DAILY RECAP

▶ Summary (2026-01-30)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.034 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
0.034	0.007	-0.019	-0.009	-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	5221.25	0.98	9.08	21.61	21.15
KOSDAQ	1164.41	2.73	17.91	24.61	23.14
KOSPI200	765.59	0.91	9.79	24.71	22.66

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	28395	3.03	17.37	39.58	31.19
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7530	1.01	29.43	31.74	47.94
305720	KODEX 2차전지산업	18185	-0.49	19.68	18.67	34.75
455850	SOL AI반도체소부장	22570	2.71	18.57	27.88	25.63
228790	TIGER 화장품	3865	2.25	11.26	12.82	12.52
395160	KODEX AI반도체	24195	1.79	16.32	33.49	26.94
498400	KODEX 200타겟위클리커	16720	1.30	9.53	21.88	20.68
102970	KODEX 증권	21485	9.37	23.18	35.15	37.86
461950	KODEX 2차전지액심소재1	7195	-0.62	25.33	26.24	43.33

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	15580	3.45	14,192,047

※ 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 %
157500	TIGER 증권	14750	9.79	23.26	35.69	38.11
102970	KODEX 증권	21485	9.37	23.18	35.15	37.86
421320	PLUS 우주항공&UAM	42700	9.04	18.55	57.75	49.38
498860	RISE 코리아금융고배당	17655	4.78	13.28	17.44	17.83
138540	TIGER 현대차그룹플러스	58320	4.12	10.82	30.96	37.40

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	11505	-2.04	-14.86	-7.38	-9.84
469170	ACE 포스코그룹포커스	7270	-1.82	12.17	18.41	28.97
108450	ACE 삼성그룹섹터가중	28110	-0.90	7.26	19.38	19.97
368190	HANARO Fn K-뉴딜디	9410	-0.79	6.02	7.30	12.56
401170	RISE 메타버스	8100	-0.74	4.51	7.43	3.85

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	778.52	1.08	6.39	11.13	10.95
Materials	635.79	0.14	3.65	10.39	9.04
Industrials	1403.94	1.02	1.76	5.80	4.94
Consumer Discr…	1962.52	-0.64	-0.38	1.28	2.94
Consumer Stapl…	917.53	-0.03	2.21	4.68	6.25
Health Care	1792.36	-0.27	-1.90	-0.17	-1.18
Financials	890.32	1.11	-1.57	-0.38	-2.55
Information Te…	5663.34	-1.86	0.09	-0.53	-0.41
Communication …	479.23	2.93	4.55	7.08	6.34
Utilities	440.44	0.08	1.08	-0.07	0.34
Real Estate	261.79	1.42	1.10	1.52	2.59

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	469.44	-0.81	-0.43	-0.76	-0.49
가치(IWD)	220.24	0.42	1.39	4.40	3.79
대형(IWL)	172.74	-0.24	0.50	1.39	1.22
중소형(IWM)	263.35	0.02	0.99	5.00	5.86
배당(VIG)	224.30	0.17	0.29	1.62	1.68
저변동성(USMV)	94.71	-0.47	0.18	0.51	1.13
모멘텀(MTUM)	261.16	0.41	1.81	3.81	3.33
퀄리티(QUAL)	204.76	0.24	1.09	3.00	2.80

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Southwest Airl…	Industrials	48.43	18.53	13.19	26.03	17.26
Royal Caribbea…	Consumer Cyclical	345.60	18.52	18.66	25.24	22.01
Meta Platforms…	Communication Services	738.31	10.40	13.73	15.03	13.51
Norwegian Crui…	Consumer Cyclical	22.92	10.25	2.03	10.80	0.61
Carnival Corpo…	Consumer Cyclical	31.14	8.43	3.31	10.18	0.71

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Las Vegas Sand…	Consumer Cyclical	52.71	-13.96	-13.12	-17.83	-19.17
United Rentals…	Industrials	786.97	-12.87	-12.85	-7.05	-6.87
First Solar, I…	Technology	224.01	-10.18	-9.02	-12.86	-18.35
Microsoft Corp…	Technology	433.50	-9.99	-7.31	-10.17	-8.34
ServiceNow, In…	Technology	116.73	-9.94	-14.69	-24.99	-20.83

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	146.70	-0.10	1.45	3.31	2.95
선진국(URTH)	190.79	-0.00	1.06	2.62	2.29
신흥국(EEM)	60.44	-0.50	4.29	8.78	7.48
미국(S&P500)	6969.01	-0.13	0.64	1.86	1.61
미국(NASDAQ)	23685.12	-0.72	0.75	1.60	1.93
미국(DJIA)	49071.56	0.11	-0.05	2.03	1.42
유럽(Eurostoxx50)	5891.95	-0.70	-0.96	2.16	-0.54
일본(Nikkei225)	53375.60	0.03	1.09	4.51	2.98
중국(CSI300)	4753.87	0.76	0.43	2.52	0.77
홍콩(HangSeng)	27968.09	0.51	4.52	6.72	6.19
대만(TWSE)	32536.27	-0.82	4.35	12.58	10.86
인도(Nifty 50)	25418.90	0.30	-1.07	-1.71	-2.78
한국(KOSPI)	5221.25	0.98	9.08	21.61	21.15

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	3.53	-3.00	7.00	-6.00	-41.00	-64.00
US TIPS 10Y	1.90	0.00	-1.00	12.00	-8.00	-23.00
IG Corporate Yield	4.83	1.00	5.00	5.00	-12.00	-44.00
HY Corporate Yield	6.49	1.00	-2.00	-4.00	-44.00	-47.00
High Yield Spread	2.72	1.00	-15.00	-13.00	-41.00	6.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	2.00	14.00	7.00	3.00	-6.00
US T-Bill 3M	3.58	-0.20	4.00	-13.80	-60.20	-60.80
US Treasury 10Y	4.23	-2.40	9.70	12.60	0.70	-32.80
US Treasury 30Y	4.85	-0.60	4.10	18.40	4.70	6.40
2Y-10Y Spread	0.70	0.60	2.70	18.60	41.70	31.20

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	3.90	15.40	39.00	62.80	53.60
국고채 10년	3.56	3.90	17.20	49.60	72.50	69.80
회사채 AA- 3년	3.63	3.70	15.00	50.40	65.60	41.60
CD 91일	2.72	2.00	-15.00	17.00	21.00	-31.00

※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	96.18	-0.28	-2.12	-2.68	-2.27
USD/KRW	1433.77	0.09	-1.45	-1.81	-0.68
USD/EUR	1.20	-0.43	2.05	2.54	1.83
USD/JPY	153.14	0.45	-2.43	-1.86	-2.29
USD/CNY	6.95	-0.10	-0.37	-1.33	-0.69

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	65.53	3.67	9.44	10.97	14.32
Brent(ICE EU)	69.67	1.86	8.48	10.32	14.68
Natural Gas(NY…	3.89	-47.86	-8.11	-11.10	7.52

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5419.20	2.22	14.90	23.91	25.61
Copper(COMEX)	6.30	6.91	7.25	15.94	11.69
Silver(COMEX)	116.61	3.10	29.35	70.17	65.28

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	431.00	0.23	-0.10	-0.77	-1.49
Wheat(CBOT)	541.75	1.07	4.80	3.12	6.96
Soybean(CBOT)	1072.00	-0.28	2.00	-1.08	4.13
Coffee(ICE US)	345.00	-1.71	-3.40	-9.29	-3.44
Sugar(ICE US)	14.71	0.00	-0.63	-0.46	0.75

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	84138.86	-5.66	-7.54	-6.48	-5.18
Ethereum	2807.58	-6.62	-9.00	-8.22	-6.43

자료: Yahoo Finance, SK증권