DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-20)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.016 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
0.016	-0.004	-0.021	-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	4904.66	1.32	10.87	17.82	13.81
KOSDAQ	968.36	1.44	3.17	5.83	2.41
KOSPI200	713.96	1.32	11.81	20.64	14.39

업종&테마ETF 거래대금 Top 10 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	24205	0.44	11.84	24.64	11.83
091180	KODEX 자동차	32055	8.06	21.65	34.05	28.48
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5600	3.90	3.46	-0.59	10.02
469070	RISE AI&로봇	17215	11.10	24.78	36.29	26.49
498400	KODEX 200타겟위클리커	15560	1.04	10.00	16.93	12.31
305720	KODEX 2차전지산업	14980	4.17	5.17	-2.04	11.00
364980	TIGER 2차전지TOP10	9565	3.97	6.00	-0.91	11.74
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4530	0.33	1.52	2.96	1.00

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
469070	RISE AI&로봇	17215	11.10	24.78	36.29	26.49
445290	KODEX 로봇액티브	33605	10.40	23.19	36.63	25.16
466930	SOL 자동차TOP3플러스	20520	9.62	25.39	39.79	33.77
138540	TIGER 현대차그룹+펀더멘	58310	9.35	26.34	38.46	37.38
139290	TIGER 200 경기소비재	27000	8.13	19.99	31.06	26.97

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
364970	TIGER 바이오TOP10	9415	-1.77	2.19	6.03	2.06
460280	KIWOOM Fn유전자혁신기	12150	-1.62	-3.05	-0.22	-4.26
322400	HANARO e커머스	11935	-1.57	-1.83	-1.72	-2.85
483020	KIWOOM 의료AI	13175	-1.53	-2.50	-0.67	-2.12
498050	HANARO 바이오코리아액티	16000	-1.39	-0.77	3.17	0.16

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)	5925.82	-1.72	0.93	3.34	0.04
일본(Nikkei225)	53583.57	-0.65	4.04	5.90	3.38
중국(CSI300)	4734.46	0.05	0.79	2.22	0.35
홍콩(HangSeng)	26563.90	-1.05	1.25	1.82	0.86
대만(TWSE)	31639.29	0.73	6.39	11.52	7.80
인도(Nifty 50)	25585.50	-0.42	-1.52	-1.36	-2.15
한국(KOSPI)	4904.66	1.32	10.87	17.82	13.81

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	3.13	5.00	12.00	53.00	67.20	54.20
국고채 10년	3.56	7.70	22.30	66.10	73.50	75.20
회사채 AA- 3년	3.60	3.90	7.60	57.50	64.90	35.80
CD 91일	2.68	0.00	-17.00	14.00	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	99.39	0.00	0.77	0.32	0.99
USD/KRW	1473.67	0.33	1.17	1.14	2.08
USD/EUR	1.16	0.35	-0.48	0.07	-0.86
USD/JPY	158.12	-0.30	0.63	1.58	0.88
USD/CNY	6.96	-0.04	-0.51	-1.41	-0.47

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	59.43	-0.02	1.77	0.83	3.68
Brent(ICE EU)	64.16	0.05	2.74	1.87	5.61
Natural Gas(NY…	3.57	14.95	-3.13	-13.27	-1.41

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4676.70	1.92	4.34	10.08	8.40
Copper(COMEX)	5.91	2.02	2.65	10.53	4.71
Silver(COMEX)	94.28	7.03	20.59	52.59	33.62

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)	355.30	-0.78	-0.04	-8.09	-0.56
Sugar(ICE US)	14.96	2.68	0.43	1.33	2.47

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	92955.58	-0.73	0.71	3.26	4.76
Ethereum	3213.40	-2.07	1.02	5.05	7.10