DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-06)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.041 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
0.041	-0.009	-0.011	-0.008	-0.004	0.088

※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	5163.57	-3.86	3.97	17.61	19.81
KOSDAQ	1108.41	-3.57	7.35	16.21	17.22
KOSPI200	756.95	-4.23	4.37	20.13	21.27

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	28055	-5.22	9.45	32.37	29.61
498400	KODEX 200타겟위클리커	16455	-3.86	3.97	17.32	18.77
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7080	-3.08	12.56	21.36	39.10
395160	KODEX AI반도체	23800	-4.99	8.57	26.89	24.87
395270	HANARO Fn K-반도체	28015	-5.23	8.07	28.25	25.15
228790	TIGER 화장품	3650	-1.48	2.43	6.22	6.26
305720	KODEX 2차전지산업	17185	-2.50	7.09	11.43	27.34
091160	KODEX 반도체	84000	-5.41	9.85	30.32	28.28
487240	KODEX AI전력핵심설비	28390	-3.55	5.56	14.27	18.09
364980	TIGER 2차전지TOP10	10430	-1.42	5.11	8.10	21.85

업종&테마ETF 일간수익률 Top&Bottom: 5 (레버리지, 인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
228800	TIGER 여행레저	3720	3.48	9.14	9.58	8.45
489030	PLUS 고배당주위클리커버드	9200	2.56	5.13	4.39	7.74
215620	HK S&P코리아로우볼	17800	1.95	6.07	7.88	8.90
228810	TIGER 미디어컨텐츠	5945	1.80	2.03	4.28	-5.18
388280	RISE K엔터&여행레저	8505	1.49	6.30	10.43	9.95

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
421320	PLUS 우주항공&UAM	41235	-9.43	5.32	43.15	44.25
463250	TIGER K방산&우주	40600	-7.83	-0.04	23.94	32.68
490480	SOL K방산	33485	-7.24	-2.58	18.39	26.79
449450	PLUS K방산	66225	-6.96	-2.78	16.40	24.95
091160	KODEX 반도체	84000	-5.41	9.85	30.32	28.28

자료: 한국거래소, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	143.21	-1.23	-1.29	0.56	0.51
선진국(URTH)	186.40	-1.37	-1.46	0.01	-0.06
신흥국(EEM)	58.50	-0.51	-0.21	4.63	4.02
미국(S&P500)	6798.40	-1.23	-1.85	-0.79	-0.88
미국(NASDAQ)	22540.59	-1.59	-3.87	-3.24	-2.99
미국(DJIA)	48908.72	-1.20	-0.59	1.33	1.09
유럽(Eurostoxx50)	5925.70	-0.75	-0.70	2.31	0.03
일본(Nikkei225)	53818.04	-0.88	0.82	4.94	3.83
중국(CSI300)	4670.42	-0.60	-1.01	0.72	-1.00
홍콩(HangSeng)	26885.24	0.14	-0.03	2.36	2.08
대만(TWSE)	31801.27	-1.51	0.51	8.72	8.35
인도(Nifty 50)	25642.80	-0.52	0.48	-0.82	-1.93
한국(KOSPI)	5163.57	-3.86	3.97	17.61	19.81

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	0.00	10.00	-6.00	-15.00	-69.00
US TIPS 10Y	1.92	-2.00	-2.00	5.00	4.00	-17.00
IG Corporate Yield	4.87	1.00	5.00	4.00	-12.00	-42.00
HY Corporate Yield	6.67	1.00	17.00	-16.00	-13.00	-34.00
High Yield Spread	2.86	1.00	5.00	-27.00	-8.00	15.00
10Y Breakeven Inflation	2.35	-1.00	9.00	7.00	-4.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.58	-1.70	5.80	-17.90	-55.50	-63.20
US Treasury 10Y	4.21	-6.50	3.10	11.70	-7.50	-21.20
US Treasury 30Y	4.86	-5.30	-0.40	16.20	0.70	22.00
2Y-10Y Spread	0.64	-6.50	-6.90	17.70	7.50	47.80

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	-50.00
국고채 3년	3.20	-0.80	25.60	31.00	79.50	62.60
국고채 10년	3.69	-2.50	28.90	46.10	91.10	86.90
회사채 AA- 3년	3.72	-0.70	26.40	43.80	82.20	52.60
CD 91일	2.75	0.00	0.00	15.00	25.00	-26.00

※T-Bill 3M, Treasury 10Y, Treasury 30Y를 제외한 나머지 미국 금리는 전 영업일 기준
자료 : FRED, 한국은행, Yahoo Finance, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	804.91	-1.09	6.58	13.27	14.71
Materials	634.69	-2.75	1.50	8.67	8.85
Industrials	1425.06	-0.61	1.87	6.55	6.52
Consumer Discr…	1883.84	-2.59	-4.40	-2.70	-1.19
Consumer Stapl…	973.25	0.25	5.62	9.91	12.71
Health Care	1804.66	-0.70	-0.96	-0.00	-0.50
Financials	885.14	-1.22	-1.24	-1.13	-3.11
Information Te…	5294.91	-1.72	-5.50	-6.52	-6.89
Communication …	464.27	-0.30	0.22	2.84	3.02
Utilities	437.99	0.11	0.29	-0.36	-0.22
Real Estate	261.36	-0.36	0.41	1.27	2.43

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	446.18	-1.71	-4.56	-5.35	-5.42
가치(IWD)	220.80	-0.82	0.74	3.94	4.05
대형(IWL)	167.99	-1.27	-2.19	-1.48	-1.56
중소형(IWM)	255.85	-1.79	-2.67	1.42	2.84
배당(VIG)	224.68	-0.82	0.06	1.42	1.85
저변동성(USMV)	94.99	-0.15	0.22	0.60	1.43
모멘텀(MTUM)	244.04	-1.22	-4.66	-3.08	-3.44
퀄리티(QUAL)	199.31	-1.15	-1.72	-0.05	0.06

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
McKesson Corpo…	Healthcare	957.51	16.49	14.68	14.79	16.28
Corpay, Inc.	Technology	335.26	11.65	4.73	9.41	11.53
Tapestry, Inc.	Consumer Cyclical	143.19	10.21	9.41	17.76	10.94
Cardinal Healt…	Healthcare	227.33	9.90	7.73	9.90	10.50
The Hershey Co…	Consumer Defensive	224.43	9.06	14.34	19.93	23.04

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Estee Lauder C…	Consumer Defensive	96.76	-19.10	-15.82	-7.71	-9.37
Coinbase Globa…	Financial Services	146.12	-13.34	-32.40	-40.40	-38.22
IQVIA Holdings…	Healthcare	180.69	-10.79	-22.15	-20.49	-19.83
Cummins Inc.	Industrials	540.44	-10.76	-5.83	2.82	3.53
Huntington Ing…	Industrials	369.55	-10.55	-10.51	4.09	5.66

자료: Yahoo Finance, SK증권

Currency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Dollar Index	97.93	0.31	-0.12	-0.72	-0.50
USD/KRW	1469.00	1.54	0.90	0.60	1.76
USD/EUR	1.18	-0.28	0.19	0.74	0.27
USD/JPY	157.02	0.79	0.28	0.54	0.19
USD/CNY	6.94	0.00	-0.35	-1.26	-0.83

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	63.20	-2.98	2.75	6.47	10.26
Brent(ICE EU)	67.45	-2.89	1.99	6.17	11.03
Natural Gas(NY…	3.49	0.78	-17.69	-19.07	-3.48

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4822.70	-1.99	0.26	8.63	11.78
Copper(COMEX)	5.75	-1.36	-2.32	4.37	1.90
Silver(COMEX)	72.46	-13.91	-20.41	1.92	2.69

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	435.25	1.34	1.66	0.25	-0.51
Wheat(CBOT)	534.75	1.52	2.44	1.97	5.58
Soybean(CBOT)	1110.75	1.69	4.73	2.73	7.89
Coffee(ICE US)	307.85	-0.26	-11.12	-17.50	-13.84
Sugar(ICE US)	14.27	-1.18	-2.88	-3.50	-2.26

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	63722.32	-12.73	-24.83	-27.82	-28.19
Ethereum	1870.17	-12.75	-32.16	-37.07	-37.67

자료: Yahoo Finance, SK증권