DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-12)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.002 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
-0.002	-0.019	-0.022	-0.002	-0.004	0.114

※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	4586.32	0.75	8.61	12.84	6.42
KOSDAQ	947.92	0.41	1.76	4.55	0.25
KOSPI200	668.25	0.61	10.65	16.13	7.06

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23310	-1.52	16.43	24.06	7.69
395160	KODEX AI반도체	19845	-1.51	11.22	17.18	4.12
228790	TIGER 화장품	3425	2.70	2.63	-1.42	-0.29
498400	KODEX 200타겟위클리커	14920	0.67	8.90	13.16	6.19
395270	HANARO Fn K-반도체	23720	-1.29	13.62	21.73	5.96
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5085	-2.31	-9.04	-8.98	-0.10
466920	SOL 조선TOP3플러스	37585	5.22	12.18	8.43	17.03
449450	PLUS K방산	64780	7.23	22.56	22.16	22.23

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
463250	TIGER K방산&우주	37995	7.54	25.60	28.15	24.17
490480	SOL K방산	32600	7.24	24.54	25.76	23.44
449450	PLUS K방산	64780	7.23	22.56	22.16	22.23
445150	KODEX 친환경조선해운액티	33530	6.90	10.13	8.66	15.46
466920	SOL 조선TOP3플러스	37585	5.22	12.18	8.43	17.03

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
475300	SOL 반도체전공정	12220	-2.71	6.19	5.05	-2.08
476260	HANARO 반도체액심공정주	9065	-2.63	7.00	3.44	-0.33
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5085	-2.31	-9.04	-8.98	-0.10
471760	TIGER AI반도체액심공정	13175	-2.19	11.70	12.64	5.23
455850	SOL AI반도체소부장	18060	-2.11	5.35	5.55	0.53

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	716.63	0.36	3.86	4.79	2.13
Materials	611.33	1.80	5.23	8.82	4.84
Industrials	1371.35	1.11	2.95	4.92	2.50
Consumer Discr…	2016.52	1.14	3.12	4.86	5.77
Consumer Stapl…	881.77	1.09	1.28	1.62	2.11
Health Care	1834.54	-0.58	1.18	3.94	1.14
Financials	926.09	-0.35	0.79	4.10	1.37
Information Te…	5688.10	0.98	0.11	-0.65	0.02
Communication …	461.38	0.75	2.35	4.71	2.38
Utilities	431.90	1.24	-0.36	-3.14	-1.61
Real Estate	256.10	0.19	0.21	-0.92	0.36

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	476.18	0.61	0.42	0.35	0.94
가치(IWD)	217.59	0.67	2.45	4.65	2.54
대형(IWL)	173.04	0.60	1.15	1.99	1.40
중소형(IWM)	260.23	0.76	3.15	5.35	4.60
배당(VIG)	224.76	0.69	1.36	2.51	1.89
저변동성(USMV)	94.64	0.13	0.21	0.58	1.06
모멘텀(MTUM)	256.99	1.44	1.81	2.42	1.69
퀄리티(QUAL)	204.07	0.82	1.92	3.45	2.45

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Builders First…	Industrials	124.66	12.01	17.14	13.47	19.14
Intel Corporat…	Technology	45.55	10.80	19.03	19.01	15.67
Vistra Corp.	Utilities	166.37	10.47	1.52	-5.76	0.69
Lennar Corpora…	Consumer Cyclical	119.25	8.85	9.13	0.14	14.42
Lam Research C…	Technology	218.36	8.66	21.83	34.41	17.99

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Las Vegas Sand…	Consumer Cyclical	58.95	-4.77	-9.55	-6.51	-9.60
CoStar Group, …	Real Estate	58.49	-4.68	-10.61	-14.77	-10.96
Datadog, Inc.	Technology	125.49	-3.97	-9.27	-19.35	-6.19
lululemon athl…	Consumer Cyclical	203.90	-3.90	-2.43	9.95	-3.28
Equity Residen…	Real Estate	60.44	-3.87	-2.49	-1.21	-2.56

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.75	0.68	1.76	2.70	1.59
선진국(URTH)	189.53	0.69	1.52	2.60	1.62
신흥국(EEM)	57.14	0.47	4.01	4.38	1.60
미국(S&P500)	6966.28	0.65	1.34	2.36	1.57
미국(NASDAQ)	23671.35	0.81	1.33	1.88	1.88
미국(DJIA)	49504.07	0.48	1.92	3.96	2.32
유럽(Eurostoxx50)	5997.47	1.58	3.65	5.37	1.25
일본(Nikkei225)	51939.89	1.61	2.68	3.71	0.21
중국(CSI300)	4758.92	0.45	2.62	3.13	0.87
홍콩(HangSeng)	26231.79	0.32	1.41	0.96	-0.41
대만(TWSE)	30288.96	-0.24	5.30	8.08	3.20
인도(Nifty 50)	25683.30	-0.75	-1.35	-0.97	-1.77
한국(KOSPI)	4586.32	0.75	8.61	12.84	6.42

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	3.49	2.00	-12.00	-3.00	-41.00	-79.00
US TIPS 10Y	1.92	4.00	0.00	17.00	-14.00	-35.00
IG Corporate Yield	4.84	3.00	-4.00	6.00	-31.00	-58.00
HY Corporate Yield	6.49	1.00	-19.00	-35.00	-49.00	-78.00
High Yield Spread	2.76	-3.00	-13.00	-42.00	-21.00	-8.00
10Y Breakeven Inflation	2.28	1.00	3.00	-2.00	-9.00	-11.00
US T-Bill 3M	3.51	0.60	-8.00	-34.00	-72.40	-69.20
US Treasury 10Y	4.17	-1.20	0.70	12.00	-25.20	-52.20
US Treasury 30Y	4.82	-3.90	2.20	18.50	-13.80	-11.30
2Y-10Y Spread	0.68	-3.20	12.70	15.00	15.80	26.80

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	4.00	-15.30	35.10	49.40	44.20
국고채 10년	3.39	4.50	1.50	42.20	56.30	60.80
회사채 AA- 3년	3.44	2.70	-12.90	41.90	50.70	27.10
CD 91일	2.70	0.00	-13.00	15.00	18.00	-30.00

※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	99.14	0.21	0.79	0.12	0.73
USD/KRW	1457.00	0.48	-0.03	0.26	0.93
USD/EUR	1.16	-0.21	-0.83	-0.07	-1.00
USD/JPY	158.06	0.75	1.10	1.94	0.85
USD/CNY	6.98	-0.10	-0.59	-1.39	-0.28

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	59.12	2.35	3.14	0.70	3.14
Brent(ICE EU)	63.34	2.18	3.63	1.06	4.26
Natural Gas(NY…	3.17	-6.99	-18.82	-22.81	-12.41

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4500.90	1.15	2.48	7.02	4.32
Copper(COMEX)	5.90	2.71	5.81	12.51	4.65
Silver(COMEX)	79.34	6.19	12.51	37.11	12.45

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	445.75	-0.06	0.68	2.58	1.89
Wheat(CBOT)	517.25	-0.14	0.34	-1.34	2.12
Soybean(CBOT)	1062.50	1.48	0.72	-1.85	3.21
Coffee(ICE US)	356.05	-4.38	-1.68	-8.76	-0.35
Sugar(ICE US)	14.89	-0.53	-0.22	0.40	1.99

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	90638.42	0.28	1.25	0.86	2.15
Ethereum	3116.14	1.09	2.21	2.76	3.86