DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-29)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.057 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
0.057	0.007	-0.022	-0.010	-0.004	0.087

※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	5170.81	1.69	9.18	20.90	19.98
KOSDAQ	1133.52	4.70	16.19	21.84	19.88
KOSPI200	758.72	1.82	10.07	24.15	21.56

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	27560	5.90	15.90	36.48	27.33
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7455	9.23	30.67	31.06	46.46
305720	KODEX 2차전지산업	18275	6.50	22.02	19.48	35.42
228790	TIGER 화장품	3780	1.89	9.79	10.38	10.04
364980	TIGER 2차전지TOP10	10855	4.37	15.16	12.85	26.81
395270	HANARO Fn K-반도체	27605	4.62	13.74	31.93	23.32
395160	KODEX AI반도체	23770	6.14	16.03	31.93	24.71
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	7240	9.37	28.36	27.52	44.22
455850	SOL AI반도체소부장	21975	7.62	17.25	25.07	22.32

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	15060	6.62	15,469,865

※ 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 %
475300	SOL 반도체전공정	15830	11.87	23.56	33.50	26.84
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	7240	9.37	28.36	27.52	44.22
476260	HANARO 반도체핵심공정주	11730	9.32	23.85	33.15	28.97
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7455	9.23	30.67	31.06	46.46
261060	TIGER 코스닥150IT	22505	9.22	24.80	32.20	28.31

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	11745	-5.59	-13.46	-5.56	-7.95
091220	TIGER 은행	14245	-2.13	5.45	7.65	8.62
494420	PLUS 미국배당증가성장주데	9540	-1.70	-2.44	-1.11	-0.09
091170	KODEX 은행	13665	-1.51	5.68	7.87	8.24
498410	KODEX 금융고배당TOP1	12430	-1.39	4.93	3.33	5.79

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	770.20	0.74	5.89	10.21	9.77
Materials	634.89	0.18	3.98	10.54	8.88
Industrials	1389.81	-0.53	1.03	4.85	3.88
Consumer Discr…	1975.14	-0.67	0.31	1.93	3.60
Consumer Stapl…	917.81	-0.78	2.52	4.85	6.29
Health Care	1797.28	-0.77	-1.69	0.21	-0.91
Financials	880.56	-0.03	-2.80	-1.43	-3.62
Information Te…	5770.71	0.62	1.92	1.27	1.48
Communication …	465.61	0.08	1.86	4.22	3.32
Utilities	440.10	-0.24	1.04	-0.19	0.26
Real Estate	258.13	-0.92	-0.24	0.13	1.16

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	472.95	-0.32	0.24	-0.07	0.25
가치(IWD)	219.27	0.07	1.13	4.07	3.33
대형(IWL)	173.35	0.08	0.88	1.77	1.58
중소형(IWM)	263.36	-0.52	1.29	5.13	5.86
배당(VIG)	223.90	-0.24	0.18	1.49	1.50
저변동성(USMV)	95.17	-0.17	0.66	1.03	1.62
모멘텀(MTUM)	259.98	-0.09	1.52	3.40	2.87
퀄리티(QUAL)	204.21	0.03	0.93	2.79	2.52

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Seagate Techno…	Technology	442.93	19.14	36.40	52.18	54.04
Western Digita…	Technology	279.70	10.70	29.08	53.39	49.01
Texas Instrume…	Technology	216.17	9.94	13.97	22.76	21.77
F5, Inc.	Technology	292.30	8.09	9.41	15.29	13.90
Microchip Tech…	Technology	80.28	6.81	10.04	25.06	23.45

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Axon Enterpris…	Industrials	549.86	-9.89	-9.70	-5.94	-2.41
Skyworks Solut…	Technology	55.28	-7.94	-8.44	-14.76	-14.16
Textron Inc.	Industrials	86.79	-7.90	-5.70	0.19	-0.30
Humana Inc.	Healthcare	194.03	-6.68	-26.56	-24.15	-26.64
Alexandria Rea…	Real Estate	54.60	-6.10	-0.07	5.27	11.49

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	146.84	-0.15	1.70	3.47	3.05
선진국(URTH)	190.86	-0.22	1.20	2.71	2.33
신흥국(EEM)	60.74	0.65	5.30	9.47	7.99
미국(S&P500)	6978.03	-0.01	0.83	2.03	1.74
미국(NASDAQ)	23857.45	0.17	1.54	2.34	2.68
미국(DJIA)	49015.60	0.02	-0.09	1.96	1.31
유럽(Eurostoxx50)	5933.20	-1.02	-0.15	2.93	0.16
일본(Nikkei225)	53358.71	0.05	1.31	4.54	2.94
중국(CSI300)	4717.99	0.26	-0.22	1.80	0.01
홍콩(HangSeng)	27826.91	2.58	4.45	6.30	5.65
대만(TWSE)	32803.82	1.50	5.81	13.80	11.77
인도(Nifty 50)	25342.75	0.66	-1.46	-2.03	-3.07
한국(KOSPI)	5170.81	1.69	9.18	20.90	19.98

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	-4.00	10.00	9.00	-38.00	-71.00
US TIPS 10Y	1.90	-2.00	-1.00	19.00	-6.00	-30.00
IG Corporate Yield	4.82	0.00	2.00	7.00	-26.00	-45.00
HY Corporate Yield	6.48	2.00	-4.00	4.00	-38.00	-49.00
High Yield Spread	2.71	2.00	-15.00	-5.00	-15.00	5.00
10Y Breakeven Inflation	2.34	2.00	11.00	4.00	-5.00	-6.00
US T-Bill 3M	3.58	-0.60	2.70	-18.10	-66.30	-63.10
US Treasury 10Y	4.25	2.80	13.50	15.80	3.10	-30.00
US Treasury 30Y	4.86	2.80	5.50	21.30	5.30	7.00
2Y-10Y Spread	0.69	6.80	3.50	6.80	41.10	41.00

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	3.07	-2.70	12.80	33.50	58.90	49.70
국고채 10년	3.52	-1.20	16.40	46.80	68.60	65.90
회사채 AA- 3년	3.59	-1.80	11.90	45.40	61.90	37.90
CD 91일	2.70	-1.00	-17.00	14.00	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	96.38	0.17	-2.02	-2.54	-2.07
USD/KRW	1430.26	-0.74	-1.70	-2.04	-0.93
USD/EUR	1.20	0.65	2.06	2.50	1.72
USD/JPY	153.31	-0.67	-2.44	-1.77	-2.18
USD/CNY	6.95	-0.12	-0.43	-1.41	-0.72

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	63.39	1.60	6.53	7.47	10.59
Brent(ICE EU)	67.54	-0.04	5.88	7.10	11.18
Natural Gas(NY…	3.76	-45.87	-7.12	-12.83	4.04

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5404.40	6.39	15.75	24.20	25.26
Copper(COMEX)	5.99	2.70	2.33	10.56	6.13

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	430.75	1.00	-0.28	-0.83	-1.54
Wheat(CBOT)	535.25	2.29	3.86	1.91	5.68
Soybean(CBOT)	1074.75	0.70	2.39	-0.87	4.40
Coffee(ICE US)	351.00	-4.42	-1.79	-7.90	-1.76
Sugar(ICE US)	14.72	-0.74	-0.61	-0.36	0.82

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	88911.36	-0.21	-2.62	-1.28	0.20
Ethereum	3001.87	-0.67	-3.13	-1.97	0.05

자료: Yahoo Finance, SK증권