DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-05)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.001 하락하여 오전 중 지수 상방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 차익 실현 또는 관망 가능성이 높은 환경으로 판단됩니다.
3. 전일 업종별 수익률 분산과 현재 외국인 수급 여건을 감안할 때, 금일은 종목 선택 중심의 알파 전략이 상대적으로 유리할 것으로 예상됩니다.

Pre-market volatility

전일 대비	vs 1주 평균	vs 1개월 평균	vs 3개월 평균	vs 6개월 평균	vs 1년 평균
-0.001	0.027	0.012	-0.012	-0.018	0.124

※본 지표는 전일 글로벌 시장 변화가 금일 코스피 변동성에 미칠 잠재적 영향을 과거 데이터 기반으로 추정합니다
※모델 관련 보고서 참고 링크: https://buly.kr/6Mo7JaP

KR Market

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
KOSPI	4309.63	2.27	4.80	8.21	-
KOSDAQ	945.57	2.17	2.10	5.23	-
KOSPI200	624.17	3.00	6.97	11.13	-

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	21645	7.63	15.28	19.22	-
228790	TIGER 화장품	3435	5.69	2.84	-2.23	-
395270	HANARO Fn K-반도체	22385	6.70	12.90	18.74	-
498400	KODEX 200타겟위클리커	14050	2.26	5.35	8.68	-
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5090	-3.60	-11.83	-7.20	-
364980	TIGER 2차전지TOP10	8560	-2.51	-9.35	-10.63	-
395160	KODEX AI반도체	19060	6.33	11.72	15.91	-
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4485	1.01	1.13	2.89	-
475050	ACE KPOP포커스	12600	2.69	12.62	10.33	-
157490	TIGER 소프트웨어	9650	3.15	3.28	1.25	-

업종&테마ETF 일간수익률 Top&Bottom: 5 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
475300	SOL 반도체전공정	12480	8.43	11.71	7.97	-
421320	PLUS 우주항공&UAM	28585	8.36	20.74	24.41	-
469150	ACE AI반도체포커스	29090	7.78	14.77	17.77	-
471760	TIGER AI반도체핵심공정	12520	7.75	10.72	8.92	-
476260	HANARO 반도체핵심공정주	9095	7.70	10.55	4.44	-

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5090	-3.60	-11.83	-7.20	-
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	5020	-3.09	-12.15	-8.99	-
455860	SOL 2차전지소부장Fn	4755	-3.06	-10.48	-7.39	-
466810	BNK 2차전지양극재	5565	-2.71	-12.02	-11.26	-
305540	TIGER 2차전지테마	16600	-2.70	-10.57	-11.02	-

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	701.68	2.09	2.16	3.14	-
Materials	583.10	1.51	2.49	4.34	-
Industrials	1337.84	1.88	1.45	2.80	-
Consumer Discr…	1906.48	-1.14	-1.79	-0.46	-
Consumer Stapl…	863.52	-0.16	-0.84	-0.52	-
Health Care	1813.78	0.44	1.00	3.60	-
Financials	913.59	0.22	0.54	3.16	-
Information Te…	5686.78	0.05	-0.45	-0.61	-
Communication …	450.67	-0.38	0.00	3.07	-
Utilities	438.96	1.19	1.03	-2.11	-
Real Estate	255.17	0.05	-0.26	-1.36	-

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	471.76	-0.33	-0.69	-0.47	-
가치(IWD)	212.20	0.88	0.61	2.60	-
대형(IWL)	170.65	0.01	-0.10	0.90	-
중소형(IWM)	248.78	1.06	-0.93	1.13	-
배당(VIG)	220.60	0.37	-0.30	0.90	-
저변동성(USMV)	93.65	-0.54	-0.77	-0.50	-
모멘텀(MTUM)	252.73	0.97	0.38	0.78	-
퀄리티(QUAL)	199.19	0.29	-0.08	1.34	-

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Micron Technol…	Technology	315.42	10.51	20.19	34.51	-
Western Digita…	Technology	187.70	8.96	6.78	21.70	-
Lam Research C…	Technology	185.06	8.11	9.73	17.95	-
Teradyne, Inc.	Technology	207.56	7.23	5.10	18.96	-
Intel Corporat…	Technology	39.38	6.72	3.62	3.99	-

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gartner, Inc.	Technology	237.03	-6.04	-2.53	-1.06	-
Palantir Techn…	Technology	167.86	-5.56	-9.04	-7.15	-
Intuit Inc.	Technology	629.46	-4.98	-5.48	-4.51	-
Adobe Inc.	Technology	333.30	-4.77	-4.49	-1.77	-
GoDaddy Inc.	Technology	118.52	-4.48	-5.99	-7.97	-

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	142.49	0.71	0.53	1.45	-
선진국(URTH)	186.51	0.40	0.20	1.31	-
신흥국(EEM)	56.24	2.80	3.47	3.31	-
미국(S&P500)	6858.47	0.19	0.03	1.10	-
미국(NASDAQ)	23235.63	-0.03	-0.57	0.30	-
미국(DJIA)	48382.39	0.66	0.34	2.16	-
유럽(Eurostoxx50)	5850.38	0.93	2.05	3.18	-
일본(Nikkei225)	50339.48	-0.37	0.18	1.23	-
중국(CSI300)	4629.94	-0.46	0.75	0.60	-
홍콩(HangSeng)	26338.47	2.76	2.40	1.32	-
대만(TWSE)	29349.81	1.33	4.04	5.76	-
인도(Nifty 50)	26328.55	0.70	1.23	1.79	0.70
한국(KOSPI)	4309.63	2.27	4.80	8.21	-

Fixed Income

US Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
Fed Funds (EFFR)	3.72	0.00	-16.00	-50.00	-61.00	-76.00
US Treasury 2Y	3.47	2.00	-7.00	-8.00	-41.00	-78.00
US TIPS 10Y	1.93	3.00	8.00	17.00	-9.00	-31.00
IG Corporate Yield	4.84	5.00	1.00	7.00	-23.00	-51.00
HY Corporate Yield	6.53	5.00	-11.00	2.00	-25.00	-77.00
High Yield Spread	2.81	-3.00	-13.00	0.00	1.00	-11.00
10Y Breakeven Inflation	2.25	0.00	1.00	-8.00	-8.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.53	-1.40	-10.20	-32.50	-70.70	-67.50
US Treasury 10Y	4.19	2.40	13.00	6.80	-16.10	-38.80
US Treasury 30Y	4.86	2.40	13.90	15.00	0.20	6.60
2Y-10Y Spread	0.72	0.40	20.00	14.80	24.90	39.20

KR Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
한국은행 기준금리	2.50	0.00	0.00	0.00	0.00	-50.00
국고채 3년	2.94	-1.80	-10.60	35.40	46.80	42.80
국고채 10년	3.39	0.10	1.80	42.70	55.80	63.70
회사채 AA- 3년	3.46	-1.70	-2.50	44.00	49.40	26.20
CD 91일	2.77	-4.00	-4.00	22.00	26.00	-49.00

※T-Bill 3M, Treasury 10Y, Treasury 30Y를 제외한 나머지 미국 금리는 전 영업일 기준
※한국 금리는 금융투자협회 최종호가수익률 기준

Currency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Dollar Index	98.43	0.16	-0.00	-0.63	-
USD/KRW	1442.19	-0.10	-1.41	-0.63	-0.10
USD/EUR	1.17	-0.22	-0.01	0.77	-0.22
USD/JPY	156.73	0.00	0.46	1.36	0.00
USD/CNY	6.99	-0.05	-0.66	-1.32	-0.05

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	57.32	-0.17	-0.61	-2.72	-
Brent(ICE EU)	60.75	-0.16	-1.08	-3.38	-
Natural Gas(NY…	3.62	-1.84	-15.40	-11.47	-

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4329.60	0.09	0.05	3.81	-
Copper(COMEX)	5.69	1.09	4.64	9.99	-
Silver(COMEX)	71.01	1.26	7.89	28.05	-

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	437.50	-0.62	-0.73	1.27	-
Wheat(CBOT)	506.50	-0.10	-2.74	-3.18	-
Soybean(CBOT)	1045.75	1.48	-2.08	-3.15	-
Coffee(ICE US)	355.10	1.82	-4.19	-9.31	-
Sugar(ICE US)	14.60	-2.73	-2.09	-2.19	-

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	91208.36	0.67	3.54	-0.00	2.79
Ethereum	3138.41	0.40	5.52	2.34	4.60