DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-20)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.023 상승하여 오전 중 지수 하방 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
0.023	-0.009	0.016	-0.028	0.001	0.057

※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	5763.22	-2.73	0.81	13.34	33.73
KOSDAQ	1143.48	-1.79	0.19	8.62	20.93
KOSPI200	862.37	-2.95	1.45	15.61	38.16

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	34555	-1.75	5.32	27.42	59.64
498400	KODEX 200타겟위클리커	18025	-2.25	1.39	14.11	33.85
395270	HANARO Fn K-반도체	35915	-1.33	6.25	29.38	60.44
472150	TIGER 배당커버드콜액티브	18260	-2.56	2.96	16.27	36.86
487240	KODEX AI전력핵심설비	33785	0.76	6.05	20.61	40.54
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4600	-0.22	0.83	2.54	3.93
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6450	-2.79	-6.51	1.56	26.72

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	10920	-1.49	8,168,077
0091P0	TIGER 코리아원자력	22510	0.27	8,113,058
0098F0	KODEX 원자력SMR	21065	-0.40	3,798,388

※ 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	36420	2.53	13.17	37.22	72.12
377990	TIGER Fn신재생에너지	27135	1.44	9.78	27.54	53.26
471760	TIGER AI반도체핵심공정	20555	1.36	9.75	32.68	64.18
385510	KODEX 신재생에너지액티브	43455	1.20	8.31	24.59	50.26
491820	HANARO 전력설비투자	41020	1.18	6.63	21.35	41.62

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
300610	TIGER K게임	6350	-7.43	-6.25	-5.26	-3.05
300950	KODEX 게임산업	6150	-6.96	-5.57	-3.89	-1.68
395280	HANARO Fn K-게임	3835	-6.35	-4.96	-3.01	-0.39
364990	TIGER 게임TOP10	5255	-5.66	-4.36	-1.87	1.06
300640	RISE 게임테마	7595	-5.06	-4.25	-3.71	-1.81

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	905.79	1.48	4.77	14.44	29.09
Materials	598.77	-1.55	-6.82	-4.83	2.69
Industrials	1385.67	-0.67	-4.47	-2.15	3.58
Consumer Discr…	1757.38	-0.87	-3.71	-7.55	-7.82
Consumer Stapl…	916.93	-0.84	-4.98	-1.94	6.19
Health Care	1703.99	-0.39	-4.96	-6.00	-6.05
Financials	811.56	0.03	-3.13	-7.64	-11.17
Information Te…	5320.53	0.00	-1.70	-4.05	-6.44
Communication …	438.58	-0.58	-1.88	-3.31	-2.68
Utilities	469.87	-0.47	-0.98	3.98	7.04
Real Estate	265.46	-0.23	-2.83	-0.06	4.03

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	435.42	-0.37	-2.88	-5.49	-7.70
가치(IWD)	213.95	-0.13	-2.82	-2.32	0.82
대형(IWL)	162.72	-0.37	-2.90	-4.34	-4.65
중소형(IWM)	247.63	0.65	-3.26	-4.27	-0.46
배당(VIG)	215.07	-0.06	-3.45	-3.98	-2.51
저변동성(USMV)	93.28	-0.22	-2.87	-2.15	-0.40
모멘텀(MTUM)	246.86	0.25	-0.87	-2.42	-2.32
퀄리티(QUAL)	194.21	0.07	-3.14	-3.69	-2.50

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Ciena Corporat…	Technology	412.58	7.09	19.74	44.55	67.67
Seagate Techno…	Technology	434.60	6.84	10.73	18.08	51.14
Baker Hughes C…	Energy	60.71	5.62	0.12	8.79	28.79
SLB Limited	Energy	47.82	5.52	-1.14	1.72	18.96
Dell Technolog…	Technology	156.76	5.06	10.09	22.78	22.66

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Fair Isaac Cor…	Technology	1113.16	-7.52	-14.45	-23.61	-32.26
Newmont Corpor…	Basic Materials	99.20	-6.89	-15.75	-14.32	-2.00
Mosaic Company…	Basic Materials	26.20	-5.69	-5.62	-4.31	4.72
International …	Consumer Cyclical	34.00	-5.29	-15.83	-19.29	-15.53
Molina Healthc…	Healthcare	142.21	-4.32	-3.74	-12.77	-20.31

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	139.38	-0.24	-3.10	-3.52	-2.18
선진국(URTH)	181.36	-0.23	-3.02	-3.68	-2.76
신흥국(EEM)	57.62	0.10	-3.25	-1.80	2.45
미국(S&P500)	6606.49	-0.27	-2.71	-3.86	-3.67
미국(NASDAQ)	22090.69	-0.28	-2.23	-4.27	-4.93
미국(DJIA)	46021.43	-0.44	-4.07	-5.65	-4.88
유럽(Eurostoxx50)	5613.83	-2.14	-4.53	-5.25	-5.23
일본(Nikkei225)	53372.53	-3.38	-4.15	-1.24	2.97
중국(CSI300)	4583.25	-1.61	-1.92	-2.11	-2.85
홍콩(HangSeng)	25500.58	-2.02	-1.86	-3.38	-3.18
대만(TWSE)	33689.68	-1.92	-0.43	6.91	14.79
인도(Nifty 50)	23002.15	-3.26	-6.04	-9.17	-12.03
한국(KOSPI)	5763.22	-2.73	0.81	13.34	33.73

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	8.00	36.00	30.00	19.00	-28.00
US TIPS 10Y	1.86	3.00	9.00	-2.00	11.00	-13.00
IG Corporate Yield	5.08	6.00	36.00	28.00	32.00	-12.00
HY Corporate Yield	7.08	6.00	55.00	49.00	67.00	-24.00
High Yield Spread	3.20	-2.00	26.00	25.00	48.00	-3.00
10Y Breakeven Inflation	2.37	-3.00	11.00	13.00	-2.00	6.00
US T-Bill 3M	3.61	0.20	1.90	9.00	-26.60	-57.80
US Treasury 10Y	4.28	2.20	22.90	13.00	14.20	2.50
US Treasury 30Y	4.85	-2.90	16.90	2.40	9.60	28.40
2Y-10Y Spread	0.52	-5.80	-13.10	-17.00	-4.80	30.50

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	3.33	6.80	18.70	31.90	88.80	70.80
국고채 10년	3.69	8.70	12.20	35.10	87.80	88.20
회사채 AA- 3년	3.92	6.00	21.00	39.20	101.70	73.10
CD 91일	2.83	0.00	5.00	-2.00	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 %
Dollar Index	99.21	-0.88	0.37	1.01	0.80
USD/KRW	1488.33	0.23	1.67	2.25	3.10
USD/EUR	1.16	0.46	-0.49	-1.21	-1.34
USD/JPY	157.68	-0.76	0.24	0.78	0.61
USD/CNY	6.90	0.19	0.13	-0.55	-1.38

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	94.65	-1.73	16.21	39.57	65.13
Brent(ICE EU)	103.21	-3.88	18.41	41.99	69.89
Natural Gas(NY…	3.14	2.45	3.47	-13.27	-13.21

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4661.10	-4.68	-8.58	-4.13	8.04
Copper(COMEX)	5.52	-0.56	-4.92	-4.96	-2.07
Silver(COMEX)	72.90	-5.62	-13.21	-12.82	3.32

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	470.00	1.46	6.42	7.86	7.43
Wheat(CBOT)	610.25	0.99	4.05	12.00	20.48
Soybean(CBOT)	1168.50	0.58	0.26	5.91	13.50
Coffee(ICE US)	302.20	0.83	3.21	-6.22	-15.42
Sugar(ICE US)	15.42	4.19	7.52	6.16	5.62

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70516.98	-1.02	0.79	-3.80	-20.53
Ethereum	2147.79	-2.54	3.41	-3.76	-28.42

자료: Yahoo Finance, SK증권