

Y U A N T A

# Quant Weekly Evaluation Report

5월 5주차 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@yantakorea.com

비반도체 명품 조연 스크리닝 (참고자료: [\[하반기 Quant 전략\] 강세장 Vital Check \(107p~\)](#))

- 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) 사이클 후반 알파 업종/종목은 1) 외국인+기관의 수급 모멘텀이 확대되며 2) 이미 모멘텀이 형성된 종목이라는 특징이 확인. 외국인과 기관이 선택한 명품 조연의 추세를 추종하는 전략이 반도체 강제 사이클 유효한 전략이라는 판단

## [5월 5주차] 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	
삼성SDI	IT가전	507,689	4,811	9,127	0.85	3,193	6,745	0.70	44.9
POSCO홀딩스	철강	335,588	1,032	3,733	0.80	1,363	2,182	0.24	7.0
대한전선	기계	97,114	669	3,818	3.24	644	1,374	0.75	43.5
산일전기	기계	82,663	1,246	3,899	3.21	-358	1,971	2.82	56.0
한화생명	보험	44,816	-1,127	293	3.17	-145	343	1.09	6.7
롯데에너지머티리얼즈	IT하드웨어	30,477	231	310	0.26	-79	682	2.50	35.9
두산퓨얼셀	IT가전	66,476	386	1,482	1.65	302	1,399	1.65	108.8
CJ제일제당	필수소비재	31,087	-8	764	2.48	-175	659	2.68	-2.3
심텍	IT하드웨어	45,706	691	1,230	1.18	118	2,026	4.17	92.0
씨에스윈드	에너지	21,044	173	1,096	4.39	510	576	0.31	-2.3
코오롱인더	화학	22,400	90	586	2.22	418	1,013	2.65	16.2
LS에코에너지	기계	23,397	75	344	1.15	238	361	0.53	57.1
호텔신라	소매(유통)	21,469	87	1,708	7.55	-7	1,380	6.46	19.1
HD현대에너지솔루션	에너지	21,022	-302	473	3.69	79	636	2.65	79.0
한국콜마	화장품, 의류, 완구	20,418	135	201	0.33	6	1,556	7.59	16.4
GS리테일	소매(유통)	22,574	145	339	0.86	80	306	1.00	17.4
더블유게임즈	소프트웨어	14,377	1	125	0.86	15	223	1.45	30.4

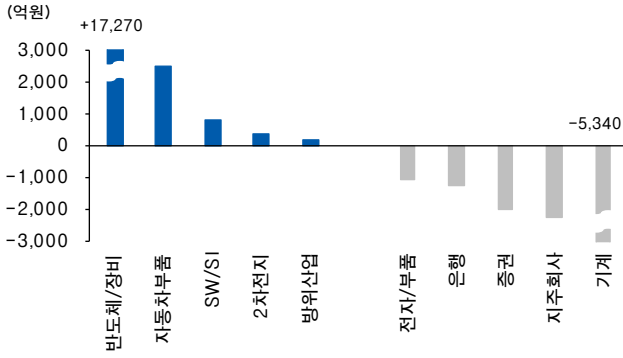
자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주: 5/28일 기준

### 주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -3.7 조원 순매도, 기관은 약 -666.7 억원 순매도. 외국인은 약 7주 연속 순매도를 지속하고 있으며 누적 약 -45.7조원 순매도. 동 기간 외국인은 반도체/장비 업종을 약 -33.2조원 순매도, 기관은 +10.6조원 순매수
- 이번주 기관 및 외국인의 수급 방향성이 일치한 업종은 2차전지(순매수), 전자/부품(순매도) 등

#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

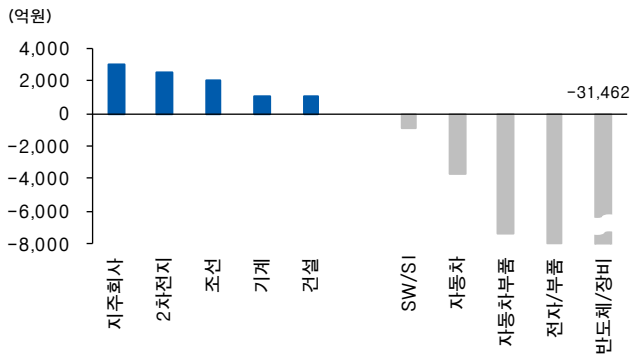


#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	17,270	105,682	124,484	
2	자동차부품	2,459	7,533	3,168	
3	SW/SI	806	2,042	2,851	
4	2차전지	333	-3,678	10,687	
5	방위산업	133	-1,401	652	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	기계	-5,340	-6,835	2,200	
2	지주회사	-2,285	-1,655	-1,284	
3	증권	-2,007	-6,005	-2,718	
4	은행	-1,278	-2,083	10,325	
5	전자/부품	-1,118	12,452	19,932	

#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

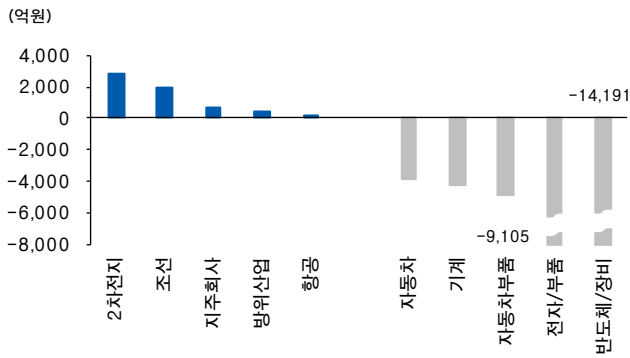


#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	지주회사	2,999	3,481	6,644	
2	2차전지	2,510	10,221	16,666	
3	조선	2,014	-6,836	-14,753	
4	기계	1,106	-22,835	-9,260	
5	건설	1,059	1,161	-10,382	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-31,462	-350,250	-606,327	
2	전자/부품	-7,988	-24,860	-20,417	
3	자동차부품	-7,407	-22,687	-22,671	
4	자동차	-3,749	-14,458	-59,724	
5	SW/SI	-899	-1,989	-4,774	

#### 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	2,842	6,543	27,354	
2	조선	1,987	-8,515	-5,909	
3	지주회사	714	1,826	5,360	
4	방위산업	423	-4,430	-5,897	
5	항공	209	1,076	451	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-14,191	-244,569	-481,843	
2	전자/부품	-9,105	-12,408	-485	
3	자동차부품	-4,948	-15,154	-19,503	
4	기계	-4,234	-29,670	-7,059	
5	자동차	-3,841	-8,854	-60,921	

자료:에프앤가이드 Quantivise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 5/28일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A010060	OCI홀딩스	화학	67,960	770	0.37
A007660	이수페타시스	전자/부품	93,597	598	0.20
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	64,511	305	0.16
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	15,498	63	0.14
A012330	현대모비스	자동차부품	622,426	2,542	0.14
A128940	한미약품	제약/바이오	62,197	252	0.14
A047810	한국항공우주	방위산업	163,661	651	0.13
A204320	HL만도	자동차부품	28,973	91	0.10
A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	61,293	179	0.10
A006280	녹십자	제약/바이오	16,677	48	0.09

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A183300	코미코	반도체/장비	9,802	126	0.42
A120110	코오롱인더	화학	21,621	193	0.29
A112610	씨에스윈드	기계	20,242	169	0.27
A375500	DL이앤씨	건설	29,601	244	0.27
A058470	리노공업	반도체/장비	75,526	527	0.22
A263750	펄어비스	인터넷/게임	28,205	185	0.22
A240810	원익IPS	반도체/장비	53,158	351	0.21
A004170	신세계	소매/유통	49,209	290	0.20
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	13,726	81	0.18
A011210	현대위아	자동차부품	24,013	111	0.15

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A204320	HL만도	자동차부품	28,973	209	0.2
A010060	OCI홀딩스	화학	67,960	449	0.2
A263750	펄어비스	인터넷/게임	28,205	147	0.2
A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	61,293	278	0.2
A006280	녹십자	제약/바이오	16,677	71	0.1
A247540	에코프로비엠	2차전지	213,760	831	0.1
A006400	삼성SDI	2차전지	544,758	2,026	0.1
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	15,498	50	0.1
A042660	한화오션	조선	380,565	1,224	0.1
A001440	대한전선	기계	93,684	275	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	16,313,757	535.3	-144,122	-192,803
A028050	삼성E&A	건설	99,568	112.0	-3,112	-7,908
A000270	기아	자동차	641,449	174.1	-1,937	-12,611
A003550	LG	지주회사	178,589	200.0	-1,110	-723
A066970	엘앤에프	2차전지	68,451	47.9	-1,161	2,773
A272210	한화시스템	방위산업	200,066	96.4	-883	-2,542
A039490	키움증권	증권	97,307	11.2	-960	-2,231
A047810	한국항공우주	방위산업	163,661	313.3	-652	-4,295
A278470	에이피알	화장품	149,940	229.3	-516	2,867
A000150	두산	지주회사	268,818	300.0	-335	1,718

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 5/28일 기준

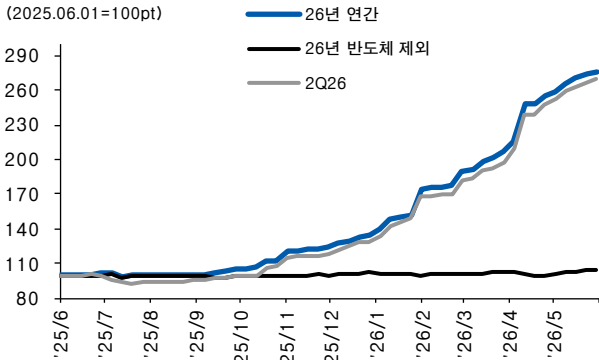
업종별

종목별

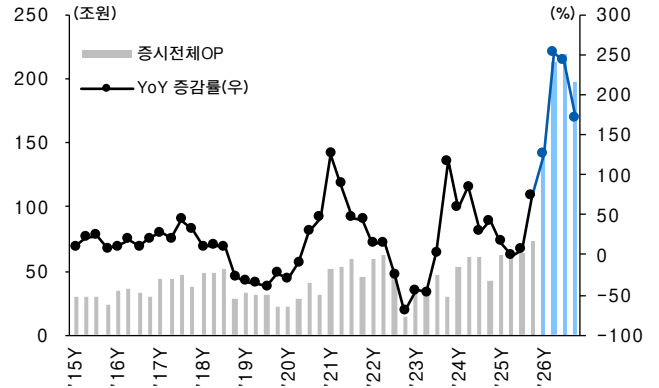
### 주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.5% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.2% 상향조정
- '26년 1분기 실적시즌 이후 이익 변동 트리거의 부재로 추정치 조정을 폭이 크게 감소되었지만, 화학, 증권, 해운 등의 업종은 '26년 연간 영업이익 추정치 상향조정이 지속

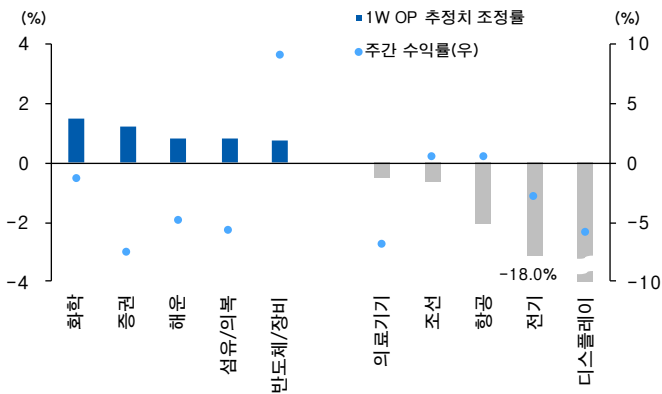
### 증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



### 증시 전체 영업이익 및 증감을 추이



### 26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

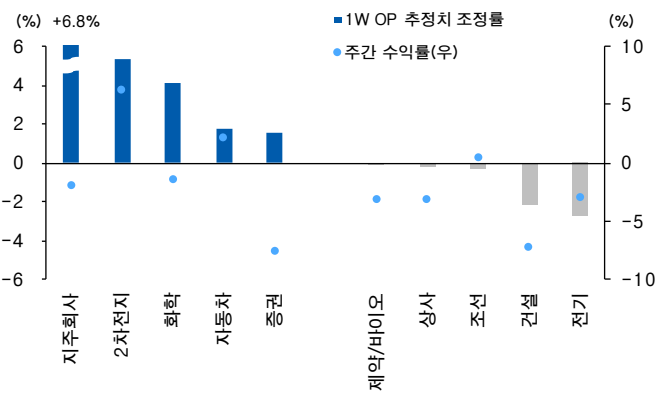


### 26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	42,523	1.5	-1.4	
2	증권	135,430	1.2	-7.7	
3	해운	16,106	0.8	-4.9	
4	섬유/의복	23,107	0.8	-5.8	
5	반도체/장비	6,185,628	0.8	9.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	디스플레이	10,794	-18.0	-5.9	
2	전기	101,367	-3.1	-2.9	
3	항공	5,829	-2.1	0.5	
4	조선	134,147	-0.7	0.5	
5	의료기기	5,719	-0.5	-6.8	

### 26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



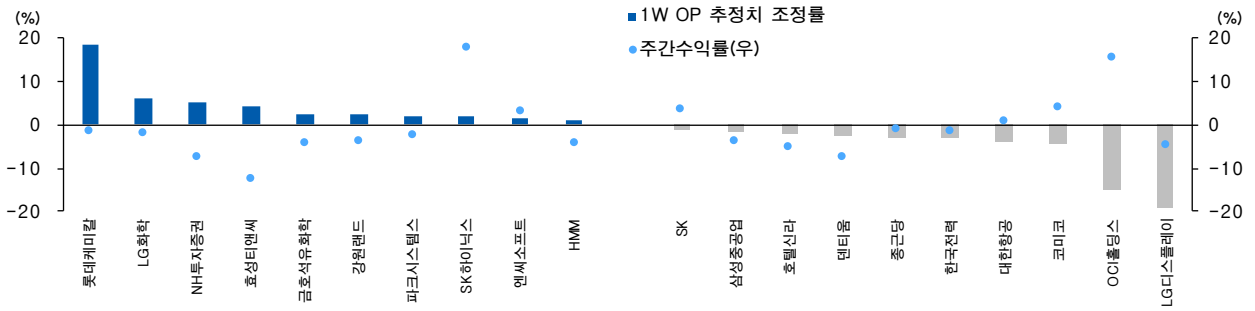
### 26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	지주회사	94,641	6.8	-2.0	
2	2차전지	1,447	5.4	6.3	
3	화학	12,379	4.1	-1.4	
4	자동차	61,454	1.7	2.2	
5	증권	41,148	1.6	-7.7	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	전기	19,703	-2.8	-2.9	
2	건설	9,222	-2.1	-7.3	
3	조선	34,924	-0.3	0.5	
4	상사	4,870	-0.2	-3.2	
5	제약/바이오	13,947	-0.1	-3.2	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주: 유니버스 200 종목 5/27일 추정치 기준(수익률 5/28일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

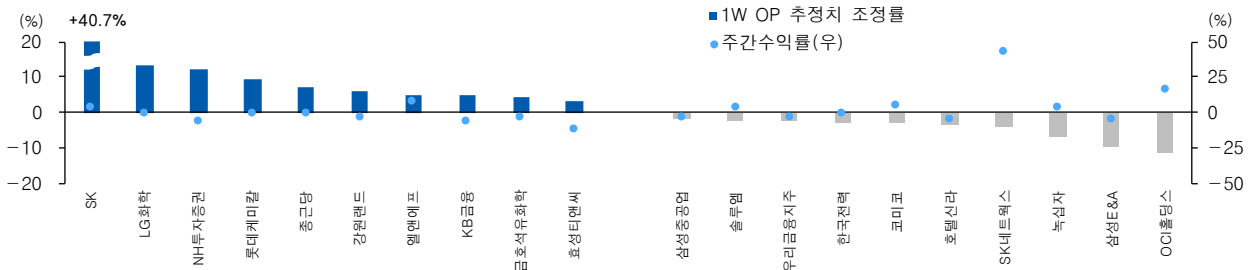


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A011170	롯데케미칼	화학	1,347	18.3	-1.7	1	A034220	LG디스플레이	디스플레이	9,930	-19.2	-4.8
2	A051910	LG화학	화학	16,350	5.9	-1.9	2	A010060	OCI홀딩스	화학	3,290	-15.1	15.7
3	A005940	NH투자증권	증권	21,468	5.3	-7.3	3	A183300	코미코	반도체/장비	1,290	-4.4	3.9
4	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	5,034	4.1	-12.3	4	A003490	대한항공	항공	6,422	-4.0	0.7
5	A011780	금호석유화학	화학	3,845	2.6	-4.2	5	A015760	한국전력	전기	98,712	-3.2	-1.6
6	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,075	2.3	-3.8	6	A185750	종근당	제약/바이오	832	-3.0	-0.9
7	A140860	파크시스템스	전자/부품	583	2.1	-2.6	7	A145720	덴티움	의료기기	862	-2.6	-7.2
8	A000660	SK하이닉스	반도체/장비	2,622,466	1.9	17.9	8	A008770	호텔신라	호텔/레저	1,705	-2.2	-5.1
9	A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	5,115	1.5	3.1	9	A010140	삼성중공업	조선	15,029	-1.5	-3.7
10	A011200	HMM	해운	10,325	1.2	-4.3	10	A034730	SK	지주회사	84,060	-1.3	3.4

'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 2분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

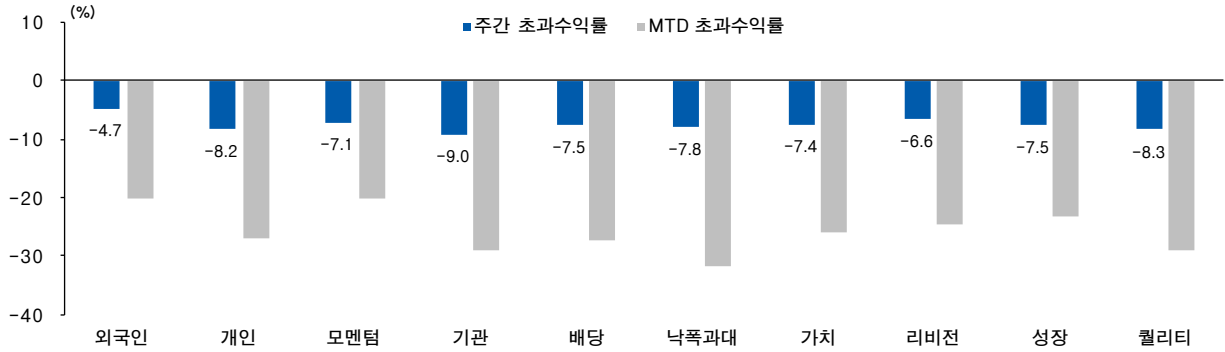
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A034730	SK	지주회사	20,763	40.7	3.4	1	A010060	OCI홀딩스	화학	1,127	-11.7	15.7
2	A051910	LG화학	화학	4,058	13.3	-1.9	2	A028050	삼성E&A	건설	1,984	-9.6	-4.9
3	A005940	NH투자증권	증권	5,937	11.9	-7.3	3	A006280	녹십자	제약/바이오	210	-7.2	2.7
4	A011170	롯데케미칼	화학	1,329	9.2	-1.7	4	A001740	SK네트웍스	상사	248	-4.1	42.6
5	A185750	종근당	제약/바이오	214	7.3	-0.9	5	A008770	호텔신라	호텔/레저	489	-3.4	-5.1
6	A035250	강원랜드	호텔/레저	438	6.2	-3.8	6	A183300	코미코	반도체/장비	330	-2.9	3.9
7	A066970	엘앤에프	2차전지	534	4.8	6.5	7	A015760	한국전력	전기	18,949	-2.9	-1.6
8	A105560	KB금융	은행	25,595	4.7	-6.4	8	A316140	우리금융지주	은행	12,786	-2.6	-4.8
9	A011780	금호석유화학	화학	1,312	4.2	-4.2	9	A248070	솔루션	전자/부품	254	-2.2	2.3
10	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	1,280	3.3	-12.3	10	A010140	삼성중공업	조선	3,954	-1.7	-3.7

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 5/27일 추정치 기준(수익률 5/28일 기준)

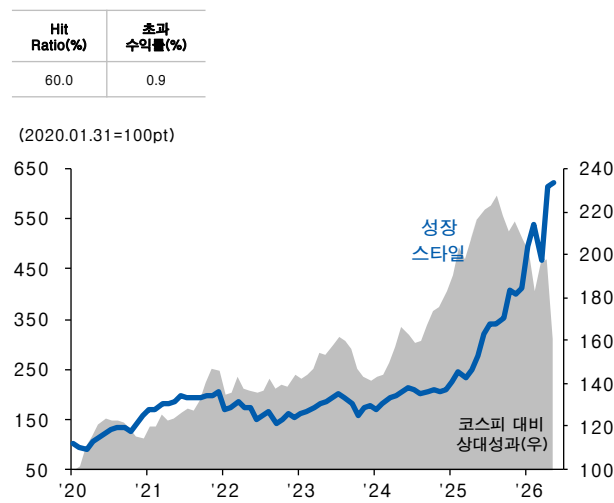
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



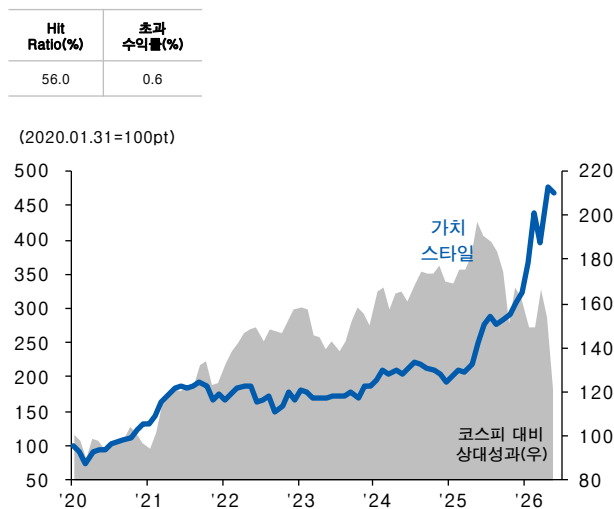
성장 스타일 성과 추이



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	2.4
A353200	대덕전자	9.1	9.6	9.5	28.2	8.9
A267270	HD건설기계	9.0	9.3	9.4	27.7	-6.5
A010130	고려아연	8.1	8.3	7.8	24.3	-4.5
A298020	효성티앤씨	6.1	8.7	9.4	24.2	-12.3
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	2.4
A298040	효성중공업	7.8	8.1	7.7	23.6	-8.8
A010120	LS ELECTRIC	7.7	7.8	8.0	23.5	-12.3
A166090	하나머티리얼즈	8.8	8.9	5.8	23.4	-14.4
A009150	삼성전기	6.8	8.3	7.7	22.8	38.0

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10 (단위: %)

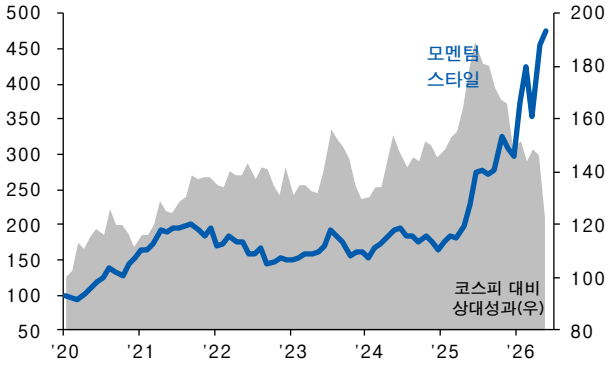
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A108670	LX하우시스	10.0	9.8	9.9	29.7	-11.3
A000370	한화손해보험	9.9	9.7	9.9	29.5	-10.4
A001450	현대해상	9.9	9.5	9.9	29.3	-10.2
A088350	한화생명	9.1	9.9	9.9	28.8	-11.9
A011170	롯데케미칼	10.0	9.6	9.1	28.7	-1.7
A139130	iM금융지주	9.4	9.4	8.9	27.7	-6.1
A015760	한국전력	9.9	9.1	8.6	27.6	-1.6
A000120	CJ대한통운	8.5	9.4	9.5	27.4	-4.6
A097950	CJ제일제당	8.7	9.0	9.8	27.4	-5.1
A024110	기업은행	9.4	9.4	8.3	27.0	-2.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 5/28일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

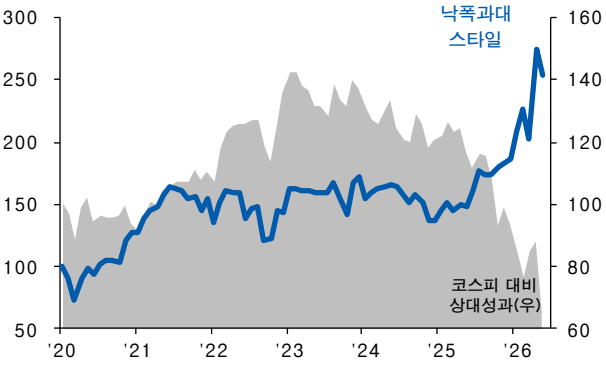
(2020.01.31=100pt)



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		
A047040	대우건설	10.0	10.0	10.0	10.0	39.8	-10.9
A009150	삼성전기	9.8	9.8	9.9	9.8	39.2	38.0
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.9	9.8	9.7	39.1	15.7
A010120	LS ELECTRIC	9.7	9.8	9.8	9.7	38.9	-12.3
A036930	주성엔지니어링	9.9	9.9	9.9	8.8	38.4	-7.1
A001440	대한전선	9.9	9.5	9.6	9.4	38.3	-12.8
A011070	LG이노텍	9.7	9.7	9.3	9.1	37.8	31.3
A353200	대덕전자	8.6	9.2	9.7	9.9	37.4	8.9
A006400	삼성SDI	9.4	9.3	9.0	8.9	36.6	4.5
A006260	LS	9.5	9.6	8.9	8.6	36.6	-12.6

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	-5.7
A293490	카카오게임즈	9.0	9.9	9.8	9.3	38.0	-10.9
A122870	와이지엔터테인먼트	8.4	9.8	9.9	9.4	37.4	-5.1
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	-5.3
A035760	CJ ENM	9.7	9.7	9.6	8.3	37.2	-5.4
A214450	파마리서치	7.3	10.0	10.0	9.0	36.2	-2.6
A207940	삼성바이오로직스	9.4	9.0	9.4	8.2	36.0	-3.0
A462870	시프트업	8.7	7.9	9.1	10.0	35.7	-3.1
A352820	하이브	9.9	9.9	9.5	6.3	35.5	-4.9

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 5/28일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

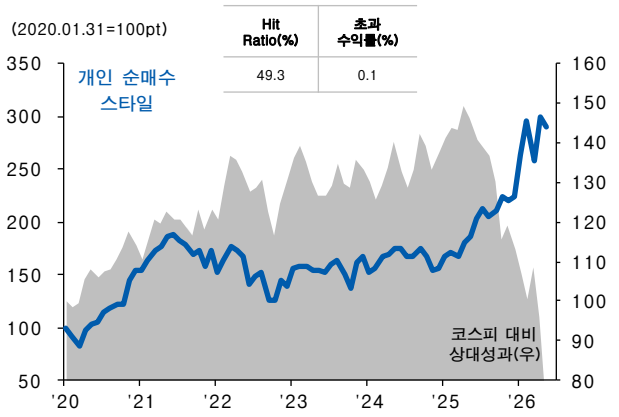
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

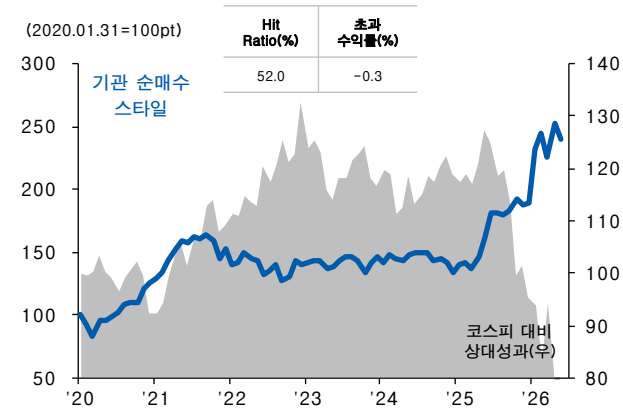


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	-6.3
A214450	파마리서치	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	-2.6
A352820	하이브	10.0	9.8	9.7	9.3	38.8	-4.9
A035420	NAVER	9.4	9.9	9.6	9.9	38.7	1.0
A006360	GS건설	9.9	9.7	9.4	9.2	38.1	-10.4
A122870	와이엔터테인먼트	9.3	9.6	9.9	9.2	37.9	-5.1
A204320	HL만도	8.9	8.9	9.9	10.0	37.6	-2.1
A028050	삼성E&A	9.8	9.8	9.4	8.3	37.2	-4.9
A047810	한국항공우주	9.7	9.5	9.2	8.7	37.0	-0.3
A067160	SOOP	8.6	9.4	8.9	9.7	36.4	-7.0

기관 순매수 스타일 성과 추이

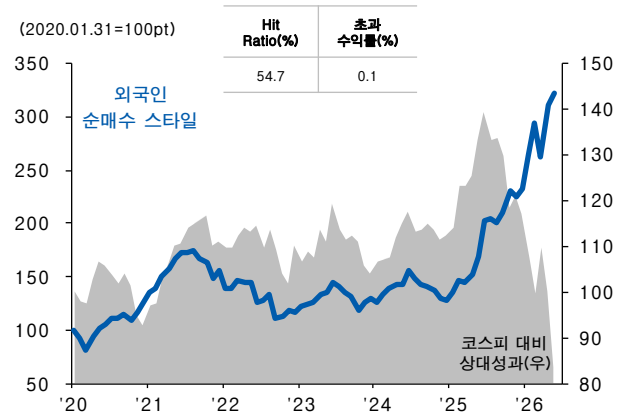


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	-7.1
A021240	코웨이	9.5	9.6	9.2	9.6	37.9	-1.9
A222800	심텍	9.9	9.5	9.2	9.3	37.9	-11.8
A375500	DLI앤씨	10.0	9.8	9.3	8.8	37.8	-6.9
A066970	엘앤에프	9.2	9.7	9.6	8.9	37.4	6.5
A008770	호텔신라	9.9	9.3	8.9	9.4	37.4	-5.1
A298020	효성티앤씨	8.9	9.3	9.7	9.5	37.3	-12.3
A058470	리노공업	8.2	9.4	9.8	9.8	37.0	-6.9
A023530	롯데쇼핑	8.8	9.6	9.5	9.0	36.8	-7.4
A112610	씨에스윈드	9.0	9.8	9.4	8.6	36.8	-8.9

외국인 순매수 스타일 성과 추이



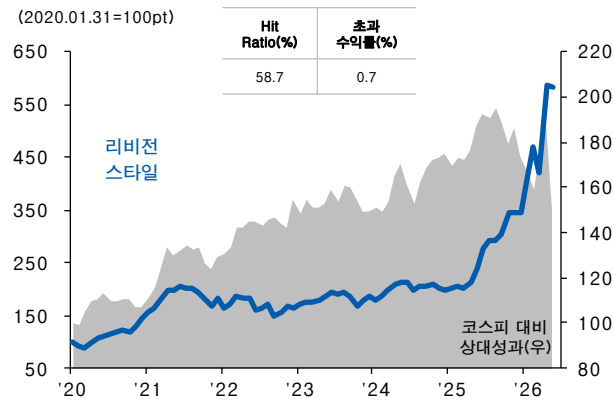
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A278470	에이피알	9.5	10.0	9.9	9.9	39.2	2.4
A403870	HPSP	9.2	9.9	10.0	9.8	38.8	-6.9
A195870	해성디에스	9.6	9.6	9.8	9.6	38.5	8.5
A008770	호텔신라	10.0	9.9	9.4	8.9	38.1	-5.1
A004170	신세계	8.8	9.8	9.7	9.5	37.7	-2.6
A241710	코스메카코리아	9.5	9.2	9.4	9.5	37.5	-6.2
A014680	한솔케미칼	9.6	9.3	8.7	9.6	37.2	-5.5
A001440	대한전선	9.9	9.7	8.6	8.7	36.9	-12.8
A336260	두산퓨얼셀	9.8	8.9	7.8	9.7	36.1	0.3
A011780	금호석유화학	8.5	9.1	9.1	9.2	35.8	-4.2

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 5/28일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

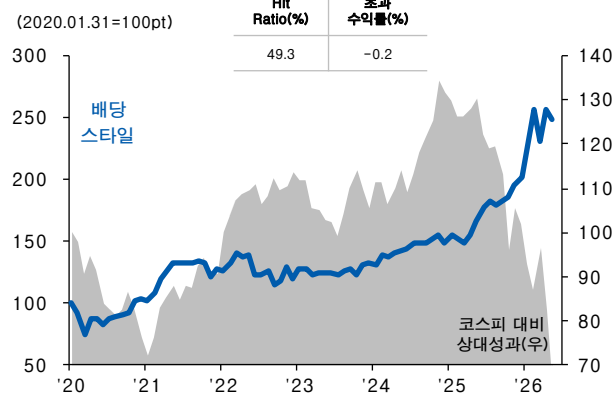


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.3	9.0	27.7	2.4
A010950	S-Oil	9.6	9.5	7.4	26.5	-1.8
A263750	풀어비스	9.2	9.1	7.6	25.9	-4.7
A006650	대한유화	9.4	9.6	6.4	25.4	-4.5
A278470	에이피알	9.4	8.6	7.3	25.3	2.4
A166090	하나머티리얼즈	9.3	8.7	6.2	24.1	-14.4
A078930	GS	8.5	9.1	6.2	23.9	-3.6
A036570	NC	8.7	8.3	6.6	23.6	3.1
A016360	삼성증권	6.2	8.9	8.4	23.5	-7.0
A000660	SK하이닉스	7.8	7.9	7.7	23.4	17.9

배당 스타일 성과 추이

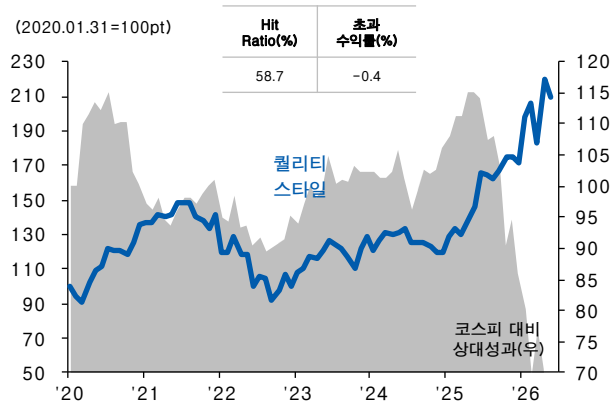


배당 스코어 Top 10

(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	-3.8
A214320	이노션	7.9	9.7	9.2	9.9	36.7	-3.6
A005940	NH투자증권	7.5	9.5	9.8	9.7	36.6	-7.3
A035250	강원랜드	8.5	9.9	8.3	9.8	36.4	-3.8
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.2	9.3	36.0	42.6
A001120	LX인터내셔널	7.8	9.1	9.6	8.9	35.5	-7.1
A017670	SK텔레콤	9.3	9.0	9.1	8.1	35.4	-5.7
A032640	LG유플러스	8.1	9.2	8.9	9.1	35.3	-4.4
A000080	하이트진로	9.7	8.4	7.9	8.8	34.7	-2.7
A016360	삼성증권	6.2	9.3	9.5	9.7	34.6	-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	9.5	9.8	9.6	9.3	38.2	-6.9
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	-6.9
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	-10.8
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.4	17.9
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.5	36.9	-3.1
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.5	-5.0
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	-4.4
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.2	35.8	-2.6
A207940	삼성바이오로직스	7.7	9.8	9.8	8.5	35.7	-3.0
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.8	35.2	-7.9

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 5/28일 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: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.