

Y U A N T A

Quant Weekly Evaluation Report

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

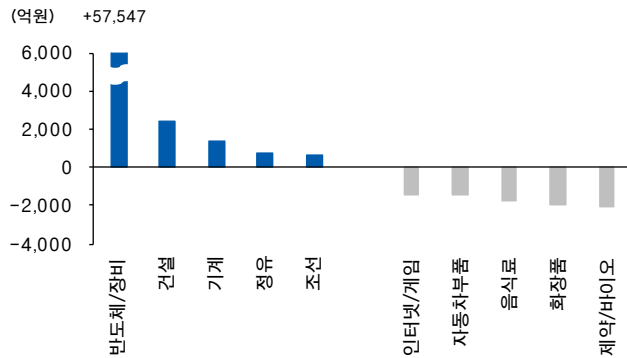
종목명	업종	시가총액 (억원)	12MF 순이익(억원, %)			3개월 이익사이클 추이(%)			이익 사이클 확대 폭(%p)
			8/9 기준	9/9 기준	조정률	6월말 기준	7월말 기준	9/9 기준	
SK	에너지	436,466	88,448	130,938	48.0	487.8	517.6	749.6	261.7
빙그레	필수소비재	7,925	907	1,301	43.5	-23.7	-14.3	39.6	63.3
삼성생명	보험	607,000	43,063	53,593	24.5	54.2	74.3	126.3	72.1
SK스퀘어	반도체	1,501,295	497,933	592,798	19.1	702.4	737.1	873.3	170.9
티에스이	반도체	29,700	1,567	1,762	12.4	188.0	246.1	310.7	122.7
현대해상	보험	41,772	8,727	10,492	20.2	-13.7	-8.7	11.0	24.6
세아베스틸지주	철강	15,008	1,287	1,448	12.5	22.4	42.9	56.7	34.4
LG전자	IT가전	333,099	24,874	28,849	16.0	54.4	72.7	78.0	23.6
삼성전기	IT하드웨어	1,048,699	24,643	26,287	6.7	134.5	214.5	250.2	115.7
삼성SDI	IT가전	462,561	11,814	12,351	4.6	35.3	198.9	306.3	271.0
LG생활건강	화장품, 의류, 완구	43,654	2,760	2,914	5.6	-29.1	-12.3	21.5	50.6
삼성전자	반도체	15,755,721	4,098,341	4,244,881	3.6	969.3	1,087.2	1,099.1	129.8
한미약품	건강관리	63,350	2,084	2,592	24.3	19.3	20.8	29.0	9.6
SK텔레콤	통신서비스	196,103	13,832	14,537	5.1	4.4	24.0	35.8	31.4
LS ELECTRIC	기계	317,250	7,020	7,355	4.8	57.5	90.4	94.0	36.5
SK하이닉스	반도체	13,557,938	3,022,686	3,128,223	3.5	773.1	793.5	816.7	43.7
이수페타시스	반도체	82,439	3,598	3,873	7.6	91.6	95.3	107.7	16.1
심텍	IT하드웨어	50,354	2,866	2,910	1.5	376.3	396.9	495.5	119.2
미스트홀딩스	화장품, 의류, 완구	21,343	2,982	3,060	2.6	3.5	15.8	28.7	25.2

자료: 에프엔가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 기관은 약 +4.9조원 순매수, 외국인은 약 -3,147억원 순매도를 기록. 기관은 반도체/장비 업종을 약 3주 연속 순매도한 뒤 순매수 전환
- 기관과 외국인은 기계 업종을 +1,409억원, +1,844억원 순매수, 정유 업종을 +723억원, +1,091억원 순매수한 반면 인터넷/게임 업종을 -1,423억원, -426억원 순매도

기관 주간 순매수 상/하위 업종

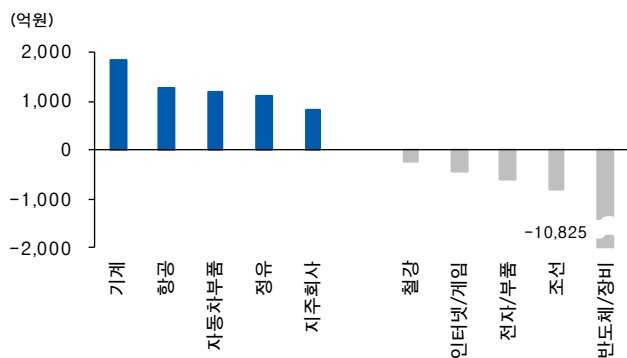


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	57,547	222	-26,152	
2	건설	2,378	5,450	10,458	
3	기계	1,409	832	-1,073	
4	정유	723	2,668	9,799	
5	조선	663	-3,924	-5,532	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	-2,035	-3,041	6,026	
2	화장품	-1,918	-1,600	4,166	
3	음식료	-1,771	-897	-211	
4	자동차부품	-1,465	-5,302	-8,171	
5	인터넷/게임	-1,423	-1,172	2,820	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

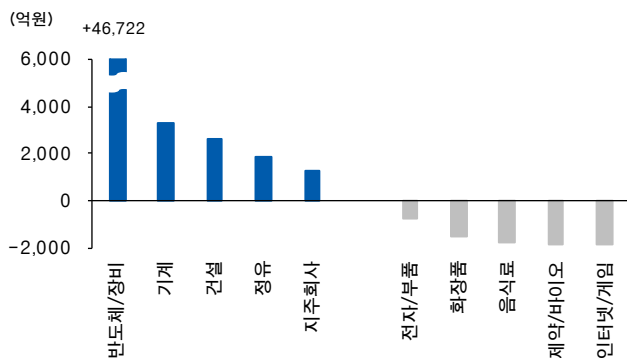


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	기계	1,844	882	-2,248	
2	항공	1,254	2,689	3,687	
3	자동차부품	1,190	1,900	5,678	
4	정유	1,091	2,304	2,387	
5	지주회사	799	1,117	712	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-10,825	-31,290	-464,665	
2	조선	-794	3,153	4,975	
3	전자/부품	-597	-2,561	1,765	
4	인터넷/게임	-426	-993	2,827	
5	철강	-256	-819	933	

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	46,722	-31,068	-490,817	
2	기계	3,253	1,714	-3,321	
3	건설	2,642	3,330	11,470	
4	정유	1,814	4,972	12,186	
5	지주회사	1,281	1,807	4,635	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	인터넷/게임	-1,849	-2,164	5,647	
2	제약/바이오	-1,829	-3,072	12,463	
3	음식료	-1,774	-71	2,622	
4	화장품	-1,550	3,463	9,904	
5	전자/부품	-776	-6,224	-1,297	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 9/10일 기준

업종별

종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A403870	HPSP	반도체/장비	45,759	1,347	0.75
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	102,723	2,640	0.70
A240810	원익IPS	반도체/장비	58,312	1,390	0.60
A222800	심텍	전자/부품	50,847	1,074	0.56
A058470	리노공업	반도체/장비	52,815	1,097	0.52
A042700	한미반도체	반도체/장비	241,140	3,729	0.40
A006650	대한유화	화학	6,910	90	0.34
A006360	GS건설	건설	31,879	400	0.33
A361610	SK아이이테크놀로지	2차전지	14,427	140	0.25
A375500	DL이앤씨	건설	32,464	247	0.20

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	10,878	276	0.66
A183300	코미코	반도체/장비	14,870	279	0.49
A213420	덕산네오룩스	디스플레이	8,095	152	0.48
A241710	코스메카코리아	화장품	12,912	191	0.36
A214450	파마리서치	의료기기	36,312	538	0.35
A003490	대한항공	항공	108,809	1,245	0.28
A257720	실리콘투	화장품	28,558	311	0.26
A353200	대덕전자	전자/부품	50,652	488	0.24
A361610	SK아이이테크놀로지	2차전지	14,427	118	0.21
A004170	신세계	소매/유통	36,411	250	0.17

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	102,723	2,677	0.7
A403870	HPSP	반도체/장비	45,759	1,144	0.6
A361610	SK아이이테크놀로지	2차전지	14,427	257	0.5
A006360	GS건설	건설	31,879	391	0.3
A222800	심텍	전자/부품	50,847	526	0.3
A028050	삼성E&A	건설	98,784	939	0.2
A096770	SK이노베이션	정유	258,820	1,950	0.2
A006650	대한유화	화학	6,910	52	0.2
A042700	한미반도체	반도체/장비	241,140	1,769	0.2
A073240	금호타이어	자동차부품	22,062	150	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	13,536,024	11,352.2	-52,891	-329,682
A015760	한국전력	전기	210,243	95.0	-1,816	-1,041
A017670	SK텔레콤	통신서비스	194,170	92.0	-1,725	-1,370
A032830	삼성생명	생명보험	619,000	241.4	-547	602
A047810	한국항공우주	방위산업	129,739	242.1	-479	-866
A047040	대우건설	건설	81,154	450.1	-170	360
A006260	LS	지주회사	100,308	186.6	-428	629
A222800	심텍	전자/부품	50,847	526.1	-56	808
A058470	리노공업	반도체/장비	52,815	89.7	-458	-518
A016360	삼성증권	증권	78,048	94.7	-441	-459

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 9/10일 기준

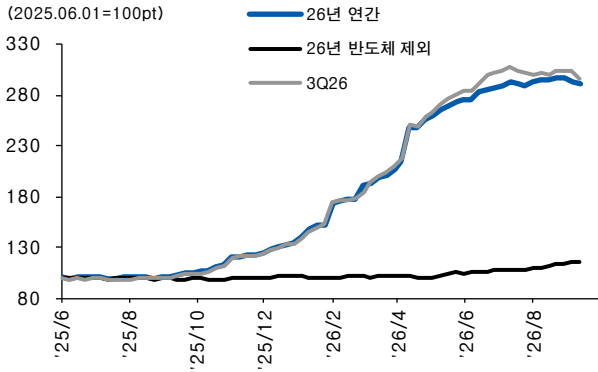
업종별

종목별

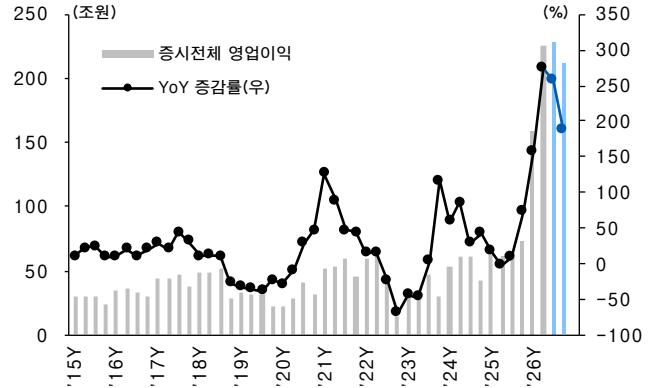
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간 -0.8% 하향, 반도체 제외 '26년 연간 -0.1% 하향 조정되며 실적시즌 공백기 약 2주간 연속 하향 조정 진행
- 이번주 '26년 연간 기준 호텔/레저(+2.2%)가 가장 높은 상향 조정률을 기록하였으며 항공(-14.5%) 업종이 가장 높은 하향 조정률을 기록

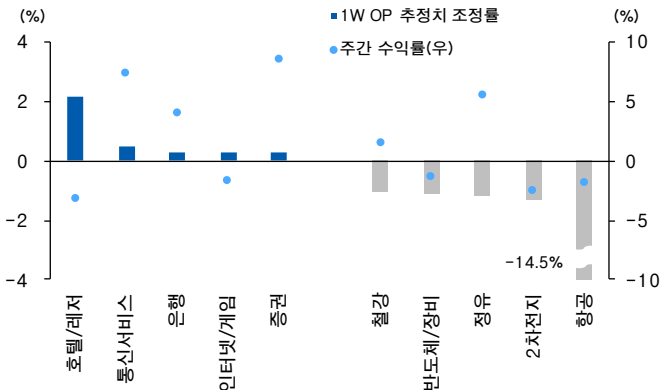
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

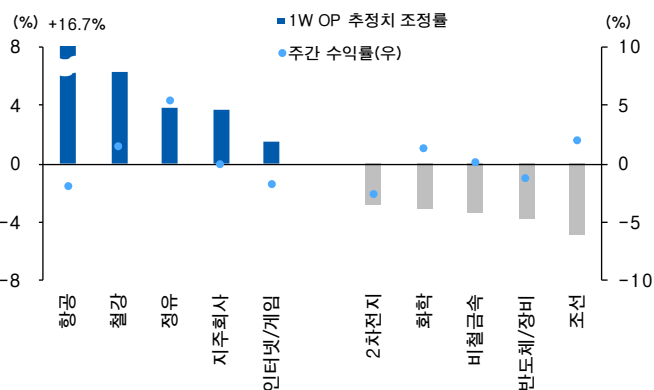


26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	호텔/레저	9,103	2.2	-3.3	
2	통신서비스	52,600	0.5	7.3	
3	은행	352,142	0.3	4.0	
4	인터넷/게임	61,011	0.3	-1.7	
5	증권	159,738	0.3	8.5	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	항공	8,761	-14.5	-1.9	
2	2차전지	13,045	-1.3	-2.6	
3	정유	138,382	-1.2	5.4	
4	반도체/장비	6,419,709	-1.1	-1.3	
5	철강	35,805	-1.1	1.4	

26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

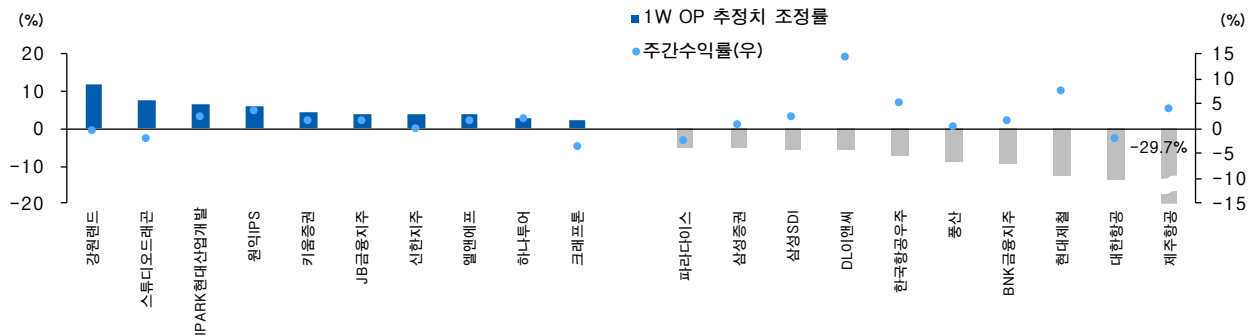
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	항공	3,950	16.7	-1.9	
2	철강	9,620	6.4	1.4	
3	정유	31,271	3.9	5.4	
4	지주회사	127,954	3.7	-0.1	
5	인터넷/게임	13,826	1.6	-1.7	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	조선	35,448	-4.9	1.9	
2	반도체/장비	1,864,954	-3.8	-1.3	
3	비철금속	5,542	-3.4	0.2	
4	화학	6,642	-3.1	1.3	
5	2차전지	3,699	-2.9	-2.6	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 9/9일 추정치 기준(수익률 9/10일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

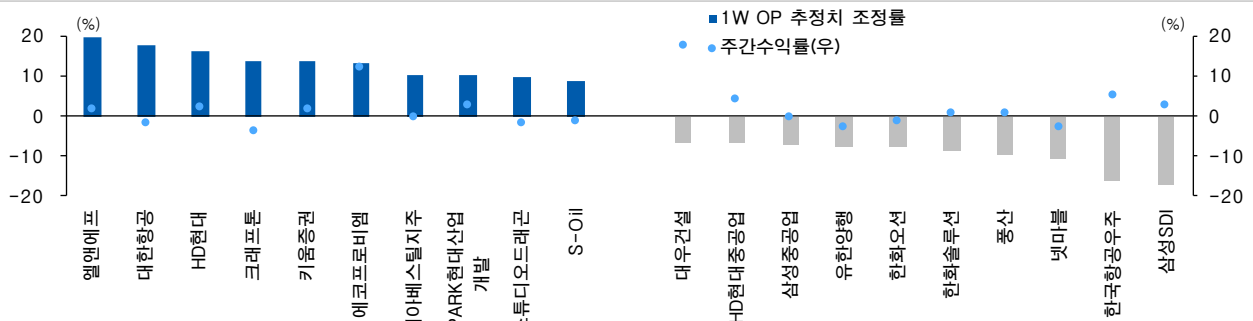


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,404	12.2	-0.4	1	A089590	제주항공	항공	260	-29.7	4.0
2	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	511	7.9	-2.1	2	A003490	대한항공	항공	8,781	-13.6	-2.2
3	A294870	IPARK현대산업개발	건설	5,360	6.4	2.4	3	A004020	현대제철	철강	3,655	-12.5	7.5
4	A240810	원익IPS	반도체/장비	1,851	6.2	3.5	4	A138930	BNK금융지주	은행	8,960	-9.6	1.4
5	A039490	키움증권	증권	24,578	4.3	1.5	5	A103140	풍산	비철금속	3,930	-9.1	0.5
6	A175330	KB금융지주	은행	10,660	4.1	1.5	6	A047810	한국항공우주	방위산업	3,163	-7.1	5.2
7	A055550	신한지주	은행	84,070	4.0	0.0	7	A375500	DL이앤씨	건설	5,472	-5.8	14.3
8	A066970	엘앤에프	2차전지	2,135	3.9	1.5	8	A006400	삼성SDI	2차전지	3,244	-5.7	2.4
9	A039130	하나투어	호텔/레저	510	2.8	2.0	9	A016360	삼성증권	증권	21,907	-5.2	0.7
10	A259960	크래프톤	인터넷/게임	14,003	2.2	-3.7	10	A034230	파라다이스	호텔/레저	1,587	-5.1	-2.5

'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위



'26년 3분기 영업이익 추정치 1W 조정을 상/하위

(단위:억원, %)

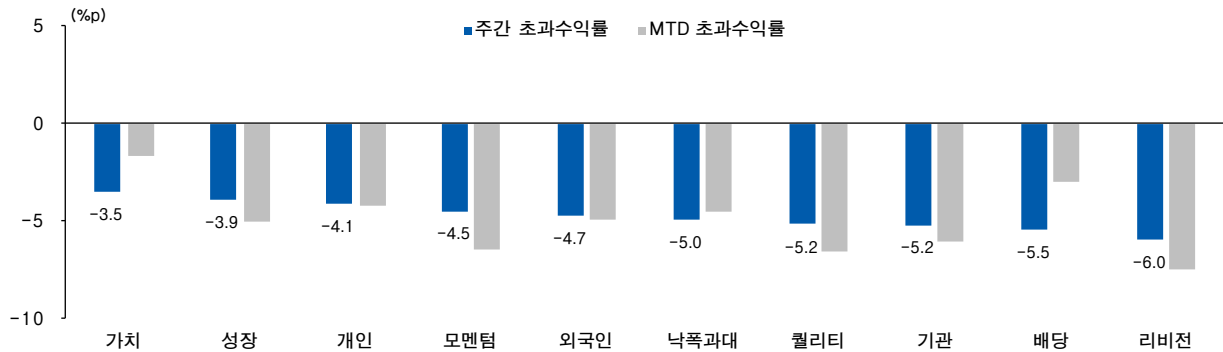
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A066970	엘앤에프	2차전지	373	19.4	1.5	1	A035760	CJ ENM	미디어/엔터	220	-25.6	3.3
2	A003490	대한항공	항공	4,250	17.7	-2.2	2	A006400	삼성SDI	2차전지	840	-17.1	2.4
3	A267250	HD현대	지주회사	32,110	16.4	2.1	3	A047810	한국항공우주	방위산업	530	-15.9	5.2
4	A259960	크래프톤	인터넷/게임	2,941	13.6	-3.7	4	A251270	넷마블	인터넷/게임	849	-10.5	-3.2
5	A039490	키움증권	증권	5,811	13.6	1.5	5	A103140	풍산	비철금속	1,000	-9.6	0.5
6	A247540	에코프로비엠	2차전지	170	13.3	12.0	6	A009830	한화솔루션	화학	1,958	-8.6	0.7
7	A001430	세아베스틸지주	철강	375	10.3	-0.4	7	A042660	한화오션	조선	5,950	-7.8	-1.5
8	A294870	IPARK현대산업개발	건설	1,440	10.1	2.4	8	A000100	유한양행	제약/바이오	309	-7.5	-3.1
9	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	147	9.6	-2.1	9	A016360	삼성증권	증권	5,170	-7.4	0.7
10	A010950	S-Oil	정유	14,873	8.5	-1.5	10	A010140	삼성중공업	조선	3,300	-7.0	-0.2

자료: 에프엔가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 9/9일 추정치 기준(수익률 9/10일 기준)

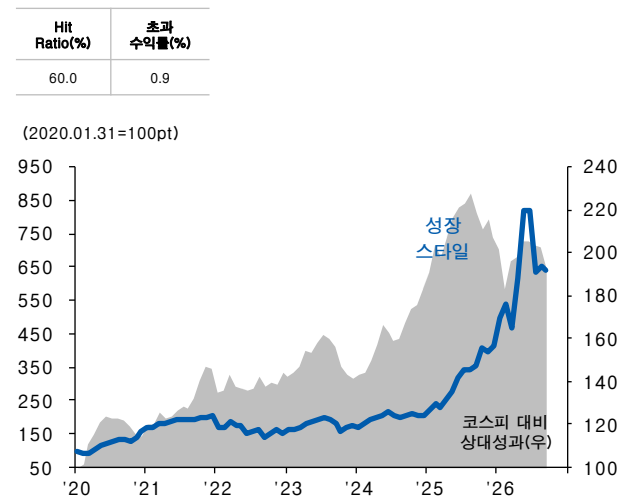
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

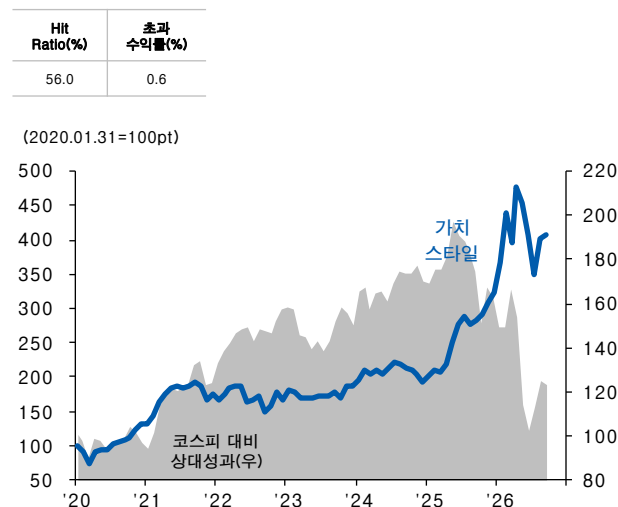


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A353200	대덕전자	8.8	9.5	9.1	27.5	3.0
A005930	삼성전자	9.1	8.8	8.6	26.5	5.3
A000880	한화	7.7	8.9	9.3	25.9	0.9
A009150	삼성전기	7.7	8.7	8.2	24.6	-0.1
A267250	HD현대	6.8	8.4	9.1	24.4	2.1
A403870	HPSP	8.8	7.9	7.2	24.0	9.4
A278470	에이피알	9.8	8.9	5.3	24.0	-8.4
A006260	LS	7.7	8.2	7.9	23.7	7.3
A267270	HD건설기계	8.1	7.9	7.3	23.3	0.9
A195870	해성디에스	7.9	7.6	7.4	22.9	2.6

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	9.5
A108670	LX하우시스	9.8	9.5	9.8	29.1	-2.8
A000370	한화손해보험	9.8	9.3	9.7	28.8	-0.5
A002350	넥센타이어	9.7	9.6	9.0	28.3	-3.5
A015760	한국전력	9.9	9.4	8.9	28.1	1.9
A036460	한국가스공사	8.5	9.7	9.8	28.1	4.0
A097950	CJ제일제당	8.7	9.4	9.8	27.9	-1.6
A088350	한화생명	8.4	9.7	9.8	27.8	4.2
A006650	대한유화	8.8	9.6	9.3	27.6	9.9
A000120	CJ대한통운	8.4	9.5	9.6	27.6	-2.3

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

성장/가치

주가

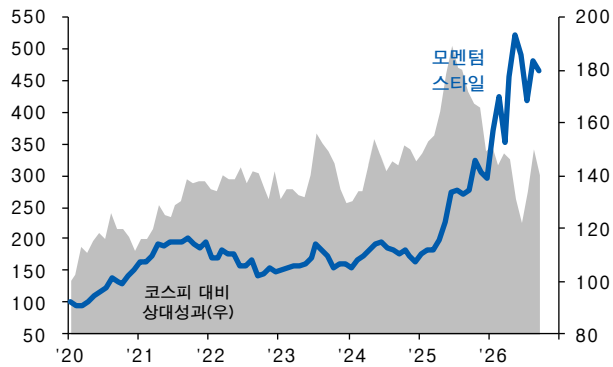
수급

기타

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

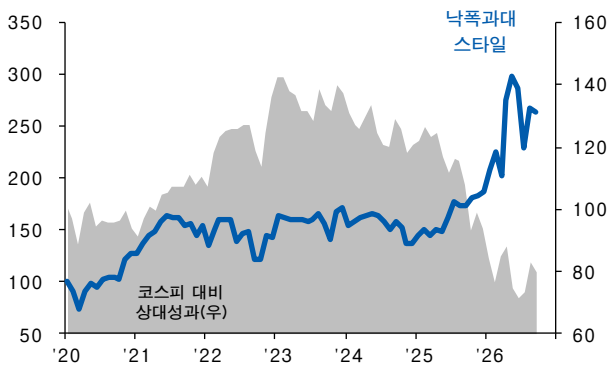
(2020.01.31=100pt)



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	-18.2
A241710	코스메카코리아	9.9	10.0	9.5	9.0	38.3	-10.1
A161890	한국콜마	9.8	9.9	9.8	8.6	38.1	-4.4
A078930	GS	9.1	9.9	9.7	9.4	38.0	-4.8
A222800	심텍	9.6	8.3	9.9	9.8	37.5	13.6
A006360	GS건설	9.6	9.1	9.4	8.5	36.5	8.8
A278470	에이피알	9.2	8.8	9.3	8.6	35.8	-8.4
A001450	현대해상	8.7	9.6	9.2	8.2	35.6	-1.4
A192820	코스맥스	9.7	9.8	9.4	6.2	35.1	-3.8
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	-0.3
A376300	디어유	9.1	7.9	9.9	10.0	36.9	-2.7
A067160	SOOP	10.0	7.8	9.6	9.3	36.7	-2.5
A214150	클래시스	9.8	7.9	9.3	8.7	35.7	-2.5
A064350	현대로템	7.0	9.0	9.1	8.9	34.0	-2.3
A263750	떨어비스	9.0	8.4	9.2	6.9	33.5	4.9
A034230	파라다이스	5.7	8.5	9.7	9.6	33.4	-2.5
A145720	덴티움	8.7	7.0	7.0	9.4	32.1	-2.0
A035720	카카오	8.7	5.1	9.2	9.0	32.0	-3.6
A248070	솔루엠	8.1	9.1	7.3	7.5	32.0	-0.6

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/10일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

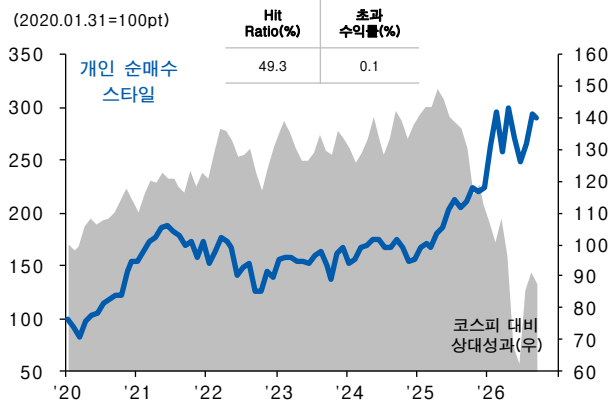
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

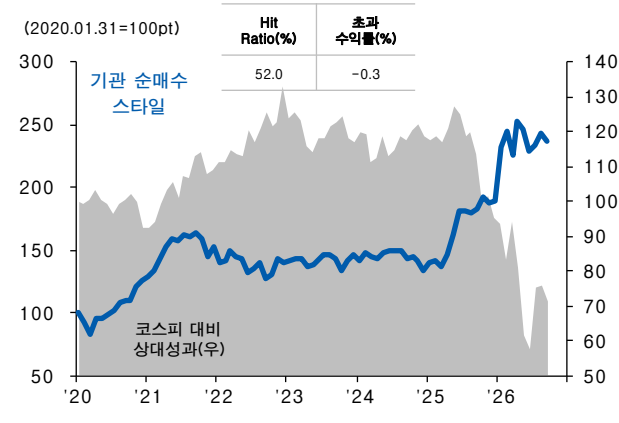


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	-2.5
A035900	JYP Ent.	10.0	9.9	8.5	9.9	38.3	-0.3
A376300	디어유	9.6	9.0	9.7	9.8	38.0	-2.7
A005380	현대차	8.5	9.7	9.6	9.7	37.5	1.4
A035760	CJ ENM	8.2	8.5	10.0	9.6	36.3	3.3
A039130	하나투어	6.9	9.2	9.9	9.8	35.7	2.0
A016360	삼성증권	9.4	8.5	9.2	8.5	35.5	0.7
A122870	와이지엔터테인먼트	9.2	6.0	9.8	10.0	34.9	1.2
A011070	LG이노텍	8.6	7.7	9.7	8.6	34.5	-0.9
A139480	이마트	9.8	9.8	6.7	8.2	34.4	0.5

기관 순매수 스타일 성과 추이

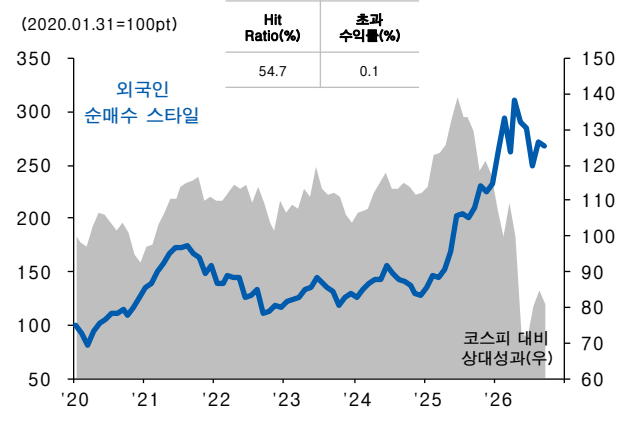


기관 순매수 스코어 Top 10

(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	1.7
A006360	GS건설	10.0	9.9	9.8	9.5	39.1	8.8
A336260	두산퓨얼셀	9.7	9.6	9.9	9.7	38.8	14.3
A161890	한국콜마	9.2	9.4	9.7	9.1	37.3	-4.4
A375500	DL이앤씨	9.3	8.9	9.6	9.2	36.9	14.3
A192820	코스맥스	9.9	9.8	9.5	7.4	36.5	-3.8
A010060	OCI홀딩스	9.1	8.0	9.6	9.6	36.2	-2.6
A001450	현대해상	9.0	9.5	9.1	7.5	35.1	-1.4
A112610	씨에스원드	8.7	8.2	9.3	9.0	35.1	8.8
A000370	한화손해보험	9.4	9.1	8.6	8.0	35.0	-0.5

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	0.8
A069960	현대백화점	9.9	9.8	9.6	9.0	38.2	3.2
A282330	BGF리테일	9.5	9.5	9.4	9.6	37.9	0.3
A023530	롯데쇼핑	9.5	9.8	9.2	9.3	37.7	3.9
A195870	해성디에스	7.8	9.7	9.5	9.9	36.8	2.6
A064350	현대로템	8.0	9.5	9.5	9.8	36.7	-2.3
A011780	금호석유화학	9.4	8.1	9.6	9.7	36.7	0.7
A298020	효성티앤씨	9.7	9.1	9.2	8.7	36.6	-1.2
A003490	대한항공	9.0	9.3	9.1	9.0	36.4	-2.2
A140860	파크시스템스	8.7	9.2	9.8	8.4	36.0	-2.9

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/10일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

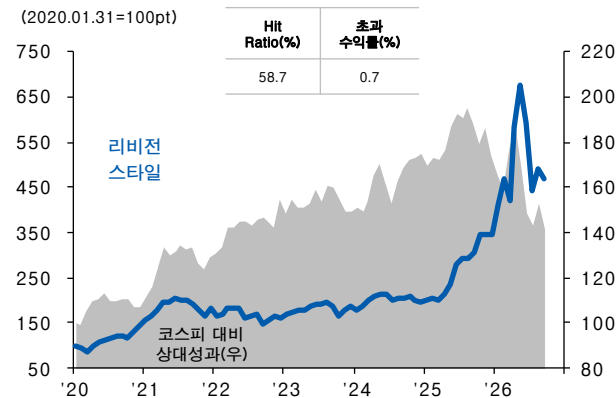
성장/가치

주가

수급

기타

리비전 스타일 성과 추이

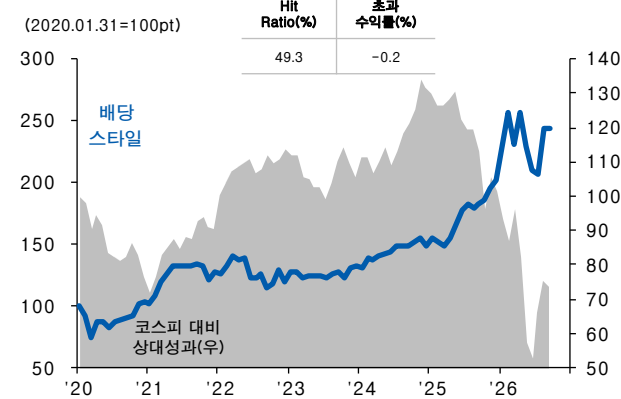


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A006260	LS	9.5	9.3	7.8	26.5	7.3
A128940	한미약품	9.5	9.8	6.4	25.7	1.7
A241710	코스메카코리아	9.0	8.0	8.4	25.5	-10.1
A192820	코스맥스	8.9	8.0	8.3	25.2	-3.8
A161890	한국콜마	8.4	8.0	8.2	24.7	-4.4
A011200	HMM	9.1	8.1	7.2	24.4	-1.0
A028670	팬오션	7.5	8.5	8.3	24.3	0.2
A353200	대덕전자	8.4	8.2	7.6	24.1	3.0
A012450	한화에어로스페이스	7.0	7.7	8.1	22.8	1.1
A181710	NHN	8.5	8.9	5.3	22.7	-18.2

배당 스타일 성과 추이

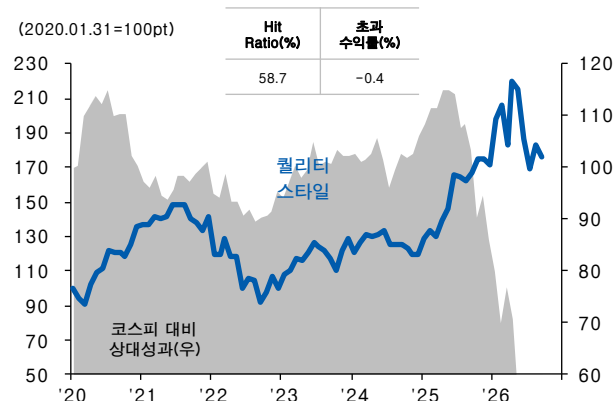


배당 스코어 Top 10

(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	-0.4
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	-0.4
A001120	LX인터내셔널	8.2	9.5	9.6	9.4	36.7	-0.6
A023530	롯데쇼핑	9.8	9.4	8.6	8.0	35.9	3.9
A032640	LG유플러스	8.4	9.4	9.2	8.7	35.7	0.0
A017670	SK텔레콤	9.4	9.2	9.2	7.6	35.4	-2.3
A016360	삼성증권	6.9	9.0	9.5	9.9	35.3	0.7
A105630	한세실업	7.7	9.3	8.4	9.6	35.0	-1.4

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	10.0
A403870	HPSP	9.3	9.9	9.8	9.3	38.4	9.4
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	38.0	12.5
A058470	리노공업	9.9	9.7	9.7	8.7	38.0	4.1
A326030	SK바이오팜	8.1	9.3	9.5	9.6	36.5	-3.7
A214150	클래시스	8.6	9.7	9.3	8.8	36.4	-2.5
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.5	36.4	-3.3
A005930	삼성전자	8.9	8.7	8.7	9.5	35.8	5.3
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	9.0	35.7	-9.6
A376300	디어유	9.5	9.5	8.8	7.5	35.2	-2.7

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱

주2) 9/10일 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.