DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-27)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.039 상승하여 오전 중 지수 하방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 차익 실현 또는 관망 가능성이 높은 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
0.039	0.004	-0.024	-0.007	0.000	0.102

※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	4949.59	-0.81	6.65	16.67	14.85
KOSDAQ	1064.41	7.09	11.18	15.29	12.57
KOSPI200	720.04	-1.00	6.84	18.96	15.36

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6730	10.42	21.38	19.30	32.22
396500	TIGER 반도체TOP10	24575	0.51	6.54	23.32	13.54
305720	KODEX 2차전지산업	17095	4.75	16.77	12.11	26.68
228790	TIGER 화장품	3725	1.92	9.85	8.78	8.44
244580	KODEX 바이오	13160	5.62	5.87	8.10	5.92
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	24545	9.06	6.51	10.05	8.13
461950	KODEX 2차전지액심소재1	6565	8.51	19.54	16.40	30.78
364980	TIGER 2차전지TOP10	10500	2.99	13.34	9.25	22.66
395160	KODEX AI반도체	21280	1.33	6.71	19.46	11.65

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14410	7.10	19,649,652

※ 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 %
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6715	11.92	7.54	-2.35	1.28
261070	TIGER 코스닥150바이오	20585	11.48	12.64	13.51	13.42
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6730	10.42	21.38	19.30	32.22
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	24545	9.06	6.51	10.05	8.13
461950	KODEX 2차전지액심소재1	6565	8.51	19.54	16.40	30.78

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200룽코스닥15	12375	-12.36	-9.03	-0.53	-3.02
307520	TIGER 지주회사	18410	-2.59	7.30	11.28	15.82
138540	TIGER 현대차그룹플러스	57240	-2.25	13.57	30.88	34.86
138530	TIGER LG그룹플러스	9145	-2.19	3.80	2.45	7.08
494420	PLUS 미국배당증가성장주데	9665	-2.03	-1.18	0.29	1.21

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	757.06	0.04	5.31	8.82	7.89
Materials	633.54	0.29	4.65	10.85	8.65
Industrials	1391.36	0.10	1.61	5.19	4.00
Consumer Discr…	1975.29	-0.71	0.43	2.07	3.61
Consumer Stapl…	921.94	-0.05	3.56	5.59	6.77
Health Care	1841.83	0.41	0.66	2.94	1.55
Financials	887.40	0.65	-2.51	-0.62	-2.87
Information Te…	5655.26	0.84	-0.13	-0.91	-0.55
Communication …	465.16	1.32	2.03	4.35	3.22
Utilities	435.71	0.78	0.16	-1.30	-0.74
Real Estate	260.17	-0.02	0.65	0.96	1.96

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	471.09	0.60	-0.27	-0.56	-0.14
가치(IWD)	219.15	0.31	1.40	4.26	3.28
대형(IWL)	172.44	0.55	0.41	1.27	1.05
중소형(IWM)	263.98	-0.31	2.05	5.63	6.11
배당(VIG)	224.62	0.66	0.59	1.91	1.82
저변동성(USMV)	95.48	0.63	1.00	1.43	1.95
모멘텀(MTUM)	257.01	0.59	0.58	2.27	1.69
퀄리티(QUAL)	203.73	0.52	0.86	2.66	2.28

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Arista Network…	Technology	143.68	5.38	9.61	8.84	7.54
Datadog, Inc.	Technology	136.64	5.00	4.92	-9.21	2.15
Baker Hughes C…	Energy	56.29	4.40	12.92	16.05	19.41
Akamai Technol…	Technology	98.66	3.77	9.41	13.60	15.93
Seagate Techno…	Technology	358.29	3.52	14.70	25.11	24.61

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
The Trade Desk…	Communication Services	33.81	-7.50	-9.00	-14.89	-10.27
Intel Corporat…	Technology	42.49	-5.72	-2.90	6.46	7.90
Darden Restaur…	Consumer Cyclical	196.43	-4.73	-1.93	5.50	4.92
Steel Dynamics…	Basic Materials	173.32	-4.41	0.11	4.07	-1.56
Caesars Entert…	Consumer Cyclical	22.37	-4.20	-6.58	-0.96	-5.05

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.72	0.39	1.23	2.81	2.27
선진국(URTH)	189.91	0.56	0.89	2.30	1.82
신흥국(EEM)	59.16	0.15	3.61	6.94	5.19
미국(S&P500)	6950.23	0.50	0.51	1.68	1.34
미국(NASDAQ)	23601.36	0.43	0.58	1.25	1.57
미국(DJIA)	49412.40	0.64	0.80	2.89	2.13
유럽(Eurostoxx50)	5957.80	0.16	0.63	3.51	0.58
일본(Nikkei225)	52885.25	-1.79	0.98	3.82	2.03
중국(CSI300)	4706.96	0.09	-0.32	1.61	-0.23
홍콩(HangSeng)	26765.52	0.06	1.12	2.43	1.62
대만(TWSE)	32064.52	0.32	4.71	11.79	9.25
인도(Nifty 50)	25048.65	-0.95	-2.88	-3.25	-4.20
한국(KOSPI)	4949.59	-0.81	6.65	16.67	14.85

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	3.61	1.00	13.00	13.00	-30.00	-68.00
US TIPS 10Y	1.95	3.00	1.00	22.00	-1.00	-25.00
IG Corporate Yield	4.83	-1.00	2.00	15.00	-24.00	-54.00
HY Corporate Yield	6.46	2.00	-7.00	0.00	-34.00	-56.00
High Yield Spread	2.68	4.00	-16.00	-20.00	-16.00	7.00
10Y Breakeven Inflation	2.32	1.00	8.00	3.00	-12.00	-10.00
US T-Bill 3M	3.58	-0.70	3.20	-14.50	-65.70	-63.00
US Treasury 10Y	4.21	-2.60	7.70	23.00	-16.30	-41.30
US Treasury 30Y	4.80	-2.80	-1.50	25.80	-10.60	-4.30
2Y-10Y Spread	0.60	-3.60	-5.30	10.00	13.70	26.70

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	3.10	-4.10	13.80	46.30	64.20	52.60
국고채 10년	3.54	-4.60	17.00	60.90	74.70	68.50
회사채 AA- 3년	3.61	-3.30	12.20	56.40	66.50	40.10
CD 91일	2.70	1.00	-17.00	15.00	19.00	-33.00

※T-Bill 3M, Treasury 10Y, Treasury 30Y를 제외한 나머지 미국 금리는 전 영업일 기준
자료 : FRED, 한국은행, Yahoo Finance, SK증권

Currency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Dollar Index	97.03	-0.58	-1.53	-1.99	-1.41
USD/KRW	1443.30	-1.36	-0.81	-1.13	-0.02
USD/EUR	1.19	1.14	1.62	2.06	1.18
USD/JPY	154.06	-2.80	-2.08	-1.28	-1.70
USD/CNY	6.95	-0.27	-0.39	-1.37	-0.61

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	60.80	-0.44	3.11	3.22	6.07
Brent(ICE EU)	64.91	-1.47	2.82	3.09	6.85
Natural Gas(NY…	3.83	-27.37	0.27	-9.04	5.89

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5054.10	1.57	10.20	17.29	17.14
Copper(COMEX)	5.94	0.49	2.06	10.24	5.32
Silver(COMEX)	108.88	7.88	29.20	66.88	54.31

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	428.50	-0.46	-1.20	-1.38	-2.06
Wheat(CBOT)	522.50	-1.32	1.65	-0.51	3.16
Soybean(CBOT)	1060.00	-0.73	1.15	-2.27	2.96
Coffee(ICE US)	357.15	1.78	0.14	-6.56	-0.04
Sugar(ICE US)	14.77	0.27	-0.56	0.08	1.16

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	87516.88	1.09	-4.34	-2.88	-1.37
Ethereum	2898.51	2.93	-6.79	-5.33	-3.40

자료: Yahoo Finance, SK증권