DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-27)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.018 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
0.018	0.038	0.033	-0.012	-0.006	0.070

※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	5460.46	-3.22	-3.18	4.79	26.70
KOSDAQ	1136.64	-1.98	0.12	6.12	20.21
KOSPI200	808.89	-3.55	-3.63	5.45	29.59

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	31540	-5.71	-5.34	11.30	45.71
091160	KODEX 반도체	95990	-5.61	-3.46	13.04	46.59
498400	KODEX 200타겟위클리커	17000	-3.00	-3.16	5.01	26.23
472150	TIGER 배당커버드콜액티브	17130	-3.57	-2.72	6.20	28.39
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6530	-2.03	-2.11	1.71	28.29
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4615	0.00	1.15	2.37	4.27

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080G0	KODEX 방산TOP10	13910	-0.50	6,473,628
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	10060	-4.46	4,693,497
0091P0	TIGER 코리아원자력	21290	-3.64	4,515,346
0098F0	KODEX 원자력SMR	19930	-3.60	3,846,441

※ 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 %
476000	UNICORN 포스트IPO액	12815	4.65	2.26	4.25	10.33
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	24655	2.22	4.64	5.49	8.61
463050	TIME K바이오액티브	21055	2.21	4.44	7.10	9.75
498050	HANARO 바이오코리아액티	16590	1.81	1.25	0.91	3.85
483020	KIWOOM 의료AI	13790	1.73	-0.34	0.80	2.45

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
475310	SOL 반도체후공정	29665	-6.21	-1.08	21.42	55.07
471760	TIGER AI반도체액심공정	18715	-6.14	-4.05	15.44	49.48
476260	HANARO 반도체액심공정주	12765	-5.83	0.93	14.40	40.35
469150	ACE AI반도체TOP3+	44900	-5.75	-3.86	16.28	54.35
396500	TIGER 반도체TOP10	31540	-5.71	-5.34	11.30	45.71

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	944.63	1.57	6.62	16.36	34.62
Materials	616.21	-0.66	-1.67	-2.38	5.68
Industrials	1365.74	-2.32	-4.01	-3.83	2.09
Consumer Discr…	1745.05	-1.87	-3.10	-7.33	-8.47
Consumer Stapl…	913.03	-0.52	-3.48	-2.74	5.73
Health Care	1700.83	-0.34	-3.25	-5.66	-6.23
Financials	816.71	-0.57	-1.35	-6.11	-10.60
Information Te…	5126.66	-2.74	-4.09	-6.82	-9.85
Communication …	410.22	-3.46	-7.04	-9.11	-8.98
Utilities	460.95	0.23	-1.90	1.58	5.01
Real Estate	256.64	0.00	-4.35	-3.42	0.58

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	422.35	-2.28	-4.50	-7.50	-10.47
가치(IWD)	212.51	-1.10	-2.19	-3.02	0.15
대형(IWL)	159.33	-1.76	-3.64	-5.83	-6.63
중소형(IWM)	247.44	-1.74	-1.77	-4.21	-0.54
배당(VIG)	214.22	-0.91	-2.48	-4.11	-2.89
저변동성(USMV)	92.21	-0.45	-3.00	-3.06	-1.54
모멘텀(MTUM)	238.21	-3.63	-3.36	-5.50	-5.75
퀄리티(QUAL)	190.15	-2.05	-3.79	-5.40	-4.54

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Brown Forman I…	Consumer Defensive	25.74	9.58	4.05	-4.09	-1.53
Valero Energy …	Energy	248.14	5.80	7.96	22.52	50.11
Best Buy Co., …	Consumer Cyclical	63.21	4.65	-0.69	-3.94	-8.63
Gartner, Inc.	Technology	156.60	4.24	-2.83	-16.54	-33.93
Occidental Pet…	Energy	64.36	4.06	12.57	30.73	51.86

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Lumentum Holdi…	Technology	688.80	-11.37	0.24	28.39	78.39
Ciena Corporat…	Technology	387.99	-11.36	7.46	29.51	57.68
Sandisk Corpor…	Technology	603.17	-11.02	-7.21	9.30	119.14
Coherent Corp.	Technology	243.29	-10.57	-5.95	7.03	25.19
Applovin Corpo…	Communication Services	391.21	-10.41	-14.25	-20.97	-36.73

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	136.38	-2.12	-3.56	-5.35	-4.29
선진국(URTH)	178.04	-1.74	-3.30	-5.12	-4.54
신흥국(EEM)	55.47	-3.40	-4.43	-5.73	-1.37
미국(S&P500)	6477.16	-1.74	-3.35	-5.32	-5.56
미국(NASDAQ)	21408.08	-2.38	-4.04	-6.62	-7.87
미국(DJIA)	45960.11	-1.01	-2.54	-5.37	-5.01
유럽(Eurostoxx50)	5565.93	-1.48	-3.02	-5.82	-6.04
일본(Nikkei225)	53603.65	-0.27	-2.05	-1.17	3.42
중국(CSI300)	4477.53	-1.32	-3.07	-4.26	-5.09
홍콩(HangSeng)	24856.43	-1.89	-2.79	-5.61	-5.63
대만(TWSE)	33337.62	-0.30	-0.75	4.30	13.59
인도(Nifty 50)	23306.45	1.72	-2.74	-7.19	-10.86
한국(KOSPI)	5460.46	-3.22	-3.18	4.79	26.70

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	3.84	-6.00	41.00	37.00	21.00	-12.00
US TIPS 10Y	2.02	-4.00	25.00	11.00	20.00	6.00
IG Corporate Yield	5.11	-6.00	40.00	30.00	28.00	-6.00
HY Corporate Yield	7.14	-8.00	62.00	61.00	61.00	-4.00
High Yield Spread	3.17	-2.00	22.00	33.00	42.00	8.00
10Y Breakeven Inflation	2.34	3.00	8.00	11.00	-4.00	-3.00
US T-Bill 3M	3.62	0.00	3.20	7.70	-24.00	-57.00
US Treasury 10Y	4.42	8.80	38.30	28.00	22.90	7.80
US Treasury 30Y	4.94	3.90	24.70	11.60	17.00	25.30
2Y-10Y Spread	0.58	14.80	-2.70	-9.00	1.90	19.80

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	3.55	-0.60	39.40	59.40	99.00	93.40
국고채 10년	3.87	0.60	27.20	49.10	92.20	102.60
회사채 AA- 3년	4.16	-0.20	42.60	66.70	115.50	96.90
CD 91일	2.82	0.00	2.00	-5.00	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	1507.47	0.68	1.93	3.25	4.42
USD/EUR	1.15	-0.71	-0.48	-1.57	-1.85
USD/JPY	159.66	0.59	0.86	1.88	1.87
USD/CNY	6.91	0.27	0.31	-0.24	-1.23

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	93.81	3.86	6.34	32.63	63.66
Brent(ICE EU)	101.32	-0.88	5.91	32.80	66.78
Natural Gas(NY…	2.93	-0.88	-3.73	-16.56	-19.13

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4372.90	-3.89	-11.12	-10.05	1.36
Copper(COMEX)	5.48	-0.97	-3.80	-5.63	-2.92
Silver(COMEX)	68.11	-5.88	-14.43	-18.40	-3.47

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	466.25	-0.21	3.53	6.66	6.57
Wheat(CBOT)	605.25	1.25	2.10	9.78	19.50
Soybean(CBOT)	1171.00	-0.06	-0.01	5.27	13.74
Coffee(ICE US)	307.10	-2.85	2.61	-3.81	-14.05
Sugar(ICE US)	15.85	1.93	8.20	8.80	8.56

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	68900.52	-3.38	-1.98	-2.99	-22.35
Ethereum	2059.58	-5.00	-2.51	-3.41	-31.36

자료: Yahoo Finance, SK증권