DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-15)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.014 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
0.014	-0.020	-0.017	0.008	-0.005	0.092

※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	4723.10	0.65	9.74	14.84	9.59
KOSDAQ	942.18	-0.72	0.96	3.44	-0.36
KOSPI200	685.76	0.74	10.92	17.54	9.87

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23620	1.79	13.97	23.68	9.12
487240	KODEX AI전력핵심설비	26400	4.06	10.03	10.60	9.82
395270	HANARO Fn K-반도체	24170	0.98	12.41	21.95	7.97
466920	SOL 조선TOP3플러스	37830	-4.47	10.87	8.26	17.80
498400	KODEX 200타겟위클리커	15015	0.30	9.04	14.16	8.37
228790	TIGER 화장품	3365	1.82	0.86	-2.66	-2.04
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4480	0.45	0.77	2.09	-0.11

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
407300	HANARO Fn골프테마	10565	5.23	10.59	15.14	13.36
307520	TIGER 지주회사	17810	4.30	9.61	10.06	12.05
491820	HANARO 전력설비투자	31800	4.07	9.87	10.59	9.79
487240	KODEX AI전력핵심설비	26400	4.06	10.03	10.60	9.82
139220	TIGER 200 건설	5375	3.37	12.42	16.24	17.74

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
494670	TIGER 조선TOP10	30275	-4.51	10.79	8.86	17.76
466920	SOL 조선TOP3플러스	37830	-4.47	10.87	8.26	17.80
441540	HANARO Fn조선해운	32850	-3.81	8.12	6.17	13.61
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	5460	-3.53	0.74	-3.26	8.76
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5480	-3.35	-0.03	-2.60	7.66

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	739.15	2.26	6.38	7.56	5.34
Materials	616.54	-0.18	4.80	9.21	5.73
Industrials	1390.72	0.14	3.70	6.00	3.95
Consumer Discr…	1971.82	-1.75	0.38	2.20	3.43
Consumer Stapl…	914.57	1.18	4.57	5.26	5.91
Health Care	1841.30	0.70	1.23	3.82	1.52
Financials	899.91	-0.20	-1.98	0.95	-1.50
Information Te…	5618.08	-1.45	-1.10	-1.92	-1.21
Communication …	459.56	-0.55	1.47	3.83	1.97
Utilities	438.65	0.74	1.16	-1.27	-0.07
Real Estate	261.58	1.08	2.21	1.28	2.51

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	470.08	-1.20	-0.90	-1.02	-0.36
가치(IWD)	218.37	0.40	2.42	4.64	2.91
대형(IWL)	171.73	-0.65	0.21	1.01	0.63
중소형(IWM)	263.21	0.71	3.87	6.22	5.80
배당(VIG)	224.65	-0.07	1.16	2.25	1.84
저변동성(USMV)	94.66	0.40	0.24	0.56	1.08
모멘텀(MTUM)	255.81	-1.20	0.95	1.86	1.22
퀄리티(QUAL)	202.62	-0.45	0.94	2.45	1.72

S&P500; 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
LyondellBasell…	Basic Materials	52.03	6.90	15.36	15.33	17.21
Dow Inc.	Basic Materials	28.27	6.50	15.84	20.04	16.50
Mosaic Company…	Basic Materials	27.65	5.48	11.23	8.12	10.49
Weyerhaeuser C…	Real Estate	26.62	4.62	10.22	15.18	11.87
EPAM Systems, …	Technology	221.44	4.46	5.20	16.53	10.47

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Intuit Inc.	Technology	566.60	-6.39	-13.14	-13.66	-9.99
Aptiv PLC	Consumer Cyclical	82.91	-6.05	3.39	3.69	5.70
Airbnb, Inc.	Consumer Cyclical	132.79	-5.20	-2.52	4.48	-0.17
Biogen Inc.	Healthcare	169.31	-5.04	-4.60	0.15	-4.79
Wells Fargo & …	Financial Services	89.25	-4.61	-5.16	0.10	-6.25

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.71	-0.12	1.44	2.43	1.56
선진국(URTH)	188.96	-0.30	0.99	2.07	1.31
신흥국(EEM)	57.77	0.45	4.21	5.18	2.72
미국(S&P500)	6926.97	-0.53	0.53	1.56	1.00
미국(NASDAQ)	23471.75	-1.00	0.25	0.80	1.02
미국(DJIA)	49149.63	-0.09	0.95	2.87	1.59
유럽(Eurostoxx50)	6005.05	-0.41	2.99	5.07	1.37
일본(Nikkei225)	54341.23	1.48	6.67	8.04	4.84
중국(CSI300)	4741.93	-0.40	1.58	2.53	0.51
홍콩(HangSeng)	26999.81	0.56	3.70	3.70	2.51
대만(TWSE)	30941.78	0.76	6.07	9.75	5.42
인도(Nifty 50)	25665.60	-0.26	-1.27	-1.08	-1.84
한국(KOSPI)	4723.10	0.65	9.74	14.84	9.59

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	0.00	2.00	6.00	-34.00	-86.00
US TIPS 10Y	1.90	0.00	-3.00	17.00	-15.00	-44.00
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	2.30	1.00	4.00	1.00	-13.00	-15.00
US T-Bill 3M	3.56	0.00	2.20	-29.30	-67.00	-65.30
US Treasury 10Y	4.14	-3.10	-4.20	16.40	-29.20	-64.80
US Treasury 30Y	4.80	-3.30	-5.60	21.20	-20.60	-18.90
2Y-10Y Spread	0.60	-3.10	-6.20	10.40	4.80	21.20

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	-0.70	-0.40	42.70	52.20	35.00
국고채 10년	3.42	0.60	9.30	51.00	54.50	57.70
회사채 AA- 3년	3.48	-0.50	-1.80	47.70	52.00	18.90
CD 91일	2.69	0.00	-14.00	15.00	17.00	-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	99.10	-0.03	0.63	0.05	0.69
USD/KRW	1462.65	-0.16	0.42	0.54	1.32
USD/EUR	1.16	-0.16	-0.63	0.07	-0.87
USD/JPY	158.59	0.38	1.27	2.11	1.18
USD/CNY	6.97	-0.01	-0.54	-1.38	-0.34

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	60.09	-1.73	4.02	2.13	4.83
Brent(ICE EU)	64.42	-1.60	4.48	2.53	6.04
Natural Gas(NY…	3.09	-9.53	-18.22	-24.95	-14.51

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4639.10	1.09	4.52	9.80	7.53
Copper(COMEX)	6.10	2.14	7.43	15.09	8.12
Silver(COMEX)	93.19	8.52	25.48	56.13	32.08

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	422.25	0.60	-4.16	-2.83	-3.49
Wheat(CBOT)	512.75	0.44	0.00	-2.29	1.23
Soybean(CBOT)	1042.50	1.88	-0.44	-3.76	1.26
Coffee(ICE US)	355.70	-1.26	-0.17	-8.41	-0.45
Sugar(ICE US)	14.64	-1.68	-1.73	-0.99	0.27

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	97448.83	2.23	7.54	8.55	9.82
Ethereum	3378.11	1.69	9.05	11.22	12.59