DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-16)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.007 하락하여 오전 중 지수 상방 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
-0.007	0.006	0.014	-0.027	0.003	0.060

※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	5487.24	-1.72	-3.00	10.26	27.33
KOSDAQ	1152.96	0.40	1.56	11.02	21.93
KOSPI200	812.93	-1.76	-3.12	11.76	30.24

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	32365	-2.54	1.81	24.16	49.53
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4600	0.66	1.05	2.87	3.93
305720	KODEX 2차전지산업	16185	-3.43	-6.72	0.76	19.93
498400	KODEX 200타겟위클리커	17025	-1.67	-3.16	10.18	26.42
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6390	-4.13	-8.56	0.98	25.54
228790	TIGER 화장품	3420	2.24	-3.89	-2.19	-0.44
091160	KODEX 반도체	96935	-1.19	1.96	23.83	48.04

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	21350	6.06	12,312,304
0098F0	KODEX 원자력SMR	20315	4.74	5,873,992
0080G0	KODEX 방산TOP10	14500	-0.92	3,556,688

※ 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 %
364990	TIGER 게임TOP10	5660	5.79	2.85	6.32	8.85
300950	KODEX 게임산업	6695	5.60	2.37	5.08	7.03
395280	HANARO Fn K-게임	4130	5.22	2.15	4.94	7.27
433500	ACE 원자력TOP10	69565	4.83	10.49	32.07	70.71
117700	KODEX 건설	6865	4.81	8.98	31.95	68.26

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
117460	KODEX 에너지화학	15080	-4.62	-5.94	4.40	21.42
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	6170	-4.34	-8.44	0.03	22.91
466810	BNK 2차전지양극재	6650	-4.25	-7.87	-0.46	19.50
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6390	-4.13	-8.56	0.98	25.54
465330	RISE 2차전지TOP10	12125	-4.11	-6.68	3.03	26.76

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	881.61	0.41	3.39	13.51	25.64
Materials	617.54	-1.04	-5.47	-1.39	5.91
Industrials	1390.60	-0.39	-5.24	-1.39	3.94
Consumer Discr…	1773.20	-0.65	-3.40	-7.25	-6.99
Consumer Stapl…	951.63	0.54	-2.38	2.20	10.20
Health Care	1741.92	-0.28	-3.99	-4.14	-3.96
Financials	809.91	0.05	-4.47	-8.46	-11.35
Information Te…	5302.08	-1.29	-2.37	-4.65	-6.76
Communication …	438.73	-0.98	-1.74	-3.30	-2.65
Utilities	474.38	0.94	0.23	5.61	8.07
Real Estate	267.94	0.20	-2.51	1.23	5.00

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	438.29	-1.13	-2.68	-5.25	-7.09
가치(IWD)	214.74	0.03	-3.20	-1.78	1.20
대형(IWL)	164.03	-0.70	-2.65	-3.73	-3.88
중소형(IWM)	246.59	-0.33	-4.82	-4.70	-0.88
배당(VIG)	217.54	-0.25	-3.23	-2.95	-1.39
저변동성(USMV)	95.07	0.08	-1.34	-0.23	1.52
모멘텀(MTUM)	243.44	-0.19	-2.67	-3.76	-3.68
퀄리티(QUAL)	195.15	-0.55	-3.36	-3.29	-2.03

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Sandisk Corpor…	Technology	661.62	6.92	7.29	37.50	140.38
Ares Managemen…	Financial Services	101.76	5.45	-12.31	-29.51	-38.82
Micron Technol…	Technology	426.13	5.13	4.23	15.81	35.10
Blackstone Inc.	Financial Services	106.78	4.56	-8.10	-22.87	-32.76
International …	Consumer Cyclical	37.25	4.49	-13.02	-11.90	-7.45

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Ulta Beauty, I…	Consumer Cyclical	535.72	-14.24	-19.36	-17.94	-13.60
Adobe Inc.	Technology	249.32	-7.58	-6.05	-16.21	-25.20
Insulet Corpor…	Healthcare	219.84	-6.88	-9.54	-16.78	-22.30
Mosaic Company…	Basic Materials	29.31	-6.54	4.11	8.05	17.15
Freeport-McMoR…	Basic Materials	56.38	-4.78	-11.49	-5.19	8.57

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	139.54	-0.65	-3.74	-3.38	-2.07
선진국(URTH)	181.75	-0.76	-3.52	-3.51	-2.55
신흥국(EEM)	56.80	-0.26	-5.57	-2.65	1.00
미국(S&P500)	6632.19	-0.61	-2.89	-3.60	-3.30
미국(NASDAQ)	22105.36	-0.93	-2.48	-4.41	-4.86
미국(DJIA)	46558.47	-0.26	-4.14	-4.74	-3.77
유럽(Eurostoxx50)	5716.61	-0.56	-3.85	-3.52	-3.50
일본(Nikkei225)	53819.61	-1.16	-4.32	0.08	3.83
중국(CSI300)	4669.14	-0.39	-0.35	-0.18	-1.03
홍콩(HangSeng)	25465.60	-0.98	-2.81	-3.46	-3.31
대만(TWSE)	33400.32	-0.54	-0.26	7.26	13.80
인도(Nifty 50)	23151.10	-2.06	-7.12	-9.16	-11.46
한국(KOSPI)	5487.24	-1.72	-3.00	10.26	27.33

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	3.76	12.00	31.00	24.00	20.00	-25.00
US TIPS 10Y	1.89	4.00	5.00	-4.00	19.00	-10.00
IG Corporate Yield	5.08	9.00	30.00	21.00	33.00	-15.00
HY Corporate Yield	7.06	16.00	51.00	41.00	60.00	-22.00
High Yield Spread	3.17	8.00	31.00	26.00	38.00	-3.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	-2.00	4.00	10.00	0.00	7.00
US T-Bill 3M	3.60	-0.20	0.30	7.80	-32.50	-58.50
US Treasury 10Y	4.28	1.20	11.30	9.10	22.40	1.10
US Treasury 30Y	4.91	2.30	9.40	5.00	22.90	31.10
2Y-10Y Spread	0.52	-10.80	-19.70	-14.90	2.40	26.10

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	3.34	6.70	13.80	24.50	90.70	76.80
국고채 10년	3.70	5.20	6.20	29.20	88.80	93.10
회사채 AA- 3년	3.92	5.30	17.30	33.70	101.80	78.10
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	100.36	0.62	1.99	2.27	1.97
USD/KRW	1499.99	2.00	2.97	3.09	3.90
USD/EUR	1.14	-0.85	-2.30	-2.74	-2.78
USD/JPY	159.54	0.21	1.88	2.03	1.79
USD/CNY	6.90	0.39	0.09	-0.69	-1.44

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	98.71	3.11	31.17	51.38	72.21
Brent(ICE EU)	98.91	-1.54	23.48	41.92	62.81
Natural Gas(NY…	3.13	-3.15	3.14	-14.91	-13.46

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5061.70	-1.06	-1.04	4.89	17.32
Copper(COMEX)	5.76	-1.16	-1.23	-0.62	2.07
Silver(COMEX)	81.34	-3.93	-2.98	-1.76	15.29

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	467.25	4.24	7.20	7.48	6.80
Wheat(CBOT)	613.75	3.63	6.58	13.94	21.17
Soybean(CBOT)	1225.25	1.01	5.53	11.74	19.01
Coffee(ICE US)	292.75	-1.26	0.66	-10.17	-18.07
Sugar(ICE US)	14.37	-0.07	1.25	-1.08	-1.58

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	71708.80	0.69	4.45	-4.10	-19.18
Ethereum	2129.70	1.55	5.60	-7.43	-29.02

자료: Yahoo Finance, SK증권