DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-12)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.029 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
-0.029	0.011	-0.010	-0.047	0.001	0.065

※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	5609.95	1.40	-0.23	13.79	30.17
KOSDAQ	1136.83	-0.07	0.55	10.24	20.23
KOSPI200	834.05	1.34	0.06	15.91	33.63

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	33210	-1.07	5.87	29.75	53.43
498400	KODEX 200타겟위클리커	17735	1.34	0.03	14.22	29.83
102970	KODEX 증권	27470	6.78	3.24	35.36	76.26
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4520	0.67	-0.52	1.20	2.12
091160	KODEX 반도체	98400	-0.83	4.71	27.86	50.27
455850	SOL AI반도체소부장	26220	-3.57	7.42	27.67	45.95
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6760	-0.59	-3.72	6.93	32.81
305720	KODEX 2차전지산업	16810	0.33	-3.30	4.70	24.56

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080G0	KODEX 방산TOP10	14380	-0.86	7,585,094
0091P0	TIGER 코리아원자력	19610	0.72	4,409,072

※ 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	18940	6.85	3.46	36.01	77.34
102970	KODEX 증권	27470	6.78	3.24	35.36	76.26
407300	HANARO Fn골프테마	11515	4.16	-0.33	8.89	23.62
494670	TIGER 조선TOP10	29695	3.90	1.91	3.24	15.50
139270	TIGER 200 금융	16365	3.58	-2.82	13.25	27.76

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
395280	HANARO Fn K-게임	3905	-3.94	-3.31	-0.60	1.43
471760	TIGER AI반도체핵심공정	19365	-3.75	9.38	32.26	54.67
364990	TIGER 게임TOP10	5335	-3.61	-2.87	0.49	2.60
455850	SOL AI반도체소부장	26220	-3.57	7.42	27.67	45.95
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6190	-3.51	-0.71	-4.69	-6.64

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	869.43	2.48	2.46	12.86	23.91
Materials	626.33	-0.33	-4.80	0.29	7.41
Industrials	1432.15	-0.27	-2.92	1.72	7.05
Consumer Discr…	1825.06	-0.27	-0.95	-4.81	-4.27
Consumer Stapl…	945.64	-1.29	-3.42	1.81	9.51
Health Care	1778.10	-0.20	-2.40	-2.25	-1.97
Financials	822.87	-0.83	-3.59	-7.35	-9.93
Information Te…	5465.64	0.35	0.33	-1.87	-3.89
Communication …	450.41	0.01	0.72	-0.76	-0.06
Utilities	466.59	-0.81	-1.08	4.17	6.29
Real Estate	269.09	-1.12	-2.25	1.81	5.46

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	451.32	-0.01	-0.06	-2.64	-4.33
가치(IWD)	217.58	-0.22	-2.30	-0.44	2.54
대형(IWL)	167.70	-0.06	-0.78	-1.68	-1.73
중소형(IWM)	252.85	-0.20	-2.97	-2.35	1.64
배당(VIG)	220.99	-0.30	-2.14	-1.48	0.18
저변동성(USMV)	95.42	-0.52	-1.04	0.15	1.89
모멘텀(MTUM)	248.79	0.21	-0.89	-1.72	-1.56
퀄리티(QUAL)	199.52	-0.38	-1.52	-1.19	0.17

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Mosaic Company…	Basic Materials	29.15	10.08	3.50	8.10	16.51
Oracle Corpora…	Technology	163.12	9.18	7.24	-5.05	-16.65
CF Industries …	Basic Materials	120.13	9.16	17.80	32.62	49.92
Valero Energy …	Energy	231.05	6.46	10.62	22.21	39.77
Sandisk Corpor…	Technology	655.43	5.90	6.73	40.46	138.13

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Fair Isaac Cor…	Technology	1165.23	-9.33	-14.44	-23.37	-29.09
The Campbell's…	Consumer Defensive	22.94	-7.05	-13.90	-15.81	-17.21
ConAgra Brands…	Consumer Defensive	16.98	-6.08	-10.04	-6.06	-1.85
International …	Basic Materials	68.72	-5.67	-12.99	-5.43	1.01
McCormick & Co…	Consumer Defensive	59.93	-5.46	-11.84	-10.47	-10.92

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	142.94	-0.08	-1.85	-1.06	0.32
선진국(URTH)	186.02	-0.18	-1.67	-1.31	-0.26
신흥국(EEM)	58.83	0.26	-2.90	0.99	4.61
미국(S&P500)	6775.80	-0.08	-1.13	-1.59	-1.21
미국(NASDAQ)	22716.13	0.08	-0.07	-1.90	-2.24
미국(DJIA)	47417.27	-0.61	-3.00	-3.10	-1.99
유럽(Eurostoxx50)	5794.68	-0.73	-2.97	-2.20	-2.18
일본(Nikkei225)	55025.37	1.43	-2.78	2.57	6.16
중국(CSI300)	4704.50	0.64	0.39	0.62	-0.28
홍콩(HangSeng)	25898.76	-0.24	-1.73	-1.81	-1.67
대만(TWSE)	34114.19	4.10	2.35	10.22	16.23
인도(Nifty 50)	23866.85	-1.63	-5.20	-6.67	-8.72
한국(KOSPI)	5609.95	1.40	-0.23	13.79	30.17

Fixed Income

US Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
Fed Funds (EFFR)	3.64	0.00	0.00	-24.00	-69.00	-69.00
US Treasury 2Y	3.57	1.00	7.00	3.00	5.00	-32.00
US TIPS 10Y	1.82	4.00	-6.00	-6.00	15.00	-9.00
IG Corporate Yield	4.90	4.00	8.00	8.00	17.00	-22.00
HY Corporate Yield	6.82	-8.00	21.00	19.00	41.00	-35.00
High Yield Spread	3.06	-13.00	19.00	15.00	28.00	-10.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	3.00	1.00	11.00	0.00	5.00
US T-Bill 3M	3.60	0.50	0.70	3.20	-32.80	-59.50
US Treasury 10Y	4.21	7.20	1.00	6.70	14.70	-8.00
US Treasury 30Y	4.86	8.60	0.90	6.70	17.80	25.40
2Y-10Y Spread	0.64	6.20	-6.00	3.70	9.70	24.00

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	-25.00
국고채 3년	3.25	-3.00	-1.40	15.20	82.20	69.30
국고채 10년	3.61	-2.10	-14.60	23.00	79.50	84.80
회사채 AA- 3년	3.85	-2.90	5.80	26.00	94.40	71.40
CD 91일	2.83	0.00	5.00	0.00	29.00	-1.00

※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	99.27	0.45	1.21	1.22	0.87
USD/KRW	1476.54	0.82	1.77	1.52	2.28
USD/EUR	1.16	-0.39	-1.49	-1.58	-1.52
USD/JPY	158.90	0.67	2.06	1.75	1.38
USD/CNY	6.86	-0.67	-0.41	-1.25	-1.87

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	88.40	5.93	22.84	38.37	54.22
Brent(ICE EU)	90.33	2.88	17.47	32.11	48.69
Natural Gas(NY…	3.22	6.72	6.12	-13.11	-10.92

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5185.60	-0.84	1.54	8.04	20.19
Copper(COMEX)	5.91	0.07	1.19	2.25	4.75
Silver(COMEX)	85.97	-3.49	2.90	4.69	21.85

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	460.50	5.56	6.15	6.05	5.26
Wheat(CBOT)	596.25	1.97	4.53	11.19	17.72
Soybean(CBOT)	1214.25	2.27	5.32	11.20	17.95
Coffee(ICE US)	286.40	-4.71	-1.51	-12.96	-19.84
Sugar(ICE US)	14.22	-1.11	0.62	-2.25	-2.60

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70695.93	1.10	4.16	-7.32	-20.33
Ethereum	2068.57	1.54	4.17	-12.93	-31.06

자료: Yahoo Finance, SK증권