DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-13)

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	-0.029	-0.023	0.003	-0.003	0.093

※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	4624.79	0.84	8.89	13.33	7.31
KOSDAQ	949.81	0.20	1.89	4.59	0.45
KOSPI200	672.86	0.69	10.61	16.38	7.80

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23180	-0.56	14.51	22.68	7.09
498400	KODEX 200타겟위클리커	15025	0.70	9.02	13.51	6.94
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5350	5.21	-3.48	-4.55	5.11
228790	TIGER 화장품	3350	-2.19	0.37	-3.41	-2.47
487240	KODEX AI전력핵심설비	25270	3.63	5.91	6.86	5.12
395160	KODEX AI반도체	19825	-0.10	10.33	16.50	4.01
466920	SOL 조선TOP3플러스	38325	1.97	13.74	10.28	19.34
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4485	-0.44	0.90	2.35	0.00

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
433500	ACE 원자력TOP10	46940	7.61	11.03	14.57	15.19
139220	TIGER 200 건설	5150	6.30	8.59	12.07	12.81
117700	KODEX 건설	4460	5.56	7.57	10.98	9.31
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5350	5.21	-3.48	-4.55	5.11
434730	HANARO 원자력iSele	53730	5.20	8.40	10.19	10.85

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
364970	TIGER 바이오TOP10	9505	-2.56	5.00	8.55	3.04
463050	TIMEFOLIO K바이오액	20035	-2.53	3.10	10.39	4.43
464610	SOL 의료기기소부장Fn	10275	-2.38	-0.42	-3.88	-0.48
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	23820	-2.26	2.86	11.19	4.93
498050	HANARO 바이오코리아액티	16515	-2.19	2.24	8.36	3.38

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	711.92	-0.66	3.07	3.97	1.46
Materials	615.82	0.73	5.56	9.45	5.61
Industrials	1381.68	0.75	3.53	5.59	3.28
Consumer Discr…	2017.25	0.04	2.94	4.77	5.81
Consumer Stapl…	894.25	1.42	2.58	3.03	3.56
Health Care	1835.79	0.07	1.11	3.84	1.21
Financials	918.68	-0.80	-0.06	3.20	0.56
Information Te…	5708.13	0.35	0.56	-0.33	0.38
Communication …	461.45	0.02	2.22	4.57	2.39
Utilities	432.72	0.19	-0.15	-2.81	-1.42
Real Estate	256.69	0.23	0.44	-0.65	0.60

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	477.20	0.21	0.66	0.53	1.15
가치(IWD)	217.71	0.06	2.39	4.59	2.60
대형(IWL)	173.32	0.16	1.27	2.08	1.56
중소형(IWM)	261.49	0.48	3.57	5.78	5.11
배당(VIG)	225.62	0.38	1.72	2.84	2.27
저변동성(USMV)	94.84	0.21	0.41	0.78	1.27
모멘텀(MTUM)	258.98	0.77	2.54	3.18	2.47
퀄리티(QUAL)	204.26	0.10	1.94	3.45	2.55

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Western Digita…	Technology	212.14	5.83	15.15	30.52	13.02
Seagate Techno…	Technology	321.48	5.75	10.34	19.11	11.80
DexCom, Inc.	Healthcare	70.98	5.31	5.32	9.51	6.67
Albemarle Corp…	Basic Materials	169.31	4.97	15.40	38.18	17.63
Dollar General…	Consumer Defensive	148.84	4.27	7.77	26.95	8.79

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Synchrony Fina…	Financial Services	79.62	-8.37	-6.32	1.34	-5.94
Capital One Fi…	Financial Services	233.33	-6.37	-5.10	2.46	-5.89
ON Semiconduct…	Technology	58.75	-5.49	3.72	11.47	3.62
Best Buy Co., …	Consumer Cyclical	67.18	-4.86	-4.48	-11.13	-2.89
QUALCOMM Incor…	Technology	169.26	-4.80	-3.64	-2.34	-2.15

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.38	0.44	2.13	3.06	2.03
선진국(URTH)	190.02	0.26	1.72	2.79	1.88
신흥국(EEM)	57.93	1.38	5.16	5.70	3.00
미국(S&P500)	6977.27	0.16	1.44	2.44	1.73
미국(NASDAQ)	23733.90	0.26	1.57	2.07	2.14
미국(DJIA)	49590.20	0.17	2.01	4.02	2.50
유럽(Eurostoxx50)	6016.30	0.31	3.71	5.55	1.56
일본(Nikkei225)	51939.89	1.61	2.68	3.71	0.21
중국(CSI300)	4789.92	0.65	3.02	3.74	1.53
홍콩(HangSeng)	26608.48	1.44	2.66	2.33	1.03
대만(TWSE)	30567.29	0.92	5.80	8.86	4.15
인도(Nifty 50)	25790.25	0.42	-0.89	-0.59	-1.36
한국(KOSPI)	4624.79	0.84	8.89	13.33	7.31

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	4.83	-1.00	1.00	5.00	-32.00	-59.00
HY Corporate Yield	6.49	0.00	-14.00	-35.00	-49.00	-76.00
High Yield Spread	2.74	-2.00	-17.00	-44.00	-23.00	-8.00
10Y Breakeven Inflation	2.28	1.00	3.00	-2.00	-9.00	-11.00
US T-Bill 3M	3.53	2.00	0.80	-32.00	-69.20	-68.00
US Treasury 10Y	4.19	1.60	-0.70	16.50	-26.80	-58.90
US Treasury 30Y	4.84	2.10	-1.80	21.70	-17.40	-12.50
2Y-10Y Spread	0.70	-0.40	11.30	19.50	14.20	20.10

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	2.98	3.80	-11.30	44.70	52.10	41.90
국고채 10년	3.39	0.60	-1.70	52.10	51.50	55.50
회사채 AA- 3년	3.47	2.40	-11.30	49.40	51.90	24.90
CD 91일	2.69	-1.00	-14.00	15.00	18.00	-31.00

※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	98.91	-0.22	0.53	-0.11	0.50
USD/KRW	1465.72	1.08	0.54	0.85	1.53
USD/EUR	1.17	0.10	-0.54	0.24	-0.69
USD/JPY	158.17	0.82	1.17	2.01	0.92
USD/CNY	6.97	-0.16	-0.65	-1.45	-0.34

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	59.54	0.71	3.69	1.37	3.87
Brent(ICE EU)	63.91	0.90	4.34	1.92	5.20
Natural Gas(NY…	3.38	6.78	-12.36	-17.69	-6.47

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4606.80	2.59	4.53	9.36	6.78
Copper(COMEX)	6.00	2.51	7.10	14.06	6.43
Silver(COMEX)	85.18	7.98	19.03	45.78	20.72

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	421.75	-5.38	-4.59	-2.96	-3.60
Wheat(CBOT)	512.25	-0.97	-0.41	-2.33	1.14
Soybean(CBOT)	1050.50	0.19	-0.15	-3.00	2.04
Coffee(ICE US)	356.35	-0.36	-0.95	-8.53	-0.27
Sugar(ICE US)	14.84	-0.34	-0.56	0.16	1.64

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	91285.35	0.50	1.74	1.73	2.88
Ethereum	3096.35	-0.72	1.34	2.18	3.20