DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-07)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.012 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
-0.012	0.007	0.003	-0.001	-0.003	0.117

※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	4525.48	1.52	8.84	12.70	5.01
KOSDAQ	955.97	-0.16	2.94	5.96	1.10
KOSPI200	659.45	1.65	11.42	16.25	5.65

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23640	3.46	22.65	28.25	9.22
498400	KODEX 200타겟위클리커	14685	1.77	8.93	12.70	4.52
395160	KODEX AI반도체	20335	2.34	16.89	22.05	6.69
228790	TIGER 화장품	3330	-2.06	-0.28	-4.72	-3.06
091160	KODEX 반도체	70785	3.19	19.57	23.72	8.10
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5295	1.44	-7.66	-4.24	4.03
102970	KODEX 증권	16690	5.87	9.73	9.91	7.09
469150	ACE AI반도체포커스	32465	4.00	24.53	29.32	11.60
091170	KODEX 은행	12875	0.70	1.69	4.36	1.98
487240	KODEX AI전력핵심설비	24695	-1.34	3.74	6.30	2.72

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
157500	TIGER 증권	11465	5.91	10.38	10.58	7.35
102970	KODEX 증권	16690	5.87	9.73	9.91	7.09
476260	HANARO 반도체액심공정주	9845	5.46	18.10	12.51	8.25
463250	TIGER K방산&우주	33895	5.12	16.32	15.26	10.77
471760	TIGER AI반도체액심공정	13950	4.85	21.14	20.24	11.42

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
479850	HANARO K-뷰티	14120	-2.62	-1.58	-5.11	-3.32
228810	TIGER 미디어컨텐츠	5800	-2.36	1.30	-1.62	-7.50
117680	KODEX 철강	12255	-2.16	-2.82	1.15	-1.41
228790	TIGER 화장품	3330	-2.06	-0.28	-4.72	-3.06
395290	HANARO Fn K-POP	8665	-1.81	2.40	1.32	-7.57

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	700.20	-2.81	1.76	2.75	-0.21
Materials	602.19	2.04	5.10	7.58	3.27
Industrials	1371.79	1.38	3.59	5.26	2.54
Consumer Discr…	1961.65	0.94	0.92	2.34	2.89
Consumer Stapl…	861.81	0.13	-0.92	-0.70	-0.20
Health Care	1843.51	1.96	2.43	5.01	1.64
Financials	937.48	0.45	2.67	5.68	2.61
Information Te…	5715.70	0.66	0.18	-0.08	0.51
Communication …	451.70	-0.49	0.36	3.03	0.23
Utilities	435.99	0.49	0.46	-2.59	-0.68
Real Estate	257.13	0.62	0.58	-0.57	0.77

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	475.73	0.46	0.22	0.37	0.84
가치(IWD)	216.55	0.90	2.42	4.51	2.05
대형(IWL)	172.56	0.50	0.97	1.94	1.12
중소형(IWM)	256.06	1.32	1.84	3.97	2.93
배당(VIG)	224.07	0.96	1.19	2.40	1.57
저변동성(USMV)	94.59	0.63	0.26	0.53	1.00
모멘텀(MTUM)	258.20	1.21	2.37	2.95	2.16
퀄리티(QUAL)	202.91	0.86	1.65	3.13	1.87

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Western Digita…	Technology	219.38	16.77	22.12	39.73	16.88
Seagate Techno…	Technology	330.42	14.00	14.25	25.16	14.91
Microchip Tech…	Technology	74.87	11.65	12.90	21.64	15.13
Moderna, Inc.	Healthcare	35.66	10.85	14.98	30.25	15.55
Micron Technol…	Technology	343.48	10.04	26.27	43.75	8.90

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
American Inter…	Financial Services	78.06	-7.49	-7.16	-2.29	-7.37
Johnson Contro…	Industrials	113.94	-6.25	-3.99	-1.56	-6.84
Chevron Corpor…	Energy	156.58	-4.44	3.57	2.70	0.44
Tesla, Inc.	Consumer Cyclical	432.96	-4.14	-6.49	-2.37	-1.17
Kinder Morgan, …	Energy	26.83	-3.85	-0.78	-0.33	-3.19

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.35	0.47	1.70	2.67	1.31
선진국(URTH)	188.98	0.52	1.42	2.55	1.32
신흥국(EEM)	57.28	0.75	4.90	5.05	1.86
미국(S&P500)	6944.82	0.62	1.20	2.28	1.26
미국(NASDAQ)	23547.17	0.65	0.79	1.58	1.34
미국(DJIA)	49462.08	0.99	2.30	4.24	2.23
유럽(Eurostoxx50)	5931.79	0.14	3.16	4.50	0.14
일본(Nikkei225)	52518.08	1.32	4.16	5.24	1.32
중국(CSI300)	4790.69	1.55	3.82	4.02	1.55
홍콩(HangSeng)	26710.45	1.38	3.58	2.80	1.41
대만(TWSE)	30576.30	1.57	7.45	9.76	4.18
인도(Nifty 50)	26178.70	-0.27	0.59	1.07	0.12
한국(KOSPI)	4525.48	1.52	8.84	12.70	5.01

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	0.00	-2.00	-11.00	-41.00	-78.00
US TIPS 10Y	1.94	1.00	12.00	14.00	-8.00	-29.00
IG Corporate Yield	4.82	-3.00	-2.00	3.00	-27.00	-55.00
HY Corporate Yield	6.50	-5.00	-7.00	-4.00	-39.00	-71.00
High Yield Spread	2.81	-2.00	-4.00	-1.00	-13.00	0.00
10Y Breakeven Inflation	2.26	1.00	0.00	-9.00	-7.00	-8.00
US T-Bill 3M	3.52	0.50	-8.30	-32.30	-72.00	-67.00
US Treasury 10Y	4.18	1.40	4.00	5.00	-16.70	-43.90
US Treasury 30Y	4.87	1.20	7.40	14.20	0.50	2.80
2Y-10Y Spread	0.71	1.40	6.00	16.00	24.30	34.10

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	2.95	1.50	-4.60	36.70	51.50	42.40
국고채 10년	3.40	0.20	4.00	43.90	58.40	58.10
회사채 AA- 3년	3.46	0.30	0.70	44.10	53.20	25.80
CD 91일	2.75	-1.00	-8.00	20.00	23.00	-35.00

※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	98.57	0.31	0.20	-0.46	0.15
USD/KRW	1447.44	0.48	-0.96	-0.29	0.26
USD/EUR	1.17	-0.12	-0.32	0.46	-0.51
USD/JPY	156.65	-0.22	0.35	1.26	-0.05
USD/CNY	6.98	-0.14	-0.73	-1.41	-0.18

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	56.97	-2.31	-0.84	-3.08	-0.61
Brent(ICE EU)	60.55	-1.96	-1.03	-3.46	-0.33
Natural Gas(NY…	3.40	-3.43	-17.13	-16.86	-5.97

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4500.50	1.43	3.41	7.51	4.31
Copper(COMEX)	6.07	2.37	10.23	16.53	7.54
Silver(COMEX)	81.08	6.46	19.42	43.57	14.92

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	443.75	-0.17	0.54	2.52	1.43
Wheat(CBOT)	510.50	-0.39	-1.45	-2.45	0.79
Soybean(CBOT)	1056.50	0.88	-0.44	-2.21	2.62
Coffee(ICE US)	372.10	3.55	1.55	-4.86	4.14
Sugar(ICE US)	14.76	0.20	-0.95	-0.78	1.10

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	92449.15	-1.53	4.21	1.70	4.19
Ethereum	3239.44	0.41	7.70	5.80	7.97