DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-05)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.003 하락하여 오전 중 지수 상방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 변동성이 군집하는 현상 덕분으로 추정되지만, 미장에서 IT업종과 모멘텀이 약화되고 있는 것을 주의할 필요가 있습니다.
3. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 차익 실현 또는 관망 가능성이 높은 환경으로 판단됩니다.

Pre-market volatility

전일 대비	vs 1주 평균	vs 1개월 평균	vs 3개월 평균	vs 6개월 평균	vs 1년 평균
-0.003	-0.020	-0.013	-0.011	0.006	0.073

※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	5371.10	1.57	8.81	22.85	24.63
KOSDAQ	1149.43	0.45	12.22	20.98	21.56
KOSPI200	790.38	1.39	9.68	26.05	26.63

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	29600	0.00	16.47	40.68	36.75
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7305	2.03	17.90	25.74	43.52
228790	TIGER 화장품	3705	-0.80	4.44	7.90	7.86
498400	KODEX 200타겟위클리커	17115	1.39	8.77	22.52	23.53
395270	HANARO Fn K-반도체	29560	0.12	14.91	36.23	32.05
395160	KODEX AI반도체	25050	0.02	15.23	34.36	31.43
487240	KODEX AI전력핵심설비	29435	4.88	10.26	18.68	22.44
102970	KODEX 증권	23065	0.07	23.74	41.07	47.99
305720	KODEX 2차전지산업	17625	2.47	11.05	14.44	30.60

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	15400	5.62	6,181,208

※ 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 %
457990	PLUS 태양광&ESS	27580	14.39	18.84	23.31	30.34
377990	TIGER Fn신재생에너지	22350	9.51	13.81	20.56	26.24
385510	KODEX 신재생에너지액티브	37070	7.08	14.08	21.42	28.18
381570	HANARO Fn친환경에너지	10430	6.59	13.30	21.62	33.12
433500	ACE 원자력TOP10	56700	5.78	10.68	27.54	39.14

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
476260	HANARO 반도체액심공정주	11595	-2.48	14.78	28.48	27.49
360150	KODEX 코스닥150롱코스	6660	-2.27	4.73	-2.76	0.45
475300	SOL 반도체전공정	16630	-2.00	20.45	36.03	33.25
365000	TIGER 인터넷TOP10	4925	-1.99	1.33	3.61	3.25
488210	KIWOOM K-반도체북미공	17840	-1.95	15.26	31.00	29.32

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	813.78	2.25	8.57	14.84	15.98
Materials	652.65	1.80	4.72	12.04	11.93
Industrials	1433.77	0.24	2.78	7.37	7.17
Consumer Discr…	1933.87	-1.16	-2.05	-0.16	1.44
Consumer Stapl…	970.85	1.05	6.05	9.88	12.43
Health Care	1817.37	1.22	-0.42	0.80	0.20
Financials	896.11	0.80	-0.23	0.11	-1.91
Information Te…	5387.64	-1.90	-4.21	-5.00	-5.26
Communication …	465.68	-1.67	0.62	3.31	3.33
Utilities	437.51	-0.44	0.33	-0.53	-0.33
Real Estate	262.31	1.53	0.93	1.65	2.80

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	453.86	-1.16	-3.24	-3.80	-3.80
가치(IWD)	222.59	0.31	1.71	4.92	4.90
대형(IWL)	170.17	-0.68	-1.04	-0.20	-0.28
중소형(IWM)	260.56	-0.84	-0.87	3.38	4.74
배당(VIG)	226.49	0.52	0.92	2.31	2.67
저변동성(USMV)	95.09	0.22	0.37	0.75	1.54
모멘텀(MTUM)	247.24	-3.59	-3.65	-1.83	-2.17
퀄리티(QUAL)	201.56	0.09	-0.67	1.13	1.19

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Enphase Energy…	Technology	51.67	38.60	36.74	56.06	53.10
Super Micro Co…	Technology	33.76	13.78	10.24	4.57	9.04
Fortive Corpor…	Technology	60.07	10.52	10.03	11.31	8.45
Eli Lilly and …	Healthcare	1107.56	10.37	4.62	5.71	2.52
Old Dominion F…	Industrials	208.54	9.89	17.99	32.39	31.00

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Boston Scienti…	Healthcare	75.39	-17.71	-18.44	-21.27	-20.40
Advanced Micro…	Technology	200.19	-17.31	-14.06	-10.77	-10.42
Palantir Techn…	Technology	139.54	-11.62	-16.05	-19.89	-16.87
Amphenol Corpo…	Technology	130.01	-11.60	-12.12	-7.42	-6.95
Micron Technol…	Technology	379.66	-9.48	-0.11	28.69	20.37

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	144.99	-0.38	-0.09	1.86	1.75
선진국(URTH)	188.96	-0.26	-0.16	1.41	1.31
신흥국(EEM)	58.81	-1.33	0.45	5.30	4.56
미국(S&P500)	6882.74	-0.51	-0.72	0.46	0.35
미국(NASDAQ)	22904.58	-1.51	-2.53	-1.71	-1.42
미국(DJIA)	49501.30	0.53	0.60	2.62	2.31
유럽(Eurostoxx50)	5970.47	-0.41	0.07	3.16	0.79
일본(Nikkei225)	54293.36	-0.78	1.88	5.97	4.75
중국(CSI300)	4698.68	0.83	-0.48	1.34	-0.40
홍콩(HangSeng)	26847.32	0.05	-0.04	2.23	1.93
대만(TWSE)	32289.81	0.29	2.29	10.64	10.02
인도(Nifty 50)	25776.00	0.19	0.90	-0.30	-1.42
한국(KOSPI)	5371.10	1.57	8.81	22.85	24.63

Fixed Income

US Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
Fed Funds (EFFR)	3.64	0.00	-8.00	-45.00	-69.00	-69.00
US Treasury 2Y	3.57	5.00	10.00	-1.00	-12.00	-65.00
US TIPS 10Y	1.94	4.00	0.00	13.00	6.00	-22.00
IG Corporate Yield	4.86	-1.00	1.00	-2.00	-9.00	-46.00
HY Corporate Yield	6.66	3.00	11.00	-17.00	-11.00	-40.00
High Yield Spread	2.85	4.00	2.00	-20.00	-10.00	12.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	1.00	11.00	6.00	1.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.60	0.50	8.00	-16.80	-53.80	-61.80
US Treasury 10Y	4.28	0.10	11.00	18.20	-1.00	-23.80
US Treasury 30Y	4.91	0.90	6.10	22.70	6.00	16.70
2Y-10Y Spread	0.71	-4.90	1.00	19.20	11.00	41.20

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	-50.00
국고채 3년	3.21	2.30	27.90	37.80	80.30	62.80
국고채 10년	3.71	5.10	31.60	50.90	93.60	86.80
회사채 AA- 3년	3.73	2.30	27.40	49.90	82.90	52.30
CD 91일	2.75	1.00	-1.00	17.00	25.00	-25.00

※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	97.68	0.24	-0.41	-1.01	-0.76
USD/KRW	1459.75	0.50	0.30	-0.04	1.12
USD/EUR	1.18	0.06	0.44	0.98	0.48
USD/JPY	156.92	0.95	0.18	0.49	0.12
USD/CNY	6.94	-0.08	-0.35	-1.26	-0.79

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	64.37	1.84	5.34	8.57	12.30
Brent(ICE EU)	68.60	1.89	4.39	8.12	12.92
Natural Gas(NY…	3.48	5.01	-18.09	-19.68	-3.90

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4966.20	1.27	3.60	12.19	15.11
Copper(COMEX)	5.90	-2.75	0.09	7.31	4.53
Silver(COMEX)	86.99	4.75	-4.84	22.99	23.29

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	429.00	0.12	0.07	-1.16	-1.94
Wheat(CBOT)	526.75	-0.38	1.07	0.47	4.00
Soybean(CBOT)	1092.00	2.46	3.25	1.01	6.07
Coffee(ICE US)	296.20	-6.59	-15.16	-20.93	-17.10
Sugar(ICE US)	14.41	-1.50	-2.15	-2.53	-1.30

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	73420.77	-2.93	-15.01	-17.25	-17.26
Ethereum	2172.18	-2.49	-23.23	-27.41	-27.60

자료: Yahoo Finance, SK증권