

Y U A N T A

# Quant Weekly Evaluation Report

4월 3주차 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 흐름이 나타날 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 3주차] 1) Bear Beta 대비 Bull Beta가 높은 2) 12MF 영업이익 및 순이익 1M 조정률 상위 20% 종목 스크리닝**

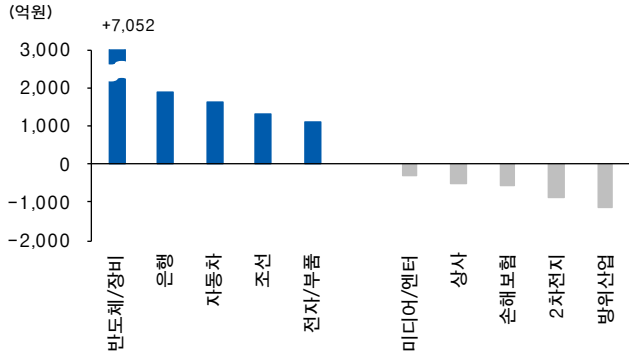
종목명	업종	시가총액 (억원)	60일 베타		12MF 영업이익(억원, %)			12MF 순이익(억원, %)		
			Bull	Bear	3/16일 기준	4/16일 기준	변동률	3/16일 기준	4/16일 기준	변동률
삼성전자	반도체	12,715,656	1.44	1.08	2,217,500	3,354,735	51.3	1,852,043	2,720,006	46.9
SK하이닉스	반도체	8,231,712	1.42	0.98	1,828,485	2,489,950	36.2	1,480,693	1,994,083	34.7
미래에셋증권	증권	395,941	1.37	1.35	26,921	31,763	18.0	19,594	23,697	20.9
삼성전기	IT하드웨어	477,293	1.13	0.83	15,256	16,375	7.3	12,145	12,922	6.4
효성중공업	기계	278,804	1.03	0.96	11,707	12,292	5.0	8,558	9,169	7.1
LS ELECTRIC	기계	282,900	1.32	1.22	6,610	7,540	14.1	4,774	5,509	15.4
리노공업	반도체	87,644	1.26	0.71	2,093	2,386	14.0	1,784	2,056	15.3
이오테크닉스	반도체	58,210	1.55	0.81	1,259	1,419	12.7	1,034	1,178	14.0
대덕전자	IT하드웨어	46,106	1.19	1.04	1,954	2,160	10.6	1,613	1,793	11.2
티씨케이	반도체	33,985	1.55	0.91	1,279	1,360	6.3	1,055	1,121	6.2
피에스케이	반도체	25,838	1.52	1.08	1,237	1,485	20.0	1,071	1,283	19.8
하나마이크론	반도체	23,030	1.29	0.79	2,522	2,707	7.3	1,056	1,164	10.2
RFHIC	IT하드웨어	24,801	1.84	0.98	546	588	7.7	449	490	9.2
하나머티리얼즈	반도체	14,240	1.73	0.70	827	995	20.3	668	781	17.1

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터

### 주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 외국인은 약 +1.1조원 순매수, 기관은 약 +1.3조원 순매수. 미국-이란 지정학적 리스크 해소 기대감에 외국인은 2주 연속 순매수
- 다만, 외국인과 기관은 반도체/장비, 전자/부품 업종을 동시 순매수한 반면, 방위산업 업종을 동시 순매도. 삼성전자, SK하이닉스, 현대차 등이 기관+외국인 순매수 전환 상위에 스크리닝

#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

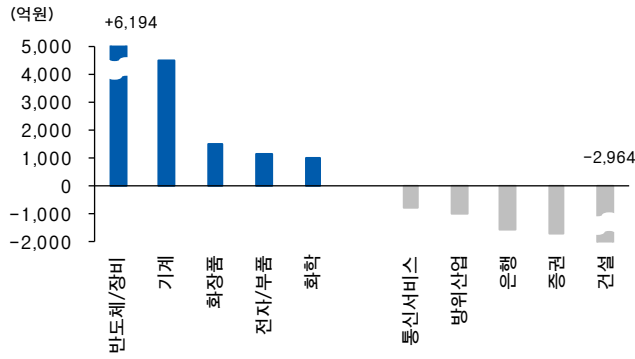


#### 기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	7,052	1,750	92,137	
2	은행	1,885	10,890	20,875	
3	자동차	1,642	-1,949	-2,847	
4	조선	1,306	2,834	-5,049	
5	전자/부품	1,089	6,351	7,361	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	방위산업	-1,158	3,397	7,140	
2	2차전지	-864	11,526	22,066	
3	손해보험	-544	-654	1,825	
4	상사	-529	280	3,487	
5	미디어/엔터	-288	-3,688	-4,989	

#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

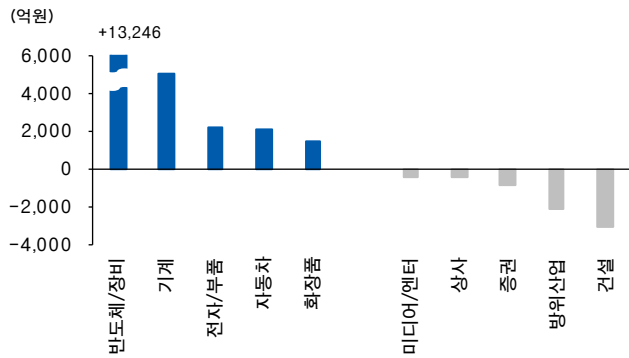


#### 외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	6,194	-126,688	-470,812	
2	기계	4,510	4,625	24,177	
3	화장품	1,528	2,813	14,878	
4	전자/부품	1,140	2,707	5,846	
5	화학	1,016	2,496	9,682	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	건설	-2,964	-13,232	-8,437	
2	증권	-1,721	-4,135	-14,657	
3	은행	-1,527	-9,716	-13,127	
4	방위산업	-977	5,361	-9,693	
5	통신서비스	-806	217	2,434	

#### 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	13,246	-124,938	-378,675	
2	기계	5,015	11,348	31,617	
3	전자/부품	2,229	9,059	13,207	
4	자동차	2,033	-19,174	-85,205	
5	화장품	1,404	3,514	16,224	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	건설	-3,050	-11,282	-7,265	
2	방위산업	-2,135	8,757	-2,554	
3	증권	-832	-2,395	-8,970	
4	상사	-486	664	3,345	
5	미디어/엔터	-416	-4,578	-849	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 4/16일 기준

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A183300	코미코	반도체/장비	15,796	261	0.45
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	30,127	300	0.27
A222800	심텍	전자/부품	28,417	275	0.26
A161890	한국콜마	화장품	19,946	193	0.25
A060250	NHN KCP	SW/SI	8,434	72	0.24
A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	57,415	512	0.24
A008770	호텔신라	호텔/레저	21,115	184	0.23
A257720	실리콘투	화장품	28,690	262	0.23
A375500	DLO앤씨	건설	38,307	286	0.19
A011070	LGI노텍	전자/부품	89,698	503	0.14

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A001440	대한전선	기계	78,494	2,089	0.76
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	30,127	582	0.52
A008770	호텔신라	호텔/레저	21,115	306	0.39
A060250	NHN KCP	SW/SI	8,434	110	0.37
A011790	SKC	화학	46,199	483	0.31
A278470	에이피알	화장품	155,181	1,415	0.23
A139480	이마트	소매/유통	28,562	253	0.23
A248070	솔루엠	전자/부품	9,415	80	0.22
A112610	씨에스윈드	기계	28,086	227	0.21
A034020	두산에너지빌리티	기계	709,742	5,294	0.20

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A001440	대한전선	기계	78,494	2,361	0.9
A336260	두산퓨얼셀	2차전지	30,127	882	0.8
A008770	호텔신라	호텔/레저	21,115	490	0.6
A060250	NHN KCP	SW/SI	8,434	183	0.6
A183300	코미코	반도체/장비	15,796	254	0.4
A011790	SKC	화학	46,199	556	0.4
A257720	실리콘투	화장품	28,690	320	0.3
A034020	두산에너지빌리티	기계	709,742	6,719	0.3
A248070	솔루엠	전자/부품	9,415	81	0.2
A145720	덴티움	의료기기	4,881	41	0.2

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A005930	삼성전자	반도체/장비	12,715,656	6,183.7	-105,589	-302,090
A000660	SK하이닉스	반도체/장비	8,231,712	8,690.6	-16,339	-87,054
A005380	현대차	자동차	1,093,406	1,984.1	-14,114	-76,149
A010130	고려아연	비철금속	353,588	307.2	-5,538	-3,977
A000270	기아	자동차	616,462	49.4	-5,059	-9,057
A028260	삼성물산	지주회사	496,237	298.2	-1,260	-378
A009540	HD한국조선해양	조선	288,754	62.9	-852	104
A018260	삼성에스디에스	SW/SI	147,792	100.7	-690	-1,299
A103140	풍산	비철금속	28,613	107.5	-631	-2,554
A036930	주성엔지니어링	반도체/장비	33,606	181.6	-518	-365

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 4/16일 기준

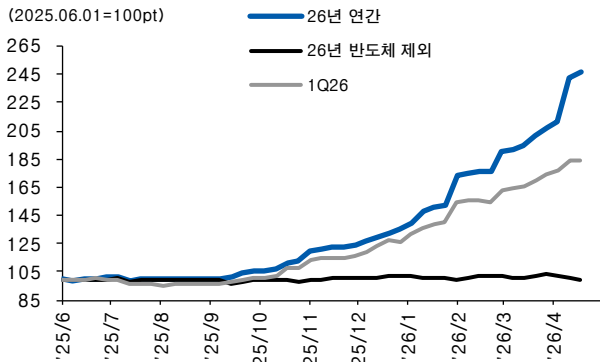
업종별

종목별

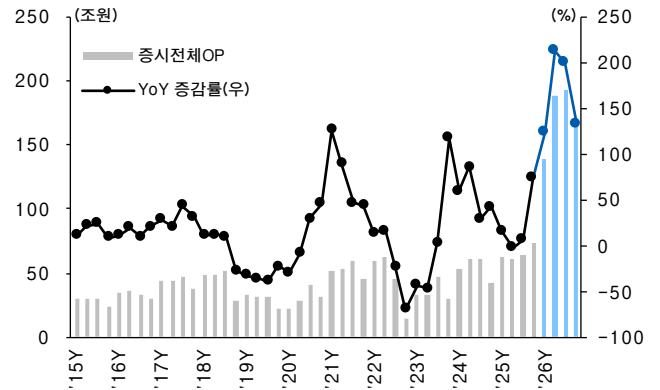
### 주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '26년 연간+2.0% 상향, 반도체 제외 '26년 연간 -1.5% 하향조정
- 26년 1분기 실적시즌이 본격화되며 종목 및 업종의 추정치 급변이 확인. 예컨대, 디스플레이 업종의 경우 약 4주 만에 추정치가 변동되었으며, 1분기 가파른 하향조정이 나타난 반면 연간 기준 상향 조정이 잇따르며 견조한 수익률을 기록

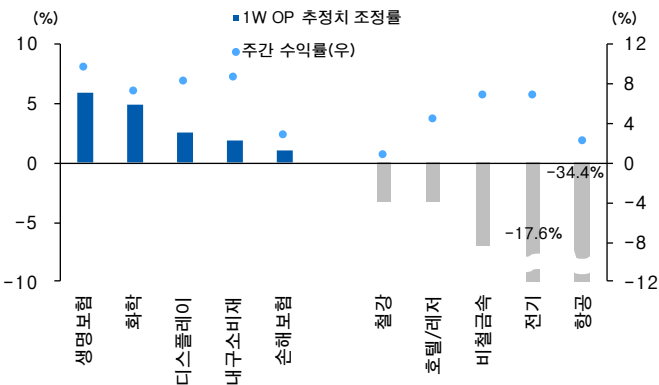
#### 증시 전체 연간, 분기 영업이익의 컨센서스 추이



#### 증시 전체 영업이익의 및 증감률 추이



#### 26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

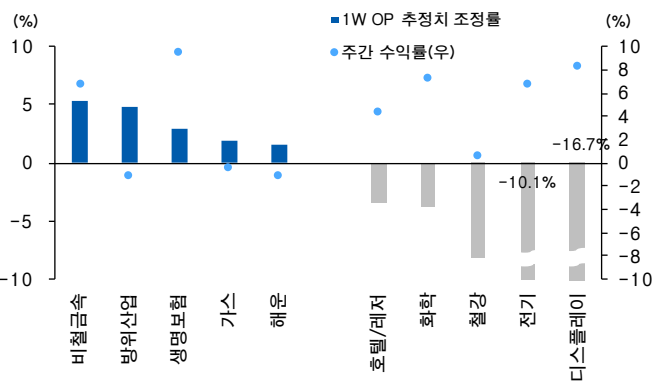


#### 26년 연간 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	생명보험	36,897	5.9	9.6	
2	화학	28,250	5.0	7.2	
3	디스플레이	14,979	2.6	8.3	
4	내구소비재	13,385	1.9	8.5	
5	손해보험	65,388	1.1	2.8	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	항공	8,608	-34.4	2.1	
2	전기	116,240	-17.6	6.8	
3	비철금속	21,722	-7.0	6.8	
4	호텔/레저	8,833	-3.3	4.3	
5	철강	38,477	-3.2	0.7	

#### 26년 1분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위



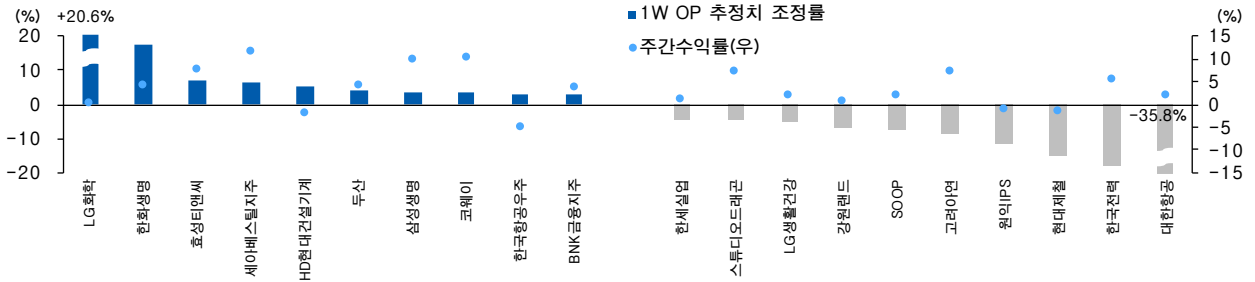
#### 26년 1분기 영업이익의 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	비철금속	6,727	5.3	6.8	
2	방위산업	10,304	4.8	-1.0	
3	생명보험	10,588	2.9	9.6	
4	가스	9,363	1.9	-0.3	
5	해운	4,227	1.6	-1.2	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	디스플레이	1,710	-16.7	8.3	
2	전기	39,800	-10.1	6.8	
3	철강	6,770	-8.2	0.7	
4	화학	418	-3.8	7.2	
5	호텔/레저	1,669	-3.4	4.3	

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
주: 유니버스 200 종목 4/15일 추정치 기준(수익률 4/16일 기준)

'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

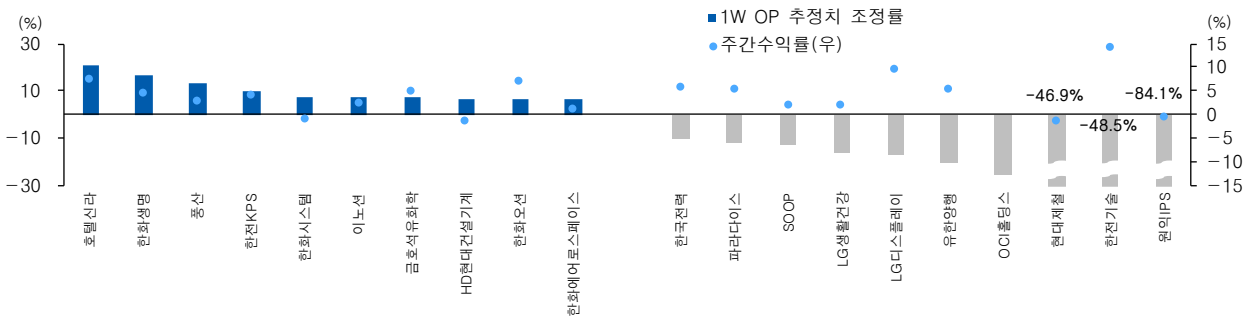


'26년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위: 억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A051910	LG화학	화학	8,045	20.6	0.4	1	A105630	한세실업	섬유/의복	1,020	-4.7	1.2
2	A088350	한화생명	생명보험	6,863	17.5	4.3	2	A253450	스튜디오드래곤	미디어/엔터	547	-4.9	7.2
3	A298020	효성티앤씨	섬유/의복	4,163	6.8	7.8	3	A051900	LG생활건강	화장품	2,691	-5.3	1.8
4	A001430	세아베스틸지주	철강	1,370	6.5	11.7	4	A035250	강원랜드	호텔/레저	2,253	-7.1	0.8
5	A267270	HD현대건설기계	기계	6,479	5.5	-1.8	5	A067160	SOOP	미디어/엔터	1,110	-7.5	1.8
6	A000150	두산	지주회사	15,969	4.1	4.2	6	A010130	고려아연	비철금속	18,179	-8.7	7.1
7	A032830	삼성생명	생명보험	30,033	3.6	10.0	7	A240810	원익IPS	반도체/장비	1,557	-11.8	-1.0
8	A021240	코웨이	내구소비재	9,866	3.4	10.3	8	A004020	현대제철	철강	5,704	-15.3	-1.6
9	A047810	한국항공우주	방위산업	5,085	3.2	-5.0	9	A015760	한국전력	전기	113,709	-17.9	5.5
10	A138930	BNK금융지주	은행	10,948	3.1	3.8	10	A003490	대한항공	항공	8,078	-35.8	2.0

'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 1분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위: 억원, %)

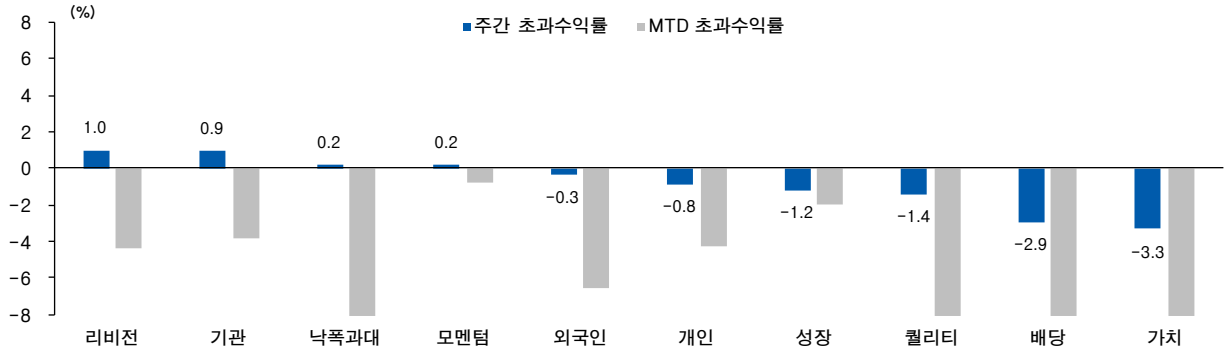
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A008770	호텔신라	호텔/레저	37	20.6	7.4	1	A015760	한국전력	전기	39,349	-10.2	5.5
2	A088350	한화생명	생명보험	2,068	16.8	4.3	2	A034230	파라디스	호텔/레저	372	-12.1	4.9
3	A103140	종산	비철금속	937	13.3	2.6	3	A067160	SOOP	미디어/엔터	260	-13.2	1.8
4	A051600	한전KPS	전기	417	9.7	3.6	4	A051900	LG생활건강	화장품	509	-16.7	1.8
5	A272210	한화시스템	방위산업	610	7.0	-1.1	5	A034220	LG디스플레이	디스플레이	1,549	-17.6	9.2
6	A214320	이노션	미디어/엔터	321	7.0	2.0	6	A000100	유한양행	제약/바이오	140	-20.7	5.2
7	A011780	금호석유화학	화학	756	6.9	4.6	7	A010060	OCI홀딩스	화학	381	-25.7	52.8
8	A267270	HD현대건설기계	기계	1,538	6.8	-1.8	8	A004020	현대제철	철강	531	-46.9	-1.6
9	A042660	한화오션	조선	3,655	6.5	6.9	9	A052690	한전기술	전기	35	-48.5	13.9
10	A012450	한화에어로스페이스	방위산업	7,668	6.1	0.8	10	A240810	원익IPS	반도체/장비	18	-84.1	-1.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 4/15일 추정치 기준(수익률 4/16일 기준)

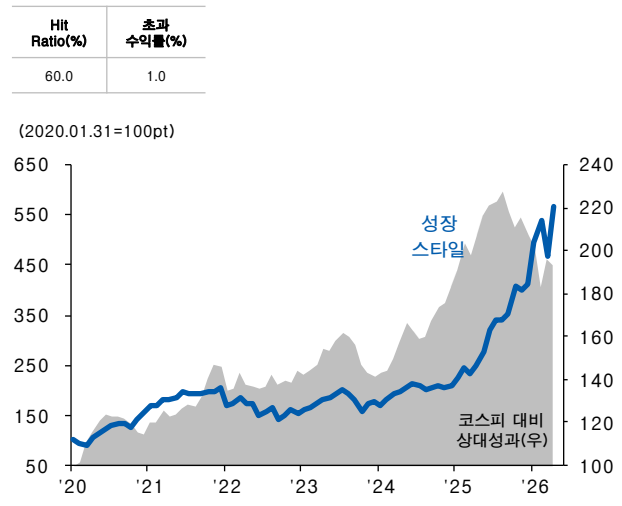
업종별

종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

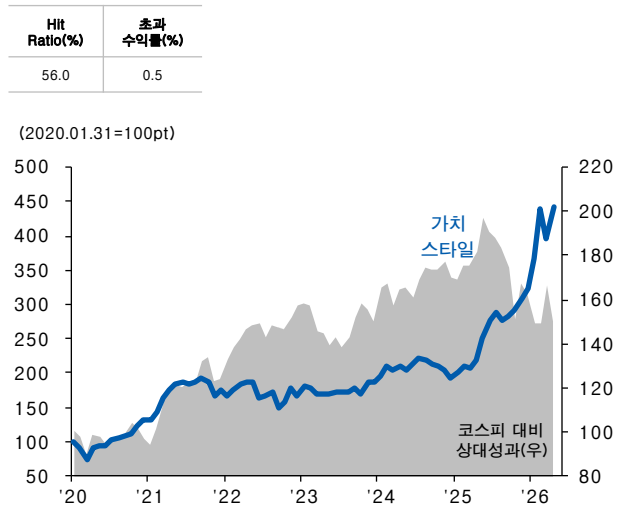


성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.4	9.7	9.6	28.6	5.6
A353200	대덕전자	8.7	9.7	9.4	27.9	3.8
A298040	효성중공업	7.2	8.5	8.4	24.1	1.7
A068270	셀트리온	8.0	8.1	7.9	24.0	4.7
A267270	HD건설기계	7.7	7.9	8.4	23.9	-1.8
A267250	HD현대	6.5	8.4	8.9	23.8	2.8
A010130	고려아연	8.4	7.0	8.2	23.6	7.1
A278470	에이피알	9.6	8.7	5.2	23.5	5.5
A009150	삼성전기	6.8	8.2	7.8	22.8	13.1
A064350	현대로템	8.0	7.6	7.2	22.8	2.4

가치 스타일 성과 추이



가치 스코어 Top 10

(단위: %)

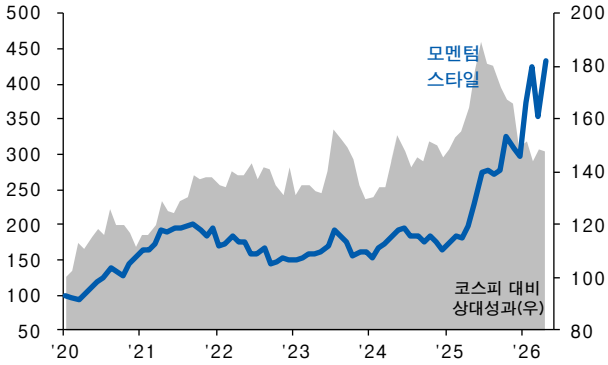
종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A036460	한국가스공사	9.8	9.7	9.9	29.4	-1.0
A000370	한화손해보험	9.8	9.7	9.9	29.4	4.2
A011170	롯데케미칼	10.0	9.7	9.4	29.1	-3.3
A001450	현대해상	9.9	9.3	9.9	29.1	0.2
A088350	한화생명	9.2	9.8	9.9	28.9	4.3
A139480	이마트	7.9	9.9	9.9	27.7	9.6
A139130	iM금융지주	9.3	9.4	8.9	27.6	3.5
A294870	HDC현대산업개발	9.5	9.5	8.1	27.1	4.0
A015760	한국전력	9.9	8.7	8.3	27.0	5.5
A023530	롯데쇼핑	7.9	10.0	9.0	26.9	14.0

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/16일 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

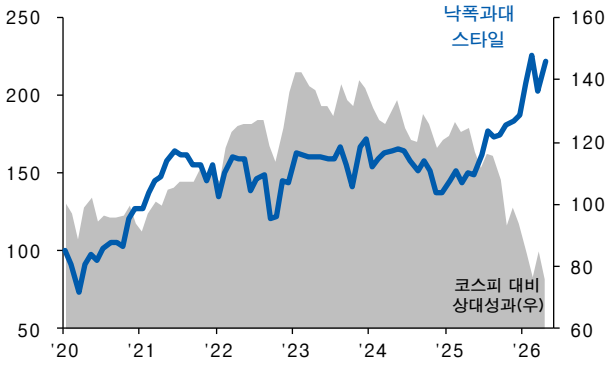
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A047040	대우건설	10.0	10.0	10.0	9.9	39.7	17.7
A353200	대덕전자	9.8	9.5	9.9	9.8	38.9	3.8
A010060	OCI홀딩스	9.8	9.5	9.4	9.1	37.8	52.8
A272210	한화시스템	8.8	9.8	9.0	9.4	37.0	-1.1
A263750	펄어비스	9.9	9.7	9.1	8.2	36.8	-0.5
A120110	코오롱인더	9.3	9.4	9.5	8.6	36.7	0.1
A066970	엘앤에프	9.6	9.1	9.1	8.4	36.0	-9.3
A010120	LS ELECTRIC	7.0	9.2	9.7	9.6	35.4	19.7
A278470	에이피알	9.3	8.9	6.8	9.8	34.7	5.5
A009150	삼성전기	6.8	9.3	9.4	9.2	34.6	13.1

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		
A122870	와이지엔터테인먼트	9.7	9.7	9.9	7.5	36.7	8.4
A376300	디어유	7.6	9.8	9.8	9.2	36.4	10.6
A041510	에스엠	8.4	10.0	9.9	8.2	36.4	13.3
A293490	카카오게임즈	6.8	9.5	9.3	9.2	34.8	2.2
A039130	하나투어	6.7	9.4	9.0	9.5	34.6	5.3
A361610	SK아이이테크놀로지	7.8	8.8	8.8	9.1	34.5	2.4
A253450	스튜디오드래곤	7.3	9.0	8.8	9.3	34.4	7.2
A067160	SOOP	6.6	8.7	9.1	9.9	34.4	1.8
A035720	카카오	9.1	9.7	9.4	5.9	34.2	6.1
A035420	NAVER	7.6	9.2	9.6	7.7	34.1	8.2

자료: 에프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/16일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0-10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

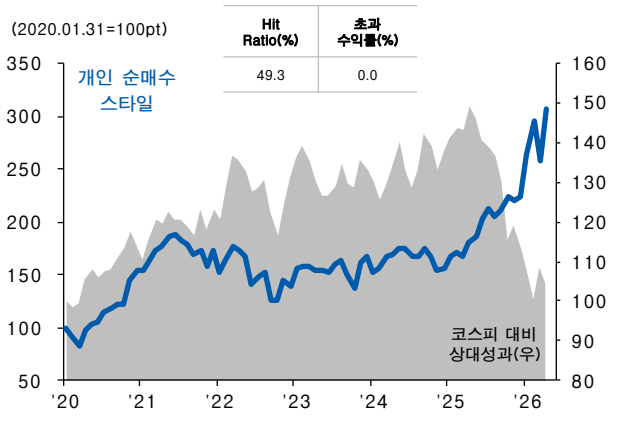
성장/가치

주가

수급

기타

개인 순매수 스타일 성과 추이

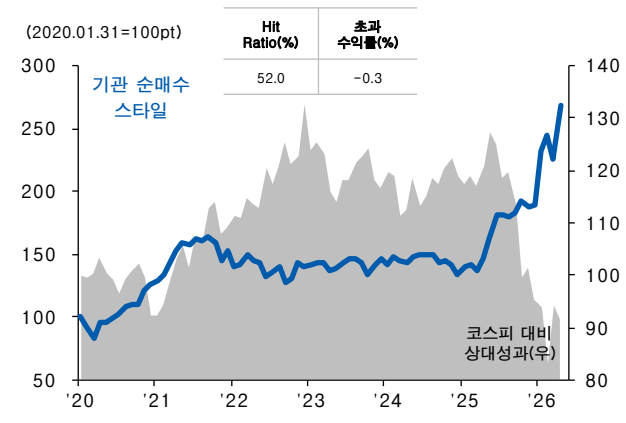


개인 순매수 스코어 Top 10

(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	2.6
A005380	현대차	9.7	9.8	9.8	9.6	38.9	9.1
A375500	DL이앤씨	9.6	9.4	9.3	9.4	37.7	4.8
A204320	HL만도	7.8	9.9	9.8	10.0	37.4	5.5
A122870	와이지엔터	9.9	9.0	10.0	8.5	37.3	8.4
A006360	GS건설	9.8	9.4	9.1	8.9	37.2	5.0
A079550	LIG넥스원	9.7	9.3	9.2	8.6	36.8	-4.1
A035420	NAVER	8.8	8.1	9.6	9.8	36.3	8.2
A004020	현대제철	9.6	9.7	9.6	7.0	35.8	-1.6
A000660	SK하이닉스	8.5	8.9	9.1	8.7	35.2	12.5

기관 순매수 스타일 성과 추이

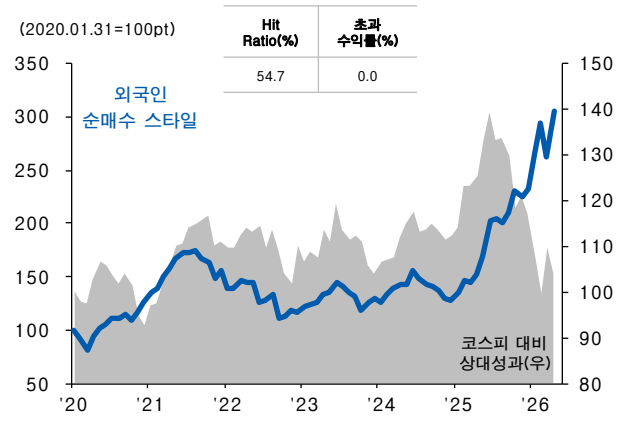


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A012510	더존비즈온	10.0	10.0	9.9	9.8	39.6	0.0
A403870	HPSP	9.7	9.9	9.9	9.9	39.4	-3.1
A240810	원익IPS	9.5	9.9	10.0	9.9	39.2	-1.0
A058470	리노공업	9.6	9.8	9.8	9.8	38.9	2.9
A034230	파라다이스	9.0	9.7	9.6	10.0	38.2	4.9
A120110	코오롱인더	9.8	9.4	9.5	9.5	38.1	0.1
A353200	대덕전자	9.8	9.6	9.1	9.5	38.0	3.8
A001120	LX인터내셔널	9.3	9.6	9.4	9.7	38.0	5.1
A166090	하나머티리얼즈	9.4	9.2	9.7	9.2	37.5	19.0
A237690	에스티팜	8.4	9.7	9.7	9.6	37.3	2.4

외국인 순매수 스타일 성과 추이



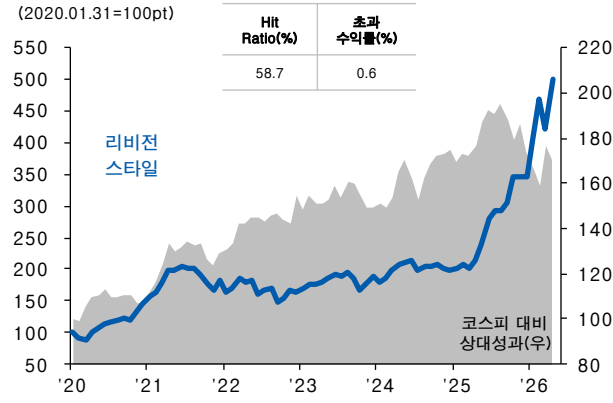
외국인 순매수 스코어 Top 10

(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	5.5
A004170	신세계	9.5	9.9	9.6	9.5	38.4	10.1
A192820	코스맥스	9.6	9.8	9.3	8.5	37.1	9.0
A069620	대웅제약	8.6	8.8	9.9	9.7	37.0	4.1
A011780	금호석유화학	9.6	8.8	9.3	9.1	36.7	4.6
A195870	해성디에스	7.5	9.7	9.8	9.7	36.7	8.0
A222800	심텍	9.9	9.6	7.4	9.5	36.2	11.7
A271560	오리온	8.8	9.4	8.5	9.4	36.0	4.0
A336260	두산퓨얼셀	8.4	7.9	9.8	9.8	35.8	27.1
A195940	HK이노엔	9.0	8.7	9.1	8.7	35.4	9.4

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/16일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10  
 주3) 초과수익률: KOSPI 대비 월평균 초과수익률

리비전 스타일 성과 추이

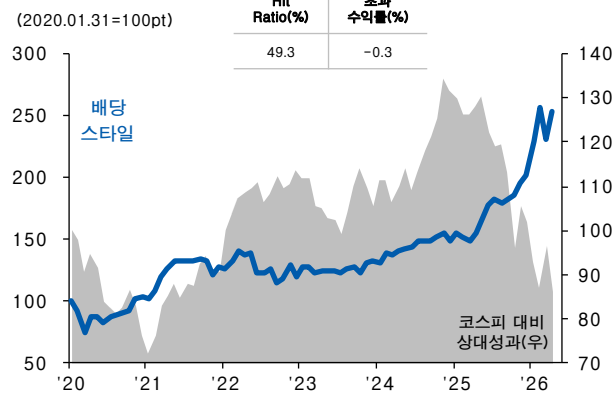


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.1	9.4	8.8	27.2	5.6
A000660	SK하이닉스	9.5	9.1	8.7	27.2	12.5
A263750	펄어비스	9.8	9.6	6.2	25.6	-0.5
A353200	대덕전자	8.1	8.9	8.1	25.1	3.8
A010950	S-Oil	9.5	9.5	6.0	25.0	-2.2
A006800	미래에셋증권	6.5	9.5	8.7	24.7	7.2
A004000	롯데정밀화학	9.4	9.5	5.7	24.5	5.7
A036570	엔씨소프트	9.3	9.4	5.7	24.3	11.0
A011200	HMM	6.6	9.1	8.5	24.2	-2.1
A052690	한전기술	8.5	8.2	6.6	23.2	13.9

배당 스타일 성과 추이

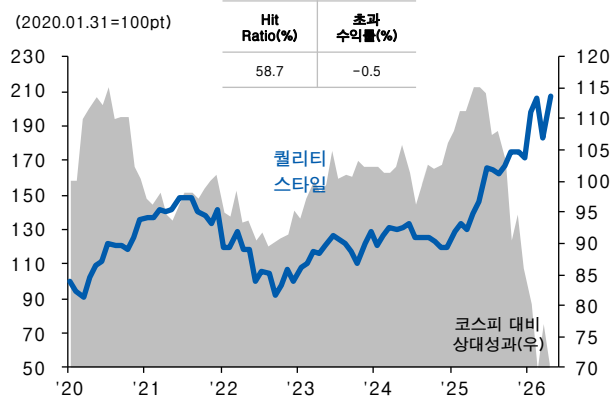


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.6	9.8	9.3	9.9	37.7	2.0
A214320	이노션	7.9	9.9	9.2	9.9	36.9	2.0
A001740	SK네트웍스	9.4	9.0	8.3	9.8	36.5	2.8
A005940	NH투자증권	7.5	9.6	9.9	9.3	36.3	3.4
A035250	강원랜드	8.5	9.7	8.2	9.5	35.9	0.8
A001120	LX인터내셔널	7.9	9.2	9.8	8.9	35.7	5.1
A032640	LG유플러스	8.1	9.4	9.0	8.7	35.2	-1.6
A023530	롯데쇼핑	9.8	8.9	8.5	7.9	35.1	14.0
A016360	삼성증권	6.2	9.5	9.5	9.6	34.7	3.6
A024110	기업은행	5.1	9.8	9.9	9.7	34.5	2.2

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	-3.1
A058470	리노공업	10.0	9.7	9.7	8.9	38.1	2.9
A042700	한미반도체	9.6	9.4	9.4	9.7	38.1	2.1
A214150	클래시스	9.1	9.8	9.6	9.3	37.8	6.3
A000660	SK하이닉스	7.9	9.8	9.7	9.9	37.3	12.5
A462870	시프트업	9.6	9.9	9.9	7.8	37.1	2.6
A145020	휴젤	9.9	9.7	9.3	7.6	36.4	2.7
A326030	SK바이오팜	8.0	9.1	9.6	9.4	36.1	8.0
A214450	파마리서치	8.0	9.5	9.2	9.1	35.8	2.6
A376300	디어유	9.7	9.5	9.2	6.9	35.3	10.6

자료: 예프앤가이드 Quantwise, 유안타증권 리서치센터  
 주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱  
 주2) 4/16일 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.