DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-18)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.004 상승하여 오전 중 지수 하방 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
0.004	-0.014	-0.028	-0.037	0.009	0.183

※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	5640.48	1.63	-0.76	12.25	30.88
KOSDAQ	1136.94	-0.12	-0.05	8.77	20.24
KOSPI200	840.89	1.70	-0.37	14.30	34.72

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	33100	-0.03	2.60	24.67	52.92
498400	KODEX 200타겟위클리커	17550	1.62	-0.66	12.47	30.32
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6410	2.23	-7.61	1.21	25.93
091160	KODEX 반도체	99470	0.00	3.19	24.83	51.91
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4580	0.11	0.48	2.29	3.48
305720	KODEX 2차전지산업	16230	1.85	-5.99	1.03	20.27

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	20915	-0.10	4,926,750
0080G0	KODEX 방산TOP10	14420	-0.35	4,855,733
0098F0	KODEX 원자력SMR	20090	0.63	3,962,062
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	12435	1.26	3,692,333

※ 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 %
457990	PLUS 태양광&ESS	33105	4.43	4.83	26.95	56.45
479850	HANARO K-뷰티	15305	4.40	-0.55	1.42	4.79
381560	HANARO Fn전기&수소차	13155	3.46	-1.83	10.20	32.08
385600	ACE 2차전지&친환경차액티	10275	3.42	-2.92	7.93	29.41
466930	SOL 자동차TOP3플러스	21620	3.35	-2.01	12.06	40.94

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
476000	UNICORN 포스트IPO액	12695	-4.37	2.11	3.82	9.30
488210	KIWOOM K-반도체북미공	20595	-2.49	4.42	25.21	49.29
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6110	-2.32	-1.25	-5.02	-7.84
385710	TIME K이노베이션액티브	12655	-1.71	-2.39	6.17	19.22
475300	SOL 반도체전공정	17480	-1.66	-2.06	18.31	40.06

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	894.01	1.02	4.10	14.05	27.41
Materials	622.17	0.18	-4.11	-0.93	6.70
Industrials	1405.84	0.25	-3.72	-0.54	5.08
Consumer Discr…	1814.78	1.00	-1.00	-4.86	-4.81
Consumer Stapl…	947.78	-0.48	-2.36	1.53	9.76
Health Care	1738.73	-0.92	-3.70	-4.24	-4.14
Financials	821.12	0.51	-2.66	-6.89	-10.12
Information Te…	5387.05	0.21	-0.74	-3.02	-5.27
Communication …	446.16	0.67	-0.18	-1.68	-1.00
Utilities	475.88	-0.26	0.42	5.61	8.41
Real Estate	270.41	0.20	-1.34	1.97	5.97

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	443.71	0.03	-1.37	-3.93	-5.95
가치(IWD)	216.84	0.11	-1.95	-0.93	2.19
대형(IWL)	165.71	-0.05	-1.48	-2.70	-2.89
중소형(IWM)	250.05	0.45	-2.97	-3.37	0.51
배당(VIG)	218.89	-0.16	-2.28	-2.34	-0.78
저변동성(USMV)	95.09	-0.58	-1.25	-0.27	1.54
모멘텀(MTUM)	248.23	0.59	-0.59	-1.90	-1.78
퀄리티(QUAL)	196.88	-0.05	-2.26	-2.43	-1.16

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Western Digita…	Technology	313.81	9.64	14.37	28.55	67.19
Delta Air Line…	Industrials	64.83	6.56	0.98	-4.84	-6.13
Global Payment…	Industrials	72.42	6.42	-4.87	-4.15	-4.12
Seagate Techno…	Technology	421.09	5.59	7.40	15.74	46.45
Apollo Global …	Financial Services	108.89	5.26	-1.47	-16.03	-25.73

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
The Trade Desk…	Communication Services	25.07	-7.42	-3.75	-19.74	-33.47
Eli Lilly and …	Healthcare	930.35	-5.94	-7.66	-10.62	-13.89
Corpay, Inc.	Technology	297.94	-3.96	-9.39	-7.93	-0.88
Intel Corporat…	Technology	44.06	-3.72	-2.80	-1.44	11.88
Cencora, Inc.	Healthcare	334.71	-3.23	-6.90	-5.03	-1.23

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	141.88	0.28	-1.84	-1.81	-0.43
선진국(URTH)	184.49	0.24	-1.79	-2.07	-1.08
신흥국(EEM)	58.75	0.63	-1.94	0.36	4.46
미국(S&P500)	6716.09	0.25	-1.47	-2.35	-2.08
미국(NASDAQ)	22479.53	0.47	-0.77	-2.73	-3.25
미국(DJIA)	46993.26	0.10	-2.73	-3.78	-2.87
유럽(Eurostoxx50)	5769.25	0.53	-2.56	-2.64	-2.61
일본(Nikkei225)	53700.39	-0.09	-4.00	-0.34	3.60
중국(CSI300)	4637.44	-0.73	-0.97	-0.92	-1.70
홍콩(HangSeng)	25868.54	0.13	-0.78	-1.94	-1.78
대만(TWSE)	33836.57	1.48	0.58	8.04	15.29
인도(Nifty 50)	23581.15	0.74	-4.60	-7.18	-9.81
한국(KOSPI)	5640.48	1.63	-0.76	12.25	30.88

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	3.68	-5.00	28.00	20.00	16.00	-34.00
US TIPS 10Y	1.87	-5.00	10.00	-5.00	19.00	-14.00
IG Corporate Yield	5.06	-5.00	34.00	23.00	33.00	-17.00
HY Corporate Yield	7.08	-9.00	52.00	41.00	64.00	-28.00
High Yield Spread	3.27	-1.00	32.00	29.00	48.00	2.00
10Y Breakeven Inflation	2.37	1.00	10.00	13.00	-1.00	8.00
US T-Bill 3M	3.61	0.00	1.20	6.20	-27.50	-58.30
US Treasury 10Y	4.20	-1.80	14.60	5.10	9.80	-10.40
US Treasury 30Y	4.85	-0.70	15.40	2.40	13.20	25.30
2Y-10Y Spread	0.52	3.20	-13.40	-14.90	-6.20	23.60

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	3.32	2.40	18.20	32.80	92.10	72.30
국고채 10년	3.69	1.20	12.10	36.80	93.60	88.70
회사채 AA- 3년	3.91	1.90	20.10	39.90	103.80	73.50
CD 91일	2.83	1.00	5.00	-1.00	27.00	-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 %
USD/KRW	1486.54	-1.01	1.88	2.15	2.97
USD/EUR	1.15	0.95	-1.14	-1.69	-1.76
USD/JPY	158.96	-0.38	1.34	1.62	1.42
USD/CNY	6.89	-0.15	-0.04	-0.80	-1.58

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	95.30	1.93	21.50	43.31	66.26
Brent(ICE EU)	103.52	3.30	23.62	45.42	70.40
Natural Gas(NY…	3.04	0.56	0.49	-16.69	-15.98

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5011.30	0.35	-2.11	3.37	16.15
Copper(COMEX)	5.77	-0.42	-1.15	-0.72	2.23
Silver(COMEX)	79.46	-1.00	-5.67	-4.62	12.62

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	454.50	0.11	3.85	4.48	3.89
Wheat(CBOT)	590.50	-1.13	1.61	9.03	16.58
Soybean(CBOT)	1156.50	0.11	-0.52	5.19	12.34
Coffee(ICE US)	294.85	-0.97	1.29	-8.87	-17.48
Sugar(ICE US)	14.47	1.97	1.59	-0.28	-0.89

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	74770.95	-0.12	7.45	0.91	-15.73
Ethereum	2339.60	-0.49	13.66	3.09	-22.02

자료: Yahoo Finance, SK증권