DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-09)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.025 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
-0.025	-0.006	-0.009	0.002	0.002	0.116

※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	4552.37	0.03	8.38	12.47	5.63
KOSDAQ	944.06	-0.35	1.44	4.31	-0.16
KOSPI200	664.18	-0.05	10.73	15.99	6.41

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23670	0.08	19.63	26.77	9.36
395160	KODEX AI반도체	20150	-0.40	13.79	19.62	5.72
498400	KODEX 200타겟위클리커	14820	0.20	8.78	12.87	5.48
395270	HANARO Fn K-반도체	24030	0.29	16.20	24.10	7.35
091160	KODEX 반도체	70160	-0.20	16.08	21.35	7.15
466920	SOL 조선TOP3플러스	35720	4.44	7.01	3.34	11.23
449450	PLUS K방산	60410	5.34	15.77	14.41	13.98
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4510	-0.11	1.49	3.09	0.56
487240	KODEX AI전력핵심설비	24395	0.76	2.55	4.09	1.48

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
490480	SOL K방산	30400	6.07	17.78	17.84	15.11
463250	TIGER K방산&우주	35330	5.81	18.64	19.73	15.46
421320	PLUS 우주항공&UAM	32745	5.63	27.65	39.54	14.55
449450	PLUS K방산	60410	5.34	15.77	14.41	13.98
466920	SOL 조선TOP3플러스	35720	4.44	7.01	3.34	11.23

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
140700	KODEX 보험	12335	-2.87	-2.60	-1.28	-3.52
215620	HK S&P코리아로우볼	15965	-2.53	-3.19	-1.10	-2.32
139290	TIGER 200 경기소비재	21980	-2.53	2.93	10.68	3.36
466930	SOL 자동차TOP3플러스	16250	-2.23	6.82	15.90	5.93
475300	SOL 반도체전공정	12560	-2.07	9.58	8.07	0.64

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	714.03	3.20	3.59	4.55	1.76
Materials	600.50	1.38	3.87	7.03	2.98
Industrials	1356.27	0.78	2.02	3.87	1.38
Consumer Discr…	1993.83	1.72	2.18	3.81	4.58
Consumer Stapl…	872.23	2.26	0.28	0.52	1.01
Health Care	1845.18	-0.91	1.95	4.72	1.73
Financials	929.33	0.57	1.32	4.54	1.72
Information Te…	5632.79	-1.54	-1.00	-1.58	-0.95
Communication …	457.95	0.59	1.67	4.11	1.62
Utilities	426.63	0.32	-1.57	-4.44	-2.81
Real Estate	255.62	0.79	0.04	-1.13	0.18

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	473.19	-0.79	-0.24	-0.24	0.30
가치(IWD)	216.15	0.84	1.92	4.07	1.86
대형(IWL)	171.98	-0.11	0.57	1.44	0.78
중소형(IWM)	258.28	1.10	2.49	4.65	3.82
배당(VIG)	223.20	0.33	0.70	1.87	1.18
저변동성(USMV)	94.49	0.33	0.09	0.42	0.90
모멘텀(MTUM)	253.36	-1.21	0.39	0.99	0.25
퀄리티(QUAL)	202.49	0.28	1.25	2.74	1.66

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Caesars Entert…	Consumer Cyclical	25.07	9.00	4.22	12.54	6.41
APA Corporation	Energy	25.37	8.47	2.86	4.70	0.04
Texas Pacific …	Energy	302.97	7.67	3.55	-0.14	1.68
Mohawk Industr…	Consumer Cyclical	114.17	6.83	3.54	0.90	4.26
Smurfit WestRo…	Consumer Cyclical	42.29	6.70	9.25	11.96	6.81

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Seagate Techno…	Technology	284.47	-7.72	-2.05	6.68	-1.07
Datadog, Inc.	Technology	130.68	-7.61	-6.39	-16.33	-2.31
Western Digita…	Technology	187.68	-6.10	3.09	17.63	-0.01
Autodesk, Inc.	Technology	276.58	-5.86	-6.43	-7.68	-3.54
Moderna, Inc.	Healthcare	33.86	-5.66	6.84	22.47	9.72

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	143.77	-0.03	1.14	2.09	0.90
선진국(URTH)	188.26	0.02	0.90	1.99	0.94
신흥국(EEM)	56.85	0.00	3.67	3.99	1.08
미국(S&P500)	6921.45	0.01	0.74	1.78	0.92
미국(NASDAQ)	23480.02	-0.44	0.51	1.14	1.05
미국(DJIA)	49266.11	0.55	1.59	3.58	1.83
유럽(Eurostoxx50)	5904.32	-0.32	2.29	3.84	-0.33
일본(Nikkei225)	51117.26	-1.63	1.18	2.18	-1.38
중국(CSI300)	4737.65	-0.82	2.34	2.73	0.42
홍콩(HangSeng)	26149.31	-1.17	1.25	0.67	-0.72
대만(TWSE)	30360.55	-0.25	5.89	8.56	3.44
인도(Nifty 50)	25876.85	-1.01	-0.65	-0.19	-1.03
한국(KOSPI)	4552.37	0.03	8.38	12.47	5.63

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	1.00	-9.00	-11.00	-39.00	-81.00
US TIPS 10Y	1.91	0.00	3.00	13.00	-10.00	-37.00
IG Corporate Yield	4.81	-1.00	-5.00	-1.00	-34.00	-63.00
HY Corporate Yield	6.48	-1.00	-16.00	-21.00	-50.00	-77.00
High Yield Spread	2.79	0.00	-10.00	-16.00	-18.00	0.00
10Y Breakeven Inflation	2.27	0.00	1.00	-7.00	-10.00	-11.00
US T-Bill 3M	3.51	-0.80	-12.50	-34.60	-73.00	-69.80
US Treasury 10Y	4.18	4.50	-0.30	13.20	-24.00	-51.00
US Treasury 30Y	4.86	4.30	4.90	22.40	-9.90	-7.40
2Y-10Y Spread	0.71	3.50	8.70	24.20	15.00	30.00

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	2.90	-0.80	-18.20	31.10	45.40	39.70
국고채 10년	3.34	-1.30	-11.20	37.70	51.80	54.50
회사채 AA- 3년	3.42	-0.50	-12.70	39.20	48.00	23.60
CD 91일	2.70	-2.00	-13.00	15.00	18.00	-34.00

※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	98.90	0.22	0.57	-0.12	0.49
USD/KRW	1452.04	0.49	-0.49	-0.02	0.58
USD/EUR	1.17	-0.28	-0.66	0.13	-0.81
USD/JPY	156.98	0.19	0.48	1.37	0.16
USD/CNY	6.98	-0.01	-0.61	-1.37	-0.19

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	58.63	4.72	2.26	-0.15	2.29
Brent(ICE EU)	62.96	5.00	3.02	0.46	3.64
Natural Gas(NY…	3.40	-3.46	-14.39	-17.06	-5.94

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4484.00	0.78	2.41	6.76	3.93
Copper(COMEX)	5.80	-0.09	4.58	10.94	2.91
Silver(COMEX)	76.63	-0.65	10.00	33.47	8.61

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	445.75	-0.22	0.81	2.71	1.89
Wheat(CBOT)	518.00	0.00	0.35	-1.14	2.27
Soybean(CBOT)	1061.25	0.81	0.39	-1.90	3.08
Coffee(ICE US)	372.65	-0.75	2.27	-4.68	4.30
Sugar(ICE US)	14.96	-0.13	0.24	0.76	2.47

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	90873.88	-0.48	1.86	0.40	2.41
Ethereum	3106.55	-1.90	2.39	1.82	3.54