

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

8월 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: [어떻게 MDD까지 사랑하겠어, 반등을 기대하는 거지](#))

- 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 펀더멘탈 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

[8월 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 영업이익의 추정치(억원)		2Q26 최저 영업이익의 추정치(억원)		최고/최저 추정치 괴리율(%)	
			7/5일 기준	8/5일 기준	7/5일 기준	8/5일 기준	7/5일 기준	8/5일 기준
기가비스	반도체	14,755	38	66.7	33.0	60	30.3	31.7
신세계	소매(유통)	40,614	1,536	1569.2	1,184.0	1,490	44.4	11.4
GKL	호텔, 레저서비스	5,734	207	244.6	180.0	230	33.3	9.6
삼성화재	보험	284,404	5,910	6929.9	5,430.0	6,610	16.2	8.8
솔브레인	반도체	22,208	403	451.5	403.0	442	0.0	4.1
농심	필수소비재	22,901	484	524.1	463.0	493	7.8	17.0
파마리서치	건강관리	39,273	665	689.1	640.0	663	7.0	13.4
NHN	소프트웨어	14,018	426	440.4	385.0	413	22.3	20.6
카카오	소프트웨어	168,997	1,902	2271.2	1,726.0	2,184	20.4	12.8
DB손해보험	보험	101,919	4,307	5021.9	3,970.0	4,734	26.0	10.5
이수페타시스	반도체	62,178	748	768.4	738.0	751	3.7	3.9
영원무역	화장품, 의류, 완구	39,083	1,780	1913.6	1,780.0	1,800	0.0	10.6
한국콜마	화장품, 의류, 완구	24,148	945	952.7	862.0	903	17.2	10.3
롯데쇼핑	소매(유통)	32,334	1,130	1136.9	1,000.0	1,050	34.0	17.1
미스토홀딩스	화장품, 의류, 완구	23,387	2,113	2208.0	1,910.0	1,910	16.2	20.9

자료: 에프앤가이드 Quantivise, 유안타증권 리서치센터

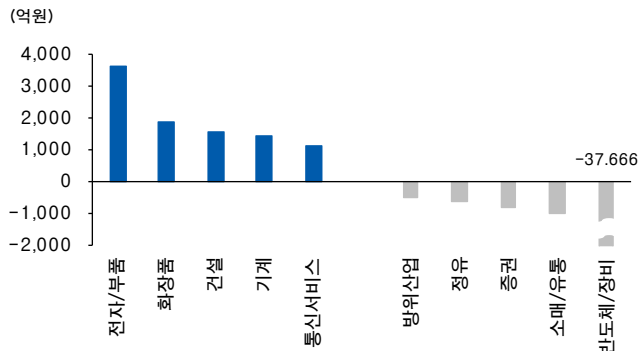
주1) 보험, 증권 업종 순이익 기준

주2) 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -4.9 조원 순매도, 기관은 약 -2.8 조원 순매도를 기록. 반도체/장비 업종의 높은 변동성이 지속되며 기관 및 외국인 자금이 이탈하는 흐름
- 그 외 인터넷/게임, 제약/바이오, 건설, 화장품, 기계 등의 업종이 기관+외국인 주간 순매수 상위에 스크리닝

기관 주간 순매수 상/하위 업종

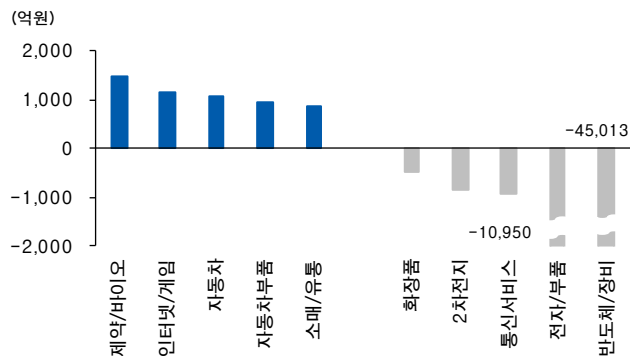


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	3,604	-1,775	-2,475	
2	화장품	1,832	2,330	4,731	
3	건설	1,548	3,535	1,930	
4	기계	1,440	-1,277	-10,449	
5	통신서비스	1,114	5,533	4,397	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-37,666	-20,813	75,848	
2	소매/유통	-1,004	-3,180	-5,002	
3	증권	-829	-4,288	-8,761	
4	정유	-648	5,789	4,393	
5	방위산업	-550	1,112	8,521	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

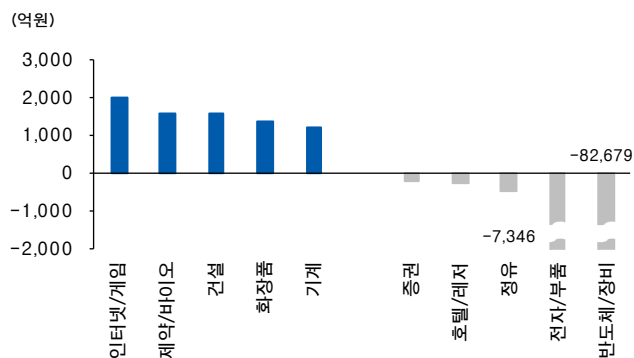


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	1,472	2,885	6,947	
2	인터넷/게임	1,143	2,070	-4,623	
3	자동차	1,054	4,486	-25,935	
4	자동차부품	953	3,447	-26,831	
5	소매/유통	871	3,517	6,314	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-45,013	-72,089	-872,876	
2	전자/부품	-10,950	-4,433	-31,070	
3	통신서비스	-920	-4,812	-8,047	
4	2차전지	-866	-482	8,586	
5	화장품	-490	1,483	36	

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	인터넷/게임	2,009	6,623	8,486	
2	제약/바이오	1,588	8,474	12,040	
3	건설	1,583	5,764	6,666	
4	화장품	1,341	3,814	4,767	
5	기계	1,182	2,876	-22,154	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-82,679	-92,902	-797,028	
2	전자/부품	-7,346	-6,208	-33,544	
3	정유	-507	5,640	6,376	
4	호텔/레저	-255	-700	-440	
5	증권	-226	1,575	-3,696	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 8/6일 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	27,900	817	0.82
A009830	한화솔루션	화학	52,255	567	0.29
A222800	심텍	전자/부품	39,712	432	0.29
A353200	대덕전자	전자/부품	49,170	563	0.28
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	21,613	220	0.27
A103140	풍산	비철금속	23,484	230	0.27
A051900	LG생활건강	화장품	48,521	415	0.23
A195870	해성디에스	반도체/장비	8,925	74	0.21
A010060	OCI홀딩스	화학	45,555	356	0.21
A192820	코스맥스	화장품	22,926	163	0.18

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A008770	호텔신라	호텔/레저	16,818	226	0.34
A069960	현대백화점	소매/유통	22,945	243	0.25
A214450	파마리서치	의료기기	40,987	371	0.23
A257720	실리콘투	화장품	25,804	218	0.22
A108670	LX하우시스	건자재	3,085	25	0.21
A004170	신세계	소매/유통	40,378	311	0.19
A204320	HL만도	자동차부품	24,042	165	0.18
A006650	대한유화	화학	5,922	39	0.17
A073240	금호타이어	자동차부품	22,808	122	0.15
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	32,391	181	0.14

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A006360	GS건설	건설	27,900	919	0.9
A051900	LG생활건강	화장품	48,521	599	0.3
A214450	파마리서치	의료기기	40,987	489	0.3
A103140	풍산	비철금속	23,484	223	0.3
A204320	HL만도	자동차부품	24,042	226	0.2
A375500	DL이앤씨	건설	27,898	246	0.2
A108670	LX하우시스	건자재	3,085	25	0.2
A294870	HDC현대산업개발	건설	14,961	100	0.2
A241710	코스메카코리아	화장품	10,242	63	0.2
A035420	NAVER	인터넷/게임	354,694	2,280	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A009830	한화솔루션	화학	52,255	178.3	-721	-1,403
A034220	LG디스플레이	디스플레이	47,800	1.8	-661	879
A010060	OCI홀딩스	화학	45,555	87.6	-461	638
A071970	HD현대마린엔진	기계	19,132	37.9	-105	-1,014
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	10,093	21.6	-114	-160
A307950	현대오토에버	SW/SI	114,358	12.1	-92	500
A237690	에스티팜	제약/바이오	21,148	46.0	-54	316
A018880	한온시스템	자동차부품	37,048	66.5	-27	80
A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	16,364	4.7	-76	-221
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	16,754	29.1	-26	544

자료: 에프엔가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 8/6일 기준

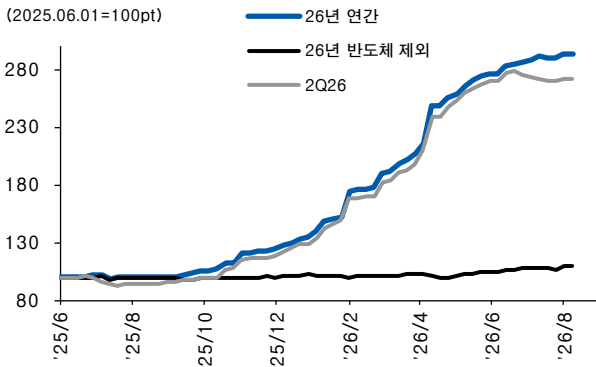
업종별

종목별

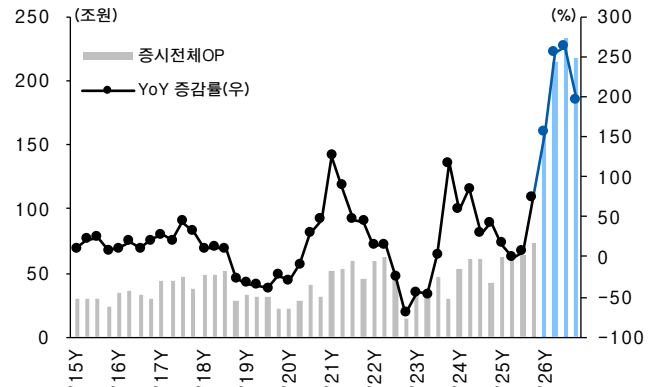
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.2% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 +0.9% 상향 조정
- 이번주 방위산업(+5.4%), 지주회사(+5.2%) 업종의 경우 강도 높은 상향 조정이 나타났으며, 정유(+3.9%), 섬유/의복(+2.8%), 해운(+2.7%) 업종 또한 상향 조정 진행

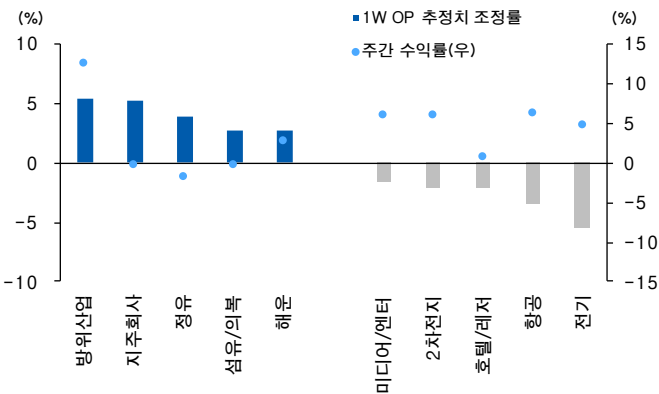
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

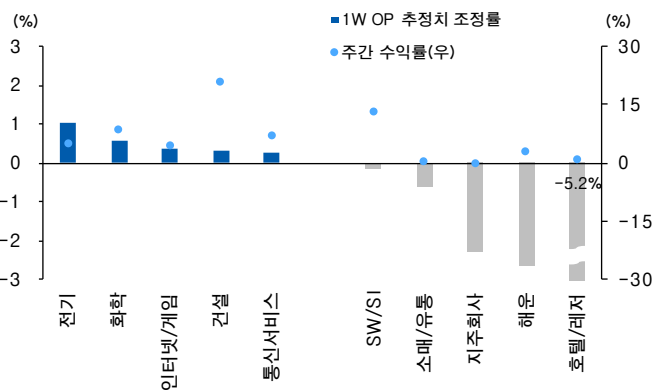


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	방위산업	56,687	5.4	12.4	
2	지주회사	410,960	5.2	-0.4	
3	정유	129,756	3.9	-1.8	
4	섬유/의복	24,138	2.8	-0.3	
5	해운	23,536	2.7	2.8	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	84,976	-5.5	4.8	
2	항공	10,983	-3.5	6.1	
3	호텔/레저	9,006	-2.2	0.7	
4	2차전지	12,750	-2.1	5.9	
5	미디어/엔터	15,388	-1.6	5.9	

26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

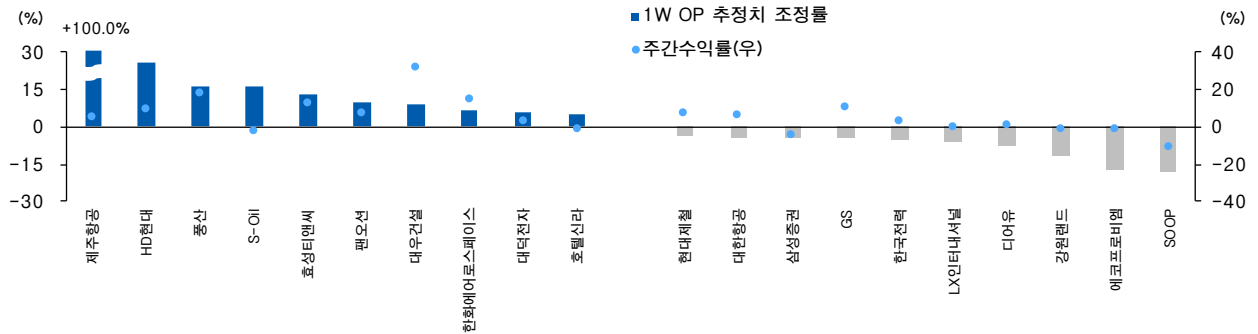
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	21,141	1.0	4.8	
2	화학	12,464	0.6	8.5	
3	인터넷/게임	16,004	0.3	4.2	
4	건설	9,692	0.3	21.0	
5	통신서비스	14,325	0.3	7.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	호텔/레저	2,021	-5.2	0.7	
2	해운	5,549	-2.7	2.8	
3	지주회사	97,463	-2.3	-0.4	
4	소매/유통	5,655	-0.6	0.2	
5	SW/SI	4,035	-0.1	13.3	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 8/5일 추정치 기준(수익률 8/6일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

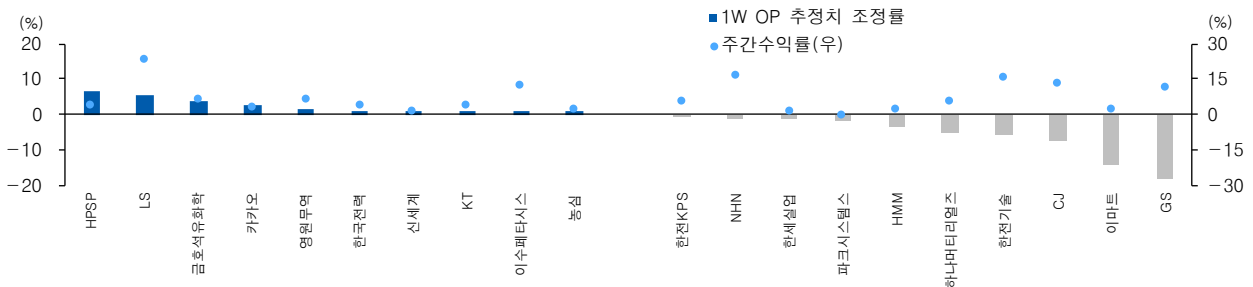


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A089590	제주항공	항공	200	100.0	5.2	1	A067160	SOOP	미디어/엔터	908	-17.8	-10.3
2	A267250	HD현대	지주회사	120,950	26.0	9.7	2	A247540	에코프로비엠	2차전지	826	-17.1	-1.0
3	A103140	풍산	비철금속	4,325	16.6	17.7	3	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,144	-12.1	-1.4
4	A010950	S-Oil	정유	42,950	16.5	-1.9	4	A376300	디어유	미디어/엔터	388	-7.9	0.7
5	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	5,571	12.8	12.2	5	A001120	LX인터내셔널	상사	4,662	-6.1	0.0
6	A028670	팬오션	해운	6,785	10.1	6.9	6	A015760	한국전력	전기	82,228	-5.7	3.3
7	A047040	대우건설	건설	8,326	9.0	32.0	7	A078930	GS	지주회사	39,300	-4.6	11.0
8	A012450	한화에너지	방위산업	46,138	6.7	14.9	8	A016360	삼성증권	증권	23,355	-4.6	-4.4
9	A353200	대덕전자	전자/부품	2,759	5.6	2.8	9	A003490	대한항공	항공	11,083	-4.3	6.2
10	A008770	호텔신라	호텔/레저	1,978	4.8	-1.6	10	A004020	현대제철	철강	3,639	-3.9	6.8

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

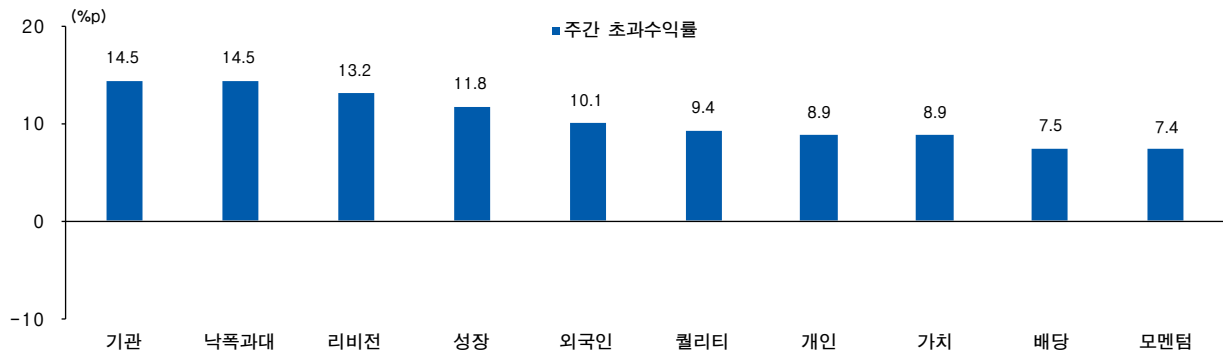
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A403870	HPSP	반도체/장비	240	6.4	3.5	1	A035250	강원랜드	호텔/레저	250	-30.6	-1.4
2	A006260	LS	지주회사	5,248	5.6	23.0	2	A078930	GS	지주회사	9,460	-18.4	11.0
3	A011780	금호석유화학	화학	1,858	3.9	6.4	3	A139480	이마트	소매/유통	331	-14.1	2.0
4	A035720	카카오	인터넷/게임	2,271	2.5	2.4	4	A001040	CJ	지주회사	5,660	-7.3	12.8
5	A111770	영원무역	섬유/의복	1,914	1.2	6.3	5	A052690	한진기술	전기	133	-5.7	14.8
6	A015760	한국전력	전기	20,338	1.2	3.3	6	A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	222	-5.1	4.8
7	A004170	신세계	소매/유통	1,569	0.9	1.1	7	A011200	HMM	해운	3,957	-3.7	2.1
8	A030200	KT	통신서비스	5,705	0.7	3.1	8	A140860	파크시스템스	전자/부품	101	-2.1	-0.8
9	A007660	이수페타시스	전자/부품	768	0.7	11.5	9	A005300	롯데칠성	음식료	579	-1.6	0.5
10	A004370	농심	음식료	524	0.6	1.8	10	A105630	한세실업	섬유/의복	184	-1.4	0.8

자료: 에프엔가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 8/5일 추정치 기준(수익률 8/6일 기준)

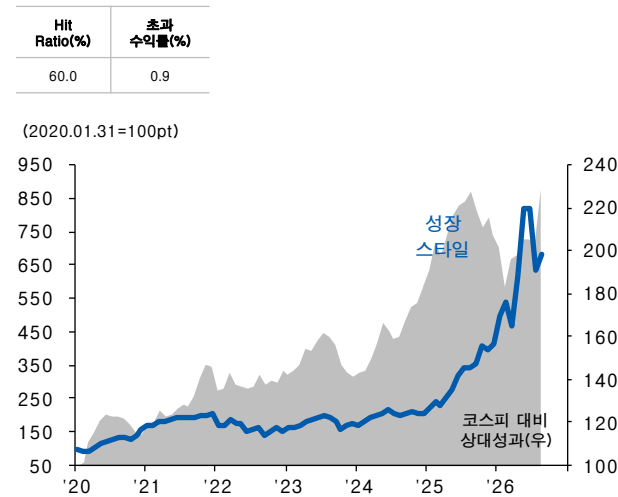
업종별

종목별

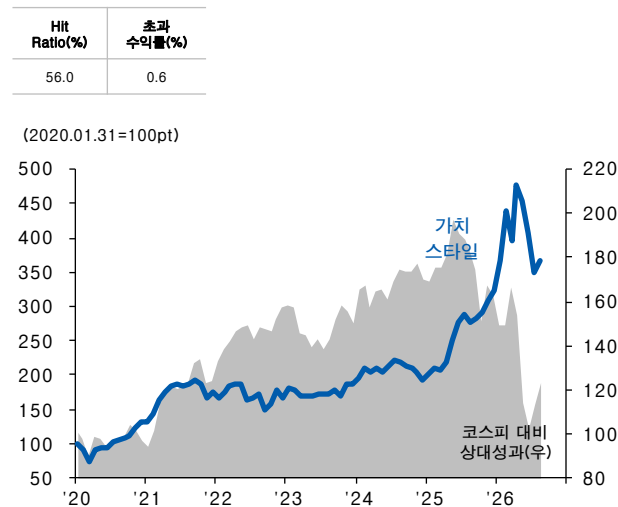
주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이



가치 스타일 성과 추이



성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.5	9.3	9.2	28.0	-12.2
A267270	HD건설기계	9.4	9.2	8.9	27.6	13.6
A353200	대덕전자	8.8	9.4	9.0	27.2	2.8
A009150	삼성전기	8.7	9.4	9.0	27.1	7.6
A010120	LS ELECTRIC	8.6	8.3	8.3	25.3	9.6
A298020	효성티앤씨	6.0	8.6	9.3	24.0	12.2
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.2	23.8	18.1
A195870	해성디에스	8.1	7.8	7.5	23.4	8.9
A329180	HD현대중공업	7.1	8.2	8.0	23.4	5.4
A068270	셀트리온	8.5	7.7	6.9	23.2	4.4

가치 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.6	29.5	3.9
A000370	한화손해보험	10.0	9.6	9.8	29.4	4.8
A108670	LX하우시스	9.9	9.5	9.8	29.2	10.8
A088350	한화생명	9.3	9.8	9.8	28.8	3.6
A036460	한국가스공사	8.7	9.7	9.9	28.2	0.9
A006650	대한유화	9.1	9.6	9.3	28.0	6.5
A097950	CJ제일제당	8.9	9.2	9.6	27.7	6.1
A001450	현대해상	9.8	8.4	9.5	27.7	0.5
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.5	27.5	3.3
A000120	CJ대한통운	8.4	9.4	9.4	27.3	5.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 8/6일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

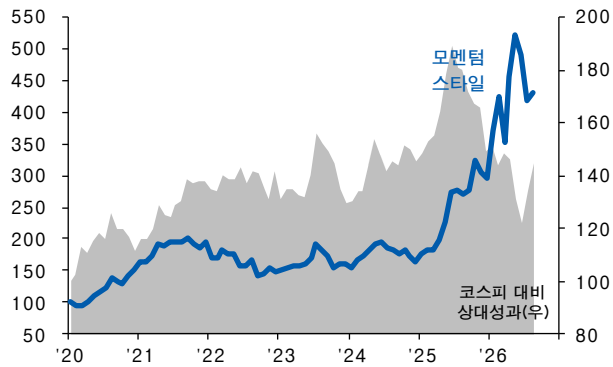
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

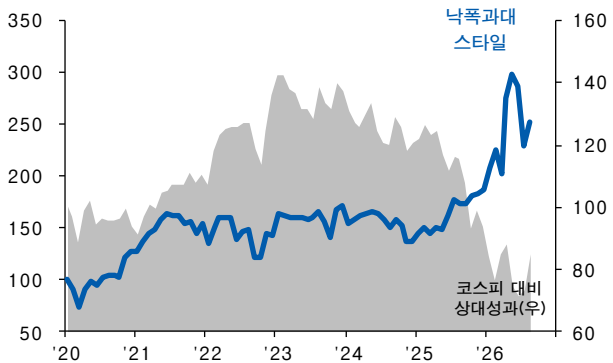
(2020.01.31=100pt)



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		
A073240	금호타이어	10.0	9.7	8.5	8.3	36.4	8.9
A078930	GS	9.9	9.0	8.9	8.7	36.4	11.0
A001450	현대해상	9.0	9.8	9.1	7.8	35.6	0.5
A010950	S-Oil	9.7	7.6	8.4	9.1	34.7	-1.9
A089860	롯데렌탈	9.9	9.4	8.8	6.5	34.6	1.9
A161390	한국타이어엔테크놀로지	8.8	9.3	7.2	8.2	33.4	4.3
A105560	KB금융	8.1	8.7	8.5	8.2	33.4	1.8
A086790	하나금융지주	8.9	8.0	8.6	7.9	33.3	6.3
A018260	삼성에스디에스	8.6	9.6	8.3	6.9	33.3	12.9
A000810	삼성화재	7.0	9.9	8.7	7.7	33.2	2.5

낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A361610	SK아이이테크놀로지	7.5	9.4	9.6	9.3	35.8	7.5
A064350	현대로템	8.3	9.4	9.1	7.3	34.0	7.9
A032350	롯데관광개발	7.6	8.8	9.7	7.8	33.8	9.0
A034230	파라다이스	8.8	8.0	9.3	7.3	33.3	3.0
A352820	하이브	6.6	7.5	9.8	9.2	33.0	7.0
A376300	디어유	5.0	7.9	9.5	10.0	32.4	0.7
A035760	CJ ENM	3.9	8.6	10.0	9.8	32.2	8.8
A035900	JYP Ent.	7.1	6.9	8.9	8.8	31.6	9.1
A122870	와이지엔터테인먼트	5.8	6.5	9.6	9.8	31.5	6.4
A011790	SKC	9.1	8.0	8.3	6.0	31.4	11.2

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 8/6일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

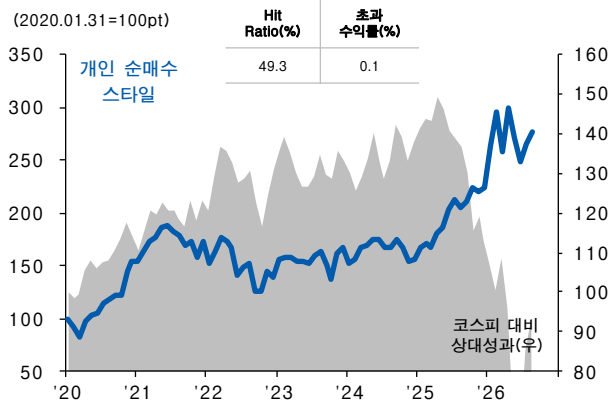
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

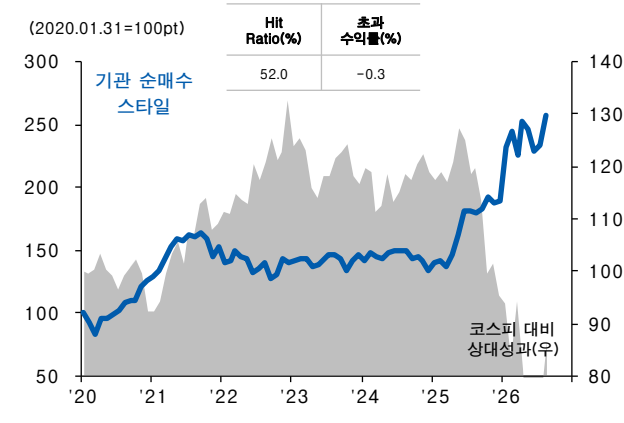


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A035760	CJ ENM	8.5	9.6	9.9	9.5	37.4	8.8
A039130	하나투어	8.2	9.5	9.6	9.9	37.2	3.8
A010120	LS ELECTRIC	9.0	9.1	9.6	9.0	36.6	9.6
A042660	한화오션	9.3	9.0	9.0	9.1	36.4	6.5
A403870	HPSP	10.0	9.7	9.1	7.6	36.3	3.5
A011790	SKC	6.2	9.9	9.7	9.7	35.4	11.2
A000660	SK하이닉스	9.3	9.1	8.5	8.4	35.2	-13.0
A361610	SK아이이테크놀로지	8.6	8.5	8.8	8.6	34.4	7.5
A114090	GKL	8.8	7.1	9.0	9.1	33.9	-0.7
A010140	삼성중공업	6.6	9.4	9.2	8.5	33.7	3.5

기관 순매수 스타일 성과 추이

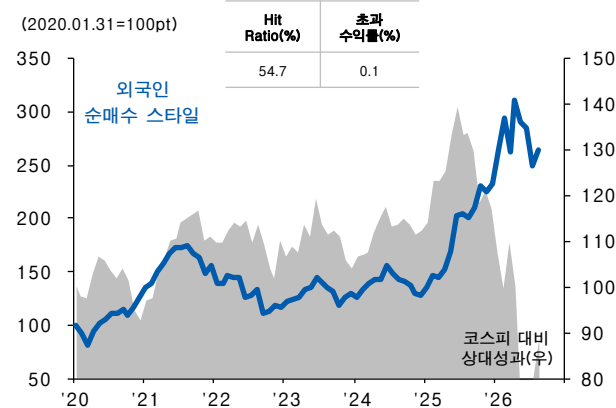


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A007660	이수페타시스	10.0	10.0	10.0	9.8	39.6	11.5
A222800	심텍	9.5	9.9	9.9	10.0	39.2	27.9
A214450	파마리서치	9.9	9.9	9.5	9.3	38.6	16.5
A353200	대덕전자	9.1	9.5	9.7	9.5	37.6	2.8
A008770	호텔신라	8.6	9.7	9.8	9.5	37.6	-1.6
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.6	9.1	8.9	37.4	7.1
A010060	OCI홀딩스	9.2	9.1	9.6	9.4	37.3	28.2
A047810	한국항공우주	9.2	9.6	8.6	9.2	36.6	17.9
A138930	BNK금융지주	8.0	9.2	9.0	9.1	35.3	-1.6
A336260	두산퓨얼셀	5.8	9.7	9.9	9.9	35.2	34.4

외국인 순매수 스타일 성과 추이



외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A004170	신세계	9.9	9.8	9.9	9.8	39.3	1.1
A183300	코미코	9.7	9.9	10.0	9.8	39.3	0.0
A195870	해성디에스	9.8	9.4	9.8	9.9	38.8	8.9
A120110	코오롱인더	9.1	9.9	9.6	9.4	37.9	18.4
A064350	현대로템	9.2	9.5	9.4	9.5	37.6	7.9
A023530	롯데쇼핑	9.5	9.6	8.7	8.1	35.8	-2.4
A140860	파크시스템스	9.4	9.6	9.7	7.0	35.6	-0.8
A011210	현대위아	9.0	9.2	8.8	8.1	35.1	7.9
A006650	대한유화	8.7	9.7	6.9	9.2	34.4	6.5
A001040	CJ	9.1	8.1	7.2	9.0	33.3	12.8

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 8/6일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

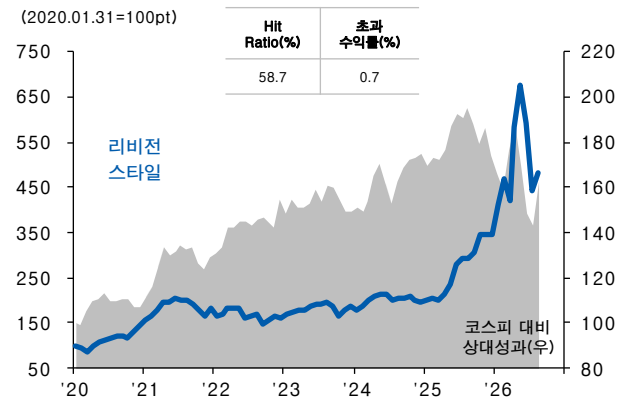
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

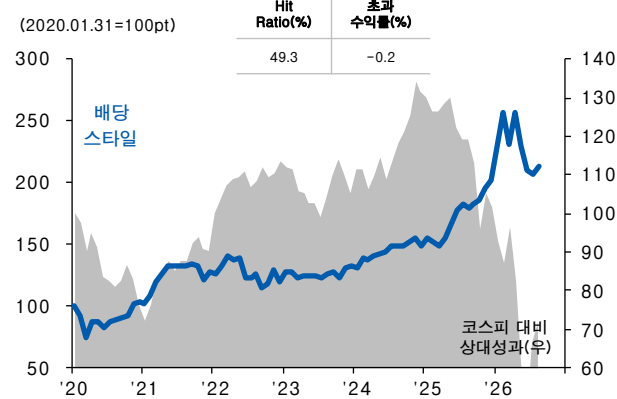


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A011200	HMM	9.3	9.8	8.9	27.9	2.1
A267270	HD건설기계	8.6	8.8	8.6	26.1	13.6
A096770	SK이노베이션	5.3	9.7	9.5	24.5	-1.7
A108670	LX하우시스	8.1	9.5	6.4	23.9	10.8
A195870	해성디에스	9.4	9.0	5.5	23.9	8.9
A016360	삼성증권	6.5	8.6	8.1	23.2	-4.4
A353200	대덕전자	7.7	7.9	7.6	23.1	2.8
A011070	LG이노텍	8.1	8.1	6.3	22.4	7.8
A006800	미래에셋증권	4.3	9.3	8.5	22.1	0.0
A009150	삼성전기	8.1	8.7	5.2	22.0	7.6

배당 스타일 성과 추이

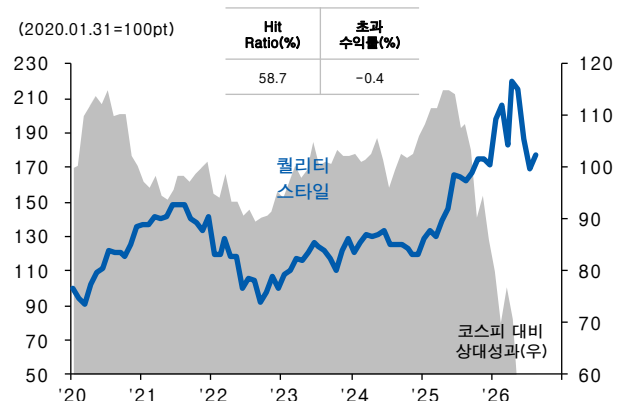


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.8	9.8	9.4	9.8	37.9	1.0
A005940	NH투자증권	8.0	9.4	9.9	9.9	37.1	-0.7
A214320	이노션	8.3	9.9	9.3	9.6	37.1	3.2
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.5	9.6	9.7	37.0	0.0
A035250	강원랜드	8.7	9.8	8.5	9.8	36.8	-1.4
A017670	SK텔레콤	9.4	9.3	9.2	8.1	35.9	11.9
A032640	LG유플러스	8.4	9.5	9.1	8.8	35.7	1.5
A023530	롯데쇼핑	9.8	9.2	8.6	7.9	35.5	-2.4
A024110	기업은행	6.0	9.7	9.9	9.3	34.9	-1.5
A016360	삼성증권	6.9	8.8	9.4	9.9	34.9	-4.4

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	3.5
A058470	리노공업	9.8	9.8	9.7	8.9	38.1	4.4
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	37.9	-13.0
A042700	한미반도체	9.6	8.7	9.5	9.6	37.4	-6.5
A214150	클래시스	8.3	9.7	9.6	9.2	36.8	10.7
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.6	9.6	36.6	5.7
A145020	휴젤	9.9	9.5	9.3	7.6	36.3	20.0
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.1	35.7	16.5
A376300	디어유	9.7	9.5	9.4	6.9	35.5	0.7
A383220	F&F	8.2	9.1	9.1	8.7	35.1	-16.8

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 8/6일 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.