DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-02)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.024 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. 이는 귀금속 가격 하락이 과거 코스피에 미치는 영향을 단순 학습한 결과로 추측되며, 미 증시에서 메모리 업체들의 큰 낙폭과 주말 사이 가상화폐 변동성 확대를 주의할 필요가 있습니다.

Pre-market volatility

전일 대비	vs 1주 평균	vs 1개월 평균	vs 3개월 평균	vs 6개월 평균	vs 1년 평균
-0.024	0.016	-0.017	-0.012	-0.003	0.071

※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	5224.36	0.06	8.11	21.16	21.23
KOSDAQ	1149.44	-1.29	15.21	22.52	21.56
KOSPI200	768.41	0.37	9.07	24.54	23.11

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	29760	4.81	20.98	45.04	37.49
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7100	-5.71	19.97	23.77	39.49
455850	SOL AI반도체소부장	23695	4.98	22.64	33.56	31.90
305720	KODEX 2차전지산업	17370	-4.48	12.88	13.24	28.71
102970	KODEX 증권	21820	1.56	22.91	36.36	40.01
395160	KODEX AI반도체	25105	3.76	18.97	37.53	31.72
395270	HANARO Fn K-반도체	29190	3.51	16.90	37.60	30.40
498400	KODEX 200타겟위클리커	16745	0.15	8.66	21.53	20.86
487240	KODEX AI전력핵심설비	28400	0.92	8.28	15.07	18.14

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	15200	-2.44	11,709,546

※ 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 %
475310	SOL 반도체후공정	25165	7.22	21.98	34.24	31.55
471760	TIGER AI반도체핵심공정	17110	5.72	22.58	39.93	36.66
475300	SOL 반도체전공정	17160	5.24	29.17	42.94	37.50
091230	TIGER 반도체	92780	5.01	20.62	41.40	35.43
494220	UNICORN SK하이닉스밸	30400	5.01	21.72	40.57	34.16

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
261070	TIGER 코스닥150바이오	21050	-6.30	10.76	14.21	15.98
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7100	-5.71	19.97	23.77	39.49
455860	SOL 2차전지소부장Fn	6350	-5.51	16.23	19.15	33.54
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	6800	-5.49	16.64	19.00	35.46
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	24015	-5.36	2.60	5.81	5.79

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	786.14	0.98	6.72	11.91	12.04
Materials	624.06	-1.84	1.33	8.09	7.02
Industrials	1400.05	-0.28	1.16	5.38	4.65
Consumer Discr…	1961.14	-0.07	-0.53	1.24	2.87
Consumer Stapl…	929.89	1.35	3.22	5.92	7.69
Health Care	1802.62	0.57	-1.33	0.29	-0.62
Financials	887.83	-0.28	-1.72	-0.69	-2.82
Information Te…	5587.88	-1.33	-1.16	-1.74	-1.74
Communication …	478.15	-0.23	4.02	6.64	6.10
Utilities	439.54	-0.20	0.80	-0.22	0.13
Real Estate	262.03	0.09	1.05	1.58	2.69

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	465.95	-0.74	-1.09	-1.42	-1.23
가치(IWD)	219.86	-0.18	0.99	4.09	3.61
대형(IWL)	172.28	-0.27	0.18	1.12	0.96
중소형(IWM)	259.65	-1.41	-0.69	3.43	4.37
배당(VIG)	224.02	-0.13	0.07	1.43	1.55
저변동성(USMV)	94.99	0.33	0.44	0.77	1.43
모멘텀(MTUM)	255.89	-2.00	-0.35	1.71	1.25
퀄리티(QUAL)	202.42	-1.13	-0.16	1.76	1.62

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Deckers Outdoo…	Consumer Cyclical	119.34	19.46	15.58	24.13	11.75
Verizon Commun…	Communication Services	44.52	11.83	11.42	10.26	9.87
Charter Commun…	Communication Services	206.12	7.62	4.07	1.23	-1.51
Air Products a…	Basic Materials	272.50	6.44	4.08	7.04	8.80
Colgate-Palmol…	Consumer Defensive	90.29	5.92	8.54	12.56	16.22

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
KLA Corporation	Technology	1427.94	-15.24	-3.00	10.67	12.04
Newmont Corpor…	Basic Materials	112.35	-11.49	-2.98	11.99	11.00
Western Digita…	Technology	250.23	-10.12	10.87	34.52	33.31
Seagate Techno…	Technology	407.69	-8.71	20.03	37.45	41.79
Take-Two Inter…	Communication Services	220.30	-7.93	-10.25	-10.11	-12.44

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.50	-0.82	0.48	2.42	2.11
선진국(URTH)	189.63	-0.61	0.34	1.95	1.67
신흥국(EEM)	59.10	-2.22	1.59	6.25	5.09
미국(S&P500)	6939.03	-0.43	0.14	1.40	1.17
미국(NASDAQ)	23461.82	-0.94	-0.25	0.67	0.97
미국(DJIA)	48892.47	-0.36	-0.50	1.60	1.05
유럽(Eurostoxx50)	5947.81	0.95	-0.15	3.05	0.41
일본(Nikkei225)	53322.85	-0.10	0.72	4.33	2.87
중국(CSI300)	4706.34	-1.00	-0.66	1.47	-0.24
홍콩(HangSeng)	27387.11	-2.08	2.15	4.41	3.98
대만(TWSE)	32063.75	-1.45	2.38	10.67	9.25
인도(Nifty 50)	24825.45	-1.96	-2.98	-3.93	-5.05
한국(KOSPI)	5224.36	0.06	8.11	21.16	21.23

Fixed Income

US Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
Fed Funds (EFFR)	3.72	0.00	-16.00	-50.00	-61.00	-76.00
US Treasury 2Y	3.53	-3.00	8.00	-7.00	-16.00	-68.00
US TIPS 10Y	1.89	-1.00	-1.00	8.00	-1.00	-26.00
IG Corporate Yield	4.82	-1.00	3.00	0.00	-13.00	-47.00
HY Corporate Yield	6.52	3.00	4.00	-15.00	-41.00	-47.00
High Yield Spread	2.77	5.00	-7.00	-17.00	-36.00	9.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	1.00	11.00	6.00	3.00	-2.00
US T-Bill 3M	3.57	-0.80	2.50	-14.60	-61.00	-61.00
US Treasury 10Y	4.24	1.40	7.80	14.00	2.10	-27.10
US Treasury 30Y	4.87	1.80	3.20	20.20	6.50	11.40
2Y-10Y Spread	0.71	4.40	-0.20	21.00	18.10	40.90

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	3.14	3.20	18.50	42.20	66.00	56.80
국고채 10년	3.61	5.00	22.20	54.60	77.50	74.80
회사채 AA- 3년	3.66	3.20	18.20	53.60	68.80	44.80
CD 91일	2.73	1.00	-8.00	18.00	22.00	-30.00

※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	97.15	0.90	-1.09	-1.67	-1.29
USD/KRW	1445.17	1.11	-0.65	-1.03	0.11
USD/EUR	1.19	-0.73	1.34	1.83	1.19
USD/JPY	154.73	1.07	-1.35	-0.85	-1.28
USD/CNY	6.95	-0.01	-0.26	-1.21	-0.61

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	65.55	0.20	8.75	10.86	14.36
Brent(ICE EU)	69.75	-1.36	7.77	10.27	14.81
Natural Gas(NY…	4.09	4.44	-3.83	-6.43	13.10

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5067.50	-4.72	6.72	15.44	17.46
Copper(COMEX)	6.01	-2.60	2.18	10.42	6.65
Silver(COMEX)	98.50	-13.62	7.72	42.07	39.61

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	427.25	-0.81	-0.82	-1.61	-2.34
Wheat(CBOT)	539.50	-0.37	4.04	2.71	6.52
Soybean(CBOT)	1069.75	-0.23	1.59	-1.21	3.91
Coffee(ICE US)	336.50	-2.60	-5.62	-11.25	-5.82
Sugar(ICE US)	14.23	-3.20	-3.62	-3.66	-2.53

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	77012.80	-2.05	-13.85	-13.90	-13.21
Ethereum	2312.28	-5.43	-22.77	-23.78	-22.93

자료: Yahoo Finance, SK증권