

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

9월 1주차 반도체의 뒤를 이어갈 사이클

CONTENTS

I 주간 스크리닝

반도체의 뒤를 이어갈 사이클

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

반도체의 뒤를 이어갈 사이클 (참고 자료: 국면의 전환, 반도체의 뒤를 이어갈 사이클)

- 1) 2분기 실적시즌 결과 반도체 업종은 추정치를 소폭 하회하며 이익 트렌드 둔화. 반면, 반도체를 제외한 증시의 경우 여전히 높은 수준의 서프라이즈 강도를 기록하며 견조한 이익 트렌드 지속되고 있으며 반도체 업종의 주도력이 점차 약화되는 흐름
- 2) 지난해 8월 이후 반도체 업종의 이익 사이클(12MF 순이익 YoY) 반등과 함께 반도체 중심의 강세장이 시작. 현재 이익 성장 모멘텀 둔화로 변동성 확대 및 주가 모멘텀 둔화. 주도주의 그늘에 가려 견조한 이익 성장 경로가 주목받지 못했던 업종 및 종목으로 시선이 분산될 것으로 전망
- 3) 이익 사이클의 가파른 상승경로가 반도체의 강세를 주도한 것과 같은 원리로, 현재 이익 사이클이 회복 혹은 상승 국면에 위치한 종목에 주목

[9월 1주차] 1) 실적시즌 전후(6월말 대비) 12MF 순이익 조정률, 2) 지난 3개월 이익 사이클 확대 폭 상위 종목 스크리닝

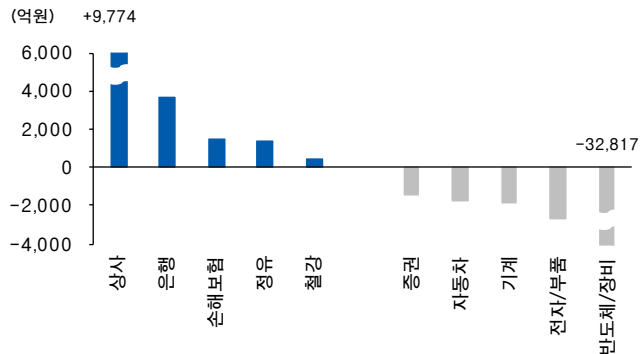
종목명	업종	시가총액 (억원)	'26년 연간 순이익(억원, %)			'27년 연간 순이익(억원, %)			이익 사이클 확대 폭(%p)
			6월말 기준	9/2 기준	조정률	6월말 기준	9/2 기준	조정률	
삼성SDI	IT가전	433,550	6,067	12,625	108.1	34.1	198.9	307.8	273.7
심텍	IT하드웨어	46,860	1,762	2,965	68.3	376.3	396.9	558.4	182.1
삼성생명	보험	588,000	35,427	53,593	51.3	54.2	74.3	116.6	62.5
삼성전기	IT하드웨어	1,045,712	19,370	26,807	38.4	134.5	214.5	243.1	108.5
빙그레	필수소비재	8,602	880	1,301	47.9	-23.7	-14.3	37.2	60.9
HS효성첨단소재	화학	7,804	475	1,463	207.9	-9.5	3.6	19.2	28.7
HD현대	조선	165,491	25,800	33,860	31.2	156.9	190.3	233.4	76.5
LG생활건강	화장품, 의류, 완구	44,477	2,189	2,914	33.1	-29.1	-12.3	23.2	52.3
세아베스틸지주	철강	14,417	998	1,399	40.1	22.4	42.9	53.9	31.6
효성티앤씨	상사, 자본재	14,931	2,263	2,997	32.5	28.0	65.6	80.3	52.3
SK스퀘어	반도체	1,295,494	484,120	592,798	22.4	702.4	737.1	825.2	122.9
SK	에너지	395,140	99,993	120,605	20.6	487.8	517.6	779.2	291.4
샘씨엔에스	반도체	8,147	361	435	20.6	231.7	290.8	317.7	86.0
대한항공	운송	106,416	7,421	9,803	32.1	-46.4	-28.9	-24.4	22.0
삼성전자	반도체	14,644,928	3,657,017	4,224,133	15.5	969.3	1,087.2	1,090.5	121.2
현대해상	보험	44,670	8,581	10,492	22.3	-13.7	-8.7	11.8	25.5
고영	IT하드웨어	19,131	546	632	15.8	93.4	124.3	142.1	48.7
브이엠	반도체	14,690	963	1,093	13.5	299.7	312.3	365.1	65.4
팬오션	운송	29,455	4,019	5,112	27.2	10.9	15.0	25.0	14.1
원익IPS	반도체	53,845	1,884	2,341	24.3	154.0	158.7	169.1	15.1
대덕전자	IT하드웨어	53,815	2,369	3,078	29.9	385.8	388.9	399.5	13.6
펄텍코리아	비철, 목재등	7,056	405	569	40.5	0.7	1.5	10.2	9.5
삼성화재	보험	293,334	22,422	27,077	20.8	3.4	11.1	19.9	16.5
한화비전	IT하드웨어	24,689	2,028	2,415	19.1	-14.5	-9.2	5.0	19.6
이수페타시스	반도체	82,218	3,243	3,873	19.4	91.6	95.3	109.2	17.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -2.3조원 순매도, 기관은 약 -3.0조원 순매도하였으며 반도체/장비 업종 중심의 매도세 지속
- 기관과 외국인은 은행 업종을 각 +3,652억원, +2,642억원 순매수한 반면 반도체/장비(-3.2조원, -2.0조원) 전자/부품(-2,743억원, -2,032억원), 기계(-1,882억원, -3,294억원) 등의 업종을 순매도

기관 주간 순매수 상/하위 업종

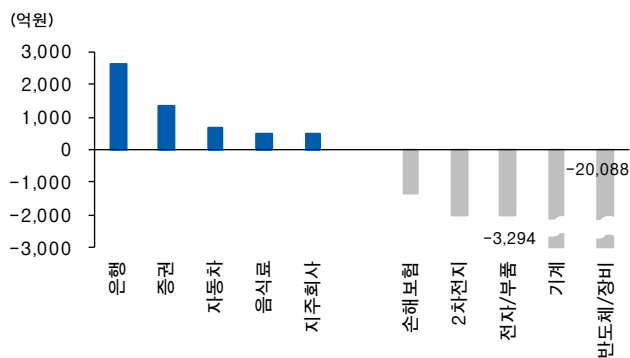


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	상사	9,779	9,478	9,774	
2	은행	3,652	6,649	20,423	
3	손해보험	1,498	3,470	7,076	
4	정유	1,365	1,919	8,094	
5	철강	414	1,453	-1,301	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-32,817	-73,020	-113,267	
2	전자/부품	-2,743	-384	-14,206	
3	기계	-1,882	338	2,936	
4	자동차	-1,791	-6,596	-14,384	
5	증권	-1,454	-4,716	-6,132	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

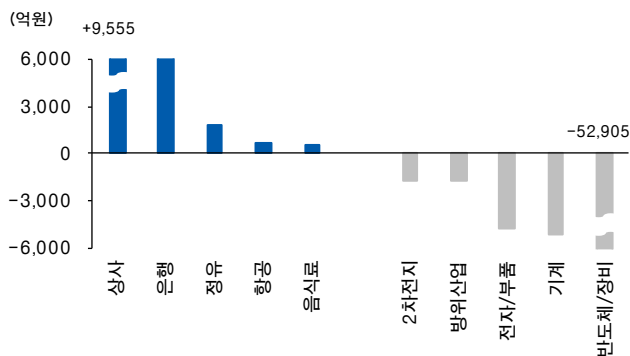


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	은행	2,642	1,337	-3,125	
2	증권	1,344	4,113	9,730	
3	자동차	671	-199	-2,560	
4	음식료	514	1,439	3,029	
5	주회사	484	731	1,808	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-20,088	-55,390	-441,692	
2	기계	-3,294	-2,519	-9,371	
3	전자/부품	-2,032	-14,477	11,649	
4	2차전지	-1,993	-6,410	-2,928	
5	손해보험	-1,327	-1,698	-4,135	

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	상사	9,555	9,169	9,367	
2	은행	6,294	7,986	17,297	
3	정유	1,756	2,937	9,472	
4	항공	673	2,527	7,519	
5	음식료	519	1,812	4,519	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-52,905	-128,410	-554,959	
2	기계	-5,177	-2,180	-6,435	
3	전자/부품	-4,775	-14,861	-2,558	
4	방위산업	-1,799	-2,345	4,957	
5	2차전지	-1,705	5,291	1,603	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 9/3일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A047050	포스코인터내셔널	상사	97,637	9,726	2.54
A006650	대한유화	화학	6,266	59	0.24
A001450	현대해상	손해보험	45,608	399	0.22
A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	18,668	163	0.21
A120110	코오롱인더	화학	17,429	137	0.20
A000370	한화손해보험	손해보험	10,448	69	0.17
A293490	카카오게임즈	인터넷/게임	9,426	64	0.16
A192820	코스맥스	화장품	32,006	214	0.16
A280360	롯데웰푸드	음식료	13,494	69	0.13
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	15,342	76	0.12

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A316140	우리금융지주	은행	255,297	4,401	0.43
A241710	코스메카코리아	화장품	14,333	142	0.24
A240810	원익IPS	반도체/장비	51,538	483	0.23
A010060	OCI홀딩스	화학	42,475	403	0.21
A128940	한미약품	제약/바이오	58,995	487	0.20
A257720	실리콘투	화장품	31,804	264	0.20
A353200	대덕전자	전자/부품	50,208	374	0.17
A006360	GS건설	건설	28,755	155	0.13
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	9,800	53	0.13
A071050	한국금융지주	증권	103,985	465	0.11

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A047050	포스코인터내셔널	상사	97,637	9,546	2.5
A316140	우리금융지주	은행	255,297	4,861	0.5
A192820	코스맥스	화장품	32,006	254	0.2
A096770	SK이노베이션	정유	221,121	1,552	0.2
A003490	대한항공	항공	107,336	673	0.2
A000370	한화손해보험	손해보험	10,448	52	0.1
A257720	실리콘투	화장품	31,804	170	0.1
A293490	카카오게임즈	인터넷/게임	9,426	47	0.1
A120110	코오롱인더	화학	17,429	76	0.1
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	15,342	51	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A015760	한국전력	전기	208,317	18.6	-1,867	-706
A016360	삼성증권	증권	77,334	32.0	-909	-809
A006260	LS	지주회사	91,104	14.8	-887	101
A032830	삼성생명	생명보험	606,000	112.0	-663	990
A352820	하이브	미디어/엔터	75,868	5.0	-466	816
A010140	삼성중공업	조선	190,520	300.0	-125	-383
A000270	기아	자동차	497,386	209.5	-197	2,163
A033780	KT&G	음식료	181,357	36.9	-288	-54
A011170	롯데케미칼	화학	26,093	77.7	-184	-186
A001040	CJ	지주회사	37,492	5.3	-201	-358

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 9/3일 기준

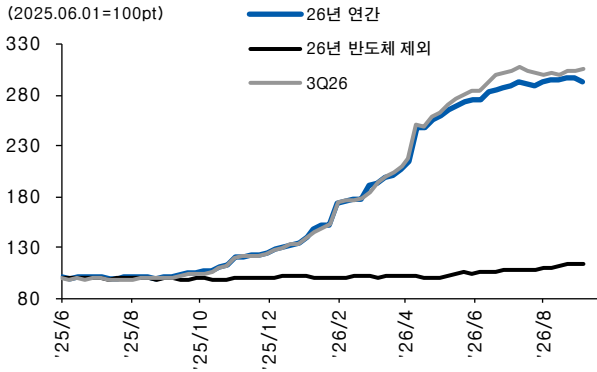
업종별

종목별

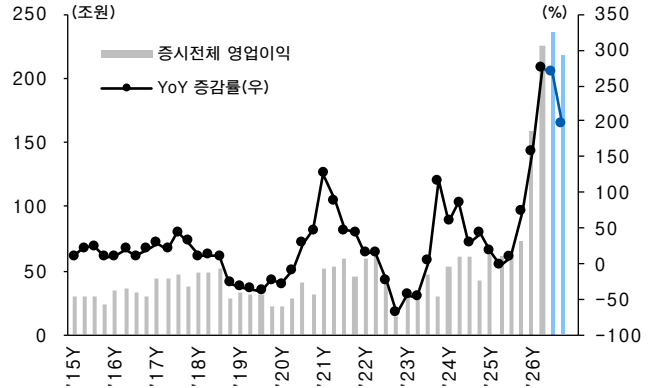
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 -0.9% 하향, 반도체 제외 '26년 연간 +0.1% 상향 조정
- 2분기 실적시즌 결과 반도체 업종은 추정치를 하회하는 실적(분기말 추정치 대비 98.5%)을 기록하며 이익 트렌드 둔화 흐름. 다만, 반도체를 제외한 업종의 경우 여전히 건조한 서프라이즈 강도(분기말 추정치 대비 115.3%)를 기록하며 이익 트렌드 우상향 지속

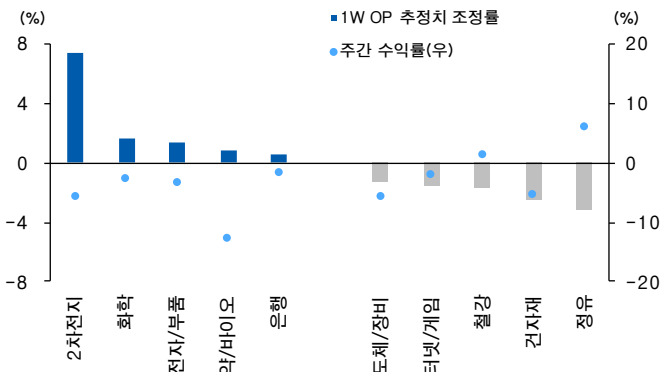
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

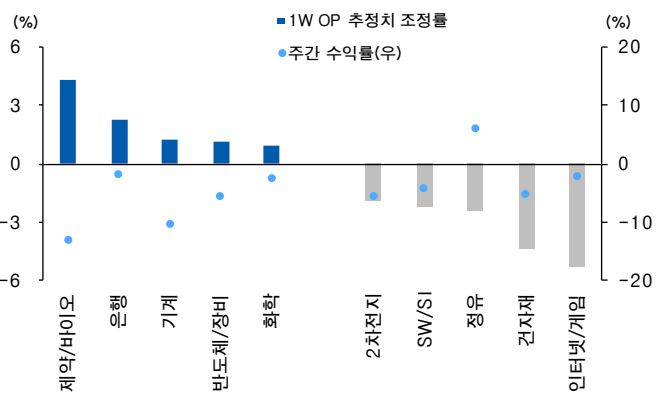


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	2차전지	13,722	7.4	-5.6	
2	화학	41,616	1.6	-2.6	
3	전자/부품	90,256	1.3	-3.5	
4	제약/바이오	59,751	0.8	-13.0	
5	은행	351,352	0.6	-1.9	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	정유	127,622	-3.1	6.0	
2	전자재	1,718	-2.5	-5.4	
3	철강	36,498	-1.8	1.1	
4	인터넷/게임	60,830	-1.6	-2.2	
5	반도체/장비	6,529,572	-1.4	-5.7	

26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

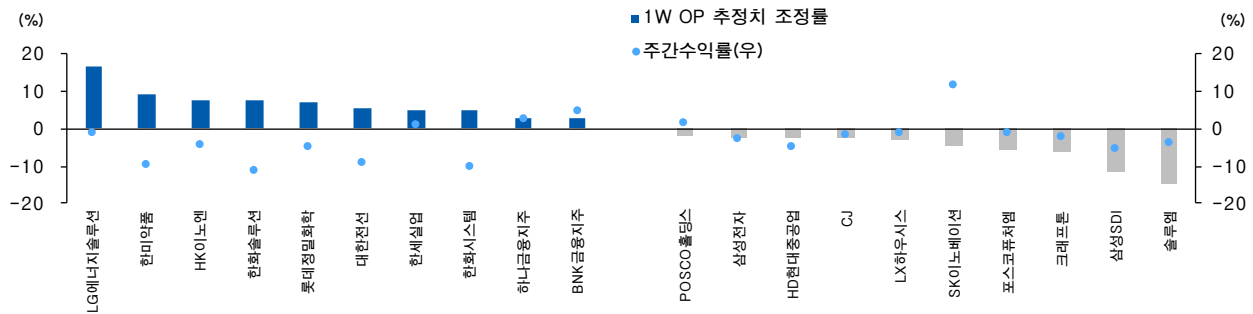
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	제약/바이오	16,321	4.4	-13.0	
2	은행	101,537	2.3	-1.9	
3	기계	19,190	1.3	-10.4	
4	반도체/장비	1,959,330	1.1	-5.7	
5	화학	6,910	0.9	-2.6	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	인터넷/게임	13,613	-5.4	-2.2	
2	전자재	348	-4.4	-5.4	
3	정유	27,322	-2.4	6.0	
4	SW/SI	3,913	-2.2	-4.3	
5	2차전지	3,839	-2.0	-5.6	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 9/2일 추정치 기준(수익률 9/3일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

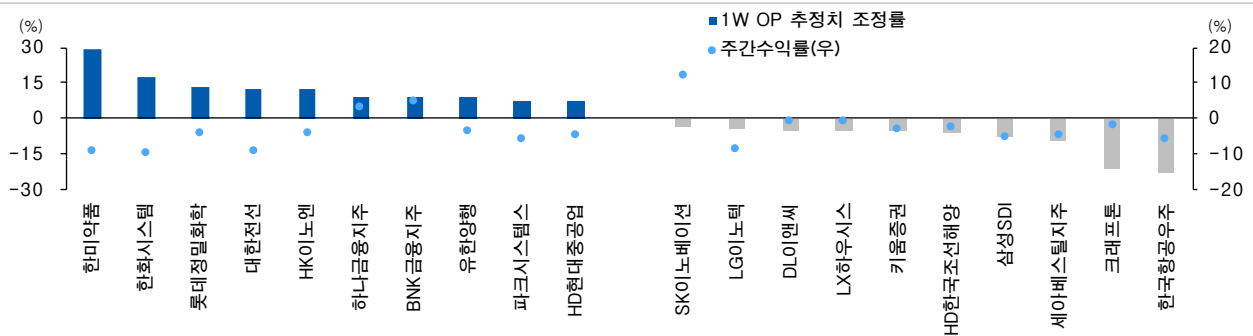


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	9,623	17.0	-1.2	1	A248070	솔루엠	전자/부품	750	-15.0	-3.9
2	A128940	한미약품	제약/바이오	4,089	9.2	-9.5	2	A006400	삼성SDI	2차전지	3,372	-11.6	-5.6
3	A195940	HK이노엔	제약/바이오	1,411	7.7	-4.4	3	A259960	크래프톤	인터넷/게임	13,701	-6.2	-2.0
4	A009830	한화솔루션	화학	9,500	7.7	-11.4	4	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	912	-5.7	-1.3
5	A004000	롯데정밀화학	화학	1,780	6.9	-4.7	5	A096770	SK이노베이션	정유	83,209	-4.7	11.9
6	A001440	대한전선	기계	2,437	5.4	-9.3	6	A108670	LX하우시스	건자재	1,353	-3.2	-1.1
7	A105630	한세실업	섬유/의복	1,096	5.1	0.9	7	A001040	CJ	지주회사	24,601	-2.5	-1.5
8	A272210	한화시스템	방위산업	2,622	4.8	-10.3	8	A329180	HD현대중공업	조선	39,597	-2.5	-4.8
9	A086790	하나금융지주	은행	60,006	3.0	2.6	9	A005930	삼성전자	반도체/장비	3,848,272	-2.4	-2.7
10	A138930	BNK금융지주	은행	10,210	3.0	4.6	10	A005490	POSCO홀딩스	철강	31,102	-2.1	1.3

'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

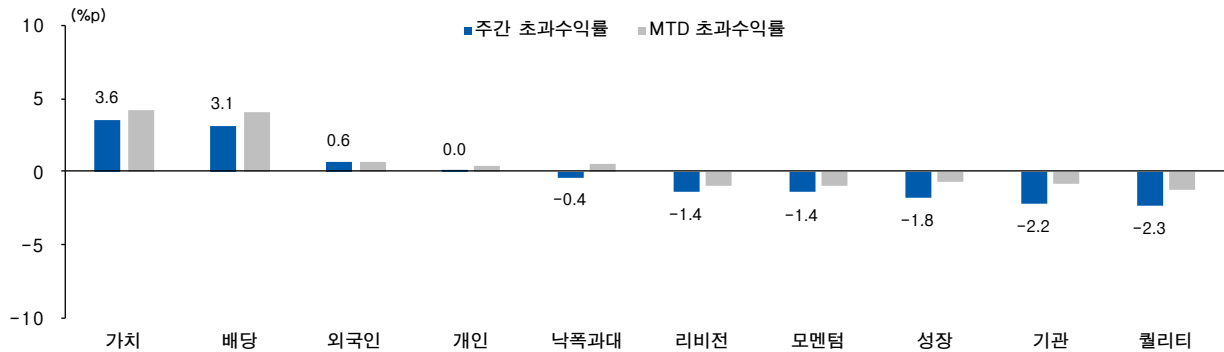
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A128940	한미약품	제약/바이오	1,285	29.6	-9.5	1	A248070	솔루엠	전자/부품	180	-39.8	-3.9
2	A272210	한화시스템	방위산업	689	17.7	-10.3	2	A047810	한국항공우주	방위산업	630	-23.1	-6.1
3	A004000	롯데정밀화학	화학	420	13.0	-4.7	3	A259960	크래프톤	인터넷/게임	2,589	-21.4	-2.0
4	A001440	대한전선	기계	576	12.7	-9.3	4	A001430	세아베스틸지주	철강	372	-9.4	-5.2
5	A195940	HK이노엔	제약/바이오	353	12.4	-4.4	5	A006400	삼성SDI	2차전지	947	-7.8	-5.6
6	A086790	하나금융지주	은행	17,420	9.1	2.6	6	A009540	HD한국조선해양	조선	15,377	-6.4	-3.0
7	A138930	BNK금융지주	은행	3,690	9.1	4.6	7	A039490	키움증권	증권	5,116	-5.8	-3.6
8	A000100	유한양행	제약/바이오	329	9.0	-4.1	8	A108670	LX하우시스	건자재	266	-5.7	-1.1
9	A140860	파크시스템스	전자/부품	192	7.5	-6.3	9	A298050	HS효성첨단소재	화학	710	-5.4	-2.0
10	A329180	HD현대중공업	조선	10,834	7.3	-4.8	10	A375500	DL이앤씨	건설	1,218	-5.1	-1.1

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 9/2일 추정치 기준(수익률 9/3일 기준)

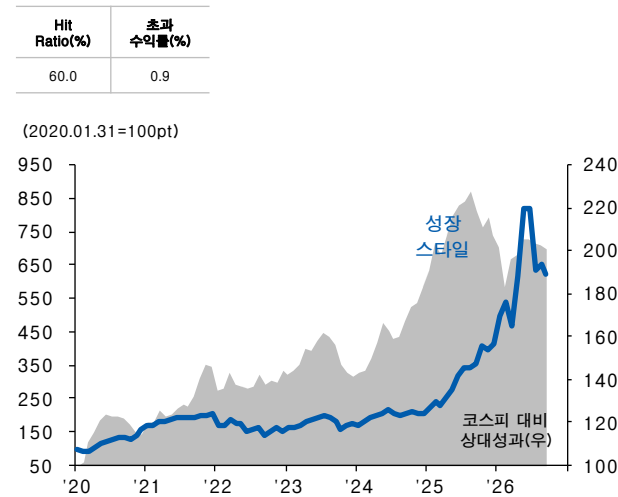
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

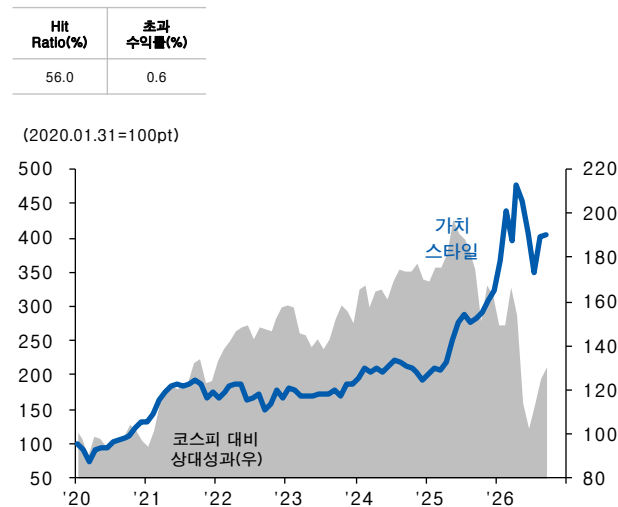


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A353200	대덕전자	8.8	9.5	9.1	27.5	-5.6
A005930	삼성전자	9.1	8.8	8.6	26.5	-2.7
A000880	한화	7.7	8.9	9.3	25.9	-0.9
A009150	삼성전기	7.7	8.7	8.2	24.6	-5.1
A267250	HD현대	6.8	8.4	9.1	24.4	-2.1
A403870	HPSP	8.8	7.9	7.2	24.0	-1.8
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	-12.0
A006260	LS	7.7	8.2	7.9	23.7	-6.7
A267270	HD건설기계	8.1	7.9	7.3	23.3	-1.0
A195870	해성디에스	7.9	7.6	7.4	22.9	-8.1

가치 스타일 성과 추이



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	29.4	2.5
A108670	LX하우스시스	9.8	9.5	9.8	29.1	-1.1
A000370	한화손해보험	9.8	9.3	9.7	28.8	5.9
A002350	넥센타이어	9.7	9.6	9.0	28.3	-6.5
A015760	한국전력	9.9	9.4	8.9	28.1	-0.3
A036460	한국가스공사	8.5	9.7	9.8	28.1	1.6
A097950	CJ제일제당	8.7	9.4	9.8	27.9	-1.8
A088350	한화생명	8.4	9.7	9.8	27.8	2.7
A006650	대한유화	8.8	9.6	9.3	27.6	0.6
A000120	CJ대한통운	8.4	9.5	9.6	27.6	-1.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 9/3일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

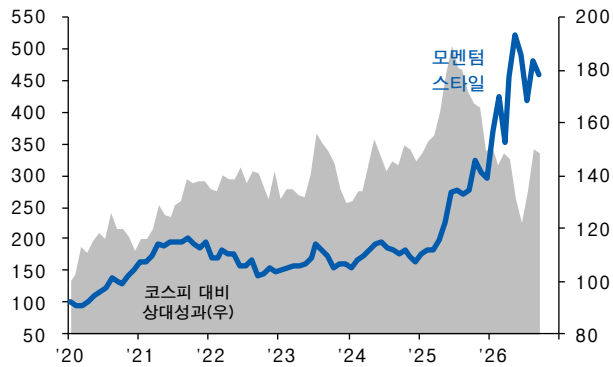
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

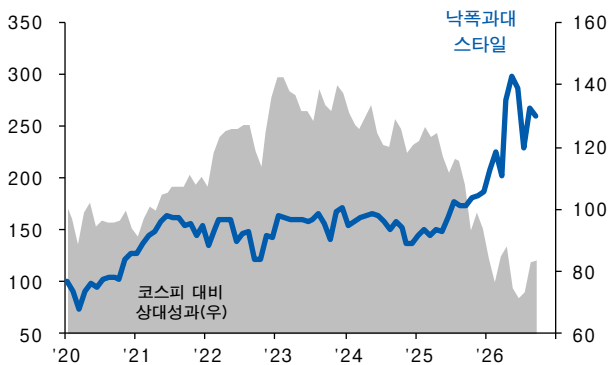
(2020.01.31=100pt)



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		
A181710	NHN	10.0	9.6	9.7	9.4	38.6	-5.5
A241710	코스메카코리아	9.9	10.0	9.5	9.0	38.3	-12.8
A161890	한국콜마	9.8	9.9	9.8	8.6	38.1	-6.9
A078930	GS	9.1	9.9	9.7	9.4	38.0	-8.0
A222800	심텍	9.6	8.3	9.9	9.8	37.5	-4.3
A006360	GS건설	9.6	9.1	9.4	8.5	36.5	-9.6
A278470	에이피알	9.2	8.8	9.3	8.6	35.8	-12.0
A001450	현대해상	8.7	9.6	9.2	8.2	35.6	2.1
A192820	코스맥스	9.7	9.8	9.4	6.2	35.1	-6.9
A010950	S-Oil	7.4	9.5	9.0	9.1	34.9	-0.9

낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A035900	JYP Ent.	9.5	8.9	9.4	9.4	37.0	-4.0
A376300	디어유	9.1	7.9	9.9	10.0	36.9	-5.8
A067160	SOOP	10.0	7.8	9.6	9.3	36.7	-4.6
A214150	클래시스	9.8	7.9	9.3	8.7	35.7	-4.7
A064350	현대로템	7.0	9.0	9.1	8.9	34.0	-9.1
A263750	떨어비스	9.0	8.4	9.2	6.9	33.5	-4.8
A034230	파라다이스	5.7	8.5	9.7	9.6	33.4	-2.1
A145720	덴티움	8.7	7.0	7.0	9.4	32.1	-2.5
A035720	카카오	8.7	5.1	9.2	9.0	32.0	-4.1
A248070	솔루엠	8.1	9.1	7.3	7.5	32.0	-3.9

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/3일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

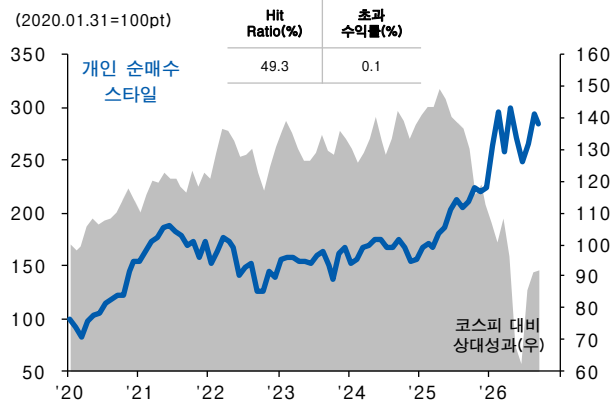
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

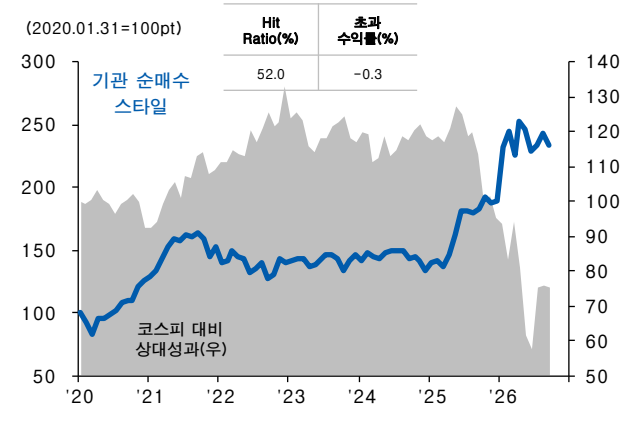


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A034230	파라다이스	9.6	9.8	9.9	9.2	38.4	-2.1
A035900	JYP Ent.	10.0	9.9	8.5	9.9	38.3	-4.0
A376300	디어유	9.6	9.0	9.7	9.8	38.0	-5.8
A005380	현대차	8.5	9.7	9.6	9.7	37.5	-4.0
A035760	CJ ENM	8.2	8.5	10.0	9.6	36.3	-2.0
A039130	하나투어	6.9	9.2	9.9	9.8	35.7	-1.4
A016360	삼성증권	9.4	8.5	9.2	8.5	35.5	-2.1
A122870	와이지엔터테인먼트	9.2	6.0	9.8	10.0	34.9	0.5
A011070	LG이노텍	8.6	7.7	9.7	8.6	34.5	-9.0
A139480	이마트	9.8	9.8	6.7	8.2	34.4	-1.7

기관 순매수 스타일 성과 추이

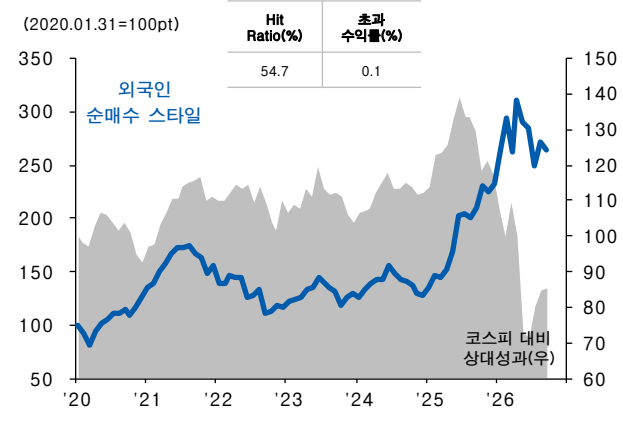


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A007660	이수페타시스	9.8	10.0	10.0	9.9	39.6	-6.0
A006360	GS건설	10.0	9.9	9.8	9.5	39.1	-9.6
A336260	두산퓨얼셀	9.7	9.6	9.9	9.7	38.8	-14.1
A161890	한국콜마	9.2	9.4	9.7	9.1	37.3	-6.9
A375500	DL이앤씨	9.3	8.9	9.6	9.2	36.9	-1.1
A192820	코스맥스	9.9	9.8	9.5	7.4	36.5	-6.9
A010060	OCI홀딩스	9.1	8.0	9.6	9.6	36.2	-17.1
A001450	현대해상	9.0	9.5	9.1	7.5	35.1	2.1
A112610	씨에스원드	8.7	8.2	9.3	9.0	35.1	-7.1
A000370	한화손해보험	9.4	9.1	8.6	8.0	35.0	5.9

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	9.2	9.9	9.9	10.0	39.0	-6.4
A069960	현대백화점	9.9	9.8	9.6	9.0	38.2	1.3
A282330	BGF리테일	9.5	9.5	9.4	9.6	37.9	2.4
A023530	롯데쇼핑	9.5	9.8	9.2	9.3	37.7	3.1
A195870	해성디에스	7.8	9.7	9.5	9.9	36.8	-8.1
A064350	현대로템	8.0	9.5	9.5	9.8	36.7	-9.1
A011780	금호석유화학	9.4	8.1	9.6	9.7	36.7	5.7
A298020	효성티앤씨	9.7	9.1	9.2	8.7	36.6	2.5
A003490	대한항공	9.0	9.3	9.1	9.0	36.4	1.6
A140860	파크시스템스	8.7	9.2	9.8	8.4	36.0	-6.3

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/3일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

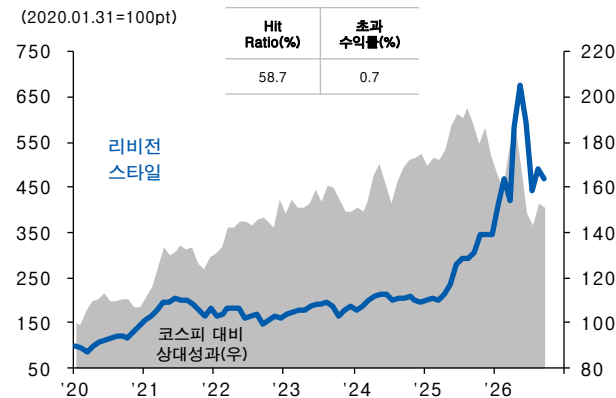
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

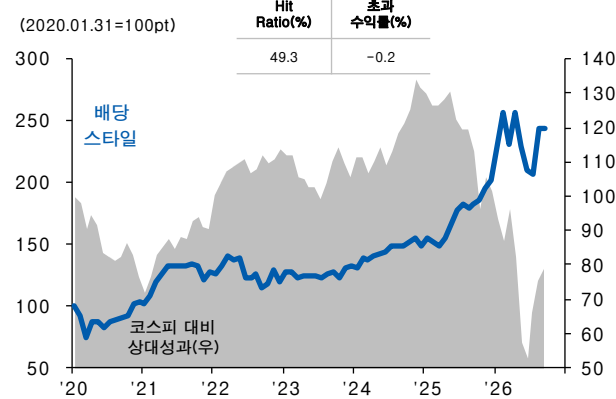


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A006260	LS	9.5	9.3	7.8	26.5	-6.7
A128940	한미약품	9.5	9.8	6.4	25.7	-9.5
A241710	코스메카코리아	9.0	8.0	8.4	25.5	-12.8
A192820	코스맥스	8.9	8.0	8.3	25.2	-6.9
A161890	한국콜마	8.4	8.0	8.2	24.7	-6.9
A011200	HMM	9.1	8.1	7.2	24.4	-1.6
A028670	팬오션	7.5	8.5	8.3	24.3	2.6
A353200	대덕전자	8.4	8.2	7.6	24.1	-5.6
A012450	한화에어로스페이스	7.0	7.7	8.1	22.8	-9.5
A181710	NHN	8.5	8.9	5.3	22.7	-5.5

배당 스타일 성과 추이

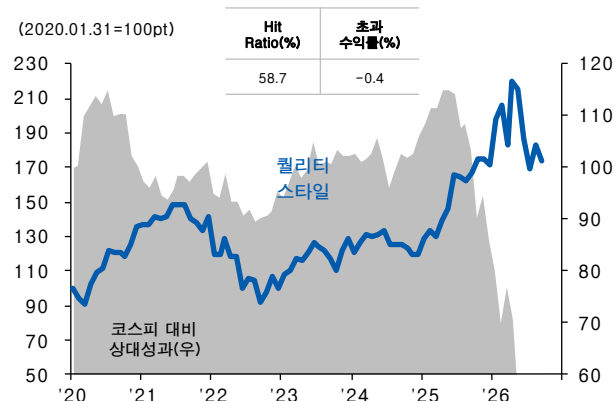


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.8	9.8	9.4	9.7	37.6	-2.1
A005940	NH투자증권	8.0	9.5	9.9	9.9	37.2	-1.3
A214320	이노션	8.3	9.9	9.3	9.5	36.9	-1.2
A035250	강원랜드	8.7	9.8	8.5	9.8	36.8	-0.5
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.5	9.6	9.4	36.7	4.8
A023530	롯데쇼핑	9.8	9.4	8.6	8.0	35.9	3.1
A032640	LG유플러스	8.4	9.4	9.2	8.7	35.7	-1.4
A017670	SK텔레콤	9.4	9.2	9.2	7.6	35.4	-9.7
A016360	삼성증권	6.9	9.0	9.5	9.9	35.3	-2.1
A105630	한세실업	7.7	9.3	8.4	9.6	35.0	0.9

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A042700	한미반도체	9.6	9.7	9.6	9.6	38.5	-4.1
A403870	HPSP	9.3	9.9	9.8	9.3	38.4	-1.8
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	38.0	-3.4
A058470	리노공업	9.9	9.7	9.7	8.7	38.0	-3.7
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.5	9.6	36.5	-1.8
A214150	클래시스	8.6	9.7	9.3	8.8	36.4	-4.7
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.5	36.4	-7.1
A005930	삼성전자	8.9	8.7	8.7	9.5	35.8	-2.7
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.0	35.7	-17.4
A376300	디어유	9.5	9.5	8.8	7.5	35.2	-5.8

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/3일 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.