YUANTA

# Quant Weekly Evaluation Report

## 2월 1주차 순환매 수혜 전략 리밸런싱

**신현용** Quant Analyst
02 3770 3634
hyunyong.shin@yuantakorea.com

유안타증권 Yuanta Securities (Korea)

# CONTENTS


## Ⅰ 주간 리밸런싱

순환매 수혜 전략 리밸런싱

## 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

## 순환매 수혜 전략 스크리닝 (참고 자료: 대형주 코어...근데 순환매·배당을 곁들인)

1) 대형주 쏠림이 지속되는 상황 속 급등 종목 출회 비율이 급격히 증가하며 순환매에 대한 갈증이 심화되는 환경

2) 수급 측면에서 순환매를 확인하기 위해 HHI(Herfindahl-Hirschman Index) 지수에 수급 데이터를 접목. 결과적으로 업종 및 종목 측면에서 수급의 분산 현상이 확인

3) '15년 이후 KOSPI 지수의 상승과 수급 분산이 동반되는 국면 속 HHI 지수 분위별 주간 성과를 분석. 결과적으로 매수과열(1분위) 혹은 시장 소외(2분위) 종목의 경우 차주 순환매 수혜가 나타날 가능성이 가장 낮은 것으로 확인. 시장의 관심이 적당한 온도로 유지되는 종목(2~4분위)에 주목

### [2월 1주차] 1) 주간 누적 기관 및 외국인 순매수 2~4분위 종목 중 2) 주간 이익 추정치 조정률 상위 20% 종목 스크리닝

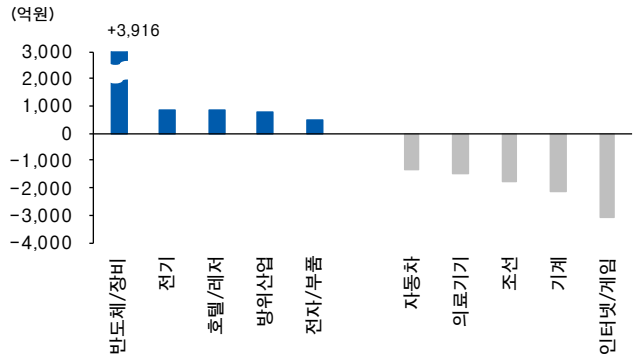
| 종목명 | 업종 | 시가총액 (억원) | 12MF 영업이익 추정치(억원, %) | | | 12MF 순이익 추정치(억원,%) | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 1/28일 기준 | 2/4일 기준 | 조정률 | 1/28일 기준 | 2/4일 기준 | 조정률 |
| 큐로셀 | 건강관리 | 6,639 | 305 | 353 | 16.0 | 289 | 320 | 11.0 |
| 서부T&D | 호텔,레저서비스 | 9,687 | 785 | 856 | 9.0 | 514 | 589 | 14.7 |
| 세아홀딩스 | 철강 | 6,996 | 2,258 | 2,363 | 4.6 | 1,363 | 1,442 | 5.7 |
| 후성 | 화학 | 8,291 | 436 | 456 | 4.4 | 265 | 281 | 6.0 |
| 드림텍 | IT하드웨어 | 5,057 | 609 | 664 | 9.0 | 511 | 533 | 4.2 |
| SK케미칼 | 화학 | 11,780 | 1,382 | 1,446 | 4.6 | 1,146 | 1,198 | 4.6 |
| 에스원 | 상사,자본재 | 29,069 | 2,421 | 2,557 | 5.6 | 1,924 | 1,992 | 3.5 |
| 태웅 | 에너지 | 6,212 | 351 | 365 | 4.1 | 311 | 326 | 4.6 |
| HS효성첨단소재 | 화학 | 9,833 | 2,086 | 2,151 | 3.1 | 921 | 948 | 2.9 |
| 한샘 | 건설,건축관련 | 10,696 | 362 | 371 | 2.3 | 295 | 303 | 2.6 |
| 켐트로닉스 | IT하드웨어 | 5,416 | 619 | 632 | 2.1 | 391 | 402 | 2.8 |
| 보령 | 건강관리 | 7,884 | 1,098 | 1,119 | 2.0 | 395 | 407 | 2.9 |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터

## 주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 -7.6조원 순매도, 기관은 약 -8,219억원 순매도를 기록
- 두 수급 주체 모두 인터넷/게임, 의료기기, 자동차 등의 업종에 순매도 기록. 기관은 반도체/장비 순매수 기록한 반면 외국인의 매도세로 외국인+기관 수급 기준 약 -7.8조원의 순매도 기록

### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

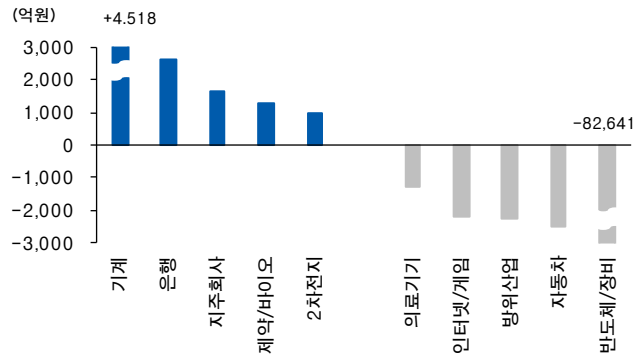



### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

| 상위 | 업종 | 1W 누적 | 1M 누적 | 3M 누적 | 5W 순매수 추이 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 반도체/장비 | 3,916 | 20,628 | 61,094 | |
| 2 | 전기 | 876 | 823 | -845 | |
| 3 | 호텔/레저 | 844 | 647 | 1,798 | |
| 4 | 방위산업 | 749 | 5,769 | 11,397 | |
| 5 | 전자/부품 | 512 | -596 | -1,535 | |
| 하위 | 업종 | 1W 누적 | 1M 누적 | 3M 누적 | 5W 순매수 추이 |
| 1 | 인터넷/게임 | -3,095 | -1,517 | -5,622 | |
| 2 | 기계 | -2,142 | -1,130 | -6,515 | |
| 3 | 조선 | -1,744 | -7,747 | -10,218 | |
| 4 | 의료기기 | -1,506 | 2,097 | 2,560 | |
| 5 | 자동차 | -1,340 | -4,789 | 1,106 | |

### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

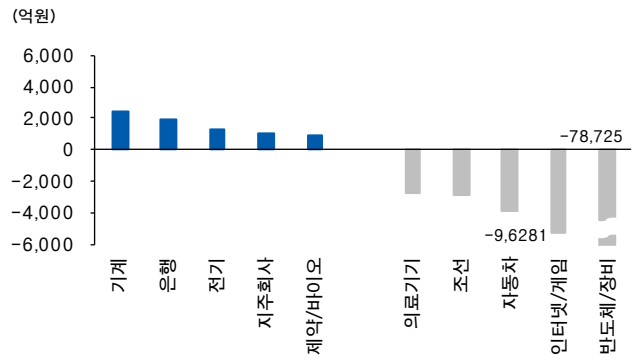



### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

| 상위 | 업종 | 1W 누적 | 1M 누적 | 3M 누적 | 5W 순매수 추이 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 기계 | 4,518 | 8,837 | 13,527 | |
| 2 | 은행 | 2,654 | 9,651 | 4,513 | |
| 3 | 지주회사 | 1,638 | 10,861 | 15,796 | |
| 4 | 제약/바이오 | 1,304 | 5,118 | 15,068 | |
| 5 | 2차전지 | 1,012 | 4,946 | 3,265 | |
| 하위 | 업종 | 1W 누적 | 1M 누적 | 3M 누적 | 5W 순매수 추이 |
| 1 | 반도체/장비 | -82,641 | -146,762 | -164,788 | |
| 2 | 자동차 | -2,504 | -53,616 | -44,232 | |
| 3 | 방위산업 | -2,248 | -421 | 1,314 | |
| 4 | 인터넷/게임 | -2,170 | 7,390 | 11,053 | |
| 5 | 의료기기 | -1,290 | -4,728 | -6,129 | |

### 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 | 기계 | 2,377 | 7,707 | 7,012 | |
| 2 | 은행 | 1,872 | 7,775 | 9,940 | |
| 3 | 전기 | 1,280 | 3,168 | 4,370 | |
| 4 | 지주회사 | 1,078 | 8,548 | 11,460 | |
| 5 | 제약/바이오 | 950 | 2,258 | 15,899 | |
| 하위 | 업종 | 1W 누적 | 1M 누적 | 3M 누적 | 5W 순매수 추이 |
| 1 | 반도체/장비 | -78,725 | -126,134 | -103,694 | |
| 2 | 인터넷/게임 | -5,265 | 5,874 | 5,430 | |
| 3 | 자동차 | -3,843 | -58,405 | -43,126 | |
| 4 | 조선 | -2,900 | 8,666 | 5,537 | |
| 5 | 의료기기 | -2,797 | -2,631 | -3,569 | |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 2/5일 기준

업종별 | 종목별

## 기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

| 종목 코드 | 종목 | 업종 | 시가총액 | 1W 누적 순매수 대금 | 순매수 강도 |
|---|---|---|---|---|---|
| A034230 | 파라다이스 | 호텔/레저 | 19,174 | 393 | 0.55 |
| A032350 | 롯데관광개발 | 호텔/레저 | 20,959 | 335 | 0.42 |
| A403870 | HPSP | 반도체/장비 | 37,884 | 568 | 0.37 |
| A023530 | 롯데쇼핑 | 소매/유통 | 27,299 | 359 | 0.35 |
| A020150 | 롯데에너지머티리얼즈 | 전자/부품 | 25,581 | 247 | 0.27 |
| A298020 | 효성티앤씨 | 섬유/의복 | 16,748 | 182 | 0.27 |
| A058470 | 리노공업 | 반도체/장비 | 72,935 | 754 | 0.26 |
| A042700 | 한미반도체 | 반도체/장비 | 184,429 | 1,650 | 0.22 |
| A267270 | HD현대건설기계 | 기계 | 60,879 | 523 | 0.22 |
| A009830 | 한화솔루션 | 화학 | 62,569 | 463 | 0.21 |

## 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

| 종목 코드 | 종목 | 업종 | 시가총액 | 1W 누적 순매수 대금 | 순매수 강도 |
|---|---|---|---|---|---|
| A376300 | 디어유 | 미디어/엔터 | 10,291 | 184 | 0.50 |
| A001440 | 대한전선 | 기계 | 59,290 | 917 | 0.40 |
| A241710 | 코스메카코리아 | 화장품 | 10,595 | 144 | 0.34 |
| A183300 | 코미코 | 반도체/장비 | 11,549 | 153 | 0.32 |
| A004370 | 농심 | 음식료 | 25,912 | 277 | 0.27 |
| A112610 | 씨에스윈드 | 기계 | 18,134 | 182 | 0.26 |
| A237690 | 에스티팜 | 제약/바이오 | 31,221 | 294 | 0.23 |
| A006360 | GS건설 | 건설 | 16,680 | 131 | 0.20 |
| A008770 | 호텔신라 | 호텔/레저 | 19,663 | 143 | 0.19 |
| A204320 | HL만도 | 자동차부품 | 28,879 | 218 | 0.19 |

## 기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

| 종목 코드 | 종목 | 업종 | 시가총액 | 1W 누적 순매수 대금 | 순매수 강도 |
|---|---|---|---|---|---|
| A376300 | 디어유 | 미디어/엔터 | 10,291 | 221 | 0.6 |
| A001440 | 대한전선 | 기계 | 59,290 | 999 | 0.4 |
| A020150 | 롯데에너지머티리얼즈 | 전자/부품 | 25,581 | 356 | 0.4 |
| A008770 | 호텔신라 | 호텔/레저 | 19,663 | 289 | 0.4 |
| A009830 | 한화솔루션 | 화학 | 62,569 | 845 | 0.4 |
| A034230 | 파라다이스 | 호텔/레저 | 19,174 | 241 | 0.3 |
| A112610 | 씨에스윈드 | 기계 | 18,134 | 241 | 0.3 |
| A023530 | 롯데쇼핑 | 소매/유통 | 27,299 | 313 | 0.3 |
| A267270 | HD현대건설기계 | 기계 | 60,879 | 710 | 0.3 |
| A006360 | GS건설 | 건설 | 16,680 | 162 | 0.2 |

## 기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

| 종목 코드 | 종목 | 업종 | 시가총액 | 1W 누적 | 1M 누적 | 3M 누적 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| A007660 | 이수페타시스 | 전자/부품 | 88,091 | 325.1 | -1,289 | -3,187 |
| A000270 | 기아 | 자동차 | 609,825 | 446.8 | -837 | 3,495 |
| A204320 | HL만도 | 자동차부품 | 28,879 | 247.9 | -642 | -2,832 |
| A267270 | HD현대건설기계 | 기계 | 60,879 | 709.5 | -47 | -208 |
| A001450 | 현대해상 | 손해보험 | 26,954 | 103.3 | -563 | -301 |
| A011210 | 현대위아 | 자동차부품 | 22,654 | 41.3 | -602 | -146 |
| A000100 | 유한양행 | 제약/바이오 | 85,542 | 124.6 | -409 | 121 |
| A088350 | 한화생명 | 생명보험 | 32,136 | 37.5 | -390 | -400 |
| A006360 | GS건설 | 건설 | 16,680 | 161.5 | -132 | 12 |
| A004370 | 농심 | 음식료 | 25,912 | 238.5 | -1 | 634 |

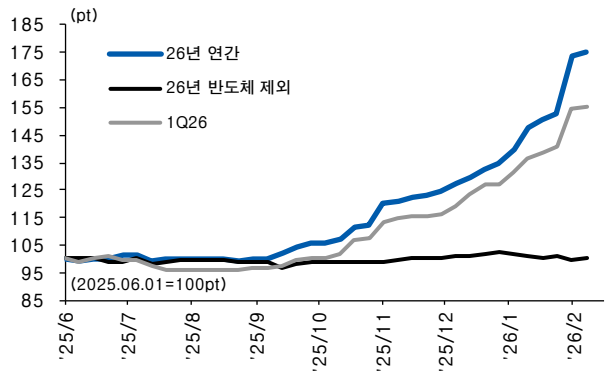
자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 2/5일 기준

업종별 종목별

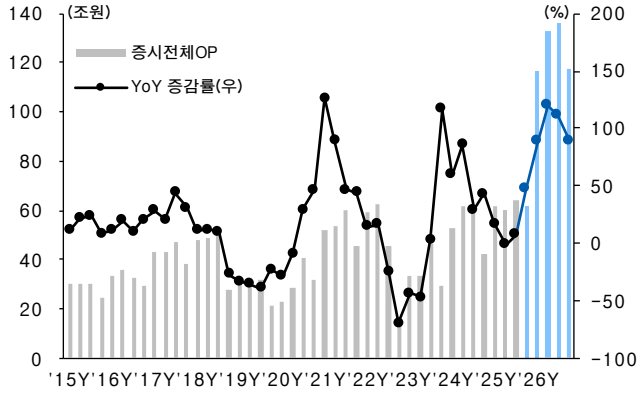
## 주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 +0.7% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.8% 상향조정. '26년 분기 전반의 상향조정 지속되며 이익 트렌드(YoY 증감률)이 더욱 가파른 우상향을 그리는 모습
- 전자/부품 업종이 '26년 연간, '26년 1분기 이익 추정치 모두 높은 상향 조정률이 나타난 반면, 화학, 호텔/레저, SW/SI 업종은 하위에 동시 스크리닝

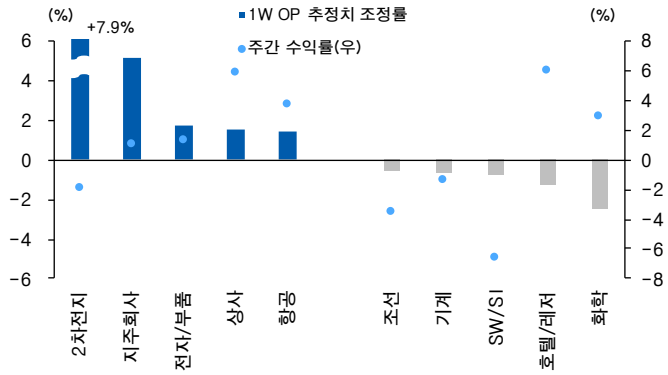
### 증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이




### 증시 전체 영업이익 및 증감률 추이




### 26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

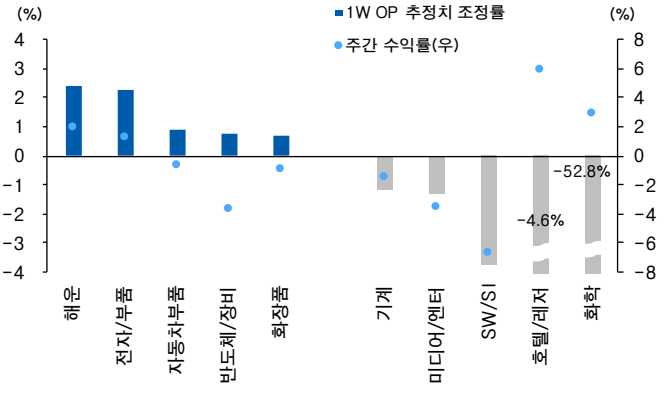



### 26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

| 상위 | 업종 | OP 추정치 | 1W 조정률 | 1W 수익률 | 5W 추정치 추이 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2차전지 | 8,954 | 7.9 | -1.9 | |
| 2 | 지주회사 | 331,404 | 5.2 | 1.1 | |
| 3 | 전자/부품 | 63,346 | 1.8 | 1.3 | |
| 4 | 상사 | 18,016 | 1.6 | 5.8 | |
| 5 | 항공 | 15,271 | 1.4 | 3.7 | |
| **하위** | **업종** | **OP 추정치** | **1W 조정률** | **1W 수익률** | **5W 추정치 추이** |
| 1 | 화학 | 32,269 | -2.5 | 2.9 | |
| 2 | 호텔/레저 | 9,078 | -1.3 | 6.0 | |
| 3 | SW/SI | 16,684 | -0.8 | -6.6 | |
| 4 | 기계 | 74,354 | -0.6 | -1.4 | |
| 5 | 조선 | 129,703 | -0.5 | -3.5 | |

### 26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위




### 26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

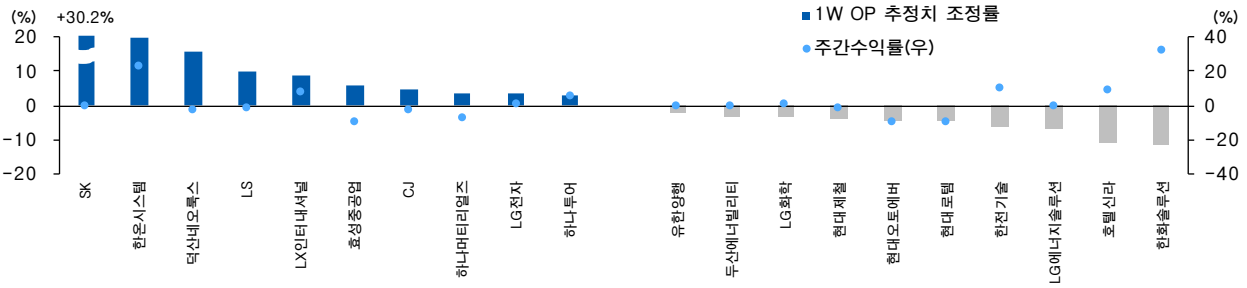
(단위:억원,%)

| 상위 | 업종 | OP 추정치 | 1W 조정률 | 1W 수익률 | 5W 추정치 추이 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 해운 | 3,445 | 2.4 | 2.1 | |
| 2 | 전자/부품 | 19,582 | 2.3 | 1.3 | |
| 3 | 자동차부품 | 17,478 | 0.9 | -0.6 | |
| 4 | 반도체/장비 | 613,113 | 0.7 | -3.6 | |
| 5 | 화장품 | 4,930 | 0.7 | -0.8 | |
| **하위** | **업종** | **OP 추정치** | **1W 조정률** | **1W 수익률** | **5W 추정치 추이** |
| 1 | 화학 | 147 | -52.8 | 2.9 | |
| 2 | 호텔/레저 | 1,920 | -4.6 | 6.0 | |
| 3 | SW/SI | 3,643 | -3.8 | -6.6 | |
| 4 | 미디어/엔터 | 3,151 | -1.3 | -3.5 | |
| 5 | 기계 | 14,887 | -1.1 | -1.4 | |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 2/4일 기준(수익률 2/5일 기준)

업종별 | 종목별

## '26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



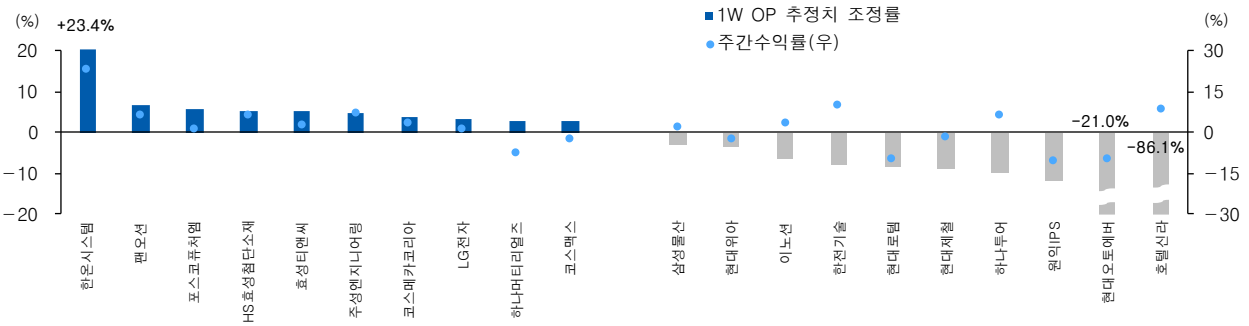

## '26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

| 상위 | 종목코드 | 종목 | 업종 | OP 추정치 | 1W 조정률 | 1W 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | A034730 | SK | 지주회사 | 58,512 | 30.2 | -0.6 |
| 2 | A018880 | 한온시스템 | 자동차부품 | 4,147 | 19.9 | 23.1 |
| 3 | A213420 | 덕산네오룩스 | 디스플레이 | 994 | 15.7 | -2.3 |
| 4 | A006260 | LS | 지주회사 | 13,325 | 9.8 | -2.0 |
| 5 | A001120 | LX인터내셔널 | 상사 | 3,540 | 8.6 | 8.1 |
| 6 | A298040 | 효성중공업 | 기계 | 10,456 | 6.1 | -10.3 |
| 7 | A001040 | CJ | 지주회사 | 29,345 | 4.7 | -3.2 |
| 8 | A166090 | 하나머티리얼즈 | 반도체/장비 | 783 | 3.5 | -7.9 |
| 9 | A066570 | LG전자 | 전자/부품 | 34,488 | 3.5 | 1.2 |
| 10 | A039130 | 하나투어 | 호텔/레저 | 688 | 3.2 | 5.7 |

| 하위 | 종목코드 | 종목 | 업종 | OP 추정치 | 1W 조정률 | 1W 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | A009830 | 한화솔루션 | 화학 | 4,213 | -11.5 | 31.6 |
| 2 | A008770 | 호텔신라 | 호텔/레저 | 1,227 | -11.3 | 8.4 |
| 3 | A373220 | LG에너지솔루션 | 2차전지 | 13,043 | -6.9 | -0.8 |
| 4 | A052690 | 한전기술 | 전기 | 699 | -6.4 | 9.7 |
| 5 | A064350 | 현대로템 | 기계 | 12,449 | -4.8 | -10.2 |
| 6 | A307950 | 현대오토에버 | SW/SI | 3,099 | -4.7 | -9.9 |
| 7 | A004020 | 현대제철 | 철강 | 6,275 | -4.1 | -1.8 |
| 8 | A051910 | LG화학 | 화학 | 13,523 | -3.6 | 0.5 |
| 9 | A034020 | 두산에너빌리티 | 기계 | 12,880 | -3.3 | 0.0 |
| 10 | A000100 | 유한양행 | 제약/바이오 | 1,587 | -2.4 | -0.6 |

## '26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위




## '26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

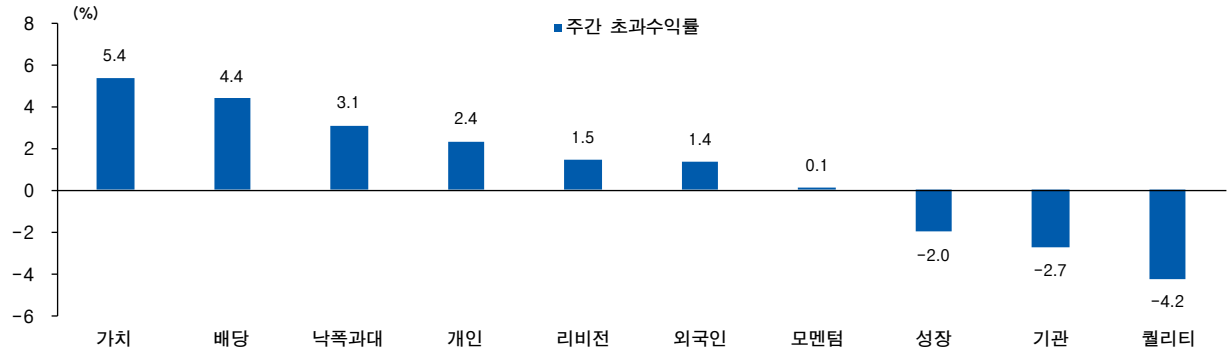
| 상위 | 종목코드 | 종목 | 업종 | OP 추정치 | 1W 조정률 | 1W 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | A018880 | 한온시스템 | 자동차부품 | 916 | 23.4 | 23.1 |
| 2 | A028670 | 팬오션 | 해운 | 1,290 | 6.6 | 6.3 |
| 3 | A003670 | 포스코퓨처엠 | 2차전지 | 60 | 5.5 | 0.9 |
| 4 | A298050 | HS효성첨단소재 | 화학 | 432 | 5.4 | 6.1 |
| 5 | A298020 | 효성티앤씨 | 섬유/의복 | 776 | 5.0 | 2.5 |
| 6 | A036930 | 주성엔지니어링 | 반도체/장비 | 98 | 4.8 | 6.8 |
| 7 | A241710 | 코스메카코리아 | 화장품 | 215 | 3.5 | 2.9 |
| 8 | A066570 | LG전자 | 전자/부품 | 13,679 | 3.2 | 1.2 |
| 9 | A166090 | 하나머티리얼즈 | 반도체/장비 | 195 | 2.9 | -7.9 |
| 10 | A192820 | 코스맥스 | 화장품 | 620 | 2.8 | -2.8 |

| 하위 | 종목코드 | 종목 | 업종 | OP 추정치 | 1W 조정률 | 1W 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | A008770 | 호텔신라 | 호텔/레저 | 12 | -86.1 | 8.4 |
| 2 | A307950 | 현대오토에버 | SW/SI | 528 | -21.0 | -9.9 |
| 3 | A240810 | 원익IPS | 반도체/장비 | 396 | -12.0 | -10.9 |
| 4 | A039130 | 하나투어 | 호텔/레저 | 180 | -10.0 | 5.7 |
| 5 | A004020 | 현대제철 | 철강 | 1,273 | -9.2 | -1.8 |
| 6 | A064350 | 현대로템 | 기계 | 2,276 | -8.6 | -10.2 |
| 7 | A052690 | 한전기술 | 전기 | 90 | -7.9 | 9.7 |
| 8 | A214320 | 이노션 | 미디어/엔터 | 335 | -6.4 | 3.1 |
| 9 | A011210 | 현대위아 | 자동차부품 | 542 | -3.3 | -2.8 |
| 10 | A028260 | 삼성물산 | 지주회사 | 9,056 | -3.3 | 1.5 |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 2/4일 기준(수익률 2/5일 기준)

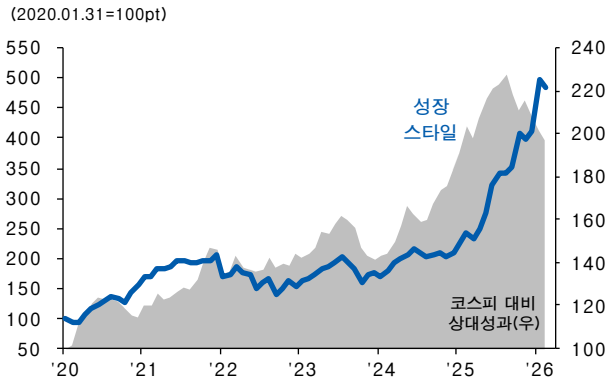
업종별 종목별

## 주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률




## 성장 스타일 성과 추이

| Hit Ratio(%) | 초과 수익률(%) |
|---|---|
| 61.1 | 1.1 |



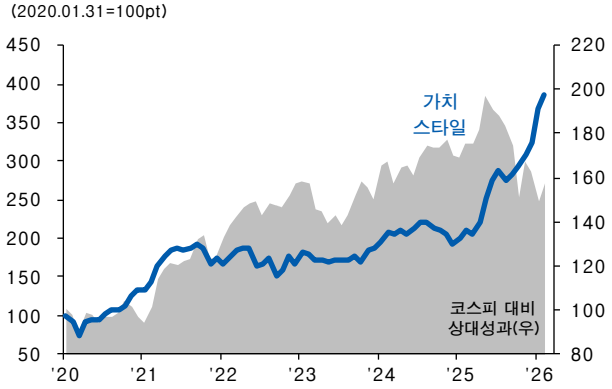

## 성장 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | 성장 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 매출 | 영업이익 | 순이익 | | |
| A005930 | 삼성전자 | 8.4 | 9.7 | 9.6 | 27.7 | 0.2 |
| A353200 | 대덕전자 | 7.3 | 9.7 | 9.7 | 26.7 | -7.2 |
| A068270 | 셀트리온 | 8.8 | 8.2 | 7.8 | 24.8 | 3.7 |
| A329180 | HD현대중공업 | 9.2 | 9.2 | 5.9 | 24.3 | -4.0 |
| A010120 | LS ELECTRIC | 8.1 | 7.7 | 8.0 | 23.8 | 10.6 |
| A195870 | 해성디에스 | 6.4 | 8.3 | 8.1 | 22.8 | -4.1 |
| A267270 | HD건설기계 | 9.9 | 6.4 | 6.5 | 22.8 | 19.2 |
| A000660 | SK하이닉스 | 9.8 | 6.4 | 6.3 | 22.5 | -6.6 |
| A071970 | HD현대마린엔진 | 9.3 | 9.2 | 3.9 | 22.4 | -6.0 |
| A278470 | 에이피알 | 9.5 | 8.1 | 4.8 | 22.4 | 3.1 |

## 가치 스타일 성과 추이

| Hit Ratio(%) | 초과 수익률(%) |
|---|---|
| 55.6 | 0.6 |




## 가치 스코어 Top 10

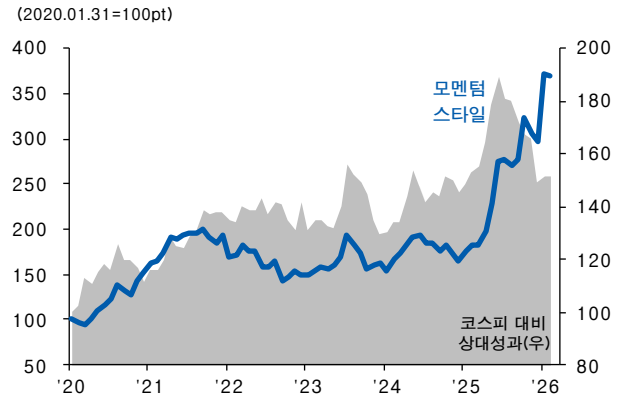
(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | 가치 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | PER | PBR | PSR | | |
| A088350 | 한화생명 | 9.7 | 9.9 | 9.9 | 29.5 | 6.5 |
| A000370 | 한화손해보험 | 9.9 | 9.7 | 9.8 | 29.4 | 5.5 |
| A036460 | 한국가스공사 | 9.7 | 9.7 | 9.8 | 29.2 | 3.2 |
| A001450 | 현대해상 | 9.9 | 9.4 | 9.8 | 29.1 | 7.1 |
| A011170 | 롯데케미칼 | 10.0 | 9.7 | 9.3 | 29.1 | -8.6 |
| A108670 | LX하우시스 | 8.8 | 9.6 | 9.9 | 28.4 | 2.4 |
| A023530 | 롯데쇼핑 | 8.6 | 10.0 | 9.4 | 28.0 | 14.4 |
| A139480 | 이마트 | 8.2 | 9.8 | 10.0 | 28.0 | 13.6 |
| A139130 | iM금융지주 | 9.6 | 9.4 | 9.0 | 28.0 | 7.8 |
| A375500 | DL이앤씨 | 9.5 | 9.5 | 8.6 | 27.6 | 3.2 |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/5일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

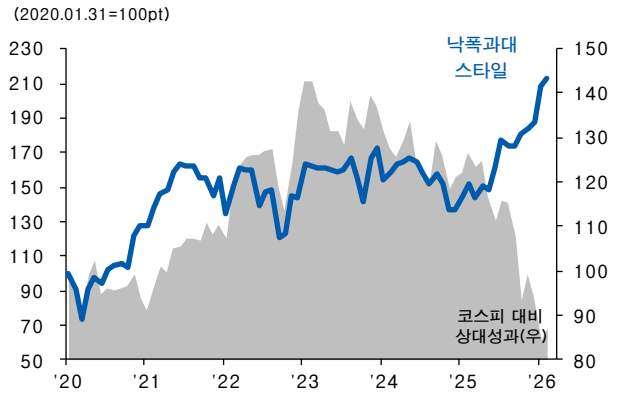
## 모멘텀 스타일 성과 추이

| Hit Ratio(%) | 초과 수익률(%) |
|---|---|
| 47.2 | 0.6 |




## 낙폭과대 스타일 성과 추이

| Hit Ratio(%) | 초과 수익률(%) |
|---|---|
| 45.8 | -0.1 |




## 모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | | 모멘텀 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 1M | 3M | 6M | 12M | | |
| A240810 | 원익IPS | 9.7 | 9.7 | 10.0 | 9.8 | 39.1 | -9.8 |
| A006800 | 미래에셋증권 | 10.0 | 9.4 | 9.4 | 9.9 | 38.6 | 17.8 |
| A001430 | 세아베스틸지주 | 9.1 | 9.9 | 9.6 | 9.6 | 38.1 | 12.1 |
| A307950 | 현대오토에버 | 8.7 | 10.0 | 9.9 | 9.4 | 37.9 | -9.9 |
| A058470 | 리노공업 | 9.9 | 9.8 | 9.5 | 8.5 | 37.6 | -9.5 |
| A000660 | SK하이닉스 | 8.8 | 9.3 | 9.9 | 9.7 | 37.6 | -6.6 |
| A005380 | 현대차 | 9.8 | 9.9 | 9.4 | 8.4 | 37.4 | -2.1 |
| A166090 | 하나머티리얼즈 | 9.6 | 9.3 | 9.7 | 8.5 | 37.0 | -7.5 |
| A039490 | 키움증권 | 9.5 | 8.8 | 9.2 | 9.4 | 36.9 | -2.4 |
| A353200 | 대덕전자 | 8.4 | 9.5 | 9.8 | 9.1 | 36.8 | -7.2 |

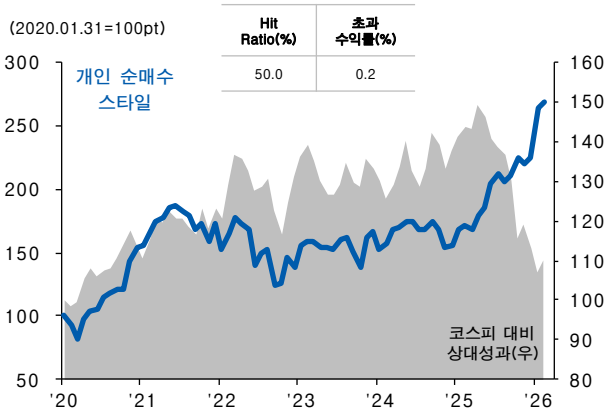
## 낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | | 낙폭 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 1M | 3M | 6M | 12M | | |
| A462870 | 시프트업 | 8.8 | 9.1 | 9.3 | 10.0 | 37.1 | -4.3 |
| A272450 | 진에어 | 8.9 | 8.4 | 9.8 | 9.9 | 37.0 | 3.5 |
| A248070 | 솔루엠 | 9.4 | 9.4 | 8.3 | 9.5 | 36.5 | 2.2 |
| A145720 | 덴티움 | 7.2 | 9.6 | 9.9 | 9.8 | 36.5 | 1.1 |
| A051900 | LG생활건강 | 8.0 | 9.0 | 9.5 | 9.5 | 36.0 | 1.6 |
| A089590 | 제주항공 | 8.4 | 8.2 | 9.6 | 9.9 | 35.9 | 5.4 |
| A000080 | 하이트진로 | 9.3 | 8.5 | 9.0 | 8.9 | 35.5 | 2.0 |
| A039130 | 하나투어 | 9.4 | 7.7 | 9.0 | 9.4 | 35.5 | 5.7 |
| A259960 | 크래프톤 | 7.4 | 8.4 | 9.8 | 9.7 | 35.3 | -6.2 |
| A112610 | 씨에스윈드 | 9.0 | 8.9 | 8.7 | 8.6 | 35.2 | 6.2 |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/5일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

## 개인 순매수 스타일 성과 추이

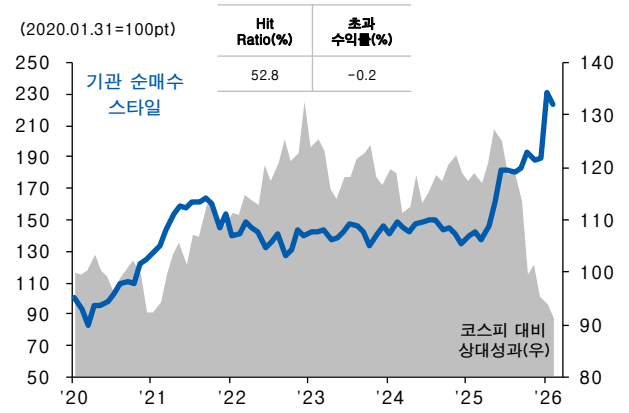



## 개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | | 개인 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 1M | 60D | 120D | 52W | | |
| A204320 | HL만도 | 10.0 | 10.0 | 9.9 | 9.9 | 39.7 | -3.5 |
| A161890 | 한국콜마 | 9.1 | 9.7 | 10.0 | 9.9 | 38.5 | -1.8 |
| A086280 | 현대글로비스 | 9.9 | 9.8 | 9.4 | 9.1 | 38.1 | -0.3 |
| A005380 | 현대차 | 9.9 | 9.7 | 9.2 | 9.3 | 38.1 | -2.1 |
| A000080 | 하이트진로 | 9.1 | 9.2 | 9.7 | 9.5 | 37.5 | 2.0 |
| A035900 | JYP Ent. | 7.2 | 9.9 | 9.8 | 9.8 | 36.6 | -5.2 |
| A006360 | GS건설 | 9.7 | 8.6 | 8.9 | 9.0 | 36.1 | 4.0 |
| A214450 | 파마리서치 | 9.5 | 9.8 | 9.4 | 7.5 | 36.0 | -30.0 |
| A097950 | CJ제일제당 | 6.4 | 9.6 | 9.9 | 10.0 | 35.8 | 3.5 |
| A018880 | 한온시스템 | 9.4 | 9.5 | 8.2 | 8.5 | 35.6 | 21.7 |

## 기관 순매수 스타일 성과 추이

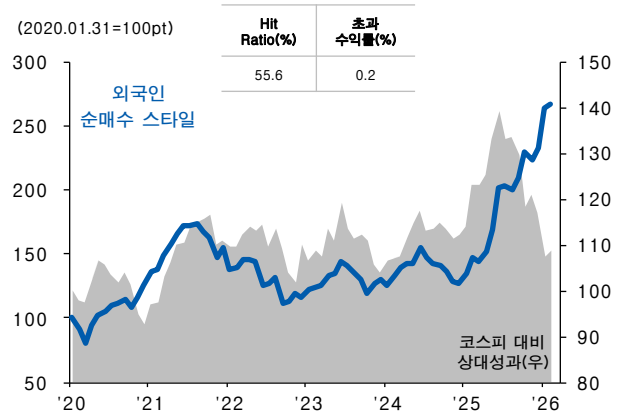



## 기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | | 기관 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 1M | 3M | 6M | 12M | | |
| A240810 | 원익IPS | 9.8 | 9.6 | 10.0 | 9.9 | 39.2 | -9.8 |
| A237690 | 에스티팜 | 9.8 | 9.9 | 9.7 | 9.8 | 39.2 | -5.4 |
| A403870 | HPSP | 9.9 | 9.7 | 9.8 | 9.8 | 39.1 | -2.2 |
| A166090 | 하나머티리얼즈 | 9.4 | 9.9 | 9.9 | 9.7 | 38.8 | -7.5 |
| A195870 | 해성디에스 | 8.6 | 9.8 | 9.9 | 9.9 | 38.1 | -4.1 |
| A058470 | 리노공업 | 9.6 | 9.6 | 9.6 | 9.4 | 38.1 | -9.5 |
| A257720 | 실리콘투 | 9.6 | 9.5 | 9.7 | 9.3 | 38.0 | -19.4 |
| A036930 | 주성엔지니어링 | 10.0 | 10.0 | 9.6 | 8.1 | 37.6 | 7.6 |
| A247540 | 에코프로비엠 | 9.2 | 9.4 | 9.5 | 9.2 | 37.2 | -8.8 |
| A140860 | 파크시스템스 | 9.3 | 9.2 | 9.5 | 9.1 | 37.1 | -15.3 |

## 외국인 순매수 스타일 성과 추이



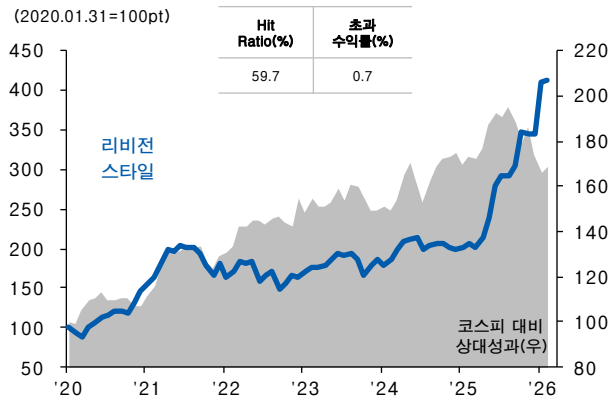

## 외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | | 외국인 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 1M | 3M | 6M | 12M | | |
| A032350 | 롯데관광개발 | 9.8 | 9.9 | 9.9 | 9.9 | 39.4 | 4.9 |
| A353200 | 대덕전자 | 9.2 | 10.0 | 9.9 | 9.5 | 38.5 | -7.2 |
| A018880 | 한온시스템 | 9.9 | 9.8 | 9.7 | 9.1 | 38.5 | 21.7 |
| A278470 | 에이피알 | 9.4 | 9.4 | 9.7 | 9.9 | 38.3 | 3.1 |
| A069620 | 대웅제약 | 8.8 | 9.9 | 9.8 | 9.7 | 38.2 | -2.4 |
| A403870 | HPSP | 10.0 | 9.8 | 9.3 | 9.1 | 38.1 | -2.2 |
| A052690 | 한전기술 | 9.9 | 9.1 | 9.4 | 9.3 | 37.6 | 10.2 |
| A012510 | 더존비즈온 | 9.1 | 9.7 | 9.6 | 9.2 | 37.5 | -11.1 |
| A028050 | 삼성E&A | 8.9 | 8.4 | 9.4 | 9.4 | 36.1 | 2.8 |
| A004000 | 롯데정밀화학 | 8.0 | 9.3 | 9.5 | 9.0 | 35.7 | 2.9 |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/5일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

## 리비전 스타일 성과 추이

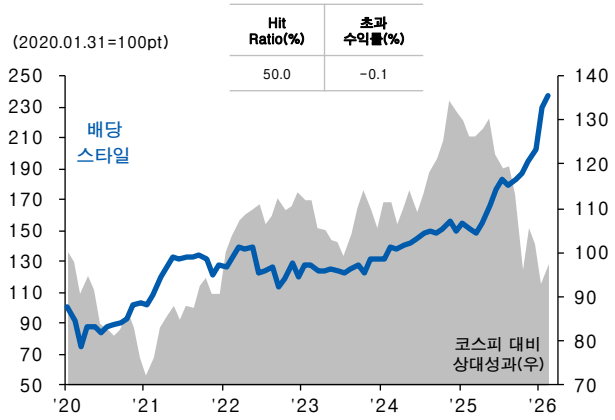



## 리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | 리비전 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 매출 | 영업이익 | 순이익 | | |
| A005930 | 삼성전자 | 9.6 | 9.7 | 9.2 | 28.5 | 0.2 |
| A000660 | SK하이닉스 | 9.6 | 9.4 | 9.1 | 28.2 | -6.6 |
| A010130 | 고려아연 | 8.6 | 9.3 | 6.5 | 24.4 | -8.4 |
| A052690 | 한전기술 | 9.1 | 9.5 | 5.4 | 24.0 | 10.2 |
| A105630 | 한세실업 | 7.7 | 8.7 | 7.2 | 23.6 | 10.5 |
| A071970 | HD현대마린엔진 | 8.7 | 9.4 | 5.5 | 23.6 | -6.0 |
| A329180 | HD현대중공업 | 9.5 | 8.3 | 5.6 | 23.3 | -4.0 |
| A195870 | 해성디에스 | 8.6 | 9.0 | 5.6 | 23.2 | -4.1 |
| A128940 | 한미약품 | 8.4 | 7.7 | 6.8 | 22.8 | 11.8 |
| A028260 | 삼성물산 | 7.9 | 7.5 | 7.2 | 22.6 | 1.9 |

## 배당 스타일 성과 추이

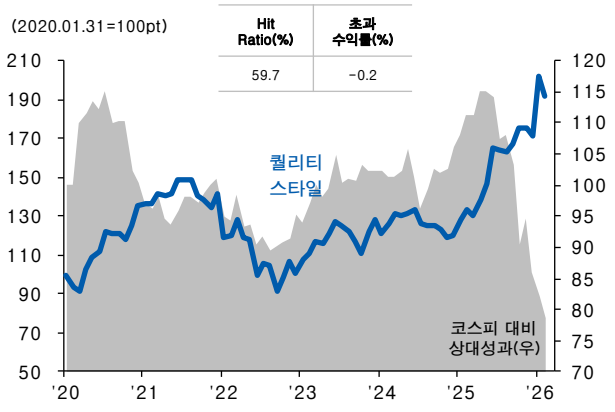



## 배당 스코어 Top 10

(단위: %)

| 종목 코드 | 종목 | 세부기준 스코어 | | | | 배당 스코어 | 주간 수익률 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 배당성향 | 3Y평균 | 5Y평균 | FY1 | | |
| A009240 | 한샘 | 9.5 | 9.9 | 9.7 | 9.9 | 39.1 | -3.0 |
| A030000 | 제일기획 | 8.9 | 9.8 | 9.3 | 9.8 | 37.8 | -5.3 |
| A001120 | LX인터내셔널 | 7.8 | 9.7 | 9.9 | 9.5 | 36.9 | 7.9 |
| A032640 | LG유플러스 | 9.2 | 9.6 | 9.1 | 8.7 | 36.6 | -2.0 |
| A005940 | NH투자증권 | 8.1 | 9.2 | 9.7 | 9.2 | 36.1 | -2.2 |
| A016360 | 삼성증권 | 7.0 | 9.8 | 9.9 | 9.4 | 36.1 | -0.2 |
| A017670 | SK텔레콤 | 8.9 | 9.0 | 8.9 | 8.9 | 35.7 | 7.2 |
| A024110 | 기업은행 | 6.8 | 9.4 | 9.8 | 9.7 | 35.7 | 3.8 |
| A214320 | 이노션 | 8.1 | 8.9 | 8.5 | 9.8 | 35.2 | 3.2 |
| A000810 | 삼성화재 | 7.5 | 9.5 | 9.3 | 8.8 | 35.1 | 0.7 |

## 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 | 9.9 | 9.7 | 9.4 | 38.5 | -2.2 |
| A058470 | 리노공업 | 9.9 | 9.8 | 9.7 | 8.6 | 38.0 | -9.5 |
| A042700 | 한미반도체 | 9.1 | 9.7 | 9.4 | 9.7 | 37.9 | -7.6 |
| A462870 | 시프트업 | 9.9 | 9.9 | 9.9 | 7.7 | 37.5 | -4.3 |
| A214150 | 클래시스 | 8.9 | 9.8 | 9.6 | 9.2 | 37.4 | -6.9 |
| A145020 | 휴젤 | 9.9 | 9.6 | 9.4 | 7.8 | 36.7 | -9.9 |
| A000660 | SK하이닉스 | 7.5 | 9.6 | 9.6 | 9.8 | 36.5 | -6.6 |
| A259960 | 크래프톤 | 9.6 | 9.5 | 9.8 | 7.3 | 36.2 | -6.2 |
| A214450 | 파마리서치 | 7.9 | 9.6 | 9.3 | 8.9 | 35.7 | -30.0 |
| A192080 | 더블유게임즈 | 9.8 | 9.4 | 9.4 | 6.8 | 35.5 | -2.5 |

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 2/5일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10
주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

YUANTA

# 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 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 투자의사결정은 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.

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)