배당 스타일 성과 추이

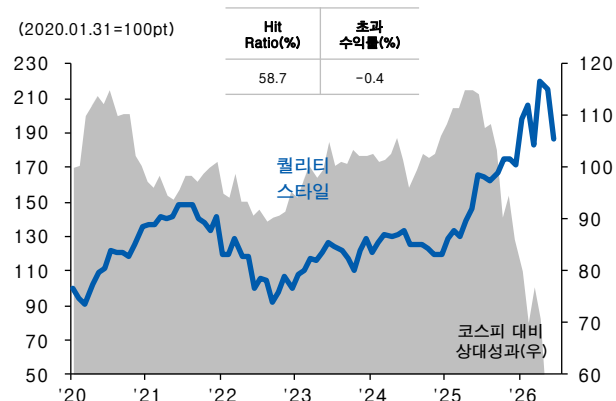


배당 스코어 Top 10

(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	0.3
A214320	이노션	8.3	9.8	9.3	9.8	37.2	-0.1
A035250	강원랜드	8.7	9.9	8.5	9.8	36.9	0.7
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.4	9.6	9.7	36.9	-9.2
A005940	NH투자증권	8.0	9.2	9.9	9.6	36.6	-8.4
A032640	LG유플러스	8.4	9.5	8.9	8.9	35.8	4.2
A017670	SK텔레콤	9.4	9.0	9.1	7.8	35.3	-21.8
A000080	하이트진로	9.7	8.5	8.1	8.9	35.1	2.8
A024110	기업은행	6.0	9.7	9.9	9.4	35.0	-4.2
A298020	효성티앤씨	9.9	7.8	9.3	7.9	34.9	-7.0

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	-19.9
A058470	리노공업	9.8	9.8	9.7	8.9	38.1	-19.5
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	37.9	-24.8
A042700	한미반도체	9.6	8.7	9.5	9.6	37.4	-16.2
A214150	클래시스	8.3	9.7	9.6	9.2	36.8	-15.5
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.6	9.6	36.6	-3.7
A145020	휴젤	9.9	9.5	9.3	7.5	36.3	-4.3
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.1	35.7	-2.5
A376300	디어유	9.7	9.5	9.4	7.0	35.6	-5.0
A383220	F&F	8.2	9.1	9.1	8.7	35.1	3.7

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 7/30일 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.