DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-23)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.003 하락하여 오전 중 지수 상방 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
-0.003	0.048	0.009	-0.013	-0.003	0.074

※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	5781.20	0.31	1.04	13.05	34.15
KOSDAQ	1161.52	1.58	1.77	9.89	22.84
KOSPI200	862.50	0.02	1.33	14.88	38.18

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	34205	-1.01	3.60	24.90	58.03
117700	KODEX 건설	7630	7.54	15.84	40.16	87.01
498400	KODEX 200타겟위클리커	18035	0.06	1.32	13.52	33.92
228790	TIGER 화장품	3600	4.50	3.64	2.76	4.80
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4625	0.54	1.33	2.99	4.50
102970	KODEX 증권	27900	2.97	1.61	28.33	79.02

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	23650	5.06	11,620,380
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	10780	-1.28	5,881,813
0098F0	KODEX 원자력SMR	21925	4.08	4,884,827
0080G0	KODEX 방산TOP10	13635	-3.23	3,490,516

※ 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 %
117700	KODEX 건설	7630	7.54	15.84	40.16	87.01
227570	TIGER 우량가치	21195	6.48	7.48	17.16	31.73
139220	TIGER 200 건설	8310	5.79	12.99	35.37	82.04
266550	PLUS 중형주저변동50	19230	4.88	6.03	14.29	24.55
228790	TIGER 화장품	3600	4.50	3.64	2.76	4.80

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
463250	TIGER K방산&우주	45120	-3.84	-2.98	11.84	47.45
490480	SOL K방산	36625	-3.31	-2.54	9.18	38.68
449450	PLUS K방산	71405	-3.11	-3.38	7.48	34.73
421320	PLUS 우주항공&UAM	44945	-2.29	-0.74	14.97	57.23
387280	TIGER 퓨처모빌리티액티브	12030	-1.76	-2.22	7.13	25.44

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	905.88	0.01	4.37	13.91	29.10
Materials	589.59	-1.53	-7.69	-6.31	1.11
Industrials	1364.93	-1.50	-5.47	-3.65	2.02
Consumer Discr…	1724.69	-1.86	-5.14	-9.08	-9.54
Consumer Stapl…	908.88	-0.88	-5.48	-2.87	5.25
Health Care	1688.86	-0.89	-5.45	-6.73	-6.89
Financials	813.14	0.19	-2.61	-7.27	-11.00
Information Te…	5203.18	-2.21	-3.62	-6.03	-8.50
Communication …	431.98	-1.50	-3.15	-4.71	-4.15
Utilities	450.54	-4.11	-4.86	-0.37	2.64
Real Estate	257.10	-3.15	-5.55	-3.22	0.76

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	427.44	-1.83	-4.38	-7.06	-9.39
가치(IWD)	211.31	-1.23	-3.71	-3.53	-0.42
대형(IWL)	160.44	-1.40	-3.98	-5.58	-5.98
중소형(IWM)	242.22	-2.18	-4.95	-6.29	-2.64
배당(VIG)	212.96	-0.98	-4.08	-4.86	-3.46
저변동성(USMV)	92.35	-1.00	-3.64	-3.08	-1.39
모멘텀(MTUM)	241.52	-2.16	-2.76	-4.45	-4.44
퀄리티(QUAL)	191.89	-1.19	-4.00	-4.78	-3.66

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Marsh	Financial Services	176.48	3.26	-1.05	-2.63	-3.28
APA Corporation	Energy	39.11	2.76	19.60	38.35	54.22
Aon plc	Financial Services	325.63	2.73	-0.40	-3.03	-5.41
The Trade Desk…	Communication Services	24.11	2.55	-6.60	-21.10	-36.01
Arthur J. Gall…	Financial Services	214.82	2.45	-1.15	-8.96	-16.09

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Super Micro Co…	Technology	20.53	-33.32	-33.89	-33.62	-33.69
Vistra Corp.	Utilities	146.02	-12.76	-11.45	-10.45	-11.63
Constellation …	Utilities	281.99	-10.90	-10.26	-9.18	-23.01
Mosaic Company…	Basic Materials	23.59	-9.96	-14.12	-13.80	-5.72
NRG Energy, In…	Utilities	145.80	-9.67	-10.50	-8.14	-12.25

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	136.54	-2.04	-4.71	-5.43	-4.18
선진국(URTH)	178.00	-1.85	-4.48	-5.40	-4.56
신흥국(EEM)	55.64	-3.44	-6.05	-5.22	-1.07
미국(S&P500)	6506.48	-1.51	-3.90	-5.23	-5.13
미국(NASDAQ)	21647.61	-2.01	-3.93	-6.07	-6.83
미국(DJIA)	45577.47	-0.96	-4.59	-6.47	-5.80
유럽(Eurostoxx50)	5501.28	-2.00	-5.94	-7.08	-7.13
일본(Nikkei225)	53372.53	-3.38	-4.15	-1.24	2.97
중국(CSI300)	4567.02	-0.35	-2.11	-2.48	-3.19
홍콩(HangSeng)	25277.32	-0.88	-2.51	-4.22	-4.03
대만(TWSE)	33543.88	-0.43	-0.93	6.15	14.29
인도(Nifty 50)	23114.50	0.49	-5.12	-8.54	-11.60
한국(KOSPI)	5781.20	0.31	1.04	13.05	34.15

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	3.79	3.00	36.00	31.00	22.00	-20.00
US TIPS 10Y	1.88	2.00	9.00	-4.00	13.00	-6.00
IG Corporate Yield	5.08	0.00	35.00	26.00	32.00	-6.00
HY Corporate Yield	7.17	9.00	62.00	59.00	76.00	-6.00
High Yield Spread	3.27	7.00	33.00	37.00	55.00	8.00
10Y Breakeven Inflation	2.38	1.00	9.00	14.00	-1.00	7.00
US T-Bill 3M	3.62	0.60	1.50	9.60	-26.00	-56.40
US Treasury 10Y	4.39	11.00	31.20	24.00	25.20	15.80
US Treasury 30Y	4.96	10.80	25.40	13.20	20.40	40.30
2Y-10Y Spread	0.60	8.00	-4.80	-7.00	3.20	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	3.41	8.10	26.80	40.00	96.90	81.20
국고채 10년	3.74	4.30	16.50	39.40	92.10	94.40
회사채 AA- 3년	3.99	7.60	28.60	46.80	109.30	82.30
CD 91일	2.81	-2.00	3.00	-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 %
Dollar Index	99.65	0.42	0.72	1.43	1.25
USD/KRW	1503.94	0.95	2.32	3.22	4.18
USD/EUR	1.15	-0.28	-0.64	-1.54	-1.75
USD/JPY	159.27	0.85	0.93	1.72	1.62
USD/CNY	6.89	-0.21	-0.03	-0.68	-1.59

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	98.23	2.17	18.19	43.38	71.37
Brent(ICE EU)	106.41	-2.06	19.33	44.74	75.16
Natural Gas(NY…	3.10	-2.24	1.86	-14.18	-14.46

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4574.90	-0.56	-9.79	-5.93	6.04
Copper(COMEX)	5.37	-1.08	-7.04	-7.48	-4.71
Silver(COMEX)	69.66	-1.75	-16.33	-16.68	-1.26

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	465.50	-0.90	4.95	6.76	6.40
Wheat(CBOT)	595.25	-2.10	1.32	8.99	17.52
Soybean(CBOT)	1161.25	-0.62	-0.46	5.08	12.80
Coffee(ICE US)	276.20	-9.80	-5.54	-13.99	-22.70
Sugar(ICE US)	15.70	2.15	8.96	8.00	7.53

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	68192.76	-0.75	-2.90	-5.61	-23.15
Ethereum	2059.29	-0.84	-1.66	-5.73	-31.37

자료: Yahoo Finance, SK증권