DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-16)

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	-0.016	-0.018	0.004	-0.006	0.100

※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	4797.55	1.58	10.56	16.19	11.32
KOSDAQ	951.16	0.95	1.86	4.28	0.59
KOSPI200	696.39	1.55	11.54	18.81	11.57

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23840	0.93	13.45	24.16	10.14
498400	KODEX 200타겟위클리커	15210	1.30	9.57	15.20	9.78
487240	KODEX AI전력핵심설비	26425	0.09	9.61	10.19	9.92
395270	HANARO Fn K-반도체	24440	1.12	12.30	22.64	9.18
469170	ACE 포스코그룹포커스	6725	8.38	14.19	11.91	19.13
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5575	1.73	2.31	-1.01	9.53
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4490	0.22	0.93	2.24	0.11
395160	KODEX AI반도체	20580	1.28	11.34	19.24	7.97
364980	TIGER 2차전지TOP10	9485	2.43	4.95	-1.86	10.81

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
469170	ACE 포스코그룹포커스	6725	8.38	14.19	11.91	19.13
469070	RISE AI&로봇	15445	6.92	14.86	23.87	13.48
117680	KODEX 철강	14030	5.29	11.09	14.96	12.87
139240	TIGER 200 철강소재	13840	4.45	10.79	14.30	12.84
404540	TIGER KRX기후변화솔루	19065	4.15	15.03	17.95	17.98

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
365000	TIGER 인터넷TOP10	4695	-2.19	1.19	-1.02	-1.57
322400	HANARO e커머스	12170	-1.58	0.05	0.26	-0.94
315270	TIGER 200커뮤니케이션	21725	-1.38	1.02	0.21	-0.75
266360	KODEX K콘텐츠	13205	-1.12	1.21	-0.13	-2.44
157490	TIGER 소프트웨어	9685	-0.97	2.80	1.57	0.36

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	732.43	-0.91	4.91	6.41	4.38
Materials	618.58	0.33	4.69	9.40	6.08
Industrials	1403.65	0.93	4.33	6.84	4.92
Consumer Discr…	1979.84	0.41	0.72	2.54	3.85
Consumer Stapl…	914.26	-0.03	4.32	5.16	5.88
Health Care	1830.58	-0.58	0.53	3.07	0.93
Financials	903.43	0.43	-1.57	1.30	-1.11
Information Te…	5646.18	0.50	-0.64	-1.42	-0.71
Communication …	457.57	-0.43	0.90	3.27	1.53
Utilities	443.22	1.04	2.11	-0.16	0.97
Real Estate	263.35	0.68	2.73	1.99	3.21

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	470.70	0.12	-0.78	-0.89	-0.23
가치(IWD)	219.22	0.41	2.58	4.93	3.31
대형(IWL)	171.99	0.13	0.28	1.12	0.79
중소형(IWM)	265.54	0.89	4.47	7.03	6.74
배당(VIG)	225.12	0.20	1.26	2.41	2.05
저변동성(USMV)	94.52	-0.12	0.05	0.41	0.93
모멘텀(MTUM)	257.27	0.60	1.34	2.42	1.80
퀄리티(QUAL)	203.35	0.37	1.18	2.75	2.09

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
KLA Corporation	Technology	1544.96	7.70	17.02	25.55	21.22
Vistra Corp.	Utilities	180.22	6.66	9.75	3.29	9.07
BlackRock, Inc.	Financial Services	1156.90	5.96	6.25	7.38	6.62
Morgan Stanley	Financial Services	191.29	5.81	5.18	11.14	5.16
NRG Energy, In…	Utilities	158.48	5.77	1.77	-2.93	-4.62

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Coinbase Globa…	Financial Services	239.28	-6.48	-1.37	-12.99	1.16
Devon Energy C…	Energy	36.32	-4.21	0.03	2.44	-4.09
Boston Scienti…	Healthcare	90.00	-3.99	-5.97	-8.05	-4.97
Charter Commun…	Communication Services	194.61	-3.82	-5.84	-8.22	-7.01
Eli Lilly and …	Healthcare	1032.71	-3.78	-3.54	2.75	-4.41

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.00	0.20	1.46	2.57	1.76
선진국(URTH)	189.27	0.18	1.02	2.18	1.48
신흥국(EEM)	58.10	0.60	4.31	5.67	3.30
미국(S&P500)	6944.47	0.26	0.68	1.76	1.25
미국(NASDAQ)	23530.02	0.25	0.41	1.01	1.27
미국(DJIA)	49442.44	0.60	1.41	3.39	2.19
유럽(Eurostoxx50)	6041.14	0.60	3.32	5.57	1.98
일본(Nikkei225)	54110.50	-0.42	5.88	7.35	4.39
중국(CSI300)	4751.43	0.20	1.51	2.68	0.71
홍콩(HangSeng)	26923.62	-0.28	3.15	3.30	2.22
대만(TWSE)	30810.58	-0.42	5.03	9.09	4.98
인도(Nifty 50)	25665.60	-0.26	-1.27	-1.08	-1.84
한국(KOSPI)	4797.55	1.58	10.56	16.19	11.32

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	3.53	-1.00	1.00	3.00	-38.00	-87.00
US TIPS 10Y	1.88	-2.00	-5.00	12.00	-16.00	-46.00
IG Corporate Yield	4.79	-3.00	-6.00	10.00	-32.00	-74.00
HY Corporate Yield	6.46	-2.00	-17.00	-12.00	-44.00	-88.00
High Yield Spread	2.76	1.00	-15.00	-28.00	-17.00	-4.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	-1.00	4.00	1.00	-12.00	-15.00
US T-Bill 3M	3.57	0.50	2.00	-26.70	-66.50	-64.00
US Treasury 10Y	4.16	2.00	1.10	15.30	-27.20	-49.30
US Treasury 30Y	4.79	-0.80	-3.70	18.40	-21.40	-9.20
2Y-10Y Spread	0.63	3.00	0.10	12.30	10.80	37.70

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	3.09	9.40	9.10	53.50	61.60	41.50
국고채 10년	3.49	7.50	18.00	60.80	62.00	63.30
회사채 AA- 3년	3.56	8.40	5.80	57.50	60.40	25.00
CD 91일	2.68	-1.00	-16.00	14.00	16.00	-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	99.38	0.25	0.86	0.33	0.98
USD/KRW	1468.57	-0.30	0.79	0.88	1.73
USD/EUR	1.16	-0.30	-0.92	-0.28	-1.22
USD/JPY	158.66	-0.33	1.18	2.06	1.23
USD/CNY	6.97	-0.16	-0.58	-1.43	-0.43

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	58.80	-5.19	1.31	-0.15	2.58
Brent(ICE EU)	63.48	-4.57	2.40	0.91	4.49
Natural Gas(NY…	3.12	0.00	-16.69	-24.22	-13.76

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4609.00	-0.37	3.51	8.97	6.83
Copper(COMEX)	5.98	-0.46	4.82	12.57	6.05
Silver(COMEX)	91.90	1.13	21.55	52.33	30.25

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	420.25	-0.41	-4.44	-3.28	-3.94
Wheat(CBOT)	510.00	-0.49	-0.53	-2.83	0.69
Soybean(CBOT)	1052.50	2.13	0.63	-2.85	2.23
Coffee(ICE US)	358.80	0.79	0.99	-7.42	0.42
Sugar(ICE US)	14.59	-0.61	-2.00	-1.21	-0.07

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	95399.38	-1.58	4.84	6.25	7.51
Ethereum	3292.60	-1.85	5.70	8.30	9.74