DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-21)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.068 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
0.068	0.009	-0.018	-0.001	-0.010	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	4885.75	-0.39	9.34	16.87	13.37
KOSDAQ	976.37	0.83	3.61	6.51	3.26
KOSPI200	708.48	-0.77	9.72	19.14	13.51

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23680	-2.17	7.98	21.30	9.40
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5770	3.04	6.35	2.34	13.36
228790	TIGER 화장품	3405	2.87	2.17	-0.78	-0.87
305720	KODEX 2차전지산업	15325	2.30	7.21	0.20	13.56
469070	RISE AI&로봇	17345	0.76	23.55	36.22	27.44
498400	KODEX 200타겟위클리커	15460	-0.64	8.28	15.72	11.58
487240	KODEX AI전력핵심설비	27010	0.41	9.73	11.11	12.35
364980	TIGER 2차전지TOP10	9770	2.14	7.79	1.22	14.14

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	13750	-0.40	22,760,531
0091P0	TIGER 코리아원자력	14805	5.71	6,092,937

※ 거래대금 상위이나 최근 상장 등의 이유로 시계열 데이터가 부재한 ETF

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
227560	TIGER 200 생활소비재	13395	5.72	9.33	9.43	11.49
421320	PLUS 우주항공&UAM	38795	5.62	24.40	53.57	35.72
422420	RISE 2차전지액티브	7480	3.82	8.57	2.05	13.51
326230	RISE 내수주플러스	11320	3.66	6.12	7.01	7.20
433500	ACE 원자력TOP10	54490	3.63	21.51	28.84	33.72

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
476260	HANARO 반도체핵심공정주	9080	-3.51	1.63	3.73	-0.16
388420	RISE 비메모리반도체액티브	16900	-3.07	1.03	3.38	-1.40
474590	WON 반도체밸류체인액티브	21555	-3.01	5.08	13.47	4.64
475310	SOL 반도체후공정	19680	-2.93	2.81	8.24	2.88
471760	TIGER AI반도체핵심공정	13180	-2.91	4.07	11.08	5.27

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	732.70	-0.17	4.10	6.12	4.42
Materials	611.05	-0.78	2.65	7.74	4.79
Industrials	1384.66	-1.99	2.17	5.14	3.50
Consumer Discr…	1920.64	-2.82	-2.31	-0.60	0.74
Consumer Stapl…	915.41	0.12	4.02	5.18	6.01
Health Care	1811.40	-0.20	-0.67	1.77	-0.13
Financials	884.29	-2.23	-3.54	-0.92	-3.21
Information Te…	5485.38	-2.94	-3.55	-4.17	-3.54
Communication …	444.94	-2.06	-2.07	0.23	-1.27
Utilities	436.42	-1.03	0.42	-1.54	-0.58
Real Estate	261.31	-1.95	1.56	1.24	2.41

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	458.75	-2.51	-3.31	-3.36	-2.76
가치(IWD)	215.94	-1.39	0.64	3.15	1.76
대형(IWL)	168.30	-2.18	-2.01	-1.11	-1.37
중소형(IWM)	262.63	-1.18	2.67	5.59	5.57
배당(VIG)	221.93	-1.64	-0.38	0.85	0.60
저변동성(USMV)	93.59	-0.88	-0.96	-0.55	-0.06
모멘텀(MTUM)	252.83	-2.15	-0.87	0.61	0.04
퀄리티(QUAL)	199.54	-1.85	-0.94	0.72	0.18

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Albemarle Corp…	Basic Materials	172.53	5.82	10.35	33.60	19.87
Expand Energy …	Energy	104.75	4.88	-1.49	-5.65	-4.57
Constellation …	Consumer Defensive	163.58	4.43	12.21	17.80	15.87
Newmont Corpor…	Basic Materials	118.94	4.22	10.63	25.53	17.51
Monster Bevera…	Consumer Defensive	81.47	4.22	5.33	10.68	6.97

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
NetApp, Inc.	Technology	94.11	-9.37	-12.04	-15.29	-11.61
Dell Technolog…	Technology	111.10	-7.82	-9.84	-17.20	-13.07
Norwegian Crui…	Consumer Cyclical	20.37	-7.45	-11.92	-2.45	-10.58
3M Company	Industrials	156.09	-6.98	-4.67	-5.97	-3.54
lululemon athl…	Consumer Cyclical	188.76	-6.49	-9.50	0.09	-10.46

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	142.36	-1.82	-0.70	0.60	-0.09
선진국(URTH)	185.60	-1.91	-1.18	0.11	-0.49
신흥국(EEM)	57.34	-0.92	2.10	4.09	1.96
미국(S&P500)	6796.86	-2.06	-1.63	-0.47	-0.90
미국(NASDAQ)	22954.32	-2.39	-2.21	-1.52	-1.21
미국(DJIA)	48488.59	-1.76	-0.75	1.24	0.22
유럽(Eurostoxx50)	5892.08	-0.57	0.24	2.69	-0.53
일본(Nikkei225)	52991.10	-1.11	2.54	4.59	2.23
중국(CSI300)	4718.88	-0.33	0.30	1.86	0.02
홍콩(HangSeng)	26487.51	-0.29	0.77	1.48	0.57
대만(TWSE)	31759.99	0.38	6.08	11.66	8.21
인도(Nifty 50)	25232.50	-1.38	-2.74	-2.68	-3.50
한국(KOSPI)	4885.75	-0.39	9.34	16.87	13.37

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	4.85	0.00	3.00	17.00	-23.00	-52.00
HY Corporate Yield	6.43	-1.00	-15.00	-9.00	-35.00	-60.00
High Yield Spread	2.65	0.00	-25.00	-32.00	-18.00	1.00
10Y Breakeven Inflation	2.33	4.00	9.00	6.00	-8.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.57	1.50	5.00	-21.60	-67.30	-62.10
US Treasury 10Y	4.30	6.40	14.40	34.20	-11.30	-31.40
US Treasury 30Y	4.92	8.00	9.20	38.10	-2.90	7.50
2Y-10Y Spread	0.74	1.40	6.40	24.20	20.70	39.60

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	3.19	6.10	18.10	61.90	72.40	56.80
국고채 10년	3.65	8.80	31.10	78.40	80.40	78.50
회사채 AA- 3년	3.65	5.40	13.00	65.40	69.30	38.50
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	98.60	-0.79	0.01	-0.46	0.18
USD/KRW	1480.64	0.62	1.63	1.57	2.56
USD/EUR	1.17	0.85	0.17	0.69	-0.23
USD/JPY	158.23	0.44	0.64	1.59	0.96
USD/CNY	6.96	-0.12	-0.51	-1.42	-0.52

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	59.42	-0.03	1.75	0.82	3.66
Brent(ICE EU)	63.88	-0.39	2.32	1.43	5.15
Natural Gas(NY…	3.91	25.97	5.66	-5.09	8.04

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4760.10	3.74	6.10	12.01	10.33
Copper(COMEX)	5.81	0.45	1.15	8.86	3.09
Silver(COMEX)	94.08	6.80	20.34	52.28	33.34

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	424.00	-0.18	-3.19	-2.44	-3.09
Wheat(CBOT)	510.50	-1.45	-0.58	-2.81	0.79
Soybean(CBOT)	1053.00	-0.45	0.67	-2.88	2.28
Coffee(ICE US)	345.80	-2.67	-2.71	-10.26	-3.22
Sugar(ICE US)	14.73	-1.54	-1.20	-0.18	0.89

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	89564.04	-3.23	-3.06	-0.59	0.94
Ethereum	3000.27	-5.85	-5.69	-2.03	-0.00