

Y U A N T A

# Quant Weekly Evaluation Report

4월 2주차 Bull/Bear 베타 + 리비전 전략

# CONTENTS

## I 주간 스크리닝

Bull/Bear 베타 + 리비전 전략

## 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

**Bull/Bear 베타 + 리비전 전략(참고자료: [기적의 선반영, 선반영의 기적](#))**

- 1) 과거 증시 변동성 피크 국면 케이스 스터디 기반, 4월 변동성의 점진적인 완화와 방향성이 구체화되는 한편 전고점 탈환을 수반한 V자형 반등 가능성은 제한적일 것으로 전망
- 2) 변동성 장세 속 종목별 낙폭 이후 회복 탄력이 차별화됨에 따라 하락에 대한 민감도는 낮고, 상승에 대한 민감도는 높은, 초과회복을 나타낼 가능성이 높은 종목에 주목
- 3) 또한, 4월 펀더멘탈에 대한 주가 반응 강도가 가장 확대되는 기간으로, 1) 하락 민감도(Bear Beta) 대비 상승 민감도(Bull Beta)가 높으며 2) 이익 추정치 1개월 조정률 상위 종목 스크리닝

**[4월 2주차] 1) Bear Beta 대비 Bull Beta가 높은 2) 12MF 영업이익 및 순이익 1M 조정률 상위 20% 종목 스크리닝**

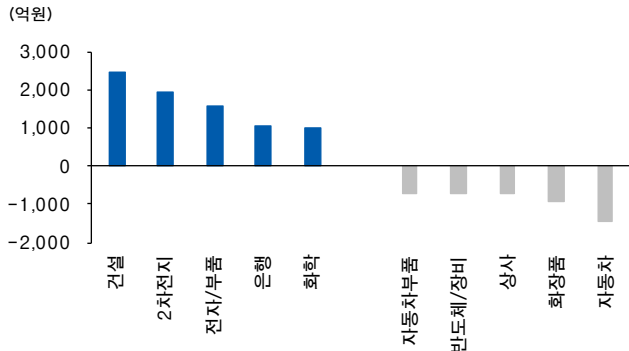
종목명	업종	시가총액 (억원)	60일 베타		12MF 영업이익(억원, %)			12MF 순이익(억원, %)		
			Bull	Bear	3/8일 기준	4/8일 기준	변동률	3/8일 기준	4/8일 기준	변동률
삼성전자	반도체	12,076,061	1.42	1.09	2,061,211	3,350,844	62.6	1,688,709	2,739,339	62.2
SK하이닉스	반도체	7,112,770	1.46	0.92	1,732,884	2,232,184	28.8	1,392,854	1,786,960	28.3
LS ELECTRIC	기계	236,400	1.23	1.03	6,610	7,460	12.9	4,774	5,344	11.9
리노공업	반도체	86,196	1.26	0.75	2,177	2,353	8.1	1,876	1,993	6.2
원익IPS	반도체	57,968	1.62	0.96	1,827	2,311	26.5	1,598	1,978	23.8
이오테크닉스	반도체	52,543	1.66	0.83	1,259	1,409	11.9	1,034	1,178	14.0
에스티팜	건강관리	29,388	1.06	0.91	786	838	6.5	670	860	28.4
피에스케이	반도체	24,129	1.57	1.10	1,179	1,456	23.4	1,002	1,283	28.0
하나마이크론	반도체	19,797	1.39	0.90	2,522	2,707	7.3	1,056	1,164	10.2
RFHIC	IT하드웨어	22,783	1.90	0.96	546	588	7.7	449	490	9.2
피에스케이홀딩스	반도체	22,188	1.90	0.06	938	976	4.0	1,030	1,189	15.5
세트렉아이	상사, 자본재	17,391	1.07	0.93	186	214	15.4	149	197	32.1
대주전자재료	IT하드웨어	18,106	1.60	0.98	365	385	5.6	275	371	34.8
인텔리안테크	IT하드웨어	12,305	1.49	0.89	429	467	8.9	357	376	5.2
테스	반도체	14,462	1.83	1.08	921	1,060	15.1	825	950	15.2
하나머티리얼즈	반도체	11,629	1.73	0.82	827	995	20.3	668	781	17.1
브이엠	반도체	10,558	1.37	1.33	798	837	4.9	655	771	17.8

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

**주간 수급 Comment**

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +4.1조원 순매수, 기관은 약 +5,464.8억원 순매수. 지난 8일 미국과 이란의 휴전 발표에 약 +1.7조원 순매수 나타나며 7주 연속 순매도 이후 이번주 순매수 전환
- 이번 외국인의 순매수는 지난 7주간 순매도가 집중된 대형주 중심이 아닌 선별적인 업종 접근이 특징. 반도체/장비 업종 제외, 가장 강도 높은 순매도가 나타난 자동차, 은행 등의 업종은 순매도 지속. 반면 7주 누적기준 순매수를 기록한 2차전지, 기계 업종을 추가 순매수

**기관 주간 순매수 상/하위 업종**

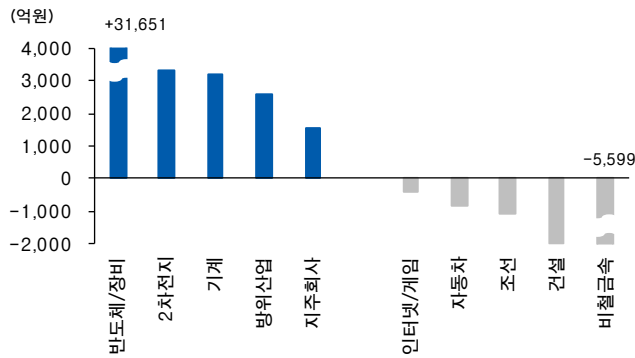


**기관 주간 순매수 상/하위 업종**

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	건설	2,479	2,387	2,302	
2	2차전지	1,944	12,510	24,160	
3	전자/부품	1,546	6,095	8,071	
4	은행	1,060	10,285	18,722	
5	화학	976	1,711	2,221	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	자동차	-1,467	-410	-2,147	
2	화장품	-922	895	1,727	
3	상사	-732	1,084	4,271	
4	반도체/장비	-708	13,218	107,176	
5	자동차부품	-706	-1,730	-2,911	

**외국인 주간 순매수 상/하위 업종**

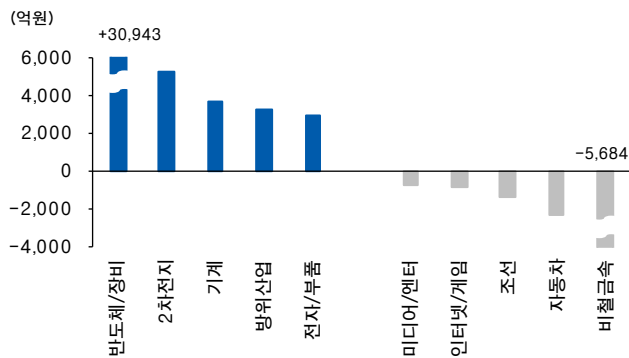


**외국인 주간 순매수 상/하위 업종**

(단위: 억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	31,651	-154,553	-509,189	
2	2차전지	3,343	4,725	16,551	
3	기계	3,179	3,121	24,439	
4	방위산업	2,603	6,159	-8,937	
5	지주회사	1,545	-1,079	13,183	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	비철금속	-5,599	-6,415	-7,751	
2	건설	-1,984	-8,340	-2,601	
3	조선	-1,050	-7,998	11,339	
4	자동차	-848	-24,115	-89,716	
5	인터넷/게임	-416	-2,947	-4,290	

**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	30,943	-141,335	-402,012	
2	2차전지	5,287	17,235	40,711	
3	기계	3,626	9,896	32,498	
4	방위산업	3,253	11,544	1,114	
5	전자/부품	2,973	7,579	12,905	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	비철금속	-5,684	-7,124	-6,199	
2	자동차	-2,316	-24,525	-91,863	
3	조선	-1,409	-6,382	3,061	
4	인터넷/게임	-893	-5,372	-10,541	
5	미디어/엔터	-763	-4,921	-1,128	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 4/9일 기준

기관 주간 판매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 판매수 대금	판매수 강도
A375500	DL이앤씨	건설	36,488	1,110	0.84
A248070	솔루엠	전자/부품	8,258	191	0.60
A222800	심텍	전자/부품	25,542	383	0.41
A006650	대한유화	화학	10,608	159	0.41
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	19,648	220	0.31
A006360	GS건설	건설	30,424	306	0.28
A097950	CJ제일제당	음식료	35,001	385	0.27
A120110	코오롱인더	화학	24,767	242	0.26
A257720	실리콘투	화장품	26,335	196	0.20
A008770	호텔신라	호텔/레저	19,212	131	0.18

외국인 주간 판매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 판매수 대금	판매수 강도
A047040	대우건설	건설	97,048	1,720	0.51
A222800	심텍	전자/부품	25,542	398	0.43
A001120	LX인터내셔널	상사	18,198	169	0.22
A032350	롯데관광개발	호텔/레저	13,739	116	0.22
A278470	에이피알	화장품	136,836	1,085	0.21
A008770	호텔신라	호텔/레저	19,212	155	0.21
A139480	이마트	소매/유통	26,078	215	0.21
A166090	하나머티리얼즈	반도체/장비	11,629	81	0.18
A001440	대한전선	기계	56,680	360	0.16
A069960	현대백화점	소매/유통	18,171	111	0.16

기관 + 외국인 주간 판매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 판매수 대금	판매수 강도
A222800	심텍	전자/부품	25,542	782	0.8
A047040	대우건설	건설	97,048	2,237	0.7
A008770	호텔신라	호텔/레저	19,212	286	0.4
A097950	CJ제일제당	음식료	35,001	534	0.4
A006650	대한유화	화학	10,608	144	0.4
A298020	효성티앤씨	섬유/의복	19,648	214	0.3
A011170	롯데케미칼	화학	41,364	366	0.2
A006400	삼성SDI	2차전지	386,811	3,188	0.2
A001440	대한전선	기계	56,680	431	0.2
A257720	실리콘투	화장품	26,335	191	0.2

기관 + 외국인 주간 판매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005930	삼성전자	반도체/장비	12,076,061	9,409.5	-112,916	-310,098
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	7,112,770	22,735.5	-25,892	-104,435
A006800	미래에셋증권	증권	375,949	579.3	-3,499	-6,113
A047040	대우건설	건설	97,048	2,237.3	-376	711
A028260	삼성물산	지주회사	486,507	217.1	-1,594	-135
A003670	포스코퓨처엠	2차전지	193,903	343.3	-1,083	1,745
A035720	카카오	인터넷/게임	209,539	187.1	-1,068	-2,118
A009540	HD한국조선해양	조선	276,723	57.1	-798	244
A034220	LG디스플레이	디스플레이	59,000	372.8	-451	-681
A006260	LS	지주회사	87,360	292.6	-434	865

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 4/9일 기준

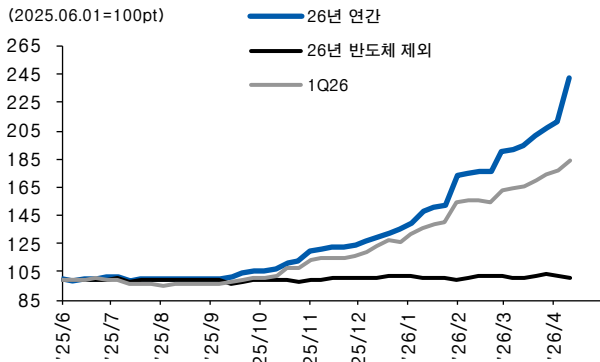
업종별

종목별

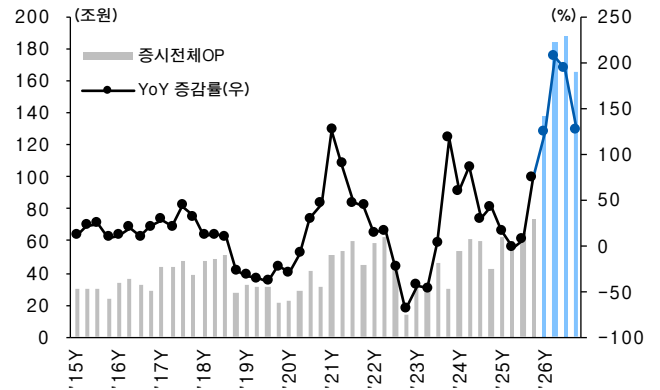
### 주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간+14.6% 상향, 반도체 제외 '26년 연간-1.3% 하향조정
- 지난 7일 삼성전자의 1Q26 잠정실적이 발표되었으며, 발표 직전 약 50조원 수준까지 높아진 분기 영업이익 추정치를 상회하는 57.2조원을 기록. 이후 반도체 업종의 견조함이 확인되며 가파른 이익 추정치 상향 조정 진행

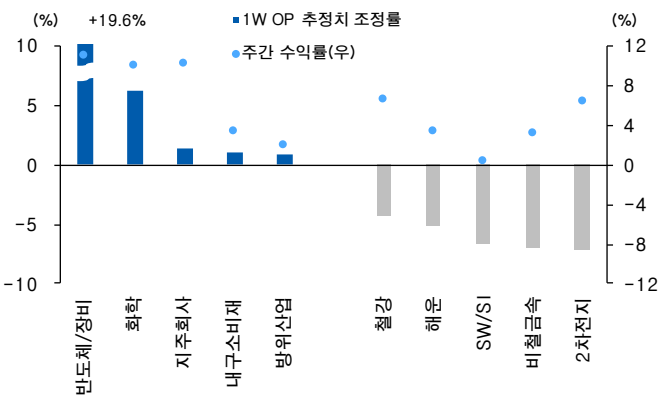
#### 증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



#### 증시 전체 영업이익의 및 증감을 추이



#### 26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

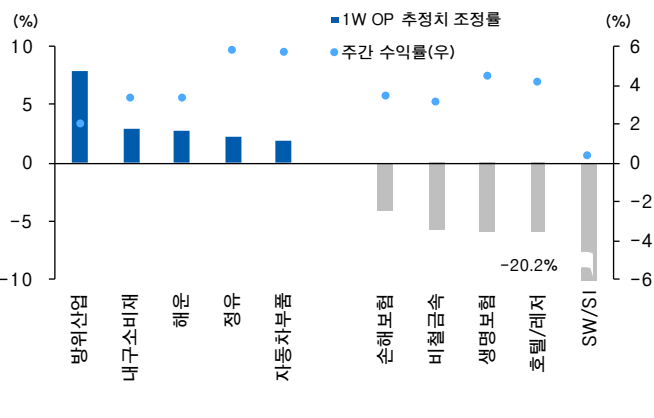


#### 26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	반도체/장비	5,230,083	19.6	11.0	
2	화학	37,298	6.3	9.9	
3	지주회사	331,573	1.3	10.3	
4	내구소비재	13,255	1.0	3.3	
5	방위산업	54,787	0.8	2.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	철강	38,385	-4.4	6.6	
2	해운	15,124	-5.2	3.3	
3	SW/SI	16,330	-6.6	0.4	
4	비철금속	23,843	-7.0	3.1	
5	2차전지	11,220	-7.2	6.3	

#### 26년 1분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



#### 26년 1분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

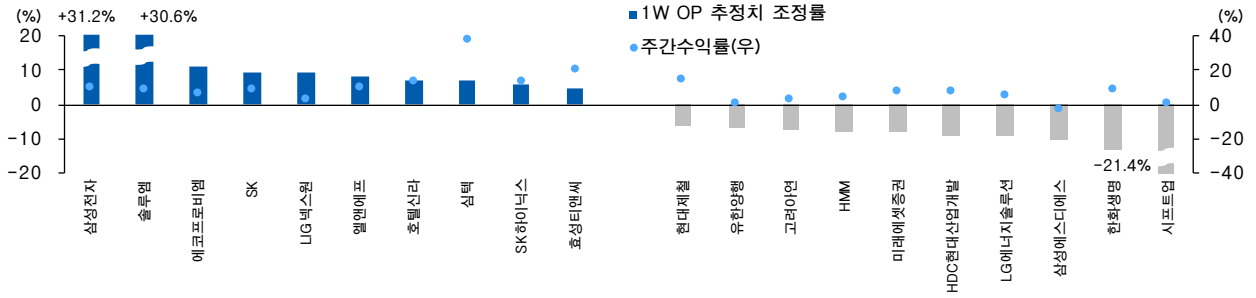
상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	방위산업	10,047	7.9	2.0	
2	내구소비재	3,124	2.9	3.3	
3	해운	4,075	2.8	3.3	
4	정유	41,819	2.3	5.9	
5	자동차부품	17,678	1.9	5.7	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	손해보험	16,389	-4.1	3.5	
2	비철금속	6,115	-5.8	3.1	
3	생명보험	10,561	-6.0	4.4	
4	호텔/레저	1,869	-6.0	4.2	
5	SW/SI	3,077	-20.2	0.4	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주: 유니버스 200 종목 4/8일 추정치 기준(수익률 4/9일 기준)

업종별

종목별

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

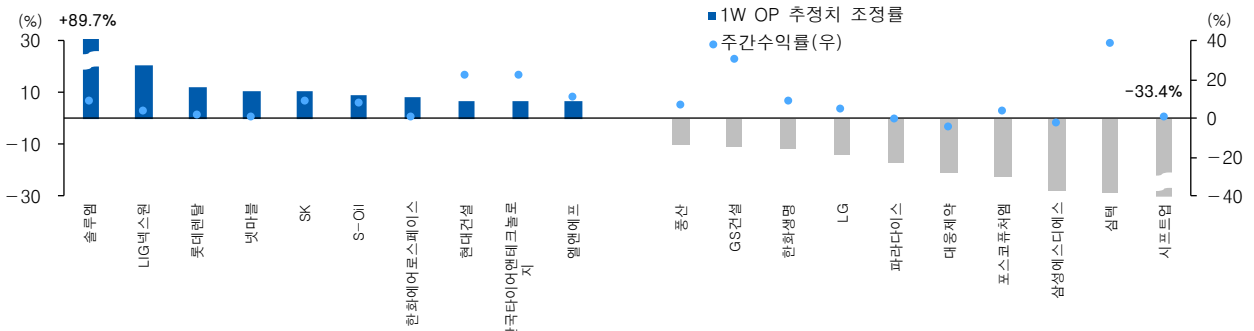


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A005930	삼성전자	반도체/장비	3,107,088	31.2	9.6	1	A004020	현대제철	철강	6,263	-6.6	14.5
2	A248070	솔루엠	전자/부품	940	30.6	8.9	2	A000100	유한양행	제약/바이오	1,404	-7.1	1.1
3	A247540	에코프로비엠	2차전지	1,077	11.0	7.0	3	A010130	고려아연	비철금속	20,393	-7.3	2.8
4	A034730	SK	지주회사	49,896	9.6	8.6	4	A011200	HMM	해운	9,670	-8.3	4.0
5	A079550	LIG넥스원	방위산업	4,608	9.4	3.1	5	A006800	미래에셋증권	증권	34,959	-8.4	7.3
6	A066970	엘앤에프	2차전지	1,621	8.2	10.0	6	A294870	HDC현대산업개발	건설	4,460	-9.0	8.1
7	A008770	호텔신라	호텔/레저	1,418	7.0	13.6	7	A373220	LG에너지솔루션	2차전지	12,647	-9.1	5.6
8	A222800	심택	전자/부품	1,383	6.9	38.0	8	A018260	삼성에스디에스	SW/SI	9,464	-10.6	-2.6
9	A000660	SK하이닉스	반도체/장비	2,109,436	6.0	13.9	9	A088350	한화생명	생명보험	6,920	-13.5	8.5
10	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	3,898	4.8	20.7	10	A462870	시프트업	인터넷/게임	1,039	-21.4	0.6

'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

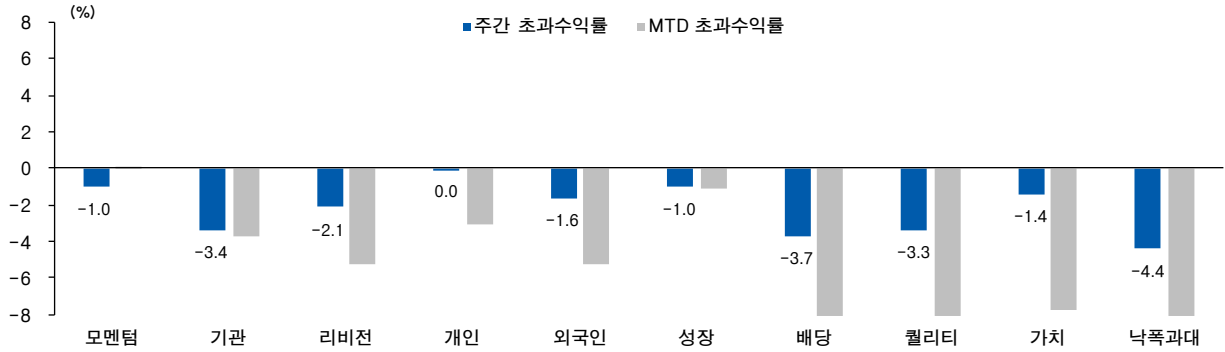
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A248070	솔루엠	전자/부품	220	89.7	8.9	1	A103140	풍산	비철금속	827	-10.1	6.2
2	A079550	LIG넥스원	방위산업	1,136	20.4	3.1	2	A006360	GS건설	건설	1,159	-10.8	30.5
3	A089860	롯데렌탈	내구소비재	790	12.4	1.3	3	A088350	한화생명	생명보험	2,041	-11.7	8.5
4	A251270	넷마블	인터넷/게임	892	10.9	0.0	4	A003550	LG	지주회사	6,423	-14.1	4.7
5	A034730	SK	지주회사	13,792	10.6	8.6	5	A034230	파라다이스	호텔/레저	461	-17.4	-1.3
6	A010950	S-Oil	정유	11,613	8.6	7.4	6	A069620	대웅제약	제약/바이오	403	-21.0	-5.3
7	A012450	한화에어로스페이스	방위산업	7,423	8.4	0.1	7	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	96	-22.6	3.1
8	A000720	현대건설	건설	1,469	6.9	21.4	8	A018260	삼성에스디에스	SW/SI	1,888	-28.4	-2.6
9	A161390	한국타이어앤테크놀로지	자동차부품	5,530	6.8	21.7	9	A222800	심택	전자/부품	63	-28.4	38.0
10	A066970	엘앤에프	2차전지	674	6.7	10.0	10	A462870	시프트업	인터넷/게임	227	-33.4	0.6

자료: 에프앤가이드 Quantivise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 4/8일 추정치 기준(수익률 4/9일 기준)

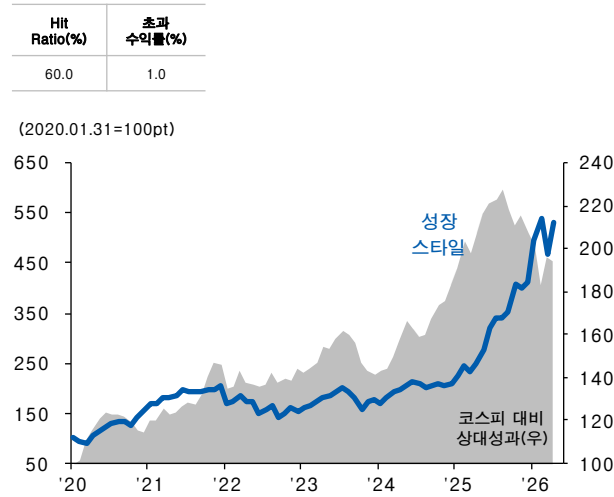
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



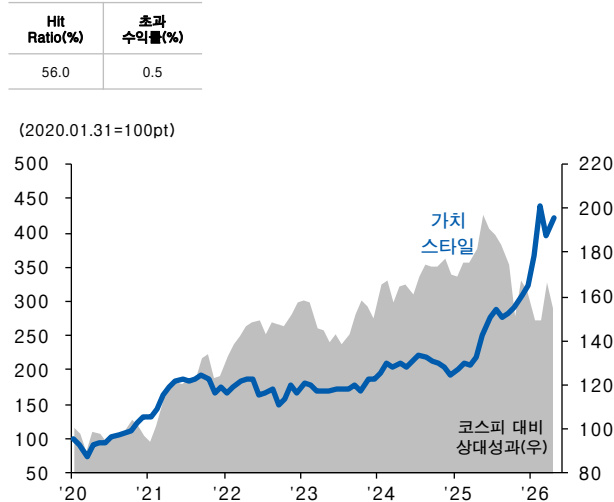
성장 스타일 성과 추이



성장 스코어 Top 10 (단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.7	9.6	28.6	9.5
A353200	대덕전자	8.7	9.7	9.4	27.9	7.6
A298040	효성중공업	7.2	8.5	8.4	24.1	12.6
A068270	셀트리온	8.0	8.1	7.9	24.0	3.2
A267270	HD건설기계	7.7	7.9	8.4	23.9	8.4
A267250	HD현대	6.5	8.4	8.9	23.8	4.0
A010130	고려아연	8.4	7.0	8.2	23.6	3.1
A278470	에이피알	9.6	8.7	5.2	23.5	11.8
A009150	삼성전기	6.8	8.2	7.8	22.8	13.1
A064350	현대로템	8.0	7.6	7.2	22.8	-3.4

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10 (단위: %)

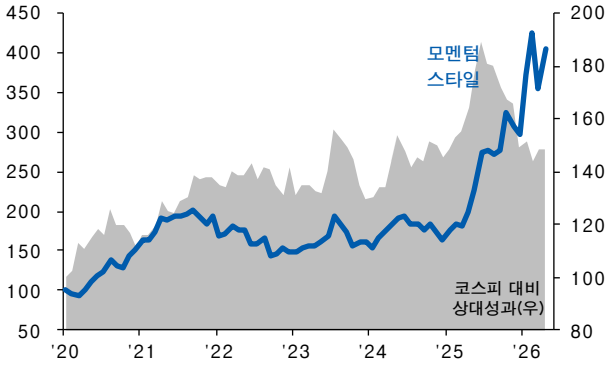
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A036460	한국가스공사	9.8	9.7	9.9	29.4	5.2
A000370	한화손해보험	9.8	9.7	9.9	29.4	0.6
A011170	롯데케미칼	10.0	9.7	9.4	29.1	19.3
A001450	현대해상	9.9	9.3	9.9	29.1	-0.5
A088350	한화생명	9.2	9.8	9.9	28.9	8.6
A139480	이마트	7.9	9.9	9.9	27.7	4.7
A139130	iM금융지주	9.3	9.4	8.9	27.6	1.6
A294870	HDC현대산업개발	9.5	9.5	8.1	27.1	8.1
A015760	한국전력	9.9	8.7	8.3	27.0	7.9
A023530	롯데쇼핑	7.9	10.0	9.0	26.9	11.4

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/9일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
48.0	0.6

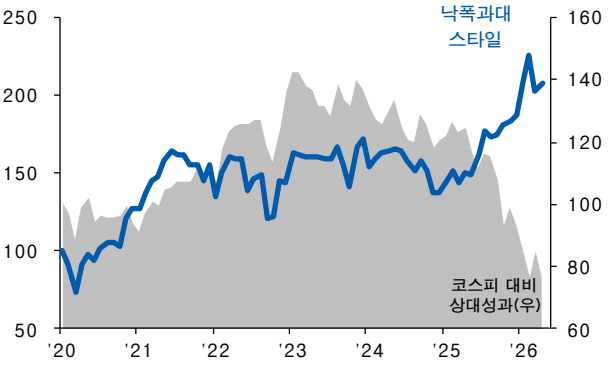
(2020.01.31=100pt)



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	초과 수익률(%)
45.3	-0.4

(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	9.9	39.7	36.7
A353200	대덕전자	9.8	9.5	9.9	9.8	38.9	7.6
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.5	9.4	9.1	37.8	-13.3
A272210	한화시스템	8.8	9.8	9.0	9.4	37.0	1.6
A263750	펄어비스	9.9	9.7	9.1	8.2	36.8	-11.0
A120110	코오롱인더	9.3	9.4	9.5	8.6	36.7	10.9
A066970	엘앤에프	9.6	9.1	9.1	8.4	36.0	9.9
A010120	LS ELECTRIC	7.0	9.2	9.7	9.6	35.4	2.5
A278470	에이피알	9.3	8.9	6.8	9.8	34.7	11.8
A009150	삼성전기	6.8	9.3	9.4	9.2	34.6	13.1

낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A122870	와이지엔터테인먼트	9.7	9.7	9.9	7.5	36.7	-1.9
A376300	디어유	7.6	9.8	9.8	9.2	36.4	2.5
A041510	에스엠	8.4	10.0	9.9	8.2	36.4	-0.1
A293490	카카오게임즈	6.8	9.5	9.3	9.2	34.8	6.9
A039130	하나투어	6.7	9.4	9.0	9.5	34.6	2.0
A361610	SK아이이테크놀로지	7.8	8.8	8.8	9.1	34.5	8.3
A253450	스튜디오드래곤	7.3	9.0	8.8	9.3	34.4	-1.3
A067160	SOOP	6.6	8.7	9.1	9.9	34.4	2.8
A035720	카카오	9.1	9.7	9.4	5.9	34.2	4.7
A035420	NAVER	7.6	9.2	9.6	7.7	34.1	2.1

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/9일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

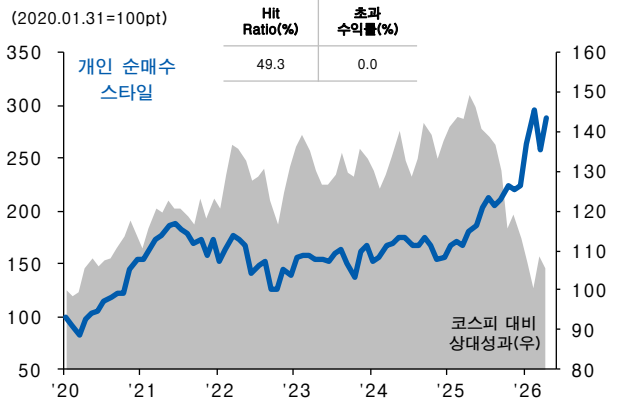
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

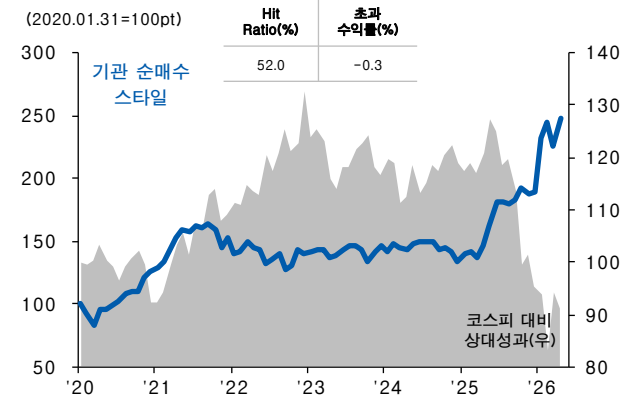


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A103140	풍산	10.0	9.9	9.9	9.9	39.6	7.0
A005380	현대차	9.7	9.8	9.8	9.6	38.9	4.2
A375500	DL이앤씨	9.6	9.4	9.3	9.4	37.7	25.8
A204320	HL만도	7.8	9.9	9.8	10.0	37.4	5.0
A122870	와이젠인터	9.9	9.0	10.0	8.5	37.3	-1.9
A006360	GS건설	9.8	9.4	9.1	8.9	37.2	30.5
A079550	LIG넥스원	9.7	9.3	9.2	8.6	36.8	3.5
A035420	NAVER	8.8	8.1	9.6	9.8	36.3	2.1
A004020	현대제철	9.6	9.7	9.6	7.0	35.8	14.0
A000660	SK하이닉스	8.5	8.9	9.1	8.7	35.2	13.9

기관 순매수 스타일 성과 추이

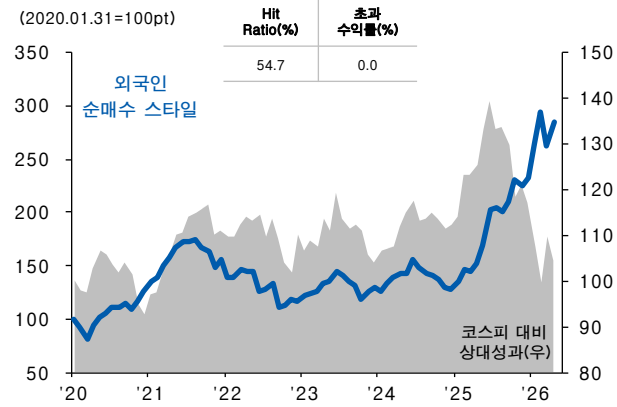


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A012510	더존비즈온	10.0	10.0	9.9	9.8	39.6	0.3
A403870	HPSP	9.7	9.9	9.9	9.9	39.4	6.8
A240810	원익IPS	9.5	9.9	10.0	9.9	39.2	4.2
A058470	리노공업	9.6	9.8	9.8	9.8	38.9	2.8
A034230	파라다이스	9.0	9.7	9.6	10.0	38.2	-1.3
A120110	코오롱인더	9.8	9.4	9.5	9.5	38.1	10.9
A353200	대덕전자	9.8	9.6	9.1	9.5	38.0	7.6
A001120	LX인터내셔널	9.3	9.6	9.4	9.7	38.0	-11.8
A166090	하나머티리얼즈	9.4	9.2	9.7	9.2	37.5	7.2
A237690	에스티팜	8.4	9.7	9.7	9.6	37.3	2.2

외국인 순매수 스타일 성과 추이



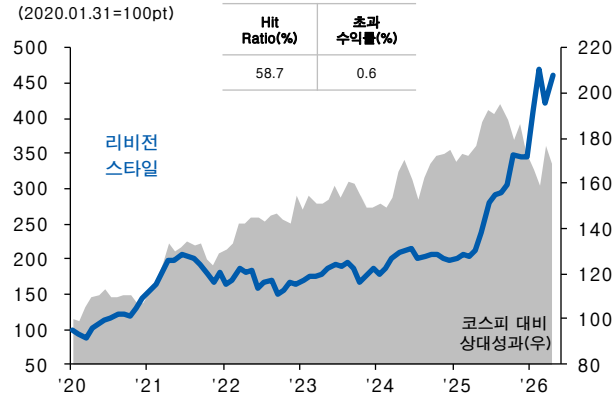
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A278470	에이피알	9.5	9.9	9.9	9.9	39.1	11.8
A004170	신세계	9.5	9.9	9.6	9.5	38.4	13.3
A192820	코스맥스	9.6	9.8	9.3	8.5	37.1	-1.8
A069620	대웅제약	8.6	8.8	9.9	9.7	37.0	-5.4
A011780	금호석유화학	9.6	8.8	9.3	9.1	36.7	10.6
A195870	해성디에스	7.5	9.7	9.8	9.7	36.7	1.3
A222800	심텍	9.9	9.6	7.4	9.5	36.2	34.3
A271560	오리온	8.8	9.4	8.5	9.4	36.0	0.5
A336260	두산퓨얼셀	8.4	7.9	9.8	9.8	35.8	-6.0
A195940	HK이노엔	9.0	8.7	9.1	8.7	35.4	1.1

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/9일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

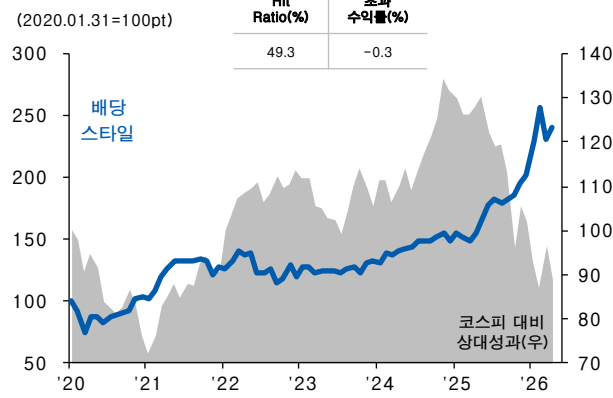
리비전 스타일 성과 추이



리비전 스코어 Top 10 (단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.1	9.4	8.8	27.2	9.5
A000660	SK하이닉스	9.5	9.1	8.7	27.2	13.9
A263750	펄어비스	9.8	9.6	6.2	25.6	-11.0
A353200	대덕전자	8.1	8.9	8.1	25.1	7.6
A010950	S-Oil	9.5	9.5	6.0	25.0	7.6
A006800	미래에셋증권	6.5	9.5	8.7	24.7	7.6
A004000	롯데정밀화학	9.4	9.5	5.7	24.5	8.8
A036570	엔씨소프트	9.3	9.4	5.7	24.3	10.5
A011200	HMM	6.6	9.1	8.5	24.2	4.0
A052690	한전기술	8.5	8.2	6.6	23.2	4.4

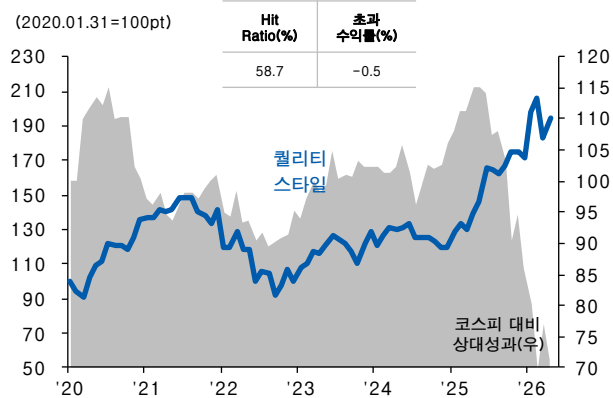
배당 스타일 성과 추이



배당 스코어 Top 10 (단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.6	9.8	9.3	9.9	37.7	-0.3
A214320	이노션	7.9	9.9	9.2	9.9	36.9	1.6
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.3	9.8	36.5	0.7
A005940	NH투자증권	7.5	9.6	9.9	9.3	36.3	11.8
A035250	강원랜드	8.5	9.7	8.2	9.5	35.9	1.1
A001120	LX인터내셔널	7.9	9.2	9.8	8.9	35.7	-11.8
A032640	LG유플러스	8.1	9.4	9.0	8.7	35.2	5.5
A023530	롯데쇼핑	9.8	8.9	8.5	7.9	35.1	11.4
A016360	삼성증권	6.2	9.5	9.5	9.6	34.7	10.3
A024110	기업은행	5.1	9.8	9.9	9.7	34.5	2.1

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	9.2	38.2	6.8
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	2.8
A042700	한미반도체	9.6	9.4	9.4	9.7	38.1	10.1
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	0.1
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.3	13.9
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.8	37.1	0.7
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.4	2.9
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	3.8
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.1	35.8	2.3
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.9	35.3	2.5

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/9일 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.