DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-08)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.013 상승하여 오전 중 지수 하방 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
0.013	-0.000	-0.067	0.051	0.105	-0.232

※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	4551.06	0.57	8.86	12.89	5.60
KOSDAQ	947.39	-0.90	1.89	4.84	0.19
KOSPI200	664.48	0.76	11.48	16.60	6.46

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23650	0.04	21.03	27.48	9.26
395160	KODEX AI반도체	20230	-0.52	15.18	20.75	6.14
498400	KODEX 200타겟위클리커	14790	0.72	9.10	13.08	5.27
228790	TIGER 화장품	3320	-0.30	-0.52	-4.77	-3.35
091180	KODEX 자동차	26295	5.62	5.79	15.27	5.39
395270	HANARO Fn K-반도체	23960	0.44	17.05	24.52	7.04
091160	KODEX 반도체	70300	-0.69	17.46	22.22	7.36
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5235	-1.13	-8.30	-5.72	2.85
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4515	0.11	1.64	3.30	0.67

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
466930	SOL 자동차TOP3플러스	16620	6.98	9.52	19.16	8.34
138540	TIGER 현대차그룹+펀더멘	46320	6.77	8.45	15.22	9.13
139290	TIGER 200 경기소비재	22550	6.34	5.68	14.02	6.04
091180	KODEX 자동차	26295	5.62	5.79	15.27	5.39
385520	KODEX 자율주행액티브	11960	4.00	4.50	12.73	4.09

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
476260	HANARO 반도체핵심공정주	9450	-4.01	12.62	7.87	3.90
261060	TIGER 코스닥150IT	17410	-3.73	4.64	4.10	-0.74
266360	KODEX K콘텐츠	13060	-3.62	0.92	-1.40	-3.51
365000	TIGER 인터넷TOP10	4720	-3.38	1.75	-0.65	-1.05
471990	KODEX AI반도체핵심장비	16795	-3.31	6.26	9.02	3.55

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	691.90	-1.19	0.53	1.44	-1.39
Materials	592.35	-1.63	2.96	5.70	1.59
Industrials	1345.76	-1.90	1.47	3.16	0.59
Consumer Discr…	1960.16	-0.08	0.69	2.15	2.82
Consumer Stapl…	852.99	-1.02	-1.89	-1.69	-1.22
Health Care	1862.19	1.01	3.18	5.87	2.67
Financials	924.03	-1.43	0.99	4.05	1.14
Information Te…	5720.67	0.09	0.36	-0.05	0.60
Communication …	455.28	0.79	1.13	3.66	1.02
Utilities	425.27	-2.46	-1.94	-4.87	-3.12
Real Estate	253.62	-1.37	-0.73	-1.91	-0.61

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	476.99	0.26	0.50	0.57	1.11
가치(IWD)	214.40	-1.00	1.27	3.35	1.03
대형(IWL)	172.26	-0.11	0.76	1.67	0.95
중소형(IWM)	255.47	-0.24	1.51	3.61	2.69
배당(VIG)	222.41	-0.74	0.41	1.57	0.82
저변동성(USMV)	94.20	-0.37	-0.17	0.11	0.59
모멘텀(MTUM)	256.44	-0.65	1.61	2.21	1.47
퀄리티(QUAL)	201.94	-0.48	1.08	2.55	1.38

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Intel Corporat…	Technology	42.63	6.47	12.19	12.06	8.25
CarMax Inc	Consumer Cyclical	43.11	5.33	7.89	9.54	9.72
Regeneron Phar…	Healthcare	812.27	4.60	6.46	16.25	4.63
CrowdStrike Ho…	Technology	478.91	4.49	-0.77	-5.66	5.58
Palo Alto Netw…	Technology	193.92	4.34	3.38	-2.75	8.11

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
First Solar, I…	Technology	241.11	-10.29	-8.78	-5.82	-12.11
Skyworks Solut…	Technology	59.82	-9.73	-8.33	-13.05	-7.11
Western Digita…	Technology	199.88	-8.89	10.34	26.18	6.49
Vistra Corp.	Utilities	154.60	-8.81	-6.03	-13.23	-6.43
CoStar Group, …	Real Estate	61.66	-8.24	-6.90	-10.82	-6.13

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	143.81	-0.37	1.25	2.19	0.93
선진국(URTH)	188.23	-0.40	0.95	2.05	0.92
신흥국(EEM)	56.85	-0.74	3.90	4.10	1.09
미국(S&P500)	6920.93	-0.34	0.79	1.84	0.91
미국(NASDAQ)	23584.28	0.16	0.94	1.64	1.50
미국(DJIA)	48996.08	-0.94	1.21	3.13	1.27
유럽(Eurostoxx50)	5923.57	-0.14	2.81	4.26	-0.00
일본(Nikkei225)	51961.98	-1.06	2.91	3.99	0.25
중국(CSI300)	4776.67	-0.29	3.34	3.65	1.25
홍콩(HangSeng)	26458.95	-0.94	2.53	1.85	0.46
대만(TWSE)	30435.47	-0.46	6.56	9.05	3.70
인도(Nifty 50)	26140.75	-0.14	0.39	0.87	-0.02
한국(KOSPI)	4551.06	0.57	8.86	12.89	5.60

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	3.46	-1.00	-10.00	-11.00	-40.00	-82.00
US TIPS 10Y	1.91	-3.00	3.00	12.00	-10.00	-35.00
IG Corporate Yield	4.82	0.00	-2.00	2.00	-27.00	-57.00
HY Corporate Yield	6.49	-1.00	-8.00	-7.00	-40.00	-67.00
High Yield Spread	2.79	-2.00	-6.00	-5.00	-13.00	3.00
10Y Breakeven Inflation	2.27	1.00	1.00	-8.00	-7.00	-7.00
US T-Bill 3M	3.52	-0.50	-10.30	-33.80	-72.20	-68.80
US Treasury 10Y	4.14	-4.10	-3.40	-1.00	-28.50	-54.50
US Treasury 30Y	4.82	-5.10	-0.10	8.20	-14.20	-9.50
2Y-10Y Spread	0.68	-3.10	6.60	10.00	11.50	27.50

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	2.91	-3.80	-12.40	32.90	46.20	40.20
국고채 10년	3.35	-4.40	-4.70	39.50	53.10	56.00
회사채 AA- 3년	3.42	-3.70	-6.90	40.40	48.50	23.60
CD 91일	2.72	-3.00	-11.00	17.00	20.00	-33.00

※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	98.70	0.13	0.35	-0.32	0.29
USD/KRW	1447.43	0.13	-0.87	-0.31	0.26
USD/EUR	1.17	-0.29	-0.43	0.36	-0.59
USD/JPY	156.78	0.10	0.38	1.30	0.03
USD/CNY	7.00	0.12	-0.49	-1.21	0.01

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	56.27	-1.51	-1.85	-4.20	-1.83
Brent(ICE EU)	60.25	-0.74	-1.35	-3.88	-0.82
Natural Gas(NY…	3.56	6.30	-11.75	-13.12	-1.58

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4468.80	-0.30	2.37	6.55	3.58
Copper(COMEX)	5.85	-2.72	5.86	12.00	3.67
Silver(COMEX)	78.30	-2.77	13.65	37.39	10.98

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	446.25	0.51	0.98	2.97	2.00
Wheat(CBOT)	518.50	1.57	0.27	-0.98	2.37
Soybean(CBOT)	1066.00	2.30	0.66	-1.40	3.55
Coffee(ICE US)	374.25	0.11	2.42	-4.32	4.74
Sugar(ICE US)	14.97	1.42	0.41	0.76	2.53

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	91103.47	-2.80	2.29	0.40	2.67
Ethereum	3139.30	-4.75	3.74	2.64	4.63