DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-19)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.001 상승하여 오전 중 지수 하방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 방향성은 제한적이나 이탈 압력은 낮은 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
0.001	-0.006	-0.022	-0.000	-0.009	0.104

※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	4840.74	0.90	10.48	16.76	12.32
KOSDAQ	954.59	0.36	2.02	4.50	0.95
KOSPI200	704.64	1.18	11.59	19.65	12.89

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	24100	1.09	12.91	24.80	11.34
498400	KODEX 200타겟위클리커	15400	1.25	9.88	16.18	11.15
395270	HANARO Fn K-반도체	24700	1.06	11.95	23.24	10.34
395160	KODEX AI반도체	20735	0.75	10.76	19.53	8.79
469070	RISE AI&로봇	15495	0.32	14.20	23.61	13.85
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	23130	2.16	0.34	6.05	1.89
228790	TIGER 화장품	3350	0.00	0.50	-2.76	-2.47
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4515	0.56	1.34	2.71	0.67

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
433500	ACE 원자력TOP10	51415	4.33	17.92	23.11	26.17
434730	HANARO 원자력iSele	58040	3.32	14.31	16.87	19.74
261070	TIGER 코스닥150바이오	18370	3.06	1.82	2.41	1.21
117700	KODEX 건설	4855	2.97	14.11	19.37	19.00
363580	KODEX 200IT TR	26250	2.52	12.92	22.55	12.49

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	5375	-3.67	0.07	-4.84	7.07
463250	TIGER K방산&우주	39730	-3.53	19.66	30.22	29.84
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5390	-3.32	-0.71	-4.33	5.89
455860	SOL 2차전지소부장Fn	5025	-3.27	-0.05	-4.29	5.68
421320	PLUS 우주항공&UAM	35855	-3.24	20.66	44.67	25.43

US Market

US GICS Level I

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	733.95	0.21	4.73	6.45	4.60
Materials	615.85	-0.44	3.82	8.75	5.62
Industrials	1412.74	0.65	4.55	7.39	5.60
Consumer Discr…	1976.41	-0.17	0.42	2.31	3.67
Consumer Stapl…	914.28	0.00	4.12	5.10	5.88
Health Care	1815.12	-0.84	-0.40	2.08	0.07
Financials	904.49	0.12	-1.45	1.37	-1.00
Information Te…	5651.40	0.09	-0.70	-1.32	-0.62
Communication …	454.28	-0.72	-0.01	2.42	0.80
Utilities	440.96	-0.51	1.48	-0.60	0.46
Real Estate	266.51	1.20	3.73	3.21	4.44

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	470.58	-0.02	-0.90	-0.90	-0.25
가치(IWD)	218.99	-0.10	2.22	4.70	3.20
대형(IWL)	172.05	0.00	0.16	1.11	0.82
중소형(IWM)	265.76	0.09	4.17	6.99	6.83
배당(VIG)	225.64	0.22	1.34	2.58	2.28
저변동성(USMV)	94.42	-0.17	-0.09	0.31	0.82
모멘텀(MTUM)	258.38	0.45	1.44	2.83	2.24
퀄리티(QUAL)	203.31	-0.09	0.98	2.66	2.07

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Super Micro Co…	Technology	32.64	10.94	8.22	-8.99	5.43
Micron Technol…	Technology	362.75	7.76	16.82	40.44	15.01
Moderna, Inc.	Healthcare	41.83	6.28	22.15	45.37	35.55
GE Vernova Inc.	Industrials	681.55	6.12	3.67	10.43	0.29
Quanta Service…	Industrials	466.75	4.27	7.56	5.75	6.16

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Constellation …	Utilities	307.71	-9.82	-11.54	-13.68	-15.98
Vistra Corp.	Utilities	166.60	-7.54	1.25	-4.33	0.83
Amcor plc	Consumer Cyclical	40.94	-7.29	-3.30	-2.01	-2.64
West Pharmaceu…	Healthcare	259.79	-7.02	-5.47	-5.57	-6.01
Albemarle Corp…	Basic Materials	163.04	-6.18	5.36	27.59	13.28

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.00	0.00	1.24	2.51	1.76
선진국(URTH)	189.21	-0.02	0.80	2.09	1.45
신흥국(EEM)	57.87	-0.38	3.42	5.15	2.90
미국(S&P500)	6940.01	-0.06	0.45	1.65	1.19
미국(NASDAQ)	23515.39	-0.06	0.17	0.91	1.20
미국(DJIA)	49359.33	-0.17	1.09	3.13	2.02
유럽(Eurostoxx50)	6029.45	-0.19	2.88	5.25	1.79
일본(Nikkei225)	53936.17	-0.32	5.15	6.80	4.06
중국(CSI300)	4731.87	-0.41	0.93	2.21	0.30
홍콩(HangSeng)	26844.96	-0.29	2.53	2.93	1.92
대만(TWSE)	31408.70	1.94	6.36	10.96	7.01
인도(Nifty 50)	25694.35	0.11	-1.14	-0.96	-1.73
한국(KOSPI)	4840.74	0.90	10.48	16.76	12.32

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	3.56	5.00	8.00	10.00	-32.00	-71.00
US TIPS 10Y	1.88	2.00	-4.00	13.00	-15.00	-36.00
IG Corporate Yield	4.81	2.00	-2.00	10.00	-30.00	-59.00
HY Corporate Yield	6.45	-1.00	-22.00	-16.00	-45.00	-68.00
High Yield Spread	2.71	-5.00	-27.00	-33.00	-22.00	-1.00
10Y Breakeven Inflation	2.33	4.00	9.00	6.00	-8.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.56	-0.80	1.40	-27.50	-67.30	-63.80
US Treasury 10Y	4.23	7.10	8.00	22.40	-20.10	-37.50
US Treasury 30Y	4.84	5.30	1.20	23.70	-16.10	-0.40
2Y-10Y Spread	0.67	2.10	-0.00	12.40	11.90	33.50

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	3.08	-1.00	8.40	52.50	60.60	45.40
국고채 10년	3.49	-0.50	16.40	60.30	61.50	68.60
회사채 AA- 3년	3.56	-0.50	5.30	57.00	59.90	28.40
CD 91일	2.68	0.00	-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	0.06	0.80	0.32	0.97
USD/KRW	1474.33	0.37	1.21	1.19	2.13
USD/EUR	1.16	-0.21	-1.00	-0.47	-1.41
USD/JPY	157.95	-0.41	0.53	1.47	0.78
USD/CNY	6.97	0.02	-0.45	-1.34	-0.41

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	59.34	0.25	1.91	0.71	3.52
Brent(ICE EU)	64.13	0.58	3.05	1.86	5.56
Natural Gas(NY…	3.10	-0.80	-16.12	-24.52	-14.23

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4595.40	-0.45	2.91	8.43	6.51
Copper(COMEX)	5.83	-1.97	1.80	9.44	3.39
Silver(COMEX)	88.54	-3.63	15.40	45.11	25.48

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	424.75	1.07	-3.24	-2.27	-2.91
Wheat(CBOT)	518.00	1.47	0.91	-1.36	2.27
Soybean(CBOT)	1057.75	0.45	1.13	-2.41	2.74
Coffee(ICE US)	355.10	-0.84	-0.09	-8.14	-0.62
Sugar(ICE US)	14.99	2.88	0.62	1.53	2.67

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	95456.09	0.37	3.57	6.12	7.58
Ethereum	3348.47	1.20	5.55	9.65	11.60