DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-19)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.030 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
0.030	-0.008	0.009	-0.021	0.007	0.071

※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	5925.03	5.04	3.88	17.20	37.48
KOSDAQ	1164.38	2.41	2.19	11.00	23.14
KOSPI200	888.57	5.67	4.83	19.92	42.36

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	35170	6.25	8.05	31.06	62.49
498400	KODEX 200타겟위클리커	18440	5.07	3.98	17.44	36.93
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4610	0.66	1.09	2.87	4.16
091160	KODEX 반도체	105100	5.66	8.15	30.55	60.51
487240	KODEX AI전력핵심설비	33530	6.83	5.90	20.41	39.48
292150	TIGER 코리아TOP10	32095	5.14	3.79	20.65	45.96
395160	KODEX AI반도체	29075	6.19	8.18	27.70	52.54

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	11085	7.46	7,876,538
0091P0	TIGER 코리아원자력	22450	7.34	7,140,077
0080G0	KODEX 방산TOP10	14245	-1.21	4,493,530

※ 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 %
139220	TIGER 200 건설	7875	7.36	9.03	30.69	72.51
457990	PLUS 태양광&ESS	35520	7.29	11.53	35.07	67.86
475310	SOL 반도체후공정	31350	6.96	11.60	35.92	63.88
474590	WON 반도체밸류체인액티브	31500	6.87	9.63	29.75	52.91
487240	KODEX AI전력핵심설비	33530	6.83	5.90	20.41	39.48

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360150	KODEX 코스닥150룽코스	5920	-3.11	-4.08	-7.66	-10.71
449450	PLUS K방산	74500	-1.19	1.75	13.48	40.57
463250	TIGER K방산&우주	47290	-1.15	2.91	19.02	54.54
490480	SOL K방산	38330	-1.01	3.04	15.77	45.13
421320	PLUS 우주항공&UAM	46995	-0.90	4.33	22.59	64.40

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	892.60	-0.16	3.61	13.34	27.21
Materials	608.17	-2.25	-5.84	-3.26	4.30
Industrials	1395.00	-0.77	-4.18	-1.41	4.27
Consumer Discr…	1772.74	-2.32	-3.09	-6.91	-7.02
Consumer Stapl…	924.70	-2.44	-4.47	-1.03	7.08
Health Care	1710.71	-1.61	-4.92	-5.72	-5.68
Financials	811.35	-1.19	-3.46	-7.83	-11.19
Information Te…	5320.27	-1.24	-1.83	-4.16	-6.44
Communication …	441.16	-1.12	-1.31	-2.77	-2.11
Utilities	472.10	-0.79	-0.48	4.63	7.55
Real Estate	266.07	-1.60	-2.76	0.25	4.27

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	437.04	-1.50	-2.69	-5.27	-7.36
가치(IWD)	214.22	-1.21	-2.92	-2.17	0.95
대형(IWL)	163.32	-1.44	-2.73	-4.06	-4.30
중소형(IWM)	246.02	-1.61	-4.20	-4.91	-1.11
배당(VIG)	215.19	-1.69	-3.66	-3.97	-2.45
저변동성(USMV)	93.49	-1.68	-2.79	-1.94	-0.17
모멘텀(MTUM)	246.24	-0.80	-1.25	-2.69	-2.57
퀄리티(QUAL)	194.08	-1.42	-3.42	-3.79	-2.57

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
LyondellBasell…	Basic Materials	75.20	5.62	18.20	37.98	69.41
Sandisk Corpor…	Technology	753.69	4.65	18.76	48.70	173.83
Ciena Corporat…	Technology	385.26	4.11	13.36	36.43	56.57
lululemon athl…	Consumer Cyclical	165.39	3.84	-4.07	-11.49	-21.55
Vistra Corp.	Utilities	170.12	3.52	2.22	4.22	2.96

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Carvana Co.	Consumer Cyclical	291.17	-7.49	-9.17	-25.42	-27.25
Otis Worldwide…	Industrials	78.53	-6.67	-11.11	-11.69	-11.10
Charter Commun…	Communication Services	209.00	-6.08	-7.42	-2.95	-0.13
The Trade Desk…	Communication Services	23.55	-6.06	-9.25	-24.05	-37.50
Amphenol Corpo…	Technology	127.81	-5.41	-8.27	-10.21	-8.52

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	139.71	-1.53	-3.11	-3.31	-1.95
선진국(URTH)	181.77	-1.47	-3.02	-3.50	-2.54
신흥국(EEM)	57.56	-2.03	-3.63	-1.79	2.35
미국(S&P500)	6624.70	-1.36	-2.63	-3.65	-3.41
미국(NASDAQ)	22152.42	-1.46	-2.09	-4.09	-4.66
미국(DJIA)	46225.15	-1.63	-3.98	-5.30	-4.46
유럽(Eurostoxx50)	5736.85	-0.56	-2.81	-3.19	-3.15
일본(Nikkei225)	55239.40	2.87	-1.13	2.33	6.57
중국(CSI300)	4658.33	0.45	-0.45	-0.50	-1.26
홍콩(HangSeng)	26025.42	0.61	-0.08	-1.39	-1.19
대만(TWSE)	34348.58	1.51	1.71	9.33	17.03
인도(Nifty 50)	23777.80	0.83	-3.42	-6.29	-9.06
한국(KOSPI)	5925.03	5.04	3.88	17.20	37.48

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	0.00	28.00	19.00	11.00	-38.00
US TIPS 10Y	1.83	-4.00	6.00	-9.00	10.00	-19.00
IG Corporate Yield	5.02	-4.00	30.00	19.00	26.00	-20.00
HY Corporate Yield	7.02	-6.00	46.00	35.00	62.00	-28.00
High Yield Spread	3.22	-5.00	27.00	23.00	51.00	4.00
10Y Breakeven Inflation	2.40	3.00	13.00	16.00	1.00	10.00
US T-Bill 3M	3.61	0.50	1.70	8.80	-26.80	-58.50
US Treasury 10Y	4.26	5.70	20.30	14.30	12.00	-2.20
US Treasury 30Y	4.88	2.90	18.30	8.20	12.50	30.20
2Y-10Y Spread	0.58	5.70	-7.70	-4.70	1.00	35.80

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	3.26	-6.30	11.90	29.40	82.00	66.30
국고채 10년	3.61	-8.60	3.50	29.40	79.10	81.80
회사채 AA- 3년	3.85	-5.10	15.00	37.10	95.70	68.70
CD 91일	2.83	0.00	5.00	-1.00	26.00	-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	1509.00	1.35	3.17	3.65	4.53
USD/EUR	1.15	-0.37	-1.70	-2.38	-2.49
USD/JPY	159.80	0.43	1.65	2.13	1.96
USD/CNY	6.87	-1.20	-0.26	-0.97	-1.77

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	98.92	2.82	23.39	47.14	72.58
Brent(ICE EU)	105.93	2.43	23.87	47.22	74.37
Natural Gas(NY…	3.19	5.31	5.27	-12.18	-11.72

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4822.20	-3.58	-5.65	-0.69	11.77
Copper(COMEX)	5.48	-4.38	-5.84	-5.74	-2.92
Silver(COMEX)	75.44	-5.14	-10.34	-9.64	6.92

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	463.50	2.09	5.47	6.48	5.94
Wheat(CBOT)	605.50	2.67	3.67	11.47	19.55
Soybean(CBOT)	1163.75	0.58	-0.03	5.67	13.04
Coffee(ICE US)	292.55	-3.15	0.29	-9.37	-18.12
Sugar(ICE US)	14.82	2.56	3.82	2.09	1.51

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	71280.05	-3.57	2.22	-3.27	-19.67
Ethereum	2191.19	-5.47	6.08	-2.63	-26.97

자료: Yahoo Finance, SK증권