DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-22)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.062 하락하여 오전 중 지수 상방 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
-0.062	0.009	-0.025	0.001	-0.003	0.080

※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	4909.93	0.49	8.80	17.00	13.93
KOSDAQ	951.29	-2.57	0.76	3.64	0.60
KOSPI200	714.94	0.91	9.48	19.67	14.54

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	23980	1.27	7.86	22.21	10.79
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	20670	-9.99	-10.14	-6.34	-8.94
463050	TIMEFOLIO K바이오액	17435	-9.15	-10.12	-6.73	-9.12
228790	TIGER 화장품	3440	1.03	3.06	0.38	0.15
469070	RISE AI&로봇	17875	3.06	25.15	39.19	31.34
364970	TIGER 바이오TOP10	8685	-7.16	-5.95	-2.54	-5.85
091180	KODEX 자동차	34250	7.69	25.88	40.90	37.27
395270	HANARO Fn K-반도체	24430	0.83	6.82	19.95	9.14
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5670	-1.73	4.32	0.66	11.39

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14300	4.00	21,654,801

※ 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 %
466930	SOL 자동차TOP3플러스	21835	8.50	28.52	46.16	42.34
139290	TIGER 200 경기소비재	28755	7.70	24.09	37.55	35.22
091180	KODEX 자동차	34250	7.69	25.88	40.90	37.27
138540	TIGER 현대차그룹+펀더멘	61245	6.57	27.77	43.12	44.29
360140	KODEX 200롱코스닥15	14910	5.86	11.40	20.73	16.85

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	20670	-9.99	-10.14	-6.34	-8.94
463050	TIMEFOLIO K바이오액	17435	-9.15	-10.12	-6.73	-9.12
261070	TIGER 코스닥150바이오	16620	-8.76	-8.02	-7.82	-8.43
498050	HANARO 바이오코리아액티	14645	-8.64	-8.86	-6.09	-8.33
364970	TIGER 바이오TOP10	8685	-7.16	-5.95	-2.54	-5.85

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	750.17	2.38	5.99	8.47	6.91
Materials	622.46	1.87	4.12	9.57	6.75
Industrials	1408.32	1.71	3.56	6.80	5.27
Consumer Discr…	1951.31	1.60	-0.74	0.95	2.35
Consumer Stapl…	917.71	0.25	4.01	5.37	6.28
Health Care	1844.05	1.80	1.01	3.46	1.67
Financials	888.03	0.42	-3.02	-0.53	-2.80
Information Te…	5539.43	0.99	-2.49	-3.18	-2.59
Communication …	451.36	1.44	-0.71	1.57	0.15
Utilities	437.28	0.20	0.54	-1.26	-0.38
Real Estate	262.31	0.38	1.76	1.66	2.80

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	462.35	0.80	-2.43	-2.57	-2.00
가치(IWD)	219.15	1.49	1.91	4.57	3.28
대형(IWL)	170.13	0.99	-0.95	-0.06	-0.30
중소형(IWM)	267.77	1.98	4.33	7.50	7.63
배당(VIG)	223.89	0.91	0.42	1.69	1.49
저변동성(USMV)	94.30	0.74	-0.21	0.21	0.69
모멘텀(MTUM)	255.33	0.98	0.03	1.59	1.03
퀄리티(QUAL)	201.93	1.20	0.17	1.88	1.38

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Moderna, Inc.	Healthcare	49.81	15.84	39.73	69.21	61.41
Intel Corporat…	Technology	54.25	11.72	28.83	37.21	37.76
Teledyne Techn…	Technology	621.28	9.72	14.72	19.40	19.76
Western Digita…	Technology	241.90	8.49	21.66	40.25	28.88
Advanced Micro…	Technology	249.80	7.71	14.18	10.51	11.78

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
The Kraft Hein…	Consumer Defensive	22.40	-5.72	-5.81	-8.31	-8.16
Oracle Corpora…	Technology	173.87	-3.36	-10.26	-18.49	-11.16
Target Corpora…	Consumer Defensive	106.03	-3.03	2.76	10.64	5.49
DBA Sempra	Utilities	85.97	-2.78	-3.29	-4.96	-4.17
GE Vernova Inc.	Industrials	667.94	-2.47	1.18	7.70	-1.71

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.01	1.16	0.34	1.72	1.07
선진국(URTH)	187.62	1.07	-0.17	1.16	0.60
신흥국(EEM)	58.24	1.62	3.29	5.61	3.56
미국(S&P500)	6875.62	1.16	-0.52	0.65	0.25
미국(NASDAQ)	23224.82	1.18	-1.04	-0.38	-0.05
미국(DJIA)	49077.23	1.21	0.36	2.39	1.44
유럽(Eurostoxx50)	5882.88	-0.16	-0.06	2.47	-0.69
일본(Nikkei225)	52774.64	-0.41	1.75	4.05	1.82
중국(CSI300)	4723.07	0.09	0.27	1.95	0.11
홍콩(HangSeng)	26585.06	0.37	0.97	1.82	0.94
대만(TWSE)	31246.37	-1.62	3.82	9.65	6.46
인도(Nifty 50)	25157.50	-0.30	-2.84	-2.93	-3.78
한국(KOSPI)	4909.93	0.49	8.80	17.00	13.93

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	3.59	3.00	10.00	13.00	-29.00	-64.00
US TIPS 10Y	1.91	3.00	-1.00	16.00	-12.00	-28.00
IG Corporate Yield	4.89	4.00	7.00	21.00	-20.00	-48.00
HY Corporate Yield	6.54	11.00	-4.00	-1.00	-26.00	-49.00
High Yield Spread	2.73	8.00	-17.00	-28.00	-9.00	9.00
10Y Breakeven Inflation	2.33	0.00	9.00	4.00	-12.00	-8.00
US T-Bill 3M	3.59	1.60	6.00	-20.00	-65.70	-60.90
US Treasury 10Y	4.25	-4.20	8.40	26.20	-13.30	-32.10
US Treasury 30Y	4.87	-4.90	2.90	29.80	-5.80	6.90
2Y-10Y Spread	0.66	-7.20	-1.60	13.20	15.70	31.90

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	3.14	-5.30	13.90	53.30	65.30	55.90
국고채 10년	3.60	-5.10	24.30	69.00	74.70	78.40
회사채 AA- 3년	3.62	-2.90	11.10	59.70	65.00	39.70
CD 91일	2.68	0.00	-17.00	14.00	17.00	-30.00

※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	98.77	0.13	0.17	-0.29	0.35
USD/KRW	1465.54	-0.41	0.65	0.51	1.52
USD/EUR	1.17	0.43	-0.08	0.40	-0.52
USD/JPY	158.38	0.13	0.72	1.63	1.05
USD/CNY	6.96	-0.07	-0.41	-1.33	-0.47

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	60.67	0.55	3.45	2.94	5.84
Brent(ICE EU)	65.28	0.55	4.07	3.64	7.46
Natural Gas(NY…	5.01	28.26	33.60	20.85	38.50

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4826.00	1.40	7.02	13.25	11.86
Copper(COMEX)	5.80	0.43	0.59	8.32	2.80
Silver(COMEX)	92.37	-1.95	16.25	47.75	30.92

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	421.75	-0.47	-3.45	-2.94	-3.60
Wheat(CBOT)	508.25	-0.39	-1.00	-3.22	0.35
Soybean(CBOT)	1065.00	1.14	1.74	-1.80	3.45
Coffee(ICE US)	347.00	0.14	-2.47	-9.70	-2.88
Sugar(ICE US)	14.77	0.34	-0.91	0.15	1.16

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	89955.09	1.86	-2.63	-0.23	1.38
Ethereum	3021.36	2.92	-4.96	-1.44	0.70