DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-17)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.023 하락하여 오전 중 지수 상방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 순매수 유입에 우호적인 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
-0.023	0.012	0.001	-0.042	-0.005	0.069

※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	5549.85	1.14	-2.11	10.99	28.78
KOSDAQ	1138.29	-1.27	0.16	9.25	20.38
KOSPI200	826.83	1.71	-1.74	13.03	32.47

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	33110	2.30	3.42	25.85	52.97
498400	KODEX 200타겟위클리커	17270	1.44	-1.99	11.23	28.24
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4575	-0.54	0.43	2.25	3.37
305720	KODEX 2차전지산업	15935	-1.54	-7.88	-0.80	18.08
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6270	-1.88	-9.88	-0.95	23.18
395270	HANARO Fn K-반도체	33895	3.26	3.06	25.80	51.42

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080G0	KODEX 방산TOP10	14470	-0.21	7,758,841
0091P0	TIGER 코리아원자력	20935	-1.94	7,541,521
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	12280	-3.12	4,976,065
0098F0	KODEX 원자력SMR	19965	-1.72	4,219,055

※ 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 %
488210	KIWOOM K-반도체북미공	21120	5.31	7.82	29.45	53.10
494220	UNICORN SK하이닉스밸	33175	4.75	4.23	24.41	46.40
363580	KODEX 200IT TR	32490	3.41	-0.20	17.68	39.23
476260	HANARO 반도체액심공정주	12550	3.33	1.91	19.68	37.99
360140	KODEX 200룽코스닥15	12975	3.26	-1.83	-0.08	1.68

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
457990	PLUS 태양광&ESS	31700	-3.24	0.88	22.36	49.81
479850	HANARO K-뷰티	14660	-3.23	-5.04	-2.75	0.38
377990	TIGER Fn신재생에너지	24635	-3.22	1.68	18.00	39.14
117700	KODEX 건설	6645	-3.20	4.75	26.70	62.87
228790	TIGER 화장품	3315	-3.07	-6.19	-5.18	-3.49

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	884.99	0.38	3.48	13.41	26.12
Materials	621.08	0.57	-4.57	-0.97	6.51
Industrials	1402.37	0.85	-4.20	-0.66	4.82
Consumer Discr…	1796.89	1.34	-2.02	-5.89	-5.75
Consumer Stapl…	952.32	0.07	-2.08	2.14	10.28
Health Care	1754.96	0.75	-3.06	-3.39	-3.24
Financials	816.95	0.87	-3.41	-7.51	-10.58
Information Te…	5375.76	1.39	-0.99	-3.25	-5.47
Communication …	443.20	1.02	-0.76	-2.30	-1.66
Utilities	477.10	0.57	0.74	6.05	8.69
Real Estate	269.86	0.72	-1.70	1.86	5.76

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	443.56	1.20	-1.47	-4.02	-5.98
가치(IWD)	216.61	0.87	-2.20	-0.98	2.08
대형(IWL)	165.79	1.07	-1.53	-2.67	-2.85
중소형(IWM)	248.92	0.94	-3.65	-3.79	0.06
배당(VIG)	219.24	0.78	-2.30	-2.19	-0.62
저변동성(USMV)	95.64	0.60	-0.72	0.33	2.12
모멘텀(MTUM)	246.78	1.37	-1.24	-2.44	-2.35
퀄리티(QUAL)	196.98	0.94	-2.34	-2.38	-1.11

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Ciena Corporat…	Technology	363.88	7.85	9.35	31.50	47.88
Dollar Tree, I…	Consumer Defensive	114.36	6.42	-6.25	-8.68	-10.45
Sandisk Corpor…	Technology	703.63	6.35	13.39	43.77	155.64
Norwegian Crui…	Consumer Cyclical	19.84	5.14	-10.38	-11.56	-12.91
Western Digita…	Technology	286.21	5.11	4.88	18.44	52.48

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Mosaic Company…	Basic Materials	27.67	-5.60	-1.37	1.74	10.59
CF Industries …	Basic Materials	122.33	-5.59	14.24	31.37	52.66
CrowdStrike Ho…	Technology	423.84	-4.06	4.44	-2.92	-6.56
Bio-Techne Corp	Healthcare	48.81	-4.01	-12.50	-20.37	-18.17
Gartner, Inc.	Technology	160.25	-3.89	0.56	-19.92	-32.39

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	141.48	1.39	-2.26	-2.05	-0.71
선진국(URTH)	184.04	1.26	-2.16	-2.29	-1.32
신흥국(EEM)	58.38	2.78	-2.73	-0.09	3.81
미국(S&P500)	6699.38	1.01	-1.81	-2.60	-2.32
미국(NASDAQ)	22374.18	1.22	-1.26	-3.20	-3.71
미국(DJIA)	46946.41	0.83	-3.08	-3.91	-2.97
유럽(Eurostoxx50)	5739.01	0.39	-3.28	-3.14	-3.12
일본(Nikkei225)	53751.15	-0.13	-4.17	-0.13	3.70
중국(CSI300)	4671.56	0.05	-0.33	-0.16	-0.98
홍콩(HangSeng)	25834.02	1.45	-1.13	-2.06	-1.92
대만(TWSE)	33342.51	-0.17	-0.59	6.79	13.60
인도(Nifty 50)	23408.80	1.11	-5.70	-8.00	-10.47
한국(KOSPI)	5549.85	1.14	-2.11	10.99	28.78

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	3.73	-3.00	21.00	21.00	17.00	-21.00
US TIPS 10Y	1.92	3.00	6.00	-1.00	22.00	-6.00
IG Corporate Yield	5.11	3.00	30.00	24.00	36.00	-10.00
HY Corporate Yield	7.17	11.00	60.00	52.00	71.00	-28.00
High Yield Spread	3.28	11.00	44.00	37.00	49.00	-12.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	0.00	9.00	13.00	-2.00	6.00
US T-Bill 3M	3.61	0.20	1.20	6.00	-26.30	-58.30
US Treasury 10Y	4.22	-6.50	16.40	7.10	14.40	-8.80
US Treasury 30Y	4.86	-4.90	16.10	3.50	18.40	24.40
2Y-10Y Spread	0.49	-3.50	-4.60	-13.90	-2.60	12.20

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	-25.00
국고채 3년	3.30	-3.80	15.80	30.10	88.20	70.40
국고채 10년	3.68	-2.10	10.90	36.70	89.30	86.70
회사채 AA- 3년	3.89	-3.20	18.20	38.00	100.60	72.60
CD 91일	2.82	-1.00	4.00	-2.00	25.00	-2.00

※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 %
USD/KRW	1490.18	1.33	2.33	2.43	3.22
USD/EUR	1.15	-0.13	-1.62	-2.04	-2.08
USD/JPY	159.09	-0.07	1.61	1.75	1.51
USD/CNY	6.89	0.38	0.08	-0.70	-1.45

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	94.19	-4.58	22.61	43.03	64.32
Brent(ICE EU)	100.82	-2.25	23.00	43.08	65.96
Natural Gas(NY…	3.03	-3.39	0.00	-17.47	-16.39

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5009.50	-0.85	-2.04	3.56	16.11
Copper(COMEX)	5.84	2.15	0.15	0.62	3.50
Silver(COMEX)	81.00	0.11	-3.54	-2.52	14.81

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	454.75	0.50	4.23	4.60	3.94
Wheat(CBOT)	597.00	-3.48	3.20	10.52	17.87
Soybean(CBOT)	1155.25	-4.60	-0.54	5.23	12.21
Coffee(ICE US)	293.10	0.95	0.95	-9.65	-17.97
Sugar(ICE US)	14.18	-1.32	-0.23	-2.31	-2.88

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	74728.70	2.66	7.93	0.39	-15.78
Ethereum	2369.73	8.83	15.88	3.68	-21.02

자료: Yahoo Finance, SK증권