DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-25)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.003 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
0.003	0.072	0.029	-0.015	0.001	0.063

※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	5553.92	2.74	-2.34	7.57	28.87
KOSDAQ	1121.44	2.24	-1.37	5.43	18.60
KOSPI200	827.64	2.83	-2.23	9.03	32.60

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	33350	2.84	0.31	19.60	54.08
498400	KODEX 200타겟위클리커	17310	2.64	-2.21	7.92	28.54
117700	KODEX 건설	6950	-4.01	4.18	25.32	70.34
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6450	6.17	-4.58	1.01	26.72
091160	KODEX 반도체	100125	2.69	0.99	19.82	52.91
305720	KODEX 2차전지산업	16385	5.64	-3.29	1.35	21.42

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	21515	-2.20	11,373,165
0098F0	KODEX 원자력SMR	20025	-1.84	10,107,059
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	10410	4.26	6,623,312
0080G0	KODEX 방산TOP10	13245	3.92	6,503,956

※ 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 %
421320	PLUS 우주항공&UAM	45740	7.95	0.71	15.00	60.01
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	6350	7.45	-2.82	2.25	26.49
466810	BNK 2차전지양극재	6840	7.38	-2.54	1.97	22.91
364980	TIGER 2차전지TOP10	10210	7.19	-2.22	2.03	19.28
465330	RISE 2차전지TOP10	12360	6.51	-2.73	3.72	29.22

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
117700	KODEX 건설	6950	-4.01	4.18	25.32	70.34
139220	TIGER 200 건설	7600	-3.31	2.50	21.77	66.48
385510	KODEX 신재생에너지액티브	42320	-2.18	3.71	18.93	46.33
457990	PLUS 태양광&ESS	34125	-1.74	4.41	25.33	61.27
377990	TIGER Fn신재생에너지	25900	-1.33	3.35	19.22	46.29

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	934.97	2.05	6.70	16.38	33.25
Materials	608.35	1.67	-3.73	-3.45	4.33
Industrials	1388.71	0.57	-3.13	-2.10	3.80
Consumer Discr…	1757.55	-0.54	-2.93	-7.00	-7.81
Consumer Stapl…	913.01	0.08	-4.24	-2.59	5.73
Health Care	1690.03	0.04	-4.57	-6.45	-6.82
Financials	820.53	0.05	-1.44	-6.05	-10.19
Information Te…	5241.67	-0.71	-2.55	-5.05	-7.83
Communication …	424.07	-2.50	-4.57	-6.28	-5.90
Utilities	458.51	0.74	-2.80	1.23	4.45
Real Estate	256.72	-0.77	-5.01	-3.39	0.61

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	429.42	-1.06	-3.54	-6.30	-8.97
가치(IWD)	213.82	0.32	-2.11	-2.40	0.76
대형(IWL)	161.34	-0.58	-3.01	-4.86	-5.46
중소형(IWM)	248.78	0.54	-1.85	-3.70	0.00
배당(VIG)	215.25	0.14	-2.56	-3.74	-2.43
저변동성(USMV)	92.31	-0.49	-3.32	-3.04	-1.43
모멘텀(MTUM)	245.54	0.42	-0.90	-2.74	-2.84
퀄리티(QUAL)	193.30	-0.34	-2.84	-3.97	-2.96

S&P500; 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corning Incorp…	Technology	142.01	8.43	3.36	21.23	56.62
Dell Technolog…	Technology	176.91	7.49	18.50	36.48	38.43
Hewlett Packar…	Technology	23.90	7.08	10.28	8.03	-1.12
LyondellBasell…	Basic Materials	76.01	6.35	13.38	34.40	71.23
Dow Inc.	Basic Materials	38.31	6.30	11.50	25.98	57.85

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Axon Enterpris…	Industrials	456.60	-9.99	-13.42	-13.91	-18.96
Estee Lauder C…	Consumer Defensive	71.48	-9.85	-23.04	-32.01	-33.05
Coinbase Globa…	Financial Services	181.04	-9.76	-7.20	-10.11	-23.46
Gartner, Inc.	Technology	151.38	-6.89	-6.02	-20.72	-36.13
The Trade Desk…	Communication Services	22.34	-6.72	-12.98	-25.71	-40.71

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	138.04	-0.55	-3.10	-4.30	-3.12
선진국(URTH)	179.85	-0.38	-2.97	-4.29	-3.57
신흥국(EEM)	56.52	-1.38	-3.71	-3.86	0.50
미국(S&P500)	6556.37	-0.37	-2.74	-4.34	-4.40
미국(NASDAQ)	21761.89	-0.84	-3.04	-5.33	-6.34
미국(DJIA)	46124.06	-0.18	-2.87	-5.19	-4.67
유럽(Eurostoxx50)	5581.29	0.13	-3.69	-5.64	-5.78
일본(Nikkei225)	52252.28	1.43	-5.26	-3.47	0.81
중국(CSI300)	4474.72	1.28	-3.59	-4.37	-5.15
홍콩(HangSeng)	25063.71	2.79	-2.54	-4.90	-4.84
대만(TWSE)	32612.24	-0.34	-3.39	2.67	11.12
인도(Nifty 50)	22912.40	1.78	-4.81	-8.92	-12.37
한국(KOSPI)	5553.92	2.74	-2.34	7.57	28.87

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	3.83	-5.00	35.00	35.00	26.00	-11.00
US TIPS 10Y	2.01	0.00	21.00	7.00	23.00	9.00
IG Corporate Yield	5.13	-5.00	39.00	29.00	33.00	-1.00
HY Corporate Yield	7.16	-10.00	68.00	62.00	74.00	-8.00
High Yield Spread	3.19	-5.00	33.00	36.00	49.00	-2.00
10Y Breakeven Inflation	2.33	0.00	5.00	9.00	-5.00	-3.00
US T-Bill 3M	3.62	0.80	2.50	6.50	-26.30	-56.20
US Treasury 10Y	4.39	5.80	30.60	25.60	22.00	6.10
US Treasury 30Y	4.94	2.90	21.60	14.30	18.90	28.60
2Y-10Y Spread	0.56	10.80	-4.40	-9.40	-4.00	17.10

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	3.52	-9.40	38.00	58.40	99.50	91.90
국고채 10년	3.83	-4.40	29.50	49.00	95.00	101.90
회사채 AA- 3년	4.12	-7.60	40.30	64.60	115.20	95.00
CD 91일	2.81	0.00	2.00	-5.00	22.00	-3.00

※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	1495.46	-0.58	1.56	2.57	3.59
USD/EUR	1.16	0.43	-0.00	-0.96	-1.19
USD/JPY	158.69	-0.34	0.44	1.32	1.25
USD/CNY	6.89	0.08	0.07	-0.56	-1.50

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	88.04	-0.10	3.18	26.67	53.59
Brent(ICE EU)	99.67	-0.27	7.95	33.14	64.07
Natural Gas(NY…	2.86	-1.11	-5.67	-19.65	-20.98

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4482.70	1.78	-10.30	-7.80	3.90
Copper(COMEX)	5.53	1.62	-3.76	-4.83	-1.99
Silver(COMEX)	71.35	3.33	-12.53	-14.64	1.13

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	462.25	0.60	3.44	5.92	5.66
Wheat(CBOT)	591.75	0.68	0.36	7.88	16.83
Soybean(CBOT)	1154.00	-0.82	-1.27	4.11	12.09
Coffee(ICE US)	319.15	3.96	7.49	-0.45	-10.68
Sugar(ICE US)	15.90	2.45	9.43	9.26	8.90

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70104.56	-1.14	-0.15	-2.10	-20.99
Ethereum	2149.30	-0.13	2.19	-0.39	-28.37

자료: Yahoo Finance, SK증권