YUANTA

Quant Weekly Evaluation Report

11월 3주차 사이클 하락기 대응 스크리닝



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

유안타증권
Yuanta Securities (Korea)

CONTENTS

Ⅰ 주간 스크리닝

사이클 하락기 대응 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@yuantakorea.com

사이클 하락기 대응 스크리닝 (참고 자료: 사이클 하락기 투자 지침서)

1) '27년 이익 사이클(12MF EPS YoY)의 하락은 기저 부담에 따라 산술적으로 예정된 수순. 사이클 하락기 주도 업종의 이익 및 주가 모멘텀이 둔화되며 시장의 시선은 분산, 쏠림은 완화

2) 이에 따라, 업종 전반에 종목이 분포된 스타일 전략의 성과는 확대. 그 중 리비전과 사이클(12MF 순이익 YoY) 상위 스타일이 하락 사이클 가장 안정적인 성과(Hit Ratio 60% 상회)를 기록

3) 결국, 증시 전반의 이익 및 주가 모멘텀이 둔화되는 국면 개별 이익 사이클이 견조한 업종 및 종목에 대한 접근이 유효. 최종적으로 '26~'28년 성장 경로와 리비전 및 사이클 스코어 상위 종목을 스크리닝

[11월 3주차] 1) 1개월 12MF 순이익 조정률, 2) 3개월 YoY 사이클 증감, 3) '26→'27→'28년 성장률 스코어 상위 30%

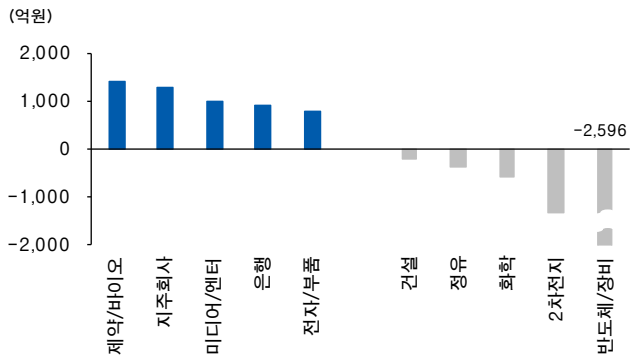
종목명	업종	시가총액 (억원)	12MF 순이익(억원, %)			3M YoY 사이클 변화 (%p)	연간 순이익 추정치(억원)		
			-1M 기준	최근	조정률		'26	'27	'28
삼성전기	IT하드웨어	605,019	28,945	34,614	19.6	41.5	17,267	36,192	54,835
롯데지주	상사,자본재	22,474	753	857	13.7	178.8	463	893	1,573
대한항공	운송	115,253	11,221	13,138	17.1	39.2	5,574	13,826	17,589
쎄트렉아이	상사,자본재	6,976	174	283	62.9	92.8	133	296	357
삼성SDI	IT가전	350,144	13,603	13,702	0.7	138.2	8,033	14,217	22,427
LS ELECTRIC	기계	174,000	7,422	8,175	10.1	13.4	5,599	8,409	10,983
디아이	반도체	7,924	691	891	29.0	171.8	709	908	1,157
포스코퓨처엠	화학	147,740	723	736	1.8	47.4	590	749	1,407
피에스케이홀딩스	반도체	27,384	2,082	2,125	2.1	34.9	1,408	2,190	2,801
SFA	기계	8,349	1,155	1,332	15.3	15.9	767	1,383	1,577
동아제약	건강관리	5,978	873	989	13.3	14.8	818	1,005	1,318
LS마린솔루션	건설,건축관련	12,381	409	397	-2.9	18.1	235	412	590
코스맥스	화장품,의류,완구	33,595	2,138	2,360	10.3	36.9	1,812	2,410	2,940
GS건설	건설,건축관련	26,145	3,331	3,536	6.2	11.8	1,597	3,713	4,138
CJ제일제당	필수소비재	27,700	3,954	4,041	2.2	5.2	2,151	4,212	4,812
두산	상사,자본재	83,716	7,415	9,544	28.7	42.7	6,773	9,796	10,815
두산에너빌리티	기계	275,762	5,660	5,034	-11.1	14.7	2,748	5,242	7,608
한전기술	유틸리티	25,416	822	745	-9.4	20.6	460	771	1,123
HPSP	반도체	31,151	1,667	1,733	3.9	15.1	1,174	1,784	2,032
현대건설	건설,건축관련	87,080	6,324	6,198	-2.0	21.3	4,422	6,360	7,921
한화솔루션	에너지	47,115	6,196	4,065	-34.4	529.5	2,125	4,241	6,577

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 스코어 내림차순

주간 수급 Comment

- 유니버스 200 종목 기준 이번주 기관은 약 +5,432억원 순매수, 외국인은 약 -3.3조원 순매도. 기관은 약 7주 연속 순매수, 외국인은 약 3주간 순매도를 지속하며 총-13.5조원 순매도
- 기관과 외국인은 반도체/장비, 2차전지 업종을 동시 순매도. 종목단에서는 제주항공(089590)이 3주 연속 동시 순매수 상위에 스크리닝

기관 주간 순매수 상/하위 업종

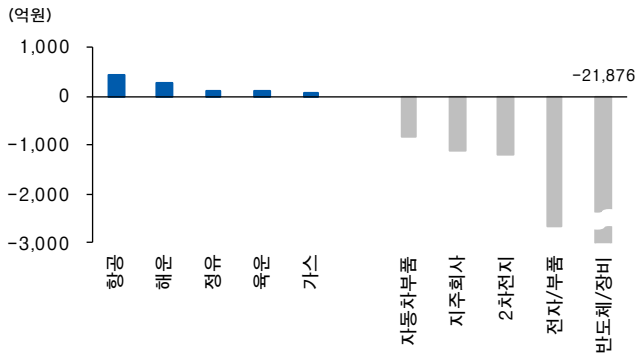


기관 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	제약/바이오	1,410	12,209	17,141	
2	지주회사	1,261	7,578	7,952	
3	미디어/엔터	975	1,339	2,439	
4	은행	912	5,302	24,104	
5	전자/부품	789	-1,307	1,436	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-2,596	32,991	7,771	
2	2차전지	-1,341	401	14,472	
3	화학	-594	-400	3,593	
4	정유	-404	-3,817	913	
5	건설	-207	793	4,620	

외국인 주간 순매수 상/하위 업종

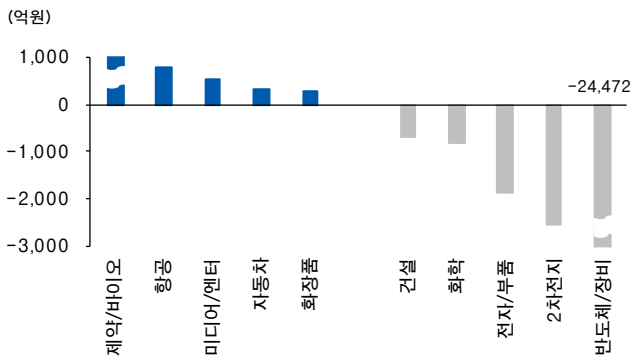


외국인 주간 순매수 상/하위 업종

(단위:억원)

상위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	항공	424	1,837	6,306	
2	해운	254	1,146	2,256	
3	정유	114	2,213	6,301	
4	육운	103	215	250	
5	가스	78	131	322	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-21,876	-106,435	-484,964	
2	전자/부품	-2,647	-17,222	-18,822	
3	2차전지	-1,215	-6,190	-15,591	
4	지주회사	-1,138	2,673	369	
5	자동차부품	-824	-1,646	-3,207	

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	제약/바이오	1,027	8,862	8,969	
2	항공	774	3,765	9,350	
3	미디어/엔터	520	906	578	
4	자동차	335	135	-14,076	
5	화장품	290	160	1,618	
하위	업종	1W 누적	1M 누적	3M 누적	5W 순매수 추이
1	반도체/장비	-24,472	-73,444	-477,192	
2	2차전지	-2,556	-5,789	-1,120	
3	전자/부품	-1,857	-18,529	-17,386	
4	화학	-837	-3,003	-2,394	
5	건설	-702	4,919	4,767	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 11/19일 기준

업종별 종목별

기관 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A241710	코스메카코리아	화장품	9,932	197	0.50
A041510	에스엠	미디어/엔터	17,720	281	0.41
A089590	제주항공	항공	6,000	95	0.40
A069960	현대백화점	소매/유통	18,115	226	0.31
A039130	하나투어	호텔/레저	4,495	40	0.23
A035900	JYP Ent.	미디어/엔터	16,025	119	0.20
A352820	하이브	미디어/엔터	67,117	502	0.20
A034230	파라다이스	호텔/레저	9,244	73	0.19
A195870	해성디에스	반도체/장비	7,659	52	0.19
A403870	HPSP	반도체/장비	33,290	224	0.18

외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A175330	JB금융지주	은행	49,242	746	0.38
A089590	제주항공	항공	6,000	72	0.30
A035760	CJ ENM	미디어/엔터	8,552	53	0.15
A097950	CJ제일제당	음식료	26,044	129	0.12
A257720	실리콘투	화장품	16,328	78	0.11
A145720	덴티움	의료기기	3,277	14	0.10
A240810	원익IPS	반도체/장비	38,874	145	0.10
A139480	이마트	소매/유통	16,941	69	0.09
A000120	CJ대한통운	육운	15,490	49	0.08
A003490	대한항공	항공	116,542	345	0.08

기관 + 외국인 주간 순매수 강도 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적 순매수 대금	순매수 강도
A089590	제주항공	항공	6,000	167	0.7
A039130	하나투어	호텔/레저	4,495	41	0.2
A145720	덴티움	의료기기	3,277	30	0.2
A352820	하이브	미디어/엔터	67,117	571	0.2
A035760	CJ ENM	미디어/엔터	8,552	75	0.2
A272450	진에어	항공	4,275	33	0.2
A034230	파라다이스	호텔/레저	9,244	52	0.1
A003490	대한항공	항공	116,542	575	0.1
A139480	이마트	소매/유통	16,941	82	0.1
A069960	현대백화점	소매/유통	18,115	81	0.1

기관 + 외국인 주간 순매수 전환 상위 종목

(단위:억원, %)

종목 코드	종목	업종	시가총액	1W 누적	1M 누적	3M 누적
A010950	S-Oil	정유	114,722	8.2	-804	805
A267270	HD현대건설기계	기계	43,460	1.9	-373	-1,050
A071050	한국금융지주	증권	68,599	7.7	-364	-230
A329180	HD현대중공업	조선	280,771	42.1	-246	-1,239
A006260	LS	지주회사	58,500	13.1	-234	-589
A240810	원익IPS	반도체/장비	38,874	13.0	-227	-840
A257720	실리콘투	화장품	16,328	12.6	-207	-637
A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	19,847	19.3	-187	145
A237690	에스티팜	제약/바이오	15,219	15.5	-175	-107
A036570	엔씨소프트	인터넷/게임	40,891	107.5	-38	-99

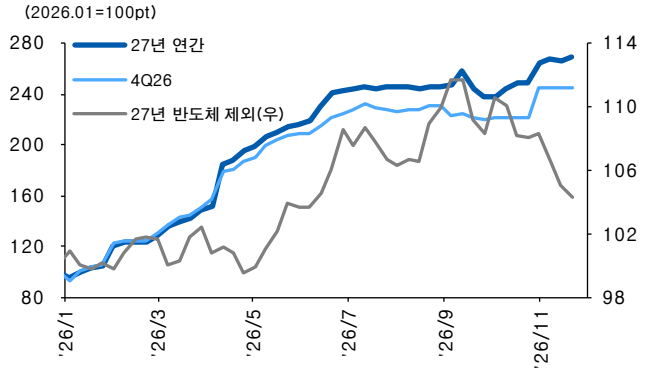
자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 기준, 11/19일 기준

업종별 종목별

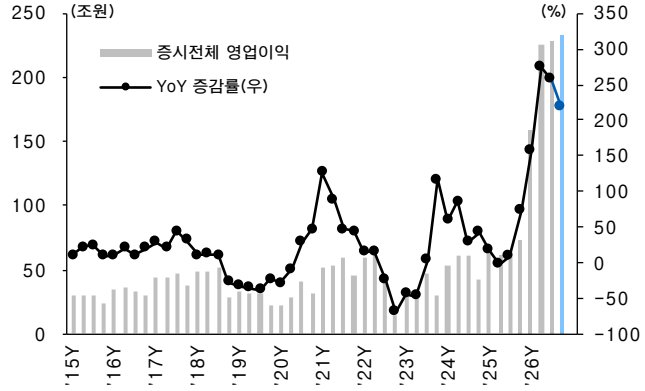
주간 컨센서스 Comment

- 유니버스 200 종목 주간 영업이익 추정치 기준 '27년 연간 +1.3% 상향 조정, 4분기 -0.1% 하향 조정. 3분기 실적시즌 결과 분기말(9월말) 영업이익 추정치 대비 약 103.7%의 달성률을 기록하며 역대 3분기 평균 달성률(96.4%)을 상회하였으나 지수는 부진한 흐름
- '27년 연간 기준 반도체/장비(+1.8%) 업종이 가장 높은 상향 조정률을 기록하였으며, 생명보험(-5.9%) 업종은 가장 높은 하향 조정률을 기록

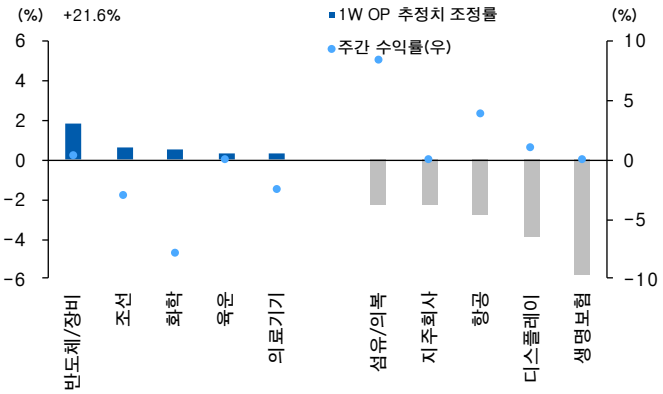
증시 전체 연간, 분기 영업이익 컨센서스 추이



증시 전체 영업이익 및 증감률 추이



27년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

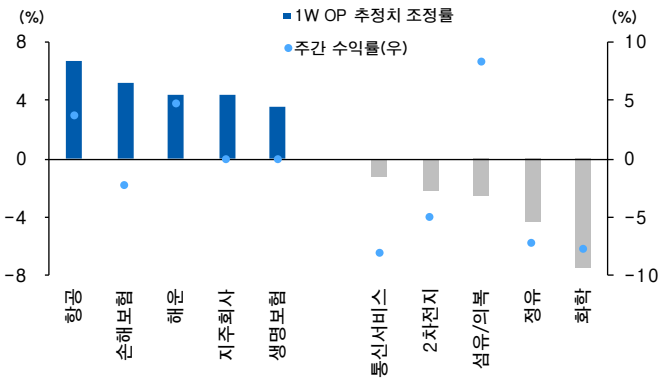


27년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	반도체/장비	10,902,607	1.8	0.3	
2	조선	161,983	0.6	-3.0	
3	화학	65,351	0.6	-7.8	
4	육운	29,195	0.3	0.0	
5	의료기기	5,785	0.3	-2.5	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	생명보험	78,527	-5.9	0.0	
2	디스플레이	9,727	-3.9	1.0	
3	항공	22,799	-2.8	3.7	
4	지주회사	504,318	-2.3	-0.1	
5	섬유/의복	24,108	-2.3	8.3	

26년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



26년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

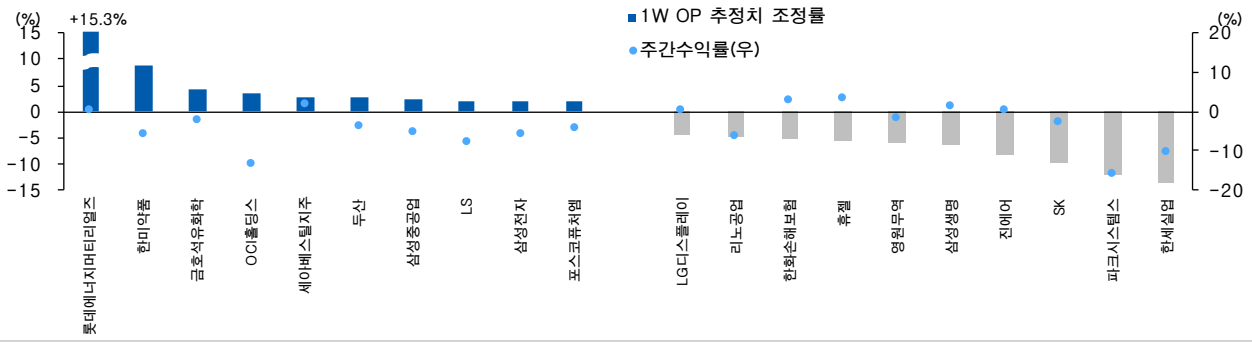
(단위:억원,%)

상위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	항공	1,701	6.7	3.7	
2	손해보험	15,849	5.2	-2.3	
3	해운	10,941	4.4	4.8	
4	지주회사	116,564	4.4	-0.1	
5	생명보험	26,522	3.5	0.0	
하위	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률	5W 추정치 추이
1	화학	4,336	-7.6	-7.8	
2	정유	36,506	-4.4	-7.3	
3	섬유/의복	3,473	-2.6	8.3	
4	2차전지	6,130	-2.1	-5.0	
5	통신서비스	9,651	-1.2	-8.0	

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주: 유니버스 200 종목 11/18일 추정치 기준(수익률 11/19일 기준)

업종별 | 종목별

'27년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



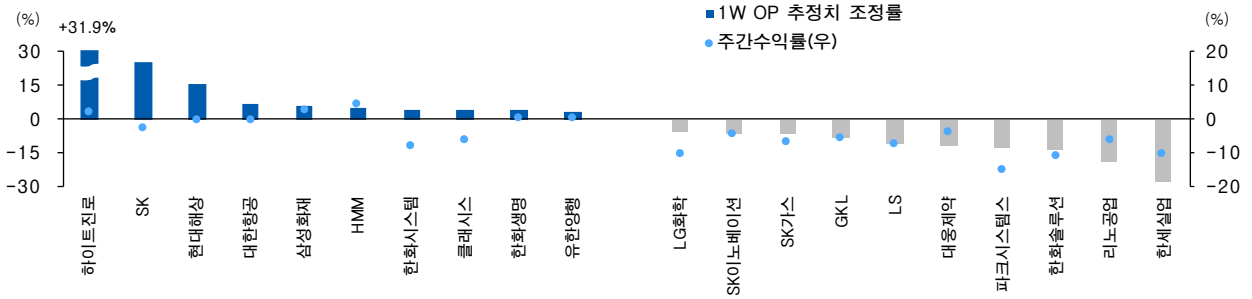
'27년 연간 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A020150	롯데에너지머티리얼즈	전자/부품	140	15.3	0.4
2	A128940	한미약품	제약/바이오	3,073	8.8	-5.8
3	A011780	금호석유화학	화학	3,560	4.3	-1.9
4	A010060	OCI홀딩스	화학	4,963	3.5	-13.1
5	A001430	세아베스틸지주	철강	1,906	2.7	1.8
6	A000150	두산	지주회사	25,233	2.7	-3.6
7	A010140	삼성중공업	조선	20,087	2.3	-5.1
8	A006260	LS	지주회사	23,096	2.1	-7.8
9	A005930	삼성전자	반도체/장비	6,189,189	2.1	-5.5
10	A003670	포스코퓨처엠	2차전지	1,723	2.0	-4.1

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A105630	한세실업	섬유/의복	926	-13.6	-10.4
2	A140860	파크시스템스	전자/부품	639	-11.9	-15.6
3	A034730	SK	지주회사	125,846	-9.9	-2.7
4	A272450	진에어	항공	760	-8.1	0.3
5	A032830	삼성생명	생명보험	70,636	-6.5	1.2
6	A111770	영원무역	섬유/의복	6,522	-6.0	-1.9
7	A145020	휴젤	제약/바이오	2,194	-5.7	3.2
8	A000370	한화손해보험	손해보험	5,257	-5.3	3.0
9	A058470	리노공업	반도체/장비	2,351	-4.8	-6.4
10	A034220	LG디스플레이	디스플레이	8,856	-4.3	0.6

'26년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위



'26년 4분기 영업이익 추정치 1W 조정률 상/하위

(단위:억원, %)

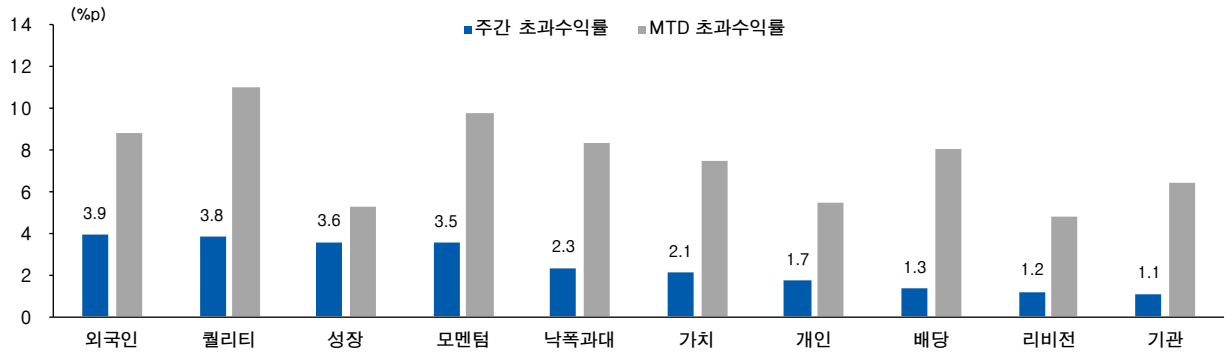
상위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A000080	하이트진로	음식료	169	31.9	2.1
2	A034730	SK	지주회사	29,958	26.0	-2.7
3	A001450	현대해상	손해보험	1,694	15.4	-0.7
4	A003490	대한항공	항공	1,586	6.7	-0.8
5	A000810	삼성화재	손해보험	9,280	6.2	2.5
6	A011200	HMM	해운	8,982	5.5	4.0
7	A272210	한화시스템	방위산업	688	4.4	-8.1
8	A214150	클래시스	의료기기	375	3.9	-6.7
9	A088350	한화생명	생명보험	1,316	3.7	0.3
10	A000100	유한양행	제약/바이오	311	3.7	0.0

하위	종목코드	종목	업종	OP 추정치	1W 조정률	1W 수익률
1	A105630	한세실업	섬유/의복	80	-27.8	-10.4
2	A058470	리노공업	반도체/장비	428	-18.9	-6.4
3	A009830	한화솔루션	화학	858	-13.3	-11.4
4	A140860	파크시스템스	전자/부품	262	-12.4	-15.6
5	A069620	대웅제약	제약/바이오	276	-11.7	-4.2
6	A006260	LS	지주회사	4,662	-11.0	-7.8
7	A114090	GKL	호텔/레저	34	-8.6	-6.1
8	A018670	SK가스	가스	1,099	-6.9	-6.9
9	A096770	SK이노베이션	정유	24,425	-6.4	-4.8
10	A051910	LG화학	화학	3,066	-6.0	-10.3

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터 주: 유니버스 200 종목 11/18일 추정치 기준(수익률 11/19일 기준)

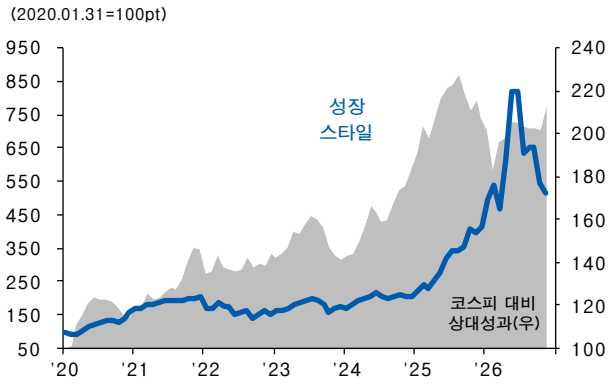
업종별 종목별

주간/MTD KOSPI 대비 초과수익률



성장 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	월평균초과 수익률(%)
57.8	1.0



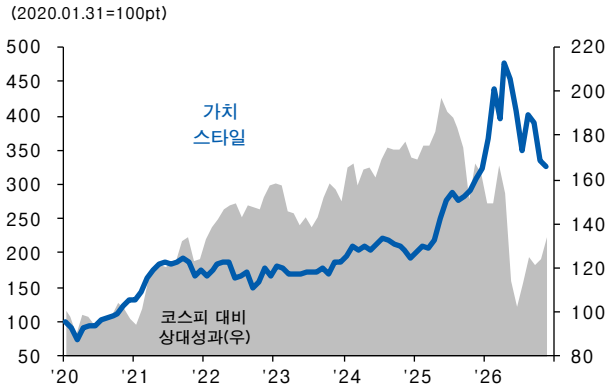
성장 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			성장 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A005930	삼성전자	9.5	9.6	9.5	28.6	-4.4
A009150	삼성전기	8.6	9.5	9.4	27.5	3.5
A353200	대덕전자	8.7	9.3	8.9	26.9	-7.1
A010120	LS ELECTRIC	8.7	8.8	8.5	25.9	-2.0
A403870	HPSP	8.7	8.0	7.6	24.3	3.9
A294870	IPARK현대산업개발	5.6	9.1	8.9	23.7	2.9
A241710	코스메카코리아	8.1	7.1	7.4	22.6	19.6
A068270	셀트리온	8.7	8.2	5.5	22.4	0.5
A000660	SK하이닉스	9.9	6.4	6.0	22.3	-2.7
A298040	효성중공업	7.1	7.9	7.3	22.2	-0.6

가치 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	월평균초과 수익률(%)
55.4	0.2



가치 스코어 Top 10

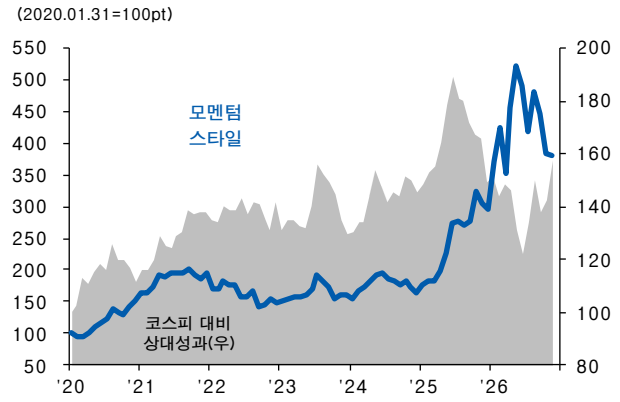
(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			가치 스코어	주간 수익률
		PER	PBR	PSR		
A011170	롯데케미칼	10.0	9.9	9.6	29.5	-0.4
A000370	한화손해보험	9.9	9.6	9.8	29.3	1.2
A088350	한화생명	9.3	9.8	9.9	28.9	0.0
A036460	한국가스공사	9.1	9.7	9.7	28.4	1.7
A108670	LX하우시스	8.5	9.5	9.9	27.9	-4.0
A002350	넥센타이어	9.3	9.6	8.8	27.7	2.0
A015760	한국전력	9.8	9.2	8.6	27.6	-8.7
A006650	대한유화	8.0	9.7	9.4	27.1	-1.0
A097950	CJ제일제당	8.3	9.0	9.7	27.0	5.8
A001450	현대해상	9.6	8.0	9.2	26.9	-5.0

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 11/19일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

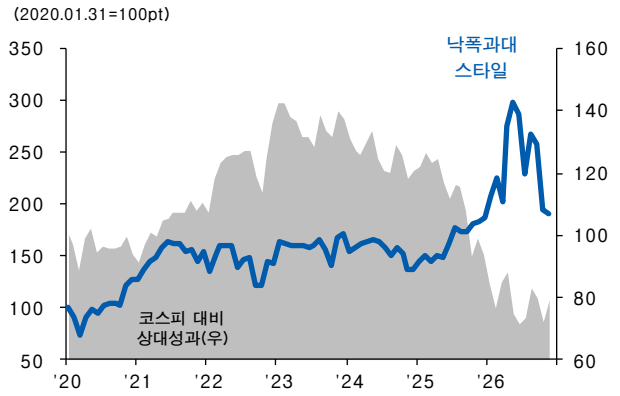
모멘텀 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	월평균초과 수익률(%)
48.2	0.5



낙폭과대 스타일 성과 추이

Hit Ratio(%)	월평균초과 수익률(%)
45.8	-0.3



모멘텀 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				모멘텀 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A028050	삼성E&A	10.0	9.6	9.4	9.7	38.6	-7.8
A089860	롯데렌탈	8.8	9.5	10.0	9.5	37.7	0.5
A028670	팬오션	8.4	8.8	8.8	9.0	34.9	2.2
A000810	삼성화재	8.9	7.2	9.8	8.9	34.8	-0.8
A033780	KT&G	9.7	7.0	9.1	8.8	34.6	3.7
A294870	IPARK현대산업개발	8.9	9.1	8.8	7.9	34.6	2.9
A005830	DB손해보험	8.0	8.4	9.2	8.8	34.3	3.0
A021240	코웨이	9.0	8.6	9.6	7.1	34.2	4.7
A011200	HMM	9.7	8.4	9.3	6.8	34.2	5.1
A353200	대덕전자	5.5	9.8	8.9	9.9	34.1	-7.1

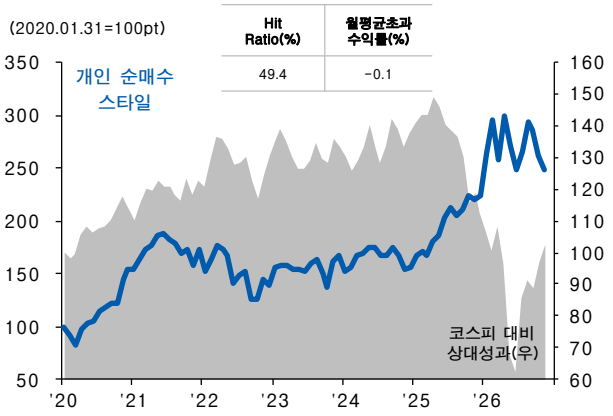
낙폭과대 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				낙폭 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A064350	현대로템	9.0	9.7	10.0	9.7	38.3	-6.6
A042660	한화오션	9.7	9.8	9.7	8.6	37.6	-6.9
A329180	HD현대중공업	9.7	9.9	9.6	7.4	36.6	-3.5
A071970	HD현대마린엔진	8.1	9.3	9.9	9.3	36.5	-9.6
A009540	HD한국조선해양	8.4	9.8	8.3	7.9	34.4	-2.7
A214450	파마리서치	9.1	10.0	5.5	9.6	34.1	10.8
A267260	HD현대일렉트릭	9.6	9.3	9.8	4.9	33.6	-0.1
A012450	한화에어로스페이스	8.9	8.7	8.5	7.0	33.1	-1.6
A214150	클래시스	5.5	9.5	8.8	9.1	32.9	-4.2
A213420	덕산네오룩스	7.0	7.7	8.9	9.0	32.6	-3.5

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 11/19일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

개인 순매수 스타일 성과 추이

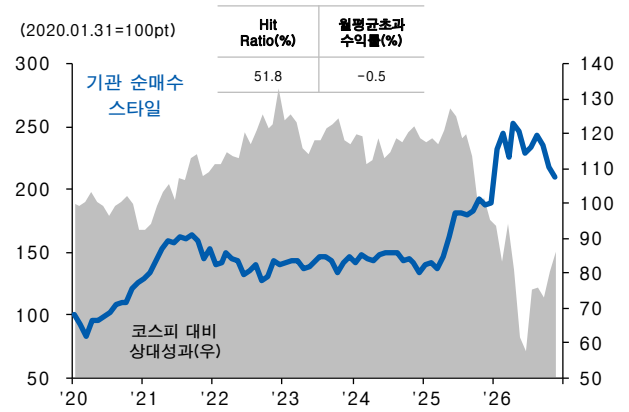


개인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				개인 스코어	주간 수익률
		1M	60D	120D	52W		
A011070	LG이노텍	9.5	9.6	10.0	9.8	38.8	2.1
A047040	대우건설	8.9	9.7	9.1	9.5	37.2	-2.1
A298040	효성중공업	9.9	9.3	9.3	8.7	37.1	-0.6
A071970	HD현대마린엔진	9.0	8.9	9.8	8.8	36.4	-9.6
A267270	HD건설기계	9.8	8.9	9.4	7.8	35.8	-1.8
A066970	엘앤에프	9.8	9.8	9.9	6.3	35.8	-7.7
A005380	현대차	7.1	8.8	9.4	9.9	35.2	-0.7
A034020	두산에너빌리티	9.4	9.2	9.2	7.2	35.0	-6.5
A039130	하나투어	8.0	7.7	9.5	9.6	34.7	18.1
A213420	덕산네오룩스	7.9	9.4	9.8	7.7	34.7	-3.5

기관 순매수 스타일 성과 추이

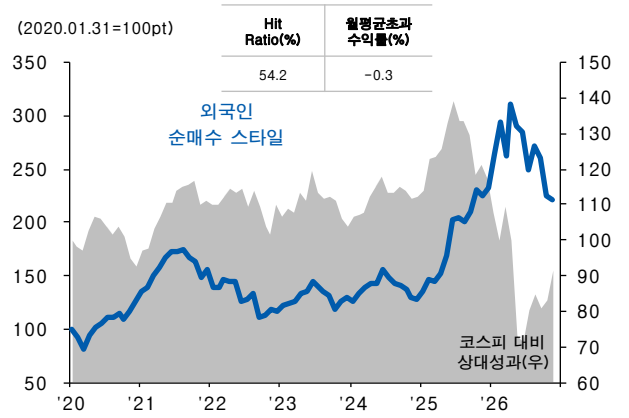


기관 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				기관 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A248070	솔루엠	9.9	9.4	9.7	9.6	38.6	-7.9
A192820	코스맥스	9.4	9.8	9.9	8.8	37.9	3.6
A020150	롯데에너지머티리얼즈	9.8	9.5	8.3	9.3	36.9	3.1
A112610	씨에스윈드	8.9	9.7	8.1	9.8	36.4	-10.1
A047050	포스코인터내셔널	6.2	10.0	9.9	9.9	36.0	-3.2
A028670	팬오션	9.5	9.3	8.7	8.5	36.0	2.2
A145720	덴티움	10.0	9.7	9.8	5.6	35.0	10.0
A353200	대덕전자	9.8	6.8	9.0	8.9	34.4	-7.1
A005830	DB손해보험	8.3	8.8	8.9	8.1	34.1	3.0
A004370	농심	9.7	9.4	9.6	5.3	33.8	-6.7

외국인 순매수 스타일 성과 추이



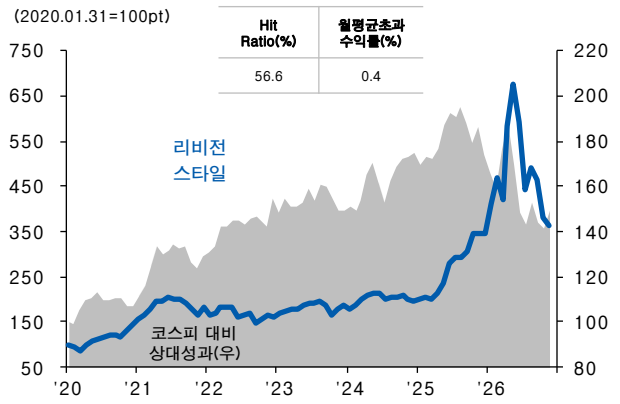
외국인 순매수 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				외국인 스코어	주간 수익률
		1M	3M	6M	12M		
A004170	신세계	9.4	9.9	10.0	10.0	39.1	18.7
A120110	코오롱인더	9.9	8.8	9.9	9.8	38.3	1.2
A183300	코미코	9.0	9.1	9.9	9.7	37.6	-5.2
A001040	CJ	9.6	9.5	9.1	9.1	37.3	3.1
A213420	덕산네오룩스	9.5	9.1	8.5	9.5	36.5	-3.5
A161890	한국콜마	9.1	9.2	9.2	8.3	35.8	15.3
A003490	대한항공	7.0	9.7	9.5	9.5	35.7	2.9
A023530	롯데쇼핑	9.7	7.4	9.5	9.1	35.6	9.1
A064350	현대로템	8.0	8.0	9.6	9.9	35.4	-6.6
A011780	금호석유화학	7.9	9.2	9.0	9.3	35.3	-4.6

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 11/19일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10

리비전 스타일 성과 추이

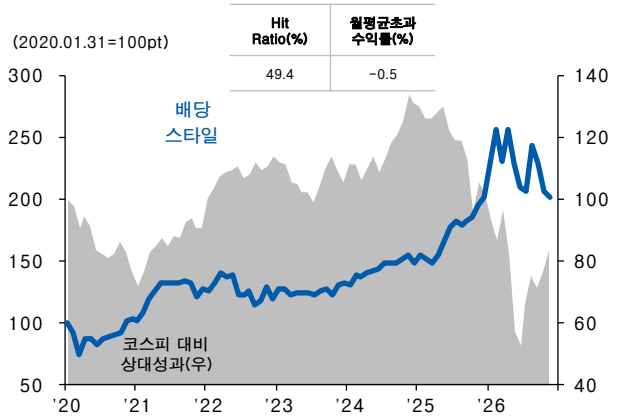


리비전 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어			리비전 스코어	주간 수익률
		매출	영업이익	순이익		
A096770	SK이노베이션	9.3	9.6	8.4	27.2	-10.0
A036570	NC	8.8	9.3	8.1	26.1	2.8
A011200	HMM	9.4	9.7	6.4	25.5	5.1
A028050	삼성E&A	8.0	8.5	8.5	25.0	-7.8
A009150	삼성전기	7.3	9.2	8.2	24.7	3.5
A028670	팬오션	8.3	8.7	7.4	24.5	2.2
A000660	SK하이닉스	9.3	9.1	5.2	23.6	-2.7
A192820	코스맥스	9.0	8.8	5.7	23.5	3.6
A036460	한국가스공사	9.0	8.3	5.3	22.6	1.7
A001120	LX인터내셔널	7.8	8.8	5.9	22.6	-3.4

배당 스타일 성과 추이

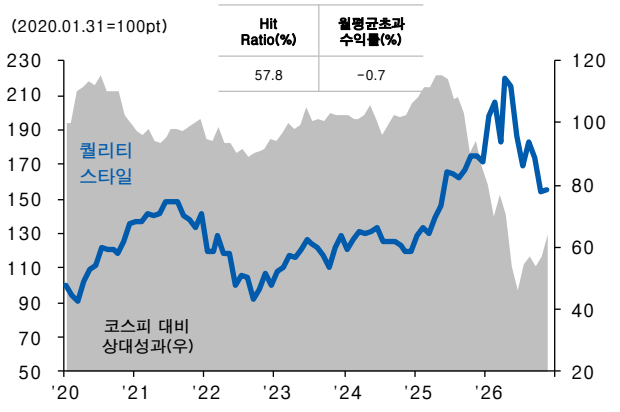


배당 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				배당 스코어	주간 수익률
		배당성향	3Y평균	5Y평균	FY1		
A030000	제일기획	8.9	9.7	9.2	9.5	37.3	-0.4
A005940	NH투자증권	8.1	9.5	9.9	9.8	37.2	2.2
A214320	이노션	8.4	9.9	9.4	9.5	37.2	-1.8
A023530	롯데쇼핑	9.9	9.5	8.7	8.9	37.0	9.1
A001120	LX인터내셔널	8.3	9.4	9.8	9.1	36.6	-3.4
A035250	강원랜드	8.8	9.8	8.5	9.3	36.3	0.5
A017670	SK텔레콤	9.5	9.1	9.1	8.0	35.6	-4.4
A032640	LG유플러스	8.5	9.3	9.0	8.4	35.3	-2.4
A016360	삼성증권	7.0	8.9	9.5	9.9	35.3	-2.3
A298020	효성티앤씨	10.0	8.3	9.6	7.4	35.2	-13.2

퀄리티 스타일 성과 추이



퀄리티 스코어 Top 10

(단위: %)

종목 코드	종목	세부기준 스코어				퀄리티 스코어	주간 수익률
		부채비율	영업이익률	순이익률	ROE		
A403870	HPSP	9.3	9.9	9.8	9.4	38.4	3.9
A000660	SK하이닉스	8.3	9.9	9.9	9.9	38.0	-2.7
A058470	리노공업	9.9	9.7	9.7	8.6	38.0	3.5
A326030	SK바이오팜	8.1	9.4	9.5	9.6	36.5	-0.9
A214150	클래시스	8.6	9.7	9.3	8.8	36.4	-4.2
A145020	휴젤	9.9	9.6	9.4	7.3	36.3	11.0
A005930	삼성전자	8.9	8.7	8.7	9.5	35.8	-4.4
A214450	파마리서치	7.9	9.4	9.3	8.9	35.6	10.8
A376300	디어유	9.5	9.5	8.8	7.4	35.1	11.6
A192080	더블유게임즈	9.8	9.3	9.2	6.4	34.8	-5.6

자료: 에프앤가이드 Quantiwise, 유안타증권 리서치센터
주1) 유니버스 200 종목 기준, 팩터 구성종목 월간 리밸런싱
주2) 11/19일 기준, 세부기준별 스코어 범위 0~10



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)