

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

9월 3주차 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 트렌드가 둔화되는 흐름. 반면, 반도체를 제외한 증시의 경우 여전히 높은 수준의 서프라이즈 강도를 기록하며 견조한 이익 트렌드가 지속. 증시 내 반도체 업종의 주도력이 점차 약화되는 흐름
- 2) 지난해 9월 반도체 업종의 이익 사이클(12MF 순이익 YoY) 반등과 함께 반도체 중심의 강세장이 시작되었으며, 현재 이익 성장 모멘텀의 둔화로 변동성 확대 및 주가 모멘텀 둔화를 시현
- 3) 주도주의 그늘에 가려 견조한 이익 성장 경로가 주목받지 못한 업종 및 종목으로 시선이 분산되는 국면으로 전환될 것으로 전망. 이익 사이클의 가파른 상승경로가 반도체 강세를 주도한 것과 같이, 현재 이익 사이클이 회복 혹은 상승 국면에 위치한 종목에 주목

[9월 3주차] 1) 1개월 12MF 순이익 조정률(리비전) 및 2) 지난 3개월 이익 사이클 확대 폭 상위 종목 스크리닝

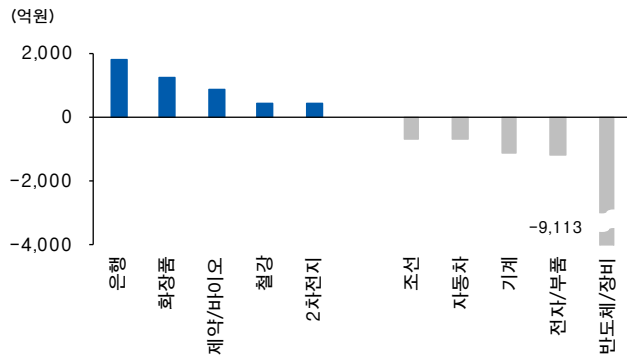
종목명	업종	시가총액 (억원)	12MF 순이익(억원, %)			3개월 이익사이클 추이(%)			이익 사이클 확대 폭(%p)
			8/17 기준	9/17 기준	조정률	6월말 기준	7월말 기준	9/17 기준	
SK	에너지	399,490	48,367	134,541	178.2	487.8	517.6	725.4	237.6
티앤엘	건강관리	4,339	584	803	37.5	-15.3	2.9	41.8	57.0
포스코퓨처엠	화학	167,397	618	928	50.3	-51.1	-26.1	-23.0	28.2
삼성생명	보험	567,000	47,236	54,713	15.8	54.2	74.3	127.0	72.8
티에스이	반도체	26,879	1,567	1,762	12.4	188.0	246.1	310.7	122.7
LG전자	IT가전	325,769	24,219	33,655	39.0	54.4	72.7	78.0	23.6
HMM	운송	191,949	14,576	16,528	13.4	-31.9	-18.2	5.5	37.4
삼성전기	IT하드웨어	1,031,520	24,744	26,327	6.4	134.5	214.5	249.0	114.4
DB하이텍	반도체	54,381	4,197	4,700	12.0	35.3	47.4	65.9	30.6
현대해상	보험	41,345	9,537	10,593	11.1	-13.7	-8.7	11.6	25.2
해성디에스	반도체	9,758	1,016	1,093	7.6	93.2	112.2	131.8	38.6
세아베스틸지주	철강	15,510	1,287	1,395	8.4	22.4	42.9	55.4	33.0
한미약품	건강관리	64,311	1,985	2,642	33.1	19.3	20.8	32.1	12.8
LG생활건강	화장품,의류,완구	45,151	2,760	2,913	5.5	-29.1	-12.3	22.0	51.1
셀트리온	건강관리	412,198	17,660	19,755	11.9	42.0	49.9	56.6	14.7
LS ELECTRIC	기계	299,100	7,065	7,355	4.1	57.5	90.4	94.0	36.5
신세계	소매(유통)	34,192	4,500	4,719	4.9	79.0	89.5	104.5	25.5
팬오션	운송	31,005	4,862	5,221	7.4	10.9	15.0	25.7	14.8
포스코인터내셔널	상사,자본재	96,406	9,663	10,453	8.2	19.3	23.2	29.4	10.2

자료: 에프엔가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 기관은 약 -9,032 억원 순매도, 외국인은 약 -6.1 조원 순매도를 기록. 외국인은 약 5주 연속(누적 약 -18.5조원) 순매도를 기록
- 기관과 외국인은 반도체/장비(-9,113 억원, -51,906 억원), 기계(-1,134 억원, -2,629 억원), 조선(-722 억원, -802 억원) 업종을 동시 순매도

기관 주간 순매수 상/하위 업종

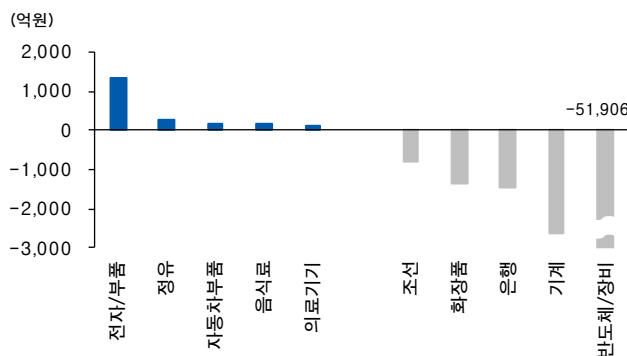


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	은행	1,765	10,287	23,451	
2	화장품	1,214	576	6,176	
3	제약/바이오	825	-519	7,493	
4	철강	402	2,514	1,418	
5	2차전지	400	7,924	11,062	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-9,113	-16,451	-29,939	
2	전자/부품	-1,206	-5,795	-3,374	
3	기계	-1,134	2,008	709	
4	자동차	-726	-7,700	-8,013	
5	조선	-722	-690	-875	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

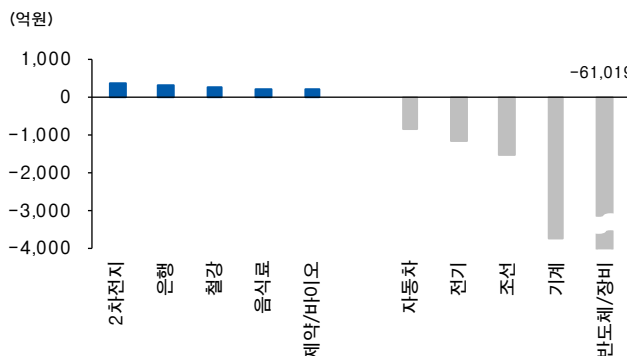


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	전자/부품	1,324	2,800	-4,511	
2	정유	251	2,277	2,554	
3	자동차부품	169	1,140	5,581	
4	음식료	145	548	2,931	
5	의료기기	139	1,623	878	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-51,906	-146,263	-475,412	
2	기계	-2,629	-4,025	-5,389	
3	은행	-1,457	-1,833	-7,926	
4	화장품	-1,345	1,206	4,501	
5	조선	-802	-20	-1,353	

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	2차전지	388	3,601	4,359	
2	은행	308	8,454	15,525	
3	철강	249	1,226	1,420	
4	음식료	222	625	3,514	
5	제약/바이오	222	-2,352	12,063	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-61,019	-162,714	-505,351	
2	기계	-3,763	-2,016	-4,681	
3	조선	-1,524	-710	-2,227	
4	전기	-1,164	-1,271	-2,180	
5	자동차	-829	-9,678	-5,798	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 9/17일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A241710	코스메카코리아	화장품	13,969	219	0.39
A128940	한미약품	제약/바이오	65,977	849	0.33
A257720	실리콘투	화장품	27,509	356	0.31
A006650	대한유화	화학	6,260	57	0.22
A375500	DL이앤씨	건설	32,503	231	0.17
A161890	한국콜마	화장품	34,794	230	0.17
A006360	GS건설	건설	31,323	191	0.15
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	32,943	169	0.13
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,248	44	0.12
A011170	롯데케미칼	화학	26,564	127	0.12

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A353200	대덕전자	전자/부품	49,763	292	0.15
A240810	원익IPS	반도체/장비	57,919	307	0.14
A010060	OCI홀딩스	화학	37,714	195	0.13
A078930	GS	지주회사	105,901	516	0.12
A181710	NHN	SW/SI	18,298	87	0.12
A214450	파마리서치	의료기기	34,234	158	0.11
A222800	심텍	전자/부품	48,683	184	0.10
A280360	롯데웰푸드	음식료	11,929	39	0.08
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	7,387	16	0.05
A011070	LG이노텍	전자/부품	119,992	258	0.05

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A128940	한미약품	제약/바이오	65,977	430	0.2
A240810	원익IPS	반도체/장비	57,919	305	0.1
A375500	DL이앤씨	건설	32,503	136	0.1
A195870	해성디에스	반도체/장비	9,248	34	0.1
A353200	대덕전자	전자/부품	49,763	147	0.1
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	10,640	31	0.1
A161890	한국콜마	화장품	34,794	102	0.1
A403870	HPSP	반도체/장비	43,701	107	0.1
A051900	LG생활건강	화장품	44,402	110	0.1
A003230	삼양식품	음식료	97,025	232	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A353200	대덕전자	전자/부품	49,763	147.5	-1,023	-622
A079550	LIG디펜스엔에어로 스페이스	방위산업	155,760	59.4	-693	898
A010060	OCI홀딩스	화학	37,714	30.1	-548	-437
A003550	LG	지주회사	169,033	39.7	-527	890
A237690	에스티팜	제약/바이오	19,186	3.9	-460	-375
A183300	코미코	반도체/장비	14,998	0.8	-240	-137
A021240	코웨이	내구소비재	76,075	80.2	-146	63
A033780	KT&G	음식료	180,423	80.9	-139	-173
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	32,943	64.5	-93	-627
A214150	클래시스	의료기기	20,517	11.3	-114	-384

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 9/17일 기준

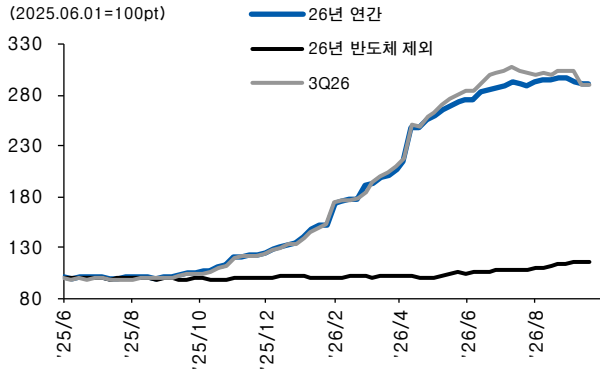
업종별

종목별

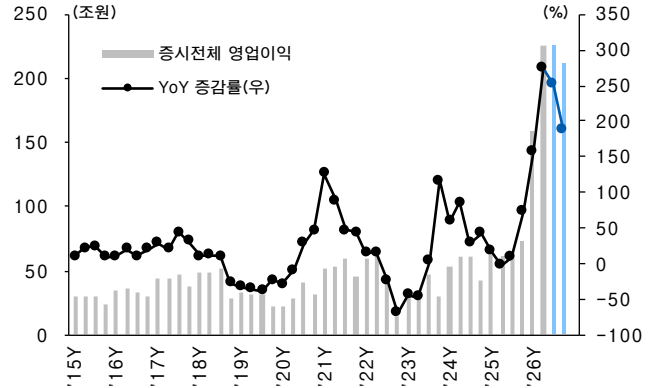
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 -0.2% 하향 조정된 반면, 반도체 제외 '26년 연간 +0.3% 상향 조정이 나타나는 등 건조한 이익 트렌드 지속. 반도체 중심의 이익 트렌드 둔화에 따라 분기 YoY 증감률은 2분기 피크아웃을 그리는 상황
- 이번주 '26년 연간 기준 생명보험(+13.0%) 업종이 가장 높은 상향 조정률을 기록하였으며 디스플레이(-29.0%) 업종이 가장 높은 하향 조정률을 기록

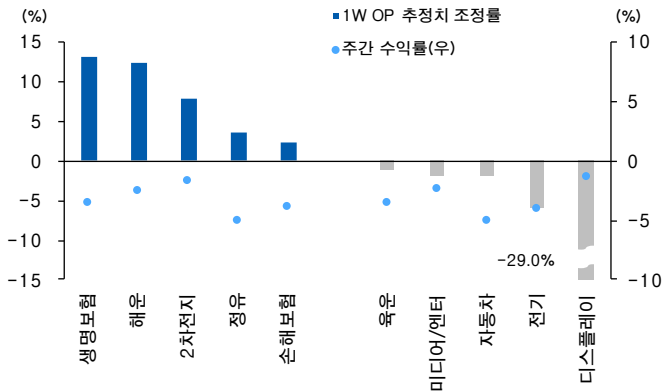
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

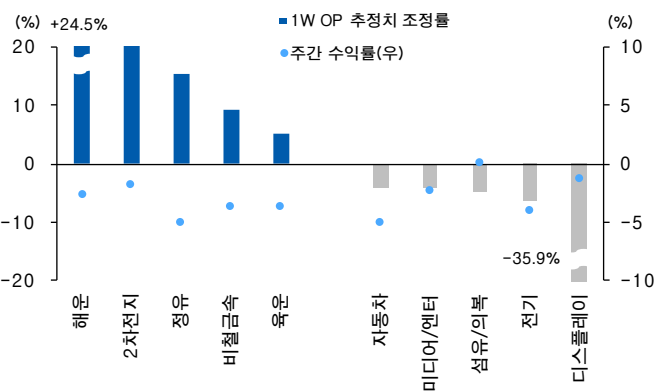


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	생명보험	49,821	13.0	-3.5	
2	해운	25,930	12.4	-2.6	
3	2차전지	14,157	7.8	-1.7	
4	정유	143,223	3.5	-5.1	
5	손해보험	76,852	2.4	-3.9	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	디스플레이	7,495	-29.0	-1.3	
2	전기	74,692	-6.0	-4.0	
3	자동차	214,110	-1.9	-5.1	
4	미디어/엔터	15,277	-1.9	-2.3	
5	육운	27,027	-1.3	-3.6	

26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

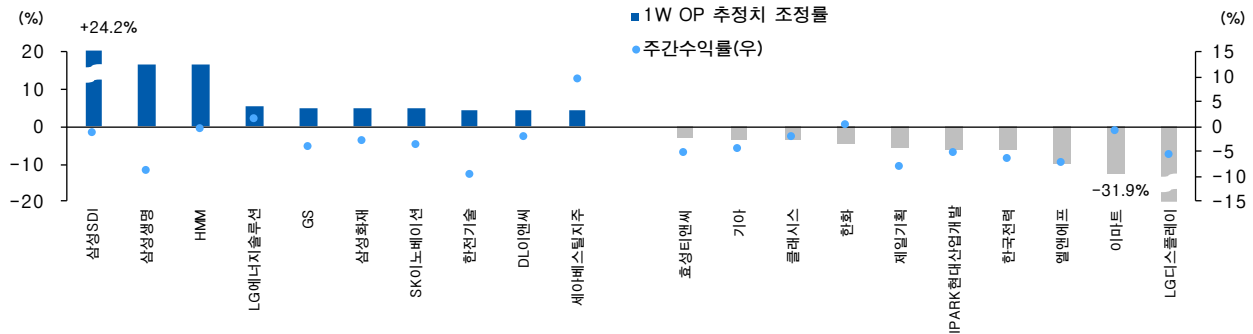
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	해운	9,825	24.5	-2.6	
2	2차전지	4,532	21.8	-1.7	
3	정유	36,139	15.6	-5.1	
4	비철금속	6,391	9.4	-3.6	
5	육운	7,410	5.3	-3.6	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	디스플레이	2,818	-35.9	-1.3	
2	전기	23,561	-6.3	-4.0	
3	섬유/의복	6,528	-4.8	0.2	
4	미디어/엔터	4,839	-4.2	-2.3	
5	자동차	55,360	-4.1	-5.1	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 9/16일 추정치 기준(수익률 9/17일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

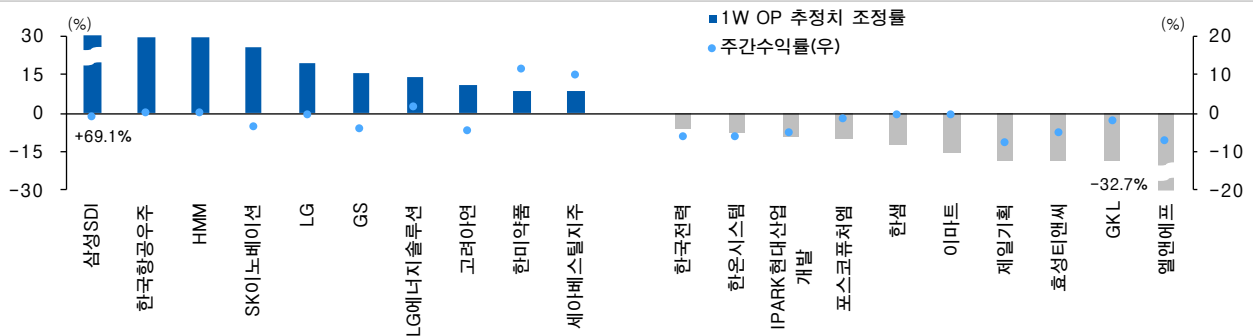


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006400	삼성SDI	2차전지	4,028	24.2	-1.1	1	A034220	LG디스플레이	디스플레이	6,554	-31.9	-5.8
2	A032830	삼성생명	생명보험	40,371	16.9	-8.8	2	A139480	이마트	소매/유통	3,619	-12.7	-0.9
3	A011200	HMM	해운	18,925	16.7	-0.5	3	A066970	엘앤에프	2차전지	1,978	-9.7	-7.3
4	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	9,512	5.3	1.4	4	A015760	한국전력	전기	72,370	-6.2	-6.3
5	A078930	GS	지주회사	53,765	5.2	-4.2	5	A294870	IPARK현대산업개발	건설	5,040	-6.0	-5.4
6	A000810	삼성화재	손해보험	33,992	5.1	-2.9	6	A030000	제일기획	미디어/엔터	3,118	-5.9	-8.1
7	A096770	SK이노베이션	정유	90,702	4.8	-3.7	7	A000880	한화	지주회사	70,780	-4.6	0.5
8	A052690	한전기술	전기	607	4.6	-9.5	8	A214150	클래시스	의료기기	1,835	-3.5	-1.9
9	A375500	DL이앤씨	건설	5,572	4.5	-2.1	9	A000270	기아	자동차	101,277	-3.3	-4.5
10	A001430	세아베스틸지주	철강	1,687	4.4	9.7	10	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	5,502	-3.1	-5.3

'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위: 억원, %)

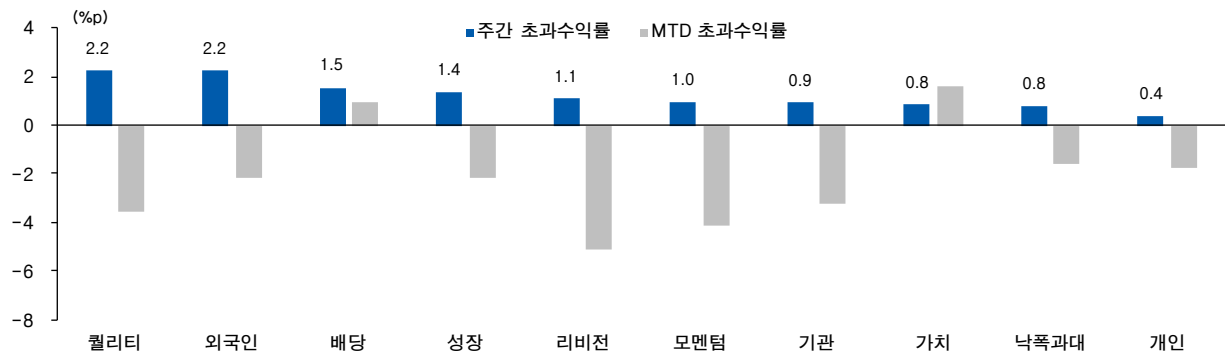
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A006400	삼성SDI	2차전지	1,420	69.1	-1.1	1	A034220	LG디스플레이	디스플레이	2,570	-38.1	-5.8
2	A047810	한국항공우주	방위산업	814	29.2	-0.1	2	A066970	엘앤에프	2차전지	261	-32.7	-7.3
3	A011200	HMM	해운	7,945	29.1	-0.5	3	A114090	GKL	호텔/레저	145	-18.9	-2.4
4	A096770	SK이노베이션	정유	20,525	25.2	-3.7	4	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	1,245	-18.8	-5.3
5	A003550	LG	지주회사	6,060	19.5	-0.6	5	A030000	제일기획	미디어/엔터	818	-18.7	-8.1
6	A078930	GS	지주회사	13,510	15.7	-4.2	6	A139480	이마트	소매/유통	1,488	-15.7	-0.9
7	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	3,169	13.8	1.4	7	A009240	한샘	건자재	72	-12.5	-0.8
8	A010130	고려아연	비철금속	5,191	10.6	-4.7	8	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	228	-10.2	-1.7
9	A128940	한미약품	제약/바이오	1,395	8.5	11.0	9	A006800	미래에셋증권	증권	2,151	-9.8	-4.9
10	A001430	세아베스틸지주	철강	407	8.4	9.7	10	A294870	IPARK현대산업개발	건설	1,308	-9.2	-5.4

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 9/16일 추정치 기준(수익률 9/17일 기준)

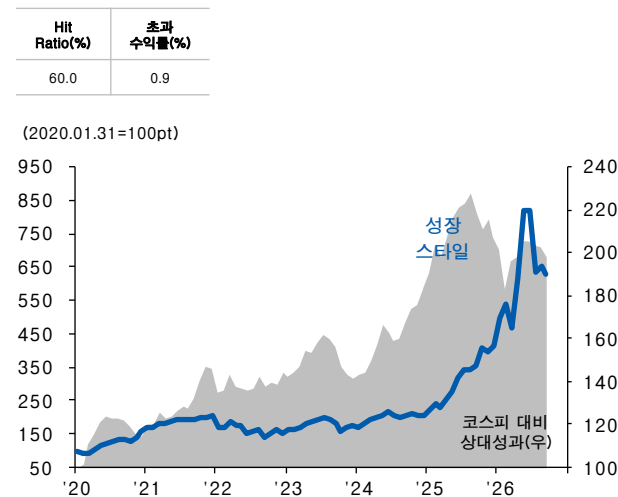
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

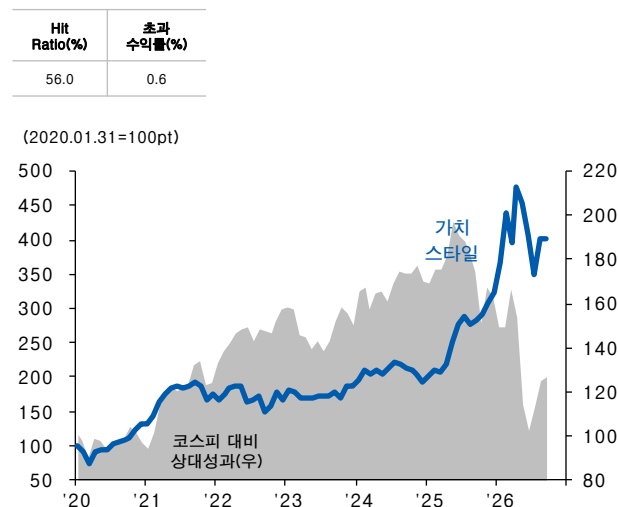


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A353200	대덕전자	8.8	9.5	9.1	27.5	0.7
A005930	삼성전자	9.1	8.8	8.6	26.5	-2.7
A000880	한화	7.7	8.9	9.3	25.9	0.5
A009150	삼성전기	7.7	8.7	8.2	24.6	-5.0
A267250	HD현대	6.8	8.4	9.1	24.4	-10.1
A403870	HPSP	8.8	7.9	7.2	24.0	-0.4
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	-5.1
A006260	LS	7.7	8.2	7.9	23.7	-4.9
A267270	HD건설기계	8.1	7.9	7.3	23.3	-0.3
A195870	해성디에스	7.9	7.6	7.4	22.9	8.6

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	-5.2
A108670	LX하우스시스	9.8	9.5	9.8	29.1	-3.0
A000370	한화손해보험	9.8	9.3	9.7	28.8	-1.5
A002350	넥센타이어	9.7	9.6	9.0	28.3	-3.6
A015760	한국전력	9.9	9.4	8.9	28.1	-6.3
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	0.3
A006650	대한유화	8.8	9.6	9.3	27.6	-5.8
A000120	CJ대한통운	8.4	9.5	9.6	27.6	-1.4

자료: 에프엔가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 9/17일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

성장/가치

주가

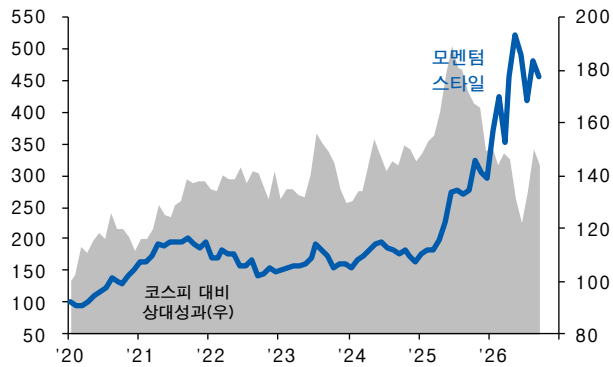
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

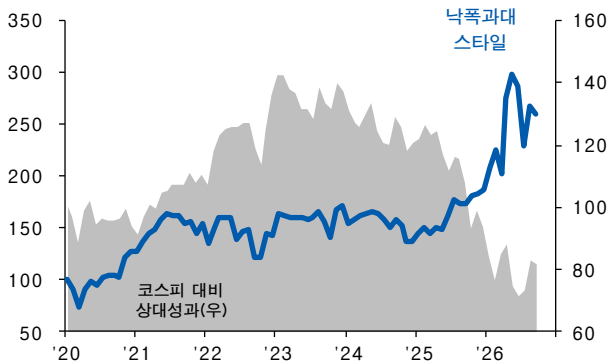
(2020.01.31=100pt)



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	0.4
A241710	코스메카코리아	9.9	10.0	9.5	9.0	38.3	4.1
A161890	한국콜마	9.8	9.9	9.8	8.6	38.1	4.3
A078930	GS	9.1	9.9	9.7	9.4	38.0	-4.2
A222800	심텍	9.6	8.3	9.9	9.8	37.5	-2.3
A006360	GS건설	9.6	9.1	9.4	8.5	36.5	-4.9
A278470	에이피알	9.2	8.8	9.3	8.6	35.8	-5.1
A001450	현대해상	8.7	9.6	9.2	8.2	35.6	-3.9
A192820	코스맥스	9.7	9.8	9.4	6.2	35.1	0.6
A010950	S-Oil	7.4	9.5	9.0	9.1	34.9	1.5

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	-1.9
A376300	디어유	9.1	7.9	9.9	10.0	36.9	-3.8
A067160	SOOP	10.0	7.8	9.6	9.3	36.7	0.5
A214150	클래시스	9.8	7.9	9.3	8.7	35.7	-1.9
A064350	현대로템	7.0	9.0	9.1	8.9	34.0	-1.5
A263750	떨어비스	9.0	8.4	9.2	6.9	33.5	-3.3
A034230	파라다이스	5.7	8.5	9.7	9.6	33.4	-2.0
A145720	덴티움	8.7	7.0	7.0	9.4	32.1	-0.8
A035720	카카오	8.7	5.1	9.2	9.0	32.0	-2.9
A248070	솔루엠	8.1	9.1	7.3	7.5	32.0	-3.1

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/17일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

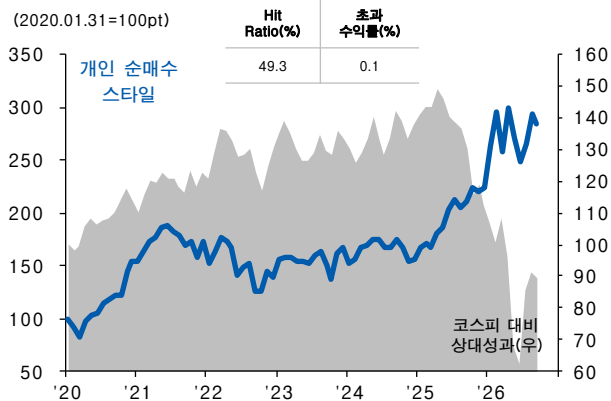
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

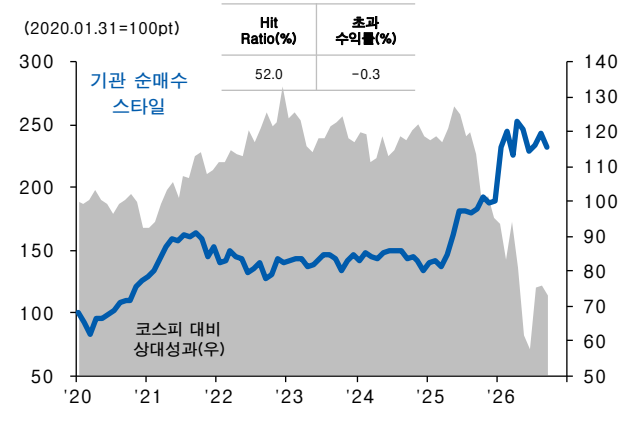


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	-2.0
A035900	JYP Ent.	10.0	9.9	8.5	9.9	38.3	-1.9
A376300	디어유	9.6	9.0	9.7	9.8	38.0	-3.8
A005380	현대차	8.5	9.7	9.6	9.7	37.5	-5.1
A035760	CJ ENM	8.2	8.5	10.0	9.6	36.3	7.1
A039130	하나투어	6.9	9.2	9.9	9.8	35.7	-4.4
A016360	삼성증권	9.4	8.5	9.2	8.5	35.5	-1.6
A122870	와이지엔터테인먼트	9.2	6.0	9.8	10.0	34.9	1.6
A011070	LG이노텍	8.6	7.7	9.7	8.6	34.5	-6.6
A139480	이마트	9.8	9.8	6.7	8.2	34.4	-0.9

기관 순매수 스타일 성과 추이

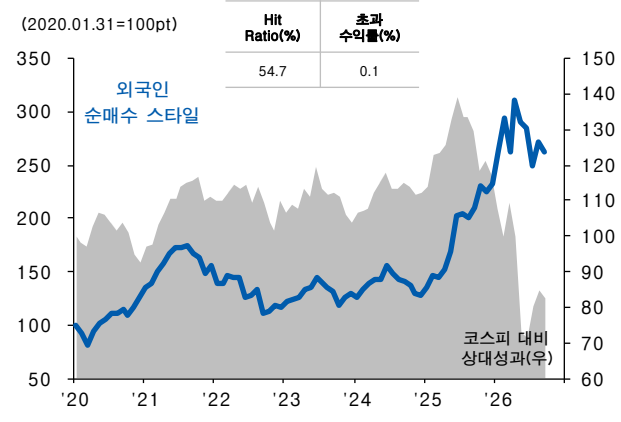


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-3.5
A006360	GS건설	10.0	9.9	9.8	9.5	39.1	-4.9
A336260	두산퓨얼셀	9.7	9.6	9.9	9.7	38.8	3.1
A161890	한국콜마	9.2	9.4	9.7	9.1	37.3	4.3
A375500	DL이앤씨	9.3	8.9	9.6	9.2	36.9	-2.1
A192820	코스맥스	9.9	9.8	9.5	7.4	36.5	0.6
A010060	OCI홀딩스	9.1	8.0	9.6	9.6	36.2	-7.6
A001450	현대해상	9.0	9.5	9.1	7.5	35.1	-3.9
A112610	씨에스원드	8.7	8.2	9.3	9.0	35.1	-2.3
A000370	한화손해보험	9.4	9.1	8.6	8.0	35.0	-1.5

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	-7.2
A069960	현대백화점	9.9	9.8	9.6	9.0	38.2	1.8
A282330	BGF리테일	9.5	9.5	9.4	9.6	37.9	-1.0
A023530	롯데쇼핑	9.5	9.8	9.2	9.3	37.7	3.2
A195870	해성디에스	7.8	9.7	9.5	9.9	36.8	8.6
A064350	현대로템	8.0	9.5	9.5	9.8	36.7	-1.5
A011780	금호석유화학	9.4	8.1	9.6	9.7	36.7	-2.4
A298020	효성티앤씨	9.7	9.1	9.2	8.7	36.6	-5.3
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	3.0

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/17일 기준, 세부기준 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

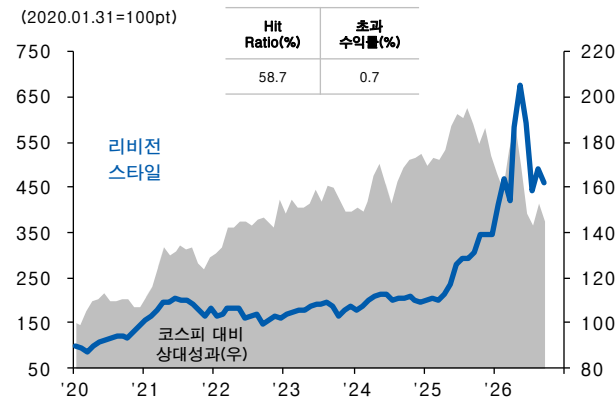
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

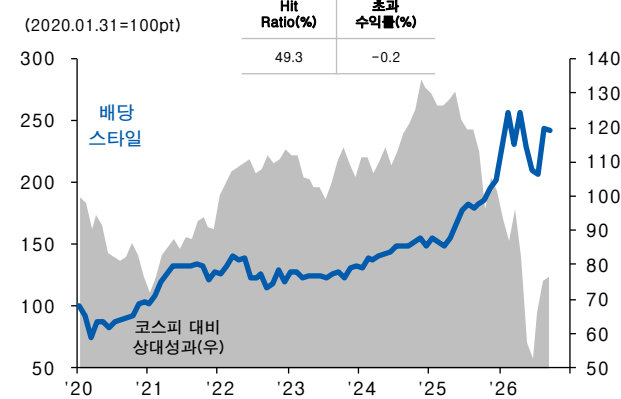


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A006260	LS	9.5	9.3	7.8	26.5	-4.9
A128940	한미약품	9.5	9.8	6.4	25.7	11.0
A241710	코스메카코리아	9.0	8.0	8.4	25.5	4.1
A192820	코스맥스	8.9	8.0	8.3	25.2	0.6
A161890	한국콜마	8.4	8.0	8.2	24.7	4.3
A011200	HMM	9.1	8.1	7.2	24.4	-0.5
A028670	팬오션	7.5	8.5	8.3	24.3	-2.5
A353200	대덕전자	8.4	8.2	7.6	24.1	0.7
A012450	한화에어로스페이스	7.0	7.7	8.1	22.8	1.5
A181710	NHN	8.5	8.9	5.3	22.7	0.4

배당 스타일 성과 추이

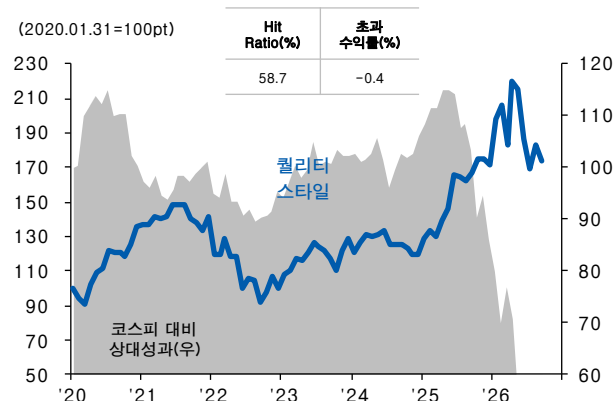


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.8	9.8	9.4	9.7	37.6	-8.1
A005940	NH투자증권	8.0	9.5	9.9	9.9	37.2	-3.4
A214320	이노션	8.3	9.9	9.3	9.5	36.9	-1.9
A035250	강원랜드	8.7	9.8	8.5	9.8	36.8	-1.2
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.5	9.6	9.4	36.7	2.2
A023530	롯데쇼핑	9.8	9.4	8.6	8.0	35.9	3.2
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	-3.6
A016360	삼성증권	6.9	9.0	9.5	9.9	35.3	-1.6
A105630	한세실업	7.7	9.3	8.4	9.6	35.0	-1.7

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	-2.4
A403870	HPSP	9.3	9.9	9.8	9.3	38.4	-0.4
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	38.0	-3.7
A058470	리노공업	9.9	9.7	9.7	8.7	38.0	0.0
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.5	9.6	36.5	-0.3
A214150	클래시스	8.6	9.7	9.3	8.8	36.4	-1.9
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.5	36.4	0.2
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	-3.7
A376300	디어유	9.5	9.5	8.8	7.5	35.2	-3.8

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/17일 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.