DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-24)

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 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
0.003	0.070	0.026	0.004	-0.000	0.078

※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	5405.75	-6.49	-5.19	5.23	25.43
KOSDAQ	1096.89	-5.56	-3.65	3.46	16.00
KOSPI200	804.86	-6.68	-5.14	6.64	28.95

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	32430	-5.19	-2.05	17.38	49.83
498400	KODEX 200타겟위클리커	16865	-6.49	-4.95	5.67	25.23
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4560	-1.41	-0.05	1.44	3.03
472150	TIGER 배당커버드콜액티브	17045	-6.65	-3.88	7.32	27.75
117700	KODEX 건설	7240	-5.11	9.09	31.70	77.45
091160	KODEX 반도체	97505	-6.12	-1.27	17.74	48.91
487240	KODEX AI전력핵심설비	32085	-6.91	-0.07	13.20	33.47

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	22000	-6.98	6,229,137
0167A0	SOL AI반도체TOP2플러스	9985	-7.37	5,533,273
0080G0	KODEX 방산TOP10	12745	-6.53	4,902,913

※ 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 %
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6170	1.48	0.34	-3.00	-6.94
494420	PLUS 미국배당증가성장주데	9355	-0.48	-1.09	-1.61	0.03
360140	KODEX 200룽코스닥15	13070	-1.25	-1.32	-0.21	2.43
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4560	-1.41	-0.05	1.44	3.03
215620	HK S&P코리아로우볼	17540	-2.12	-3.10	0.80	7.31

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
475050	ACE KPOP포커스	9690	-10.28	-13.90	-17.14	-23.10
395290	HANARO Fn K-POP	7350	-10.26	-13.16	-16.31	-21.60
494670	TIGER 조선TOP10	26165	-8.96	-10.81	-9.96	1.77
102970	KODEX 증권	25450	-8.78	-6.45	16.11	63.30
466920	SOL 조선TOP3플러스	33140	-8.42	-9.73	-8.98	3.19

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	916.19	1.14	5.11	14.65	30.57
Materials	598.38	1.49	-5.79	-4.96	2.62
Industrials	1380.82	1.16	-4.04	-2.59	3.21
Consumer Discr…	1767.17	2.46	-2.65	-6.67	-7.31
Consumer Stapl…	912.24	0.37	-4.75	-2.60	5.64
Health Care	1689.40	0.03	-5.00	-6.60	-6.86
Financials	820.15	0.86	-1.64	-6.28	-10.23
Information Te…	5279.08	1.46	-2.08	-4.52	-7.17
Communication …	434.96	0.69	-2.36	-3.98	-3.49
Utilities	455.16	1.03	-3.71	0.57	3.69
Real Estate	258.70	0.62	-4.65	-2.64	1.38

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	434.02	1.54	-2.76	-5.47	-8.00
가치(IWD)	213.13	0.86	-2.66	-2.71	0.44
대형(IWL)	162.28	1.15	-2.69	-4.41	-4.90
중소형(IWM)	247.45	2.16	-2.65	-4.24	-0.53
배당(VIG)	214.94	0.93	-2.95	-3.93	-2.57
저변동성(USMV)	92.76	0.44	-3.06	-2.62	-0.95
모멘텀(MTUM)	244.52	1.24	-1.44	-3.20	-3.25
퀄리티(QUAL)	193.95	1.07	-2.77	-3.70	-2.63

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Albemarle Corp…	Basic Materials	167.56	6.93	-1.21	-0.19	16.42
Smurfit WestRo…	Consumer Cyclical	38.70	6.88	-8.55	-10.19	-2.27
Qnity Electron…	Technology	114.92	6.81	-0.47	11.09	35.23
Palantir Techn…	Technology	160.84	6.74	7.84	3.01	-4.18
Carvana Co.	Consumer Cyclical	299.60	6.51	-4.76	-21.77	-25.15

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Estee Lauder C…	Consumer Defensive	79.29	-7.72	-16.60	-25.01	-25.73
Fair Isaac Cor…	Technology	1063.33	-5.70	-16.87	-25.95	-35.29
Centene Corpor…	Healthcare	32.81	-4.62	-16.56	-21.54	-21.47
Micron Technol…	Technology	404.35	-4.39	-2.74	4.62	28.19
Expeditors Int…	Industrials	140.54	-3.97	-2.45	-8.06	-7.45

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	138.81	1.66	-2.87	-3.82	-2.58
선진국(URTH)	180.54	1.43	-2.88	-3.99	-3.20
신흥국(EEM)	57.31	3.00	-2.87	-2.45	1.90
미국(S&P500)	6581.00	1.15	-2.62	-4.07	-4.05
미국(NASDAQ)	21946.76	1.38	-2.46	-4.66	-5.55
미국(DJIA)	46208.47	1.38	-3.01	-5.10	-4.49
유럽(Eurostoxx50)	5574.32	1.33	-4.25	-5.80	-5.90
일본(Nikkei225)	51515.49	-3.48	-6.98	-4.75	-0.61
중국(CSI300)	4418.00	-3.26	-5.05	-5.61	-6.35
홍콩(HangSeng)	24382.47	-3.54	-5.47	-7.53	-7.43
대만(TWSE)	32722.50	-2.45	-3.23	3.29	11.49
인도(Nifty 50)	22512.65	-2.60	-7.01	-10.70	-13.90
한국(KOSPI)	5405.75	-6.49	-5.19	5.23	25.43

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	3.88	9.00	41.00	40.00	31.00	-7.00
US TIPS 10Y	2.01	13.00	21.00	9.00	26.00	8.00
IG Corporate Yield	5.18	10.00	44.00	36.00	42.00	6.00
HY Corporate Yield	7.26	9.00	76.00	68.00	85.00	7.00
High Yield Spread	3.24	-3.00	38.00	34.00	52.00	7.00
10Y Breakeven Inflation	2.33	-5.00	5.00	9.00	-5.00	0.00
US T-Bill 3M	3.61	-0.60	1.70	6.50	-24.60	-57.30
US Treasury 10Y	4.33	-5.70	24.80	16.50	18.70	8.20
US Treasury 30Y	4.91	-4.80	18.70	8.10	15.40	31.60
2Y-10Y Spread	0.45	-14.70	-16.20	-23.50	-12.30	15.20

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	3.62	20.70	47.40	65.40	112.80	102.00
국고채 10년	3.88	14.30	33.90	50.00	103.10	107.40
회사채 AA- 3년	4.20	20.60	47.90	69.70	126.20	103.20
CD 91일	2.81	0.00	2.00	-4.00	23.00	-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	1486.82	-0.20	1.21	2.06	2.99
USD/EUR	1.16	0.40	0.01	-0.88	-1.08
USD/JPY	158.40	0.30	0.41	1.17	1.06
USD/CNY	6.88	-0.28	-0.10	-0.75	-1.66

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	88.88	-9.60	5.50	28.77	55.06
Brent(ICE EU)	100.26	-10.63	10.30	35.04	65.04
Natural Gas(NY…	2.89	-6.53	-4.64	-19.22	-20.04

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4411.40	-3.48	-12.32	-9.27	2.25
Copper(COMEX)	5.49	2.70	-4.84	-5.54	-2.72
Silver(COMEX)	69.29	-0.10	-15.90	-17.11	-1.79

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	460.50	-1.07	3.44	5.56	5.26
Wheat(CBOT)	589.25	-1.01	0.13	7.65	16.34
Soybean(CBOT)	1164.50	0.28	-0.31	5.20	13.11
Coffee(ICE US)	306.90	-0.92	3.91	-4.40	-14.11
Sugar(ICE US)	15.52	-1.15	7.32	6.72	6.30

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70916.27	4.53	0.81	-1.41	-20.08
Ethereum	2162.57	5.33	2.85	-0.40	-27.92

자료: Yahoo Finance, SK증권