DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-26)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.012 하락하여 오전 중 지수 상방 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
-0.012	0.053	0.032	-0.012	0.003	0.076

※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	5642.21	1.59	-0.50	8.75	30.92
KOSDAQ	1159.55	3.40	2.01	8.62	22.63
KOSPI200	838.70	1.34	-0.64	9.87	34.37

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	33450	0.30	0.34	18.92	54.54
498400	KODEX 200타겟위클리커	17525	1.24	-0.71	8.72	30.13
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6665	3.33	-0.88	4.08	30.94
487240	KODEX AI전력핵심설비	34280	5.43	6.79	19.53	42.60
117700	KODEX 건설	7150	2.88	6.66	27.78	75.25
305720	KODEX 2차전지산업	16785	2.44	-0.48	3.59	24.38

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	22095	2.70	9,161,274
0080G0	KODEX 방산TOP10	13980	5.55	7,081,849
0098F0	KODEX 원자력SMR	20675	3.25	5,710,283
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	10530	1.15	4,740,486

※ 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 %
463250	TIGER K방산&우주	47070	7.03	0.61	14.41	53.82
449450	PLUS K방산	73300	6.37	-0.70	8.69	38.30
421320	PLUS 우주항공&UAM	48525	6.09	6.11	20.87	69.76
157500	TIGER 증권	18320	6.05	-0.90	19.76	71.54
395280	HANARO Fn K-게임	3965	6.02	0.15	0.12	2.99

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	12875	-2.39	-2.33	-1.93	0.90
422260	VITA MZ소비액티브	9950	-0.20	-1.50	-3.39	0.76
227560	TIGER 200 생활소비재	13120	-0.04	-0.21	-0.18	9.20
460280	KIWOOM Fn유전자혁신기	13515	0.00	-3.19	2.18	6.50
396500	TIGER 반도체TOP10	33450	0.30	0.34	18.92	54.54

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	930.05	-0.53	5.59	15.17	32.55
Materials	620.32	1.97	-1.44	-1.64	6.38
Industrials	1398.13	0.68	-2.18	-1.51	4.51
Consumer Discr…	1778.33	1.18	-1.55	-5.74	-6.72
Consumer Stapl…	917.76	0.52	-3.37	-2.16	6.28
Health Care	1706.58	0.98	-3.28	-5.44	-5.91
Financials	821.40	0.11	-1.11	-5.76	-10.09
Information Te…	5270.91	0.56	-1.72	-4.37	-7.31
Communication …	424.91	0.20	-4.11	-6.00	-5.72
Utilities	459.90	0.30	-2.30	1.44	4.77
Real Estate	256.63	-0.04	-4.71	-3.42	0.57

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	432.20	0.65	-2.63	-5.53	-8.39
가치(IWD)	214.87	0.49	-1.40	-1.94	1.26
대형(IWL)	162.19	0.53	-2.23	-4.26	-4.96
중소형(IWM)	251.82	1.22	-0.40	-2.53	1.22
배당(VIG)	216.19	0.44	-1.88	-3.28	-2.00
저변동성(USMV)	92.63	0.35	-2.80	-2.66	-1.09
모멘텀(MTUM)	247.18	0.67	-0.05	-2.04	-2.20
퀄리티(QUAL)	194.12	0.42	-2.14	-3.50	-2.55

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Super Micro Co…	Technology	24.05	8.19	-18.95	-21.21	-22.32
Hewlett Packar…	Technology	25.78	7.87	17.56	16.41	6.66
EchoStar Corpo…	Communication Services	119.07	7.43	6.79	3.98	6.14
Advanced Micro…	Technology	220.27	7.26	9.68	2.73	-1.43
Intel Corporat…	Technology	47.18	7.08	4.14	3.53	19.81

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Verisk Analyti…	Industrials	185.05	-4.97	-9.57	-9.79	-16.27
Insulet Corpor…	Healthcare	216.00	-4.21	-7.88	-15.54	-23.65
Sandisk Corpor…	Technology	677.86	-3.50	3.89	24.18	146.28
Micron Technol…	Technology	382.09	-3.40	-7.32	-2.01	21.14
Brown & Brown, …	Financial Services	64.29	-3.32	-7.21	-11.91	-17.17

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	139.34	0.94	-1.87	-3.36	-2.21
선진국(URTH)	181.19	0.75	-1.95	-3.52	-2.85
신흥국(EEM)	57.42	1.59	-1.69	-2.40	2.10
미국(S&P500)	6591.90	0.54	-1.95	-3.74	-3.89
미국(NASDAQ)	21929.83	0.77	-2.03	-4.49	-5.62
미국(DJIA)	46429.49	0.66	-1.91	-4.49	-4.04
유럽(Eurostoxx50)	5649.33	1.22	-2.07	-4.46	-4.63
일본(Nikkei225)	53749.62	2.87	-2.23	-0.81	3.70
중국(CSI300)	4537.47	1.40	-2.03	-3.02	-3.82
홍콩(HangSeng)	25335.95	1.09	-1.21	-3.84	-3.81
대만(TWSE)	33439.11	2.54	-0.75	4.94	13.93
인도(Nifty 50)	23306.45	1.72	-2.74	-7.19	-10.86
한국(KOSPI)	5642.21	1.59	-0.50	8.75	30.92

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	3.90	7.00	42.00	43.00	26.00	-14.00
US TIPS 10Y	2.06	5.00	26.00	15.00	26.00	8.00
IG Corporate Yield	5.17	4.00	43.00	36.00	33.00	-3.00
HY Corporate Yield	7.22	6.00	74.00	69.00	69.00	6.00
High Yield Spread	3.19	0.00	33.00	35.00	43.00	14.00
10Y Breakeven Inflation	2.31	-2.00	5.00	7.00	-7.00	-4.00
US T-Bill 3M	3.62	0.00	3.20	6.50	-24.00	-56.20
US Treasury 10Y	4.33	-6.40	29.90	19.20	14.10	2.10
US Treasury 30Y	4.90	-4.40	20.10	9.90	13.10	24.10
2Y-10Y Spread	0.43	-13.40	-12.10	-23.80	-11.90	16.10

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	3.56	3.50	40.40	61.90	99.60	94.60
국고채 10년	3.86	2.40	28.10	51.40	91.60	103.80
회사채 AA- 3년	4.16	3.70	43.30	68.30	115.70	97.90
CD 91일	2.82	1.00	2.00	-4.00	24.00	-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	1504.20	1.27	1.96	3.10	4.19
USD/EUR	1.16	-0.39	-0.32	-1.34	-1.60
USD/JPY	159.44	0.61	0.81	1.77	1.73
USD/CNY	6.90	0.30	0.20	-0.40	-1.37

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	91.35	-1.08	5.19	30.22	59.37
Brent(ICE EU)	98.14	-6.08	4.48	29.87	61.55
Natural Gas(NY…	2.93	-0.27	-3.25	-16.99	-18.88

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4502.20	2.34	-9.19	-7.36	4.35
Copper(COMEX)	5.52	1.75	-3.46	-4.91	-2.17
Silver(COMEX)	71.32	2.95	-11.39	-14.56	1.08

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	467.50	1.08	4.18	7.05	6.86
Wheat(CBOT)	599.50	1.61	1.40	9.04	18.36
Soybean(CBOT)	1173.50	1.60	0.29	5.68	13.99
Coffee(ICE US)	315.80	-0.64	5.89	-1.31	-11.61
Sugar(ICE US)	15.53	-2.20	6.55	6.68	6.37

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70980.93	0.66	1.05	-0.46	-20.01
Ethereum	2165.06	0.43	2.69	0.94	-27.84

자료: Yahoo Finance, SK증권