DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-28)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.035 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
0.035	0.011	-0.022	-0.011	-0.008	0.091

※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	5084.85	2.73	8.45	19.39	17.99
KOSDAQ	1082.59	1.71	12.12	16.86	14.49
KOSPI200	745.13	3.48	9.31	22.53	19.38

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	26025	5.90	11.23	29.81	20.24
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6825	1.41	21.68	20.61	34.09
395160	KODEX AI반도체	22395	5.24	10.93	25.08	17.50
228790	TIGER 화장품	3710	-0.40	8.58	8.36	8.01
395270	HANARO Fn K-반도체	26385	5.46	10.26	26.92	17.87
305720	KODEX 2차전지산업	17160	0.38	16.10	12.45	27.16
498400	KODEX 200타겟위클리커	16220	2.92	8.45	19.18	17.07
455850	SOL AI반도체소부장	20420	4.45	10.47	16.70	13.67

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14125	-1.98	9,525,449
0091P0	TIGER 코리아원자력	14550	1.50	5,918,861

※ 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 %
476260	HANARO 반도체핵심공정주	10730	7.57	15.37	22.36	17.98
494220	UNICORN SK하이닉스밸	26600	6.46	11.51	25.52	17.39
091160	KODEX 반도체	78105	6.34	11.75	27.29	19.28
091230	TIGER 반도체	81410	6.15	10.96	26.57	18.76
396500	TIGER 반도체TOP10	26025	5.90	11.23	29.81	20.24

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
421320	PLUS 우주항공&UAM	38135	-1.79	10.38	43.89	33.41
475050	ACE KPOP포커스	12130	-1.70	2.87	7.45	-3.73
490480	SOL K방산	33525	-1.70	5.07	22.42	26.94
463250	TIGER K방산&우주	39550	-1.60	6.09	25.63	29.25
449450	PLUS K방산	66735	-1.44	4.87	20.27	25.92

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	764.53	0.99	5.73	9.66	8.96
Materials	633.78	0.04	4.27	10.63	8.69
Industrials	1397.16	0.42	1.79	5.51	4.43
Consumer Discr…	1988.52	0.67	1.05	2.70	4.30
Consumer Stapl…	925.02	0.33	3.59	5.80	7.12
Health Care	1811.28	-1.66	-0.98	1.10	-0.14
Financials	880.80	-0.74	-2.99	-1.38	-3.59
Information Te…	5735.40	1.42	1.32	0.59	0.85
Communication …	465.24	0.02	1.92	4.27	3.23
Utilities	441.14	1.25	1.34	-0.01	0.50
Real Estate	260.53	0.14	0.71	1.07	2.10

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	474.31	0.66	0.48	0.18	0.54
가치(IWD)	219.11	0.00	1.23	4.12	3.26
대형(IWL)	173.21	0.46	0.84	1.72	1.50
중소형(IWM)	264.74	0.29	2.09	5.81	6.42
배당(VIG)	224.48	-0.04	0.48	1.80	1.76
저변동성(USMV)	95.35	-0.18	0.85	1.25	1.82
모멘텀(MTUM)	260.16	1.25	1.72	3.51	2.94
퀄리티(QUAL)	204.12	0.19	0.98	2.81	2.48

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corning Incorp…	Technology	109.76	15.60	20.18	24.88	21.05
Sysco Corporat…	Consumer Defensive	83.93	10.98	10.95	11.99	15.58
General Motors…	Consumer Cyclical	86.37	8.74	5.51	12.28	6.66
Amphenol Corpo…	Technology	167.01	7.36	14.12	19.31	19.54
HCA Healthcare…	Healthcare	505.77	7.07	6.50	5.76	7.52

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Humana Inc.	Healthcare	208.00	-21.10	-22.22	-19.18	-21.36
UnitedHealth G…	Healthcare	282.69	-19.61	-16.39	-14.71	-15.97
Elevance Healt…	Healthcare	323.00	-14.31	-11.59	-5.82	-8.82
CVS Health Cor…	Healthcare	72.14	-13.98	-10.09	-8.58	-9.97
Centene Corpor…	Healthcare	41.51	-10.32	-7.39	3.33	-0.66

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	147.06	0.92	2.01	3.70	3.21
선진국(URTH)	191.27	0.72	1.52	2.99	2.55
신흥국(EEM)	60.33	1.95	5.14	8.91	7.26
미국(S&P500)	6978.60	0.41	0.89	2.08	1.75
미국(NASDAQ)	23817.10	0.91	1.45	2.19	2.50
미국(DJIA)	49003.41	-0.83	-0.06	1.99	1.28
유럽(Eurostoxx50)	5994.59	0.62	1.04	4.06	1.20
일본(Nikkei225)	53333.54	0.85	1.55	4.60	2.90
중국(CSI300)	4705.69	-0.03	-0.40	1.56	-0.26
홍콩(HangSeng)	27126.95	1.35	2.20	3.76	2.99
대만(TWSE)	32317.92	0.79	4.94	12.40	10.11
인도(Nifty 50)	25175.40	0.51	-2.23	-2.71	-3.71
한국(KOSPI)	5084.85	2.73	8.45	19.39	17.99

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	13.00	12.00	-31.00	-69.00
US TIPS 10Y	1.92	-3.00	1.00	19.00	-4.00	-31.00
IG Corporate Yield	4.82	-1.00	2.00	15.00	-25.00	-53.00
HY Corporate Yield	6.46	0.00	-6.00	6.00	-39.00	-52.00
High Yield Spread	2.69	1.00	-17.00	-13.00	-20.00	9.00
10Y Breakeven Inflation	2.32	0.00	9.00	4.00	-10.00	-11.00
US T-Bill 3M	3.57	-0.50	2.70	-16.00	-66.50	-61.80
US Treasury 10Y	4.22	1.00	8.70	16.50	-13.70	-30.50
US Treasury 30Y	4.83	2.70	1.20	23.20	-5.40	6.20
2Y-10Y Spread	0.62	2.00	-4.30	4.50	17.30	38.50

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	3.09	-0.20	13.60	41.70	63.40	52.40
국고채 10년	3.53	-1.40	15.60	54.60	74.50	67.10
회사채 AA- 3년	3.61	-0.40	11.80	52.20	65.50	39.70
CD 91일	2.71	1.00	-16.00	16.00	20.00	-32.00

※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	95.67	-1.42	-2.80	-3.31	-2.80
USD/KRW	1432.47	-0.85	-1.53	-1.88	-0.77
USD/EUR	1.20	1.48	2.76	3.23	2.41
USD/JPY	152.38	-1.80	-3.06	-2.35	-2.78
USD/CNY	6.95	-0.27	-0.35	-1.33	-0.60

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	62.52	3.12	5.53	6.08	9.07
Brent(ICE EU)	66.66	1.63	5.03	5.80	9.73
Natural Gas(NY…	3.79	-44.28	-3.84	-11.23	4.73

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5176.20	1.90	12.04	19.56	19.97
Copper(COMEX)	5.93	-0.85	1.76	9.85	5.20
Silver(COMEX)	111.85	-2.81	29.53	68.41	58.52

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	426.50	-0.41	-1.39	-1.81	-2.51
Wheat(CBOT)	523.50	0.19	1.80	-0.29	3.36
Soybean(CBOT)	1067.50	0.54	1.82	-1.56	3.69
Coffee(ICE US)	369.50	3.72	3.34	-3.23	3.41
Sugar(ICE US)	14.83	0.27	-0.05	0.43	1.58

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	89221.04	1.08	-2.40	-0.97	0.55
Ethereum	3015.77	3.05	-2.83	-1.51	0.51

자료: Yahoo Finance, SK증권