DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-23)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.001 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
-0.001	0.014	-0.024	-0.002	-0.007	0.090

※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	4952.53	0.87	8.72	17.59	14.92
KOSDAQ	970.35	2.00	2.55	5.59	2.62
KOSPI200	722.30	1.03	9.44	20.38	15.72

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	24275	1.23	7.86	23.11	12.15
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6085	7.32	11.45	8.04	19.55
228790	TIGER 화장품	3620	5.23	8.04	5.68	5.39
305720	KODEX 2차전지산업	16350	8.28	13.36	7.11	21.16
469070	RISE AI&로봇	17660	-1.20	21.85	36.41	29.76
364980	TIGER 2차전지TOP10	10190	6.70	11.45	5.83	19.04
364970	TIGER 바이오TOP10	8775	1.04	-4.96	-1.59	-4.88
498400	KODEX 200타겟위클리커	15770	1.22	8.42	17.17	13.82
091180	KODEX 자동차	33145	-3.23	20.00	35.25	32.85

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14035	-1.85	16,414,600

※ 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 %
305720	KODEX 2차전지산업	16350	8.28	13.36	7.11	21.16
465330	RISE 2차전지TOP10	11750	8.10	14.03	9.32	22.84
466810	BNK 2차전지양극재	6720	8.04	12.48	6.01	20.75
305540	TIGER 2차전지테마	20100	7.98	13.07	6.90	21.08
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	6035	7.48	11.55	7.03	20.22

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
466930	SOL 자동차TOP3플러스	20990	-3.87	21.37	39.30	36.83
139290	TIGER 200 경기소비재	27720	-3.60	17.97	31.64	30.36
091180	KODEX 자동차	33145	-3.23	20.00	35.25	32.85
138540	TIGER 현대차그룹+펀더멘	59490	-2.87	21.89	37.95	40.16
494670	TIGER 조선TOP10	30215	-2.14	4.81	7.72	17.52

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	752.17	0.27	5.73	8.55	7.20
Materials	626.30	0.62	4.35	10.04	7.41
Industrials	1401.11	-0.51	2.76	6.13	4.73
Consumer Discr…	1975.02	1.22	0.45	2.12	3.60
Consumer Stapl…	916.46	-0.14	3.58	5.16	6.13
Health Care	1844.67	0.03	0.95	3.36	1.70
Financials	894.07	0.68	-2.21	0.13	-2.14
Information Te…	5578.07	0.70	-1.71	-2.45	-1.91
Communication …	458.45	1.57	0.74	3.04	1.73
Utilities	434.07	-0.73	-0.22	-1.88	-1.11
Real Estate	259.43	-1.10	0.55	0.60	1.67

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	466.05	0.79	-1.54	-1.75	-1.21
가치(IWD)	219.73	0.27	1.99	4.73	3.55
대형(IWL)	171.15	0.57	-0.37	0.51	0.29
중소형(IWM)	269.80	0.75	4.79	8.17	8.45
배당(VIG)	224.07	0.09	0.44	1.73	1.58
저변동성(USMV)	94.72	0.40	0.23	0.65	1.14
모멘텀(MTUM)	256.11	0.28	0.28	1.89	1.34
퀄리티(QUAL)	202.61	0.32	0.44	2.17	1.72

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Enphase Energy…	Technology	40.48	12.54	16.70	26.91	19.94
Arista Network…	Technology	138.41	8.74	6.32	4.40	3.60
Datadog, Inc.	Technology	131.25	6.31	0.30	-13.25	-1.88
Northern Trust…	Financial Services	153.12	6.02	6.86	13.18	9.94
Meta Platforms…	Communication Services	647.63	5.66	0.47	0.49	-0.43

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Abbott Laborat…	Healthcare	108.60	-10.05	-12.32	-13.40	-12.55
McCormick & Co…	Consumer Defensive	61.22	-8.02	-9.04	-7.68	-9.00
GE Aerospace	Industrials	295.00	-7.38	-7.12	-3.49	-8.03
Huntington Ban…	Financial Services	17.64	-6.02	-1.33	4.76	0.92
Dollar Tree, I…	Consumer Defensive	126.77	-4.64	-2.93	7.85	-0.73

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.81	0.56	0.79	2.24	1.63
선진국(URTH)	188.58	0.49	0.28	1.64	1.11
신흥국(EEM)	58.69	0.74	3.65	6.31	4.36
미국(S&P500)	6913.35	0.55	-0.00	1.17	0.80
미국(NASDAQ)	23436.02	0.91	-0.14	0.51	0.86
미국(DJIA)	49384.01	0.63	0.88	2.95	2.07
유럽(Eurostoxx50)	5956.17	1.25	0.95	3.65	0.55
일본(Nikkei225)	53688.89	1.73	3.10	5.70	3.58
중국(CSI300)	4723.71	0.01	0.17	1.95	0.13
홍콩(HangSeng)	26629.96	0.17	0.98	1.96	1.11
대만(TWSE)	31746.08	1.60	4.88	11.16	8.16
인도(Nifty 50)	25289.90	0.53	-2.16	-2.37	-3.28
한국(KOSPI)	4952.53	0.87	8.72	17.59	14.92

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	3.60	1.00	12.00	15.00	-31.00	-67.00
US TIPS 10Y	1.97	6.00	5.00	29.00	-1.00	-23.00
IG Corporate Yield	4.85	-4.00	1.00	15.00	-22.00	-48.00
HY Corporate Yield	6.48	-6.00	-10.00	-7.00	-32.00	-49.00
High Yield Spread	2.69	-4.00	-19.00	-27.00	-15.00	8.00
10Y Breakeven Inflation	2.34	1.00	11.00	4.00	-10.00	-4.00
US T-Bill 3M	3.59	0.00	4.10	-17.50	-65.70	-62.70
US Treasury 10Y	4.25	-0.40	8.00	25.20	-13.70	-35.00
US Treasury 30Y	4.85	-2.40	1.60	26.20	-8.20	3.30
2Y-10Y Spread	0.65	-1.40	-4.00	10.20	17.30	32.00

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	3.11	-2.90	14.60	51.80	62.40	53.20
국고채 10년	3.56	-4.40	17.90	64.50	70.30	73.10
회사채 AA- 3년	3.62	-0.90	11.50	60.20	64.10	38.80
CD 91일	2.68	0.00	-17.00	14.00	17.00	-35.00

※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	98.32	-0.45	-0.29	-0.73	-0.10
USD/KRW	1463.68	-0.95	0.53	0.34	1.39
USD/EUR	1.18	0.21	0.45	0.93	0.02
USD/JPY	158.45	0.18	0.72	1.62	1.10
USD/CNY	6.97	0.18	-0.22	-1.16	-0.34

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	59.35	-2.10	1.09	0.77	3.54
Brent(ICE EU)	64.04	-1.84	1.94	1.73	5.42
Natural Gas(NY…	4.83	-0.98	27.46	15.77	33.42

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4924.40	1.92	8.61	15.19	14.14
Copper(COMEX)	5.80	1.28	0.41	8.20	2.89
Silver(COMEX)	96.22	4.35	18.99	51.99	36.38

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	424.00	0.53	-2.68	-2.42	-3.09
Wheat(CBOT)	515.75	1.58	0.46	-1.80	1.83
Soybean(CBOT)	1064.00	-0.05	1.60	-1.93	3.35
Coffee(ICE US)	347.80	0.09	-2.26	-9.28	-2.66
Sugar(ICE US)	14.96	1.49	0.38	1.44	2.47

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	89454.80	0.09	-3.12	-0.82	0.81
Ethereum	2938.48	-1.36	-7.24	-4.19	-2.06