DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-14)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.004 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
0.004	-0.027	-0.025	0.008	0.005	0.069

※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	4692.64	1.47	9.74	14.55	8.89
KOSDAQ	948.98	-0.09	1.72	4.34	0.36
KOSPI200	680.71	1.17	10.98	17.21	9.06

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23205	0.11	13.33	22.18	7.21
498400	KODEX 200타겟위클리커	15180	1.03	9.41	14.24	8.04
228790	TIGER 화장품	3305	-1.34	-0.91	-4.53	-3.78
091180	KODEX 자동차	28620	6.79	13.29	22.77	14.71
305720	KODEX 2차전지산업	14930	5.89	3.37	-2.43	10.63
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5670	5.98	2.76	0.87	11.39
395160	KODEX AI반도체	20000	0.88	10.42	16.99	4.93
487240	KODEX AI전력핵심설비	25370	0.40	6.08	6.83	5.53
364980	TIGER 2차전지TOP10	9510	6.49	4.50	-1.60	11.10

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
469170	ACE 포스코그룹포커스	6245	8.33	6.38	4.37	10.63
466930	SOL 자동차TOP3플러스	18250	8.18	17.51	27.86	18.97
138540	TIGER 현대차그룹+펀더멘	52035	7.58	18.88	26.79	22.59
139290	TIGER 200 경기소비재	24460	7.47	12.88	21.42	15.02
385600	ACE 2차전지&친환경차액티	8895	7.10	8.16	9.40	12.03

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	23075	-3.13	-0.24	7.20	1.65
498050	HANARO 바이오코리아액티	16110	-2.45	-0.17	5.31	0.85
244580	KODEX 바이오	12350	-2.33	-1.40	3.84	-0.60
464610	SOL 의료기기소부장Fn	10050	-2.19	-2.21	-5.84	-2.66
463050	TIMEFOLIO K바이오액	19625	-2.05	0.99	7.61	2.29

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	722.80	1.53	4.42	5.38	3.01
Materials	617.63	0.29	5.42	9.59	5.92
Industrials	1388.78	0.51	3.81	5.99	3.81
Consumer Discr…	2007.02	-0.51	2.24	4.11	5.27
Consumer Stapl…	903.88	1.08	3.54	4.08	4.67
Health Care	1828.46	-0.40	0.60	3.26	0.81
Financials	901.72	-1.84	-1.85	1.22	-1.30
Information Te…	5700.57	-0.13	0.38	-0.49	0.24
Communication …	462.11	0.14	2.19	4.55	2.54
Utilities	435.43	0.63	0.44	-2.09	-0.80
Real Estate	258.79	0.82	1.21	0.18	1.42

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	475.84	-0.30	0.32	0.20	0.86
가치(IWD)	217.50	-0.10	2.16	4.36	2.50
대형(IWL)	172.67	-0.40	0.82	1.62	1.18
중소형(IWM)	261.37	-0.05	3.37	5.62	5.06
배당(VIG)	224.80	-0.36	1.29	2.39	1.90
저변동성(USMV)	94.31	-0.58	-0.14	0.20	0.70
모멘텀(MTUM)	258.94	-0.00	2.33	3.12	2.46
퀄리티(QUAL)	203.53	-0.34	1.47	2.98	2.18

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Moderna, Inc.	Healthcare	39.60	17.02	21.20	40.97	28.32
Intel Corporat…	Technology	47.29	7.33	21.36	22.63	20.09
Advanced Micro…	Technology	220.97	6.39	4.24	-2.33	-1.12
Revvity, Inc.	Healthcare	110.18	6.05	10.55	12.60	12.26
Viatris Inc.	Healthcare	13.37	5.44	8.81	19.48	7.30

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Salesforce, In…	Technology	241.05	-7.07	-7.32	-4.00	-4.95
Solventum Corp…	Healthcare	80.05	-6.58	-1.84	2.21	1.30
Adobe Inc.	Technology	309.93	-5.41	-10.00	-8.42	-7.01
Progressive Co…	Financial Services	205.07	-5.28	-7.57	-7.34	-3.32
Allstate Corpo…	Financial Services	197.66	-5.27	-4.86	-3.32	-3.02

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.89	-0.34	1.67	2.63	1.68
선진국(URTH)	189.54	-0.27	1.37	2.45	1.62
신흥국(EEM)	57.52	-0.72	4.10	4.84	2.28
미국(S&P500)	6963.74	-0.19	1.14	2.16	1.53
미국(NASDAQ)	23709.87	-0.10	1.35	1.88	2.04
미국(DJIA)	49191.99	-0.80	1.11	3.07	1.67
유럽(Eurostoxx50)	6029.83	0.22	3.67	5.64	1.79
일본(Nikkei225)	53549.16	3.10	5.55	6.73	3.31
중국(CSI300)	4761.03	-0.60	2.20	3.02	0.92
홍콩(HangSeng)	26848.47	0.90	3.32	3.20	1.94
대만(TWSE)	30707.22	0.46	5.82	9.16	4.62
인도(Nifty 50)	25732.30	-0.22	-1.05	-0.82	-1.58
한국(KOSPI)	4692.64	1.47	9.74	14.55	8.89

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	3.54	5.00	0.00	2.00	-36.00	-73.00
US TIPS 10Y	1.90	-2.00	2.00	15.00	-16.00	-39.00
IG Corporate Yield	4.84	1.00	-3.00	10.00	-30.00	-68.00
HY Corporate Yield	6.49	0.00	-16.00	-21.00	-50.00	-88.00
High Yield Spread	2.74	0.00	-17.00	-37.00	-26.00	-7.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	1.00	3.00	-1.00	-12.00	-14.00
US T-Bill 3M	3.56	2.70	3.50	-29.80	-67.50	-65.80
US Treasury 10Y	4.17	-1.60	-2.30	12.50	-29.20	-63.20
US Treasury 30Y	4.83	-1.20	-3.00	18.90	-18.60	-15.80
2Y-10Y Spread	0.63	-6.60	-2.30	10.50	6.80	9.80

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	3.00	2.30	-9.00	48.30	52.40	33.90
국고채 10년	3.41	2.00	0.30	55.60	50.70	54.10
회사채 AA- 3년	3.49	1.70	-9.60	52.00	51.80	18.00
CD 91일	2.69	0.00	-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	99.15	0.29	0.73	0.12	0.74
USD/KRW	1474.65	1.33	1.17	1.41	2.15
USD/EUR	1.16	0.21	-0.66	0.07	-0.87
USD/JPY	159.12	0.61	1.66	2.52	1.52
USD/CNY	6.98	0.00	-0.53	-1.34	-0.27

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	60.98	2.49	5.88	3.72	6.39
Brent(ICE EU)	65.35	2.32	6.33	4.10	7.57
Natural Gas(NY…	3.41	0.18	-10.78	-17.11	-5.61

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4591.60	-0.28	3.84	8.87	6.43
Copper(COMEX)	6.00	0.28	6.42	13.67	6.41
Silver(COMEX)	86.67	2.43	19.06	46.94	22.83

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	420.25	-0.30	-4.81	-3.30	-3.94
Wheat(CBOT)	510.50	-0.15	-0.51	-2.69	0.79
Soybean(CBOT)	1039.00	0.58	-0.98	-4.08	0.92
Coffee(ICE US)	360.55	1.26	0.74	-7.32	0.91
Sugar(ICE US)	14.86	0.13	-0.34	0.40	1.78

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	94410.38	3.53	4.83	5.22	6.40
Ethereum	3204.13	3.62	4.43	5.68	6.79