

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

5월 2주차 비반도체 명품 조연 스크리닝

CONTENTS

I 주간 스크리닝

비반도체 명품 조연 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

비반도체 명품 조연 스크리닝

- 1) '05년 이후 약 5번의 반도체 강제 사이클 분석 결과 현재의 반도체 강제 사이클은 후반전에 접어든 것으로 판단
- 2) 사이클 후반 반도체는 계속해서 코스피 대비 높은 초과수익을 기록하는 경향이 나타나는 한편 반도체의 성과를 상회하는 업종의 수가 증가하며 비반도체 명품조연을 통해 추가 알파 창출이 가능할 것으로 전망
- 3) 해당 업종/종목은 1) 외국인+기관의 수급 모멘텀이 확대되며 2) 이미 모멘텀이 형성된 종목이라는 특징이 확인. 외국인과 기관이 선택한 명품조연의 추세를 추종하는 전략이 반도체 강제 사이클 후반부 핵심일 것으로 판단

[5월 2주차] 1) 외국인+기관 3개월 수급 모멘텀 및 2) 3개월 수익률 스코어 상위 20% 종목 스크리닝

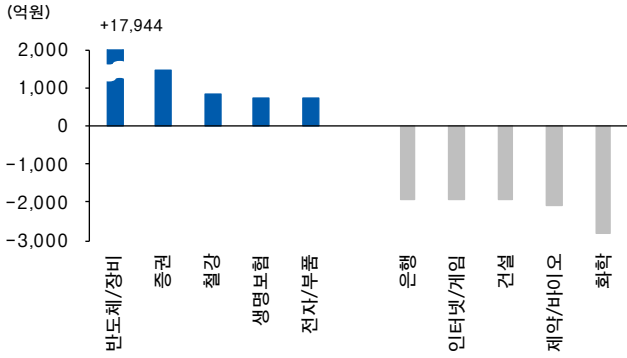
종목명	업종	시가총액 (억원)	외국인 수급 모멘텀(억원, %)			기관 수급 모멘텀(억원, %)			3M 수익률 (%)
			직전 3M	최근 3M	시총대비 모멘텀 강도	직전 3M	최근 3M	시총대비 모멘텀 강도	
LG에너지솔루션	IT가전	1,127,880	-60	4,299	0.39	-3,208	4,882	0.72	22.5
두산에너지리티	기계	813,513	8,671	15,942	0.89	1,854	4,240	0.29	2.17
삼성SDI	IT가전	562,487	-467	7,512	1.42	1,781	10,698	1.59	2.50
POSCO홀딩스	철강	400,962	1,245	2,915	0.42	1,874	3,678	0.45	2.16
LG화학	화학	298,959	1,343	4,971	1.21	-3,681	885	1.53	2.35
현대로템	상사, 자본재	285,953	810	5,049	1.48	498	2,070	0.55	1.99
SK이노베이션	에너지	248,000	-388	4,726	2.06	-609	1,270	0.76	2.25
대한전선	기계	129,022	441	2,306	1.45	659	1,168	0.39	2.37
이수퍼타시스	IT하드웨어	111,288	-4,787	750	4.98	-494	2,415	2.61	2.53
산일전기	기계	97,818	306	3,503	3.27	22	2,836	2.88	2.75
롯데에너지머티리얼즈	IT하드웨어	41,107	-66	287	0.86	173	645	1.15	2.39
두산퓨얼셀	IT가전	51,282	-46	1,332	2.69	194	1,065	1.70	2.66
CJ제일제당	필수소비재	34,625	-170	513	1.97	-285	775	3.06	2.23
심텍	IT하드웨어	35,027	19	934	2.61	451	1,941	4.25	2.74
씨에스윈드	에너지	28,213	415	863	1.59	255	1,532	4.52	2.59
LS에코에너지	기계	28,206	-193	314	1.80	158	401	0.86	2.50
호텔신라	소매(유통)	25,080	222	1,267	4.17	138	971	3.32	2.60
파미셀	화학	12,063	-35	477	4.25	-154	276	3.56	2.65

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 5/7일 기준

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +9,250.8 억원 순매수, 기관은 약 +4,044.5 억원 순매수. 두 주체 모두 반도체/장비 업종에 순매수 집중된 모습. 반면, 제약/바이오 및 인터넷/게임 업종을 동시 순매도
- 종목단에서는 심텍, 호텔신라를 동시 순매수하였으며, 현대차, 삼성E&A, 키움증권이 기관+외국인 주간 순매수 전환 상위에 스크리닝

기관 주간 순매수 상/하위 업종

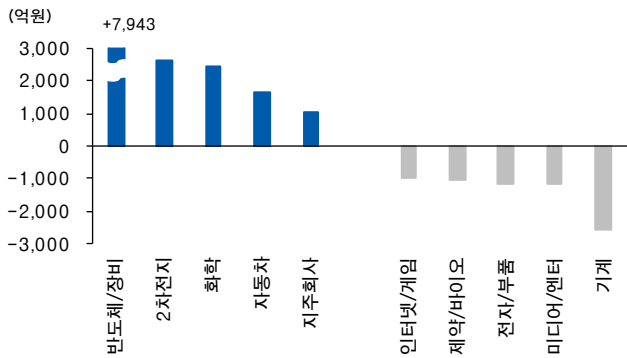


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	17,944	36,322	112,296	[Red]
2	증권	1,478	929	4,549	[Red]
3	철강	849	3,975	4,382	[Red]
4	생명보험	745	802	595	[Red]
5	전자/부품	728	4,477	10,789	[Red]
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	화학	-2,816	1,147	2,845	[Blue]
2	제약/바이오	-2,073	-6,930	-5,461	[Blue]
3	건설	-1,942	-3,829	-2,860	[Blue]
4	인터넷/게임	-1,940	-3,281	-9,063	[Blue]
5	은행	-1,935	1,506	21,030	[Blue]

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

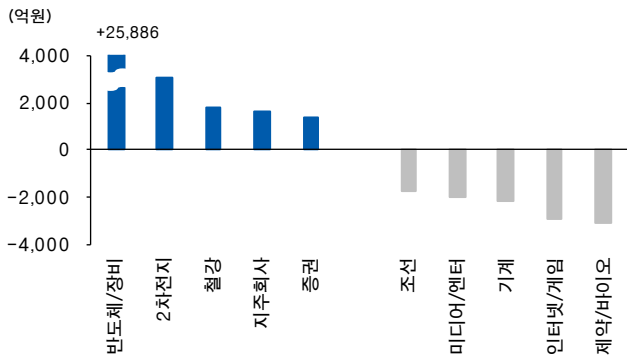


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	7,943	36,424	-416,390	[Red]
2	2차전지	2,609	8,278	16,283	[Red]
3	화학	2,440	5,536	11,824	[Red]
4	자동차	1,652	-6,256	-44,696	[Red]
5	지주회사	1,041	3,975	6,980	[Red]
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	기계	-2,557	1,680	10,416	[Blue]
2	미디어/엔터	-1,182	-3,738	-1,335	[Blue]
3	전자/부품	-1,147	1,354	3,814	[Blue]
4	제약/바이오	-1,057	-3,518	5,880	[Blue]
5	인터넷/게임	-980	-5,031	-17,359	[Blue]

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	반도체/장비	25,886	72,745	-304,094	[Red]
2	2차전지	3,055	15,749	37,731	[Red]
3	철강	1,825	7,027	5,986	[Red]
4	지주회사	1,622	6,626	12,778	[Red]
5	증권	1,385	-3,351	-13,237	[Red]
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	-3,131	-10,448	419	[Blue]
2	인터넷/게임	-2,920	-8,311	-26,422	[Blue]
3	기계	-2,138	12,250	28,757	[Blue]
4	미디어/엔터	-1,971	-6,776	-9,199	[Blue]
5	조선	-1,798	940	551	[Blue]

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 5/7일 기준

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A222800	심텍	전자/부품	39,769	319	0.30
A051900	LG생활건강	화장품	42,082	267	0.21
A195870	해성디에스	반도체/장비	14,620	86	0.21
A214450	파마리서치	의료기기	34,546	211	0.20
A248070	솔루엠	전자/부품	10,854	63	0.20
A240810	원익IPS	반도체/장비	65,233	310	0.16
A008770	호텔신라	호텔/레저	25,786	107	0.14
A023530	롯데쇼핑	소매/유통	38,501	146	0.13
A011070	LG이노텍	전자/부품	150,759	445	0.10
A016360	삼성증권	증권	129,664	357	0.09

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A011790	SKC	화학	65,929	1,084	0.62
A108670	LX하우시스	건자재	3,583	58	0.52
A010060	OCI홀딩스	화학	61,238	482	0.25
A257720	실리콘투	화장품	27,405	196	0.24
A222800	심텍	전자/부품	39,769	239	0.22
A028670	팬오션	해운	32,235	179	0.19
A018880	한온시스템	자동차부품	50,287	296	0.19
A006650	대한유화	화학	11,245	62	0.18
A128940	한미약품	제약/바이오	55,151	290	0.17
A008770	호텔신라	호텔/레저	25,786	128	0.17

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A108670	LX하우시스	건자재	3,583	59	0.5
A222800	심텍	전자/부품	39,769	559	0.5
A008770	호텔신라	호텔/레저	25,786	235	0.3
A051900	LG생활건강	화장품	42,082	333	0.3
A240810	원익IPS	반도체/장비	65,233	423	0.2
A018880	한온시스템	자동차부품	50,287	314	0.2
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	263,281	1,505	0.2
A039490	키움증권	증권	122,224	650	0.2
A005490	POSCO홀딩스	철강	423,942	2,164	0.2
A003490	대한항공	항공	97,026	485	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005380	현대차	자동차	1,171,214	1,228.4	-3,473	-33,954
A028050	삼성E&A	건설	126,224	199.3	-3,279	-5,073
A039490	키움증권	증권	122,224	650.2	-1,662	-1,464
A272210	한화시스템	방위산업	220,469	123.9	-1,872	-5,277
A006800	미래에셋증권	증권	442,058	1,725.9	-227	-6,763
A247540	에코프로비엠	2차전지	230,391	745.7	-1,067	120
A298040	효성중공업	기계	429,022	505.9	-833	2,949
A240810	원익IPS	반도체/장비	65,233	422.7	-915	-1,493
A214450	파마리서치	의료기기	34,546	124.0	-392	-2,783
A014680	한솔케미칼	화학	32,803	9.9	-429	-406

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 5/7일 기준

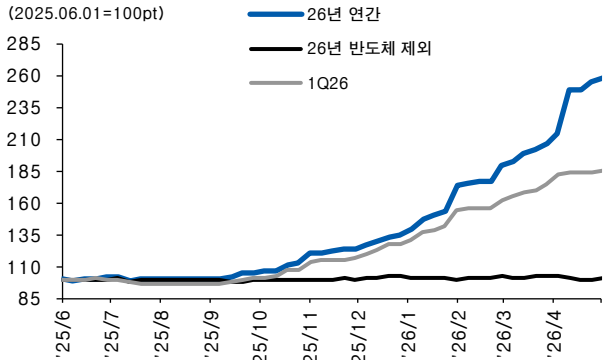
업종별

종목별

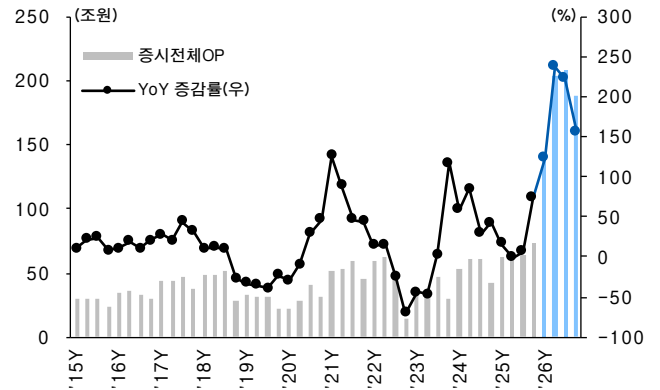
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +2.2% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 +0.9% 하향조정
- 26년 1분기 실적시즌 이후 증시 전체 영업이익의 추정치는 상향조정 지속되는 반면 반도체 제외 업종의 경우 부진한 흐름 지속. KOSPI 지수는 전고점을 돌파하며 약 7,490.1Pt 수준을 기록하고 있지만 P/E는 여전히 7.6배 수준

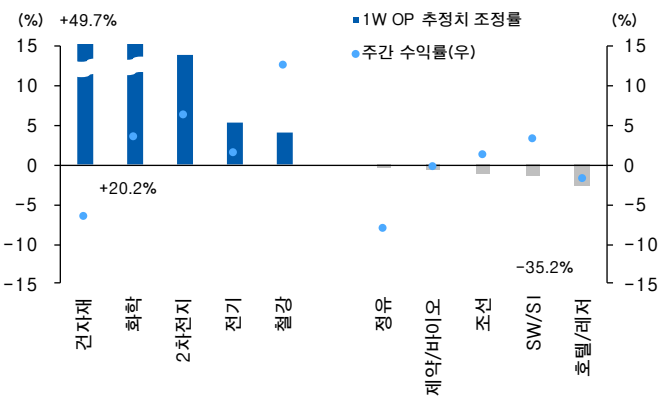
증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익의 및 증감을 추이



26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

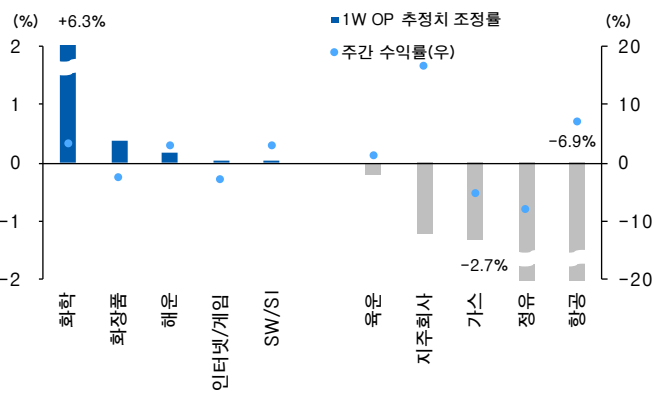


26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	건자재	1,467	49.7	-6.5	
2	화학	37,185	20.2	3.4	
3	2차전지	13,555	13.9	6.2	
4	전기	120,771	5.4	1.4	
5	철강	39,135	4.1	12.4	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	호텔/레저	8,930	-2.7	-1.8	
2	SW/SI	14,994	-1.4	3.1	
3	조선	125,743	-1.1	1.1	
4	제약/바이오	57,552	-0.7	-0.2	
5	정유	70,270	-0.4	-8.2	

26년 1분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



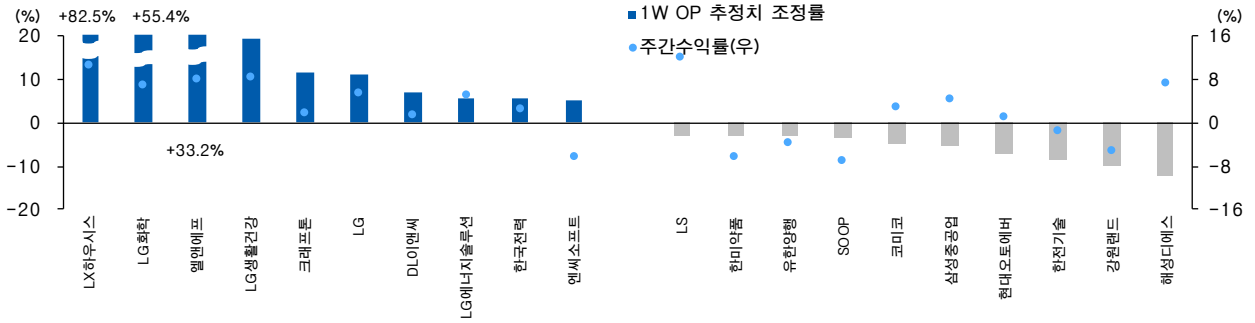
26년 1분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	2,091	6.3	3.4	
2	화학품	5,296	0.4	-2.6	
3	해운	4,173	0.2	3.1	
4	인터넷/게임	15,931	0.0	-2.8	
5	SW/SI	2,828	0.0	3.1	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	항공	4,820	-6.9	7.0	
2	정유	32,992	-2.7	-8.2	
3	가스	9,133	-1.3	-5.2	
4	지주회사	78,320	-1.2	16.6	
5	육운	6,360	-0.2	1.3	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주: 유니버스 200 종목 5/6일 추정치 기준(수익률 5/7일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

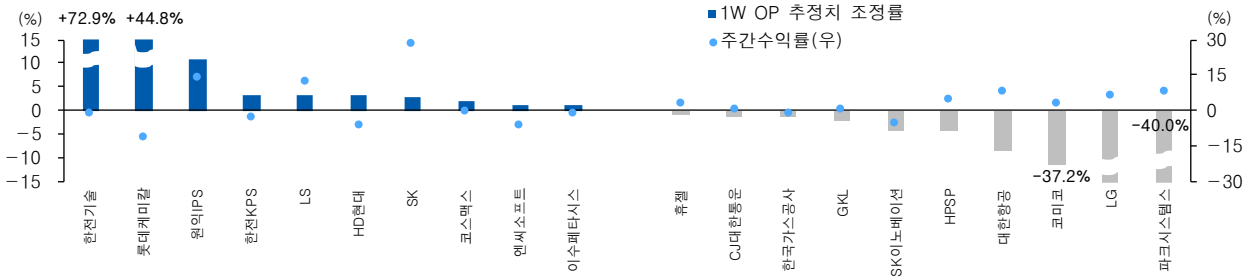


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A108670	LX하우시스	건자재	1,077	82.5	10.7	1	A195870	해성디에스	반도체/장비	902	-12.2	7.2
2	A051910	LG화학	화학	14,754	55.4	7.1	2	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,028	-10.0	-5.2
3	A066970	엘앤에프	2차전지	2,358	33.2	8.1	3	A052690	한진기술	전기	592	-8.5	-1.7
4	A051900	LG생활건강	화장품	3,325	19.6	8.3	4	A307950	현대오트에버	SW/SI	2,792	-7.1	1.1
5	A259960	크래프톤	인터넷/게임	14,199	11.7	1.9	5	A010140	삼성중공업	조선	15,275	-5.2	4.2
6	A003550	LG	지주회사	16,476	11.3	5.5	6	A183300	코미코	반도체/장비	1,350	-4.9	2.9
7	A375500	DLI앤씨	건설	5,075	6.9	1.3	7	A067160	SOOP	미디어/엔터	1,151	-3.4	-7.0
8	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	11,786	5.9	4.9	8	A000100	유한양행	제약/바이오	1,328	-3.1	-3.9
9	A015760	한국전력	전기	118,289	5.6	2.6	9	A128940	한미약품	제약/바이오	2,631	-3.0	-6.4
10	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	4,872	5.2	-6.5	10	A006260	LS	지주회사	13,852	-2.9	11.9

'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

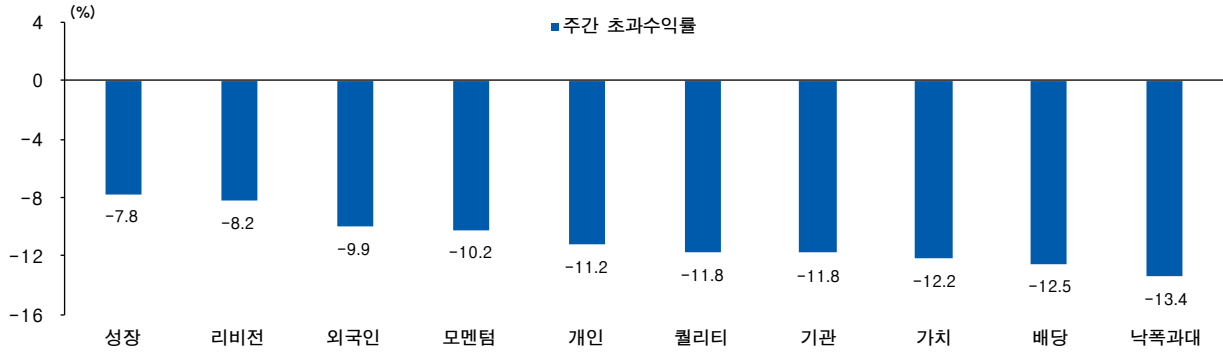
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A052690	한진기술	전기	61	72.9	-1.7	1	A140860	파크시스템스	전자/부품	27	-40.0	7.3
2	A011170	롯데케미칼	화학	425	44.8	-11.9	2	A003550	LG	지주회사	3,253	-37.2	5.5
3	A240810	원익IPS	반도체/장비	26	10.9	13.5	3	A183300	코미코	반도체/장비	300	-11.8	2.9
4	A051600	한진KPS	전기	430	3.2	-3.5	4	A003490	대한항공	항공	3,800	-8.6	7.3
5	A006260	LS	지주회사	3,651	3.1	11.9	5	A403870	HPSP	반도체/장비	152	-4.5	4.0
6	A267250	HD현대	지주회사	18,580	3.1	-6.6	6	A096770	SK이노베이션	정유	20,514	-4.2	-5.7
7	A034730	SK	지주회사	9,799	2.9	27.8	7	A114090	GKL	호텔/레저	148	-2.4	-0.3
8	A192820	코스맥스	화장품	570	1.9	-1.2	8	A036460	한국가스공사	가스	7,850	-1.5	-1.7
9	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	961	1.2	-6.5	9	A000120	CJ대한통운	육운	1,023	-1.3	-0.3
10	A007660	이수페타시스	전자/부품	673	1.1	-1.9	10	A145020	휴젤	제약/바이오	411	-1.1	2.8

자료: 에프앤가이드 Quantivise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 5/6일 추정치 기준(수익률 5/7일 기준)

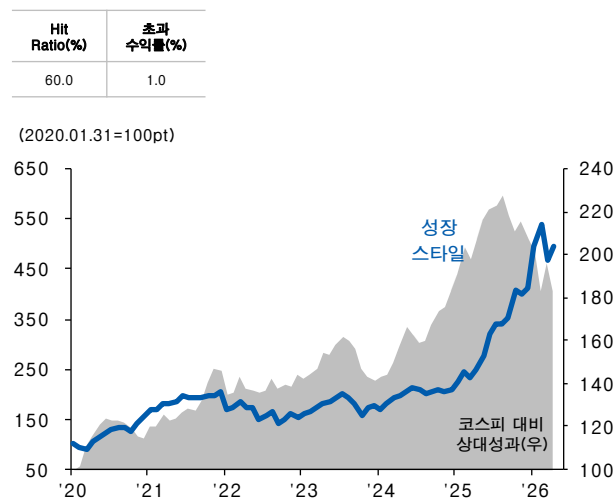
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

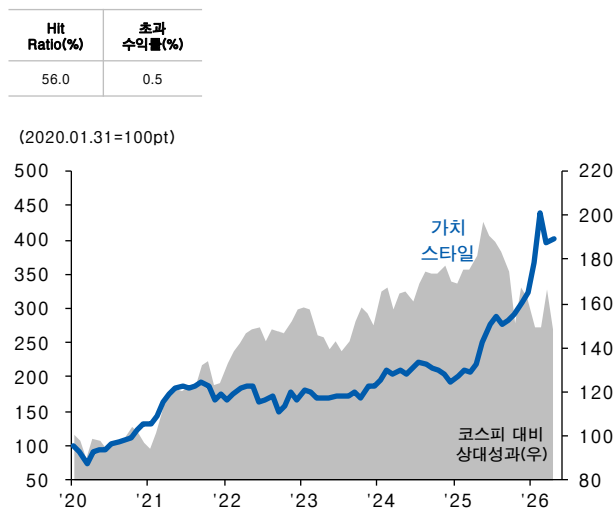


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.8	9.8	9.8	29.4	23.1
A353200	대덕전자	9.1	9.6	9.5	28.2	7.0
A267270	HD건설기계	9.0	9.3	9.4	27.7	4.7
A010130	고려아연	8.1	8.3	7.8	24.3	-1.2
A298020	효성티앤씨	6.1	8.7	9.4	24.2	-6.8
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	-5.4
A298040	효성중공업	7.8	8.1	7.7	23.6	17.6
A010120	LS ELECTRIC	7.7	7.8	8.0	23.5	14.6
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.9	5.8	23.4	6.8
A009150	삼성전기	6.8	8.3	7.7	22.8	10.2

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

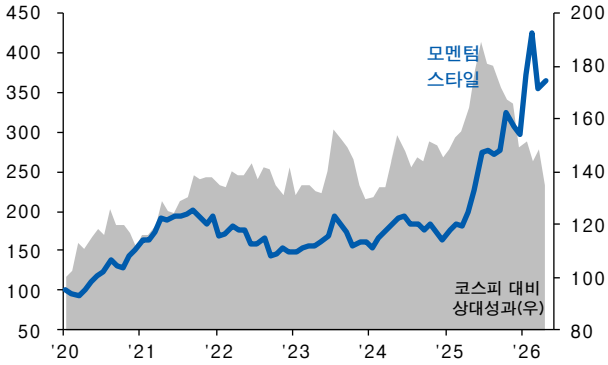
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A108670	LX하우시스	10.0	9.8	9.9	29.7	10.7
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	1.8
A001450	현대해상	9.9	9.5	9.9	29.3	1.6
A088350	한화생명	9.1	9.9	9.9	28.8	0.8
A011170	롯데케미칼	10.0	9.6	9.1	28.7	-11.9
A139130	iM금융지주	9.4	9.4	8.9	27.7	0.8
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.6	27.6	2.6
A000120	CJ대한통운	8.5	9.4	9.5	27.4	-0.3
A097950	CJ제일제당	8.7	9.0	9.8	27.4	-6.1
A024110	기업은행	9.4	9.4	8.3	27.0	-3.8

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 5/7일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

(2020.01.31=100pt)



모멘텀 스코어 Top 10

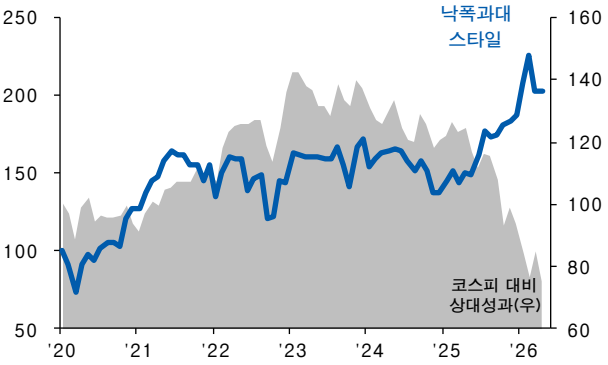
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A047040	대우건설	10.0	10.0	10.0	10.0	39.8	-5.1
A009150	삼성전기	9.8	9.8	9.9	9.8	39.2	10.2
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.9	9.8	9.7	39.1	-10.9
A010120	LS ELECTRIC	9.7	9.8	9.8	9.7	38.9	14.6
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.9	9.9	8.8	38.4	7.2
A001440	대한전선	9.9	9.5	9.6	9.4	38.3	13.9
A011070	LG이노텍	9.7	9.7	9.3	9.1	37.8	11.2
A353200	대덕전자	8.6	9.2	9.7	9.9	37.4	7.0
A006400	삼성SDI	9.4	9.3	9.0	8.9	36.6	-0.1
A006260	LS	9.5	9.6	8.9	8.6	36.6	11.9

낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.3	-0.4

(2020.01.31=100pt)



낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A253450	스튜디오드래곤	9.5	9.8	9.7	9.6	38.6	-3.0
A293490	카카오게임즈	9.0	9.9	9.8	9.3	38.0	-4.7
A122870	와이지엔터테인먼트	8.4	9.8	9.9	9.4	37.4	-6.9
A067160	SOOP	9.1	9.4	9.2	9.8	37.4	-7.0
A000100	유한양행	9.5	8.9	9.6	9.3	37.2	-3.9
A035760	CJ ENM	9.7	9.7	9.6	8.3	37.2	-5.2
A214450	파마리서치	7.3	10.0	10.0	9.0	36.2	6.1
A207940	삼성바이오로직스	9.4	9.0	9.4	8.2	36.0	-0.1
A462870	시프트업	8.7	7.9	9.1	10.0	35.7	-2.0
A352820	하이브	9.9	9.9	9.5	6.3	35.5	-7.4

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 5/7일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

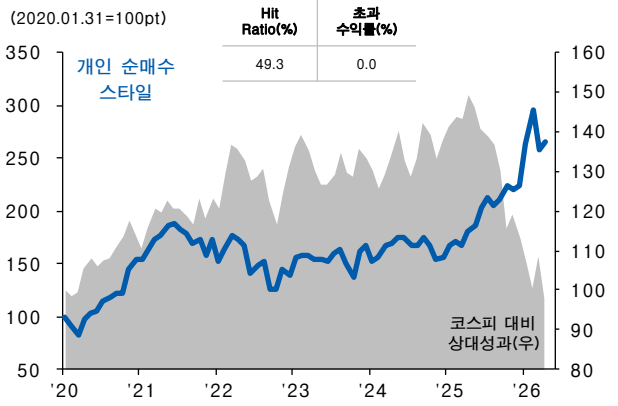
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

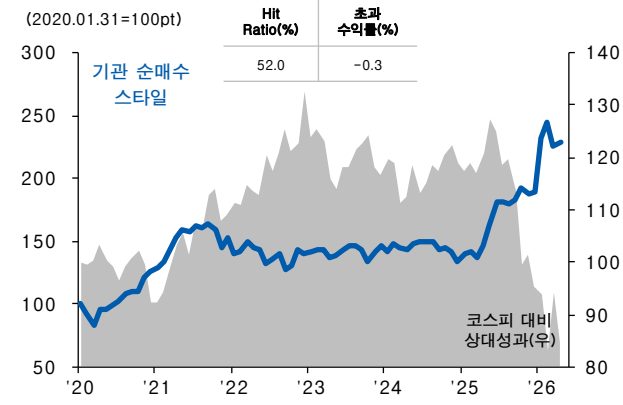


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A103140	풍산	9.3	10.0	9.8	9.9	38.9	-2.7
A214450	파마리서치	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	6.1
A352820	하이브	10.0	9.8	9.7	9.3	38.8	-7.4
A035420	NAVER	9.4	9.9	9.6	9.9	38.7	-1.7
A006360	GS건설	9.9	9.7	9.4	9.2	38.1	3.4
A122870	와이엔터테인먼트	9.3	9.6	9.9	9.2	37.9	-6.9
A204320	HL만도	8.9	8.9	9.9	10.0	37.6	0.9
A028050	삼성E&A	9.8	9.8	9.4	8.3	37.2	21.3
A047810	한국항공우주	9.7	9.5	9.2	8.7	37.0	1.7
A067160	SOOP	8.6	9.4	8.9	9.7	36.4	-7.0

기관 순매수 스타일 성과 추이

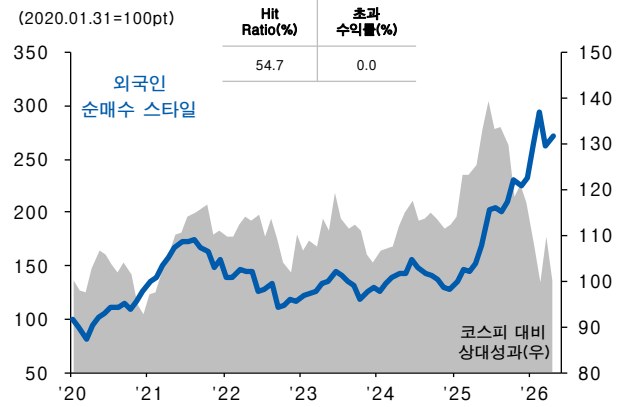


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A120110	코오롱인더	9.8	9.9	9.8	9.7	39.2	0.9
A021240	코웨이	9.5	9.6	9.2	9.6	37.9	0.9
A222800	심텍	9.9	9.5	9.2	9.3	37.9	22.4
A375500	DLI앤씨	10.0	9.8	9.3	8.8	37.8	1.3
A066970	엘앤에프	9.2	9.7	9.6	8.9	37.4	8.1
A008770	호텔신라	9.9	9.3	8.9	9.4	37.4	0.3
A298020	효성티앤씨	8.9	9.3	9.7	9.5	37.3	-6.8
A058470	리노공업	8.2	9.4	9.8	9.8	37.0	-4.9
A023530	롯데쇼핑	8.8	9.6	9.5	9.0	36.8	0.6
A112610	씨에스윈드	9.0	9.8	9.4	8.6	36.8	-14.5

외국인 순매수 스타일 성과 추이



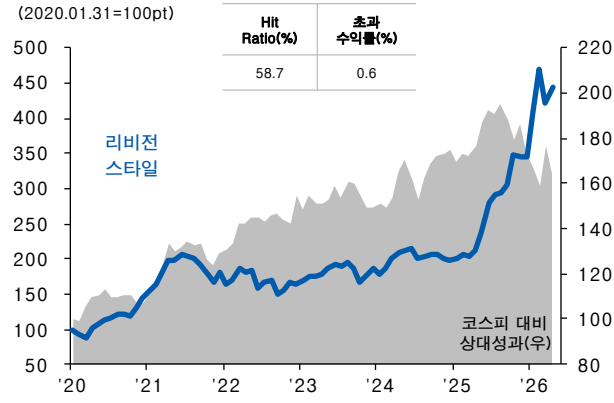
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A278470	에이피알	9.5	10.0	9.9	9.9	39.2	-5.4
A403870	HPSP	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	4.0
A195870	해성디에스	9.6	9.6	9.8	9.6	38.5	7.2
A008770	호텔신라	10.0	9.9	9.4	8.9	38.1	0.3
A004170	신세계	8.8	9.8	9.7	9.5	37.7	6.4
A241710	코스메카코리아	9.5	9.2	9.4	9.5	37.5	-5.4
A014680	한솔케미칼	9.6	9.3	8.7	9.6	37.2	1.2
A001440	대한전선	9.9	9.7	8.6	8.7	36.9	13.9
A336260	두산퓨얼셀	9.8	8.9	7.8	9.7	36.1	25.3
A011780	금호석유화학	8.5	9.1	9.1	9.2	35.8	-10.1

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 5/7일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

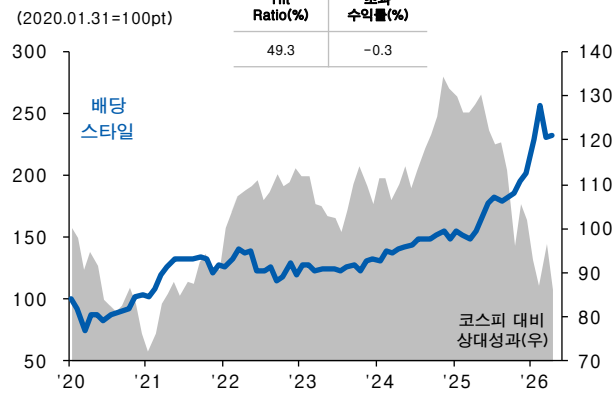


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.3	9.0	27.7	23.1
A010950	S-Oil	9.6	9.5	7.4	26.5	-12.1
A263750	풀어비스	9.2	9.1	7.6	25.9	-10.9
A006650	대한유화	9.4	9.6	6.4	25.4	-4.5
A278470	에이피알	9.4	8.6	7.3	25.3	-5.4
A166090	하나머티리얼즈	9.3	8.7	6.2	24.1	6.8
A078930	GS	8.5	9.1	6.2	23.9	-4.0
A036570	NC	8.7	8.3	6.6	23.6	-6.5
A016360	삼성증권	6.2	8.9	8.4	23.5	35.1
A000660	SK하이닉스	7.8	7.9	7.7	23.4	28.6

배당 스타일 성과 추이

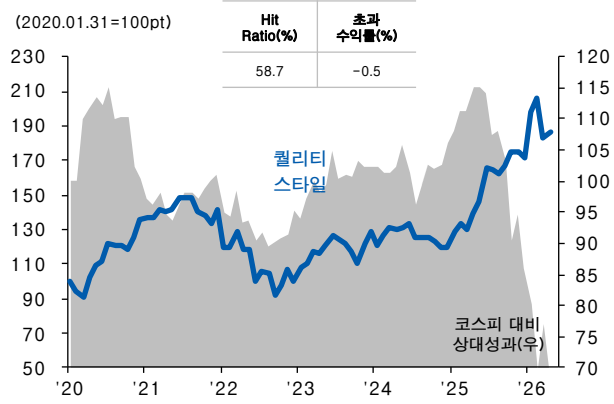


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.6	9.8	9.4	9.9	37.7	-4.3
A214320	이노션	7.9	9.7	9.2	9.9	36.7	-0.8
A005940	NH투자증권	7.5	9.5	9.8	9.7	36.6	12.0
A035250	강원랜드	8.5	9.9	8.3	9.8	36.4	-5.2
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.2	9.3	36.0	15.2
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.1	9.6	8.9	35.5	-9.1
A017670	SK텔레콤	9.3	9.0	9.1	8.1	35.4	-2.0
A032640	LG유플러스	8.1	9.2	8.9	9.1	35.3	-3.0
A000080	하이트진로	9.7	8.4	7.9	8.8	34.7	-1.5
A016360	삼성증권	6.2	9.3	9.5	9.7	34.6	35.1

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.5	9.8	9.6	9.3	38.2	4.0
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	-4.9
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	-3.1
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.4	28.6
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.5	36.9	-2.0
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.5	2.8
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	-0.3
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.2	35.8	6.1
A207940	삼성바이오로직스	7.7	9.8	9.8	8.5	35.7	-0.1
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.8	35.2	-9.9

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
 주2) 5/7일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

Quant Weekly Evaluation Report

- 이 자료에 게재된 내용들은 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인함. (작성자:신현웅)
- 당사는 동 자료를 전문투자자 및 제 3 자에게 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 투자이사결정은 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.