DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-03)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.013 하락하여 오전 중 지수 상방 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
-0.013	-0.004	-0.010	-0.008	-0.005	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	4949.67	-5.26	1.91	14.38	14.85
KOSDAQ	1098.36	-4.44	9.32	16.67	16.16
KOSPI200	725.46	-5.59	2.42	17.07	16.23

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	27235	-8.48	9.74	31.80	25.83
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6840	-3.66	14.01	18.84	34.38
305720	KODEX 2차전지산업	16520	-4.89	6.43	7.64	22.42
498400	KODEX 200타겟위클리커	15795	-5.67	1.98	14.22	14.00
395160	KODEX AI반도체	23065	-8.13	8.48	25.62	21.01
395270	HANARO Fn K-반도체	27130	-7.06	7.83	27.09	21.20
487240	KODEX AI전력핵심설비	25760	-9.30	-1.93	4.36	7.15
455850	SOL AI반도체소부장	21650	-8.63	11.19	21.52	20.51
228790	TIGER 화장품	3710	-2.62	5.76	8.26	8.01

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14330	-5.72	9,804,240

※ 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 %
494420	PLUS 미국배당증가성장주데	9615	0.68	-1.68	-0.45	0.69
215620	HK S&P코리아로우볼	17365	0.40	4.71	5.79	6.24
360150	KODEX 코스닥150룽코스	7010	0.14	10.95	2.11	5.73
360140	KODEX 200룽코스닥15	11785	-0.08	-12.03	-5.15	-7.64
091170	KODEX 은행	13410	-0.56	2.97	5.52	6.57

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
476260	HANARO 반도체액심공정주	11115	-9.38	12.36	24.39	22.21
487240	KODEX AI전력핵심설비	25760	-9.30	-1.93	4.36	7.15
475300	SOL 반도체전공정	15570	-9.27	15.99	29.06	24.76
491820	HANARO 전력설비투자	31205	-9.24	-1.45	4.90	7.73
486240	DAISHIN343 AI반도	18140	-9.14	5.87	19.66	17.30

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	770.57	-1.98	4.12	9.43	9.82
Materials	628.50	0.71	1.67	8.57	7.79
Industrials	1417.68	1.26	2.14	6.54	5.97
Consumer Discr…	1975.23	0.72	0.01	1.96	3.61
Consumer Stapl…	944.58	1.58	4.38	7.39	9.39
Health Care	1813.61	0.61	-0.73	0.79	-0.01
Financials	896.91	1.02	-0.62	0.27	-1.83
Information Te…	5613.82	0.46	-0.64	-1.22	-1.28
Communication …	479.76	0.34	4.04	6.77	6.45
Utilities	432.75	-1.54	-0.68	-1.70	-1.41
Real Estate	259.10	-1.12	-0.15	0.44	1.54

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	467.44	0.32	-0.73	-1.06	-0.92
가치(IWD)	221.60	0.79	1.57	4.76	4.43
대형(IWL)	173.07	0.46	0.57	1.54	1.42
중소형(IWM)	262.16	0.97	0.02	4.28	5.38
배당(VIG)	226.24	0.99	0.94	2.35	2.56
저변동성(USMV)	95.35	0.37	0.72	1.10	1.81
모멘텀(MTUM)	258.34	0.96	0.49	2.62	2.22
퀄리티(QUAL)	203.66	0.62	0.34	2.31	2.25

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Carnival Corpo…	Consumer Cyclical	32.44	8.08	7.46	14.28	4.93
Western Digita…	Technology	270.11	7.94	17.53	43.69	43.91
Norwegian Crui…	Consumer Cyclical	23.64	7.63	5.10	13.83	3.75
Old Dominion F…	Industrials	186.13	7.47	7.31	19.68	16.92
Corning Incorp…	Technology	110.35	6.87	16.68	23.92	21.70

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Walt Disney Co…	Communication Services	104.54	-7.32	-6.81	-5.09	-6.54
EQT Corporation	Energy	54.75	-5.16	2.23	-2.11	2.41
ONEOK, Inc.	Energy	75.32	-4.89	0.12	3.20	1.32
Axon Enterpris…	Industrials	459.99	-4.88	-22.88	-19.69	-18.36
Expand Energy …	Energy	106.94	-4.87	0.66	-4.41	-2.58

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	146.31	0.56	0.91	2.91	2.68
선진국(URTH)	190.67	0.55	0.78	2.44	2.23
신흥국(EEM)	59.28	0.30	1.62	6.42	5.40
미국(S&P500)	6976.44	0.54	0.60	1.90	1.72
미국(NASDAQ)	23592.11	0.56	0.23	1.21	1.53
미국(DJIA)	49407.66	1.05	0.44	2.59	2.12
유럽(Eurostoxx50)	6007.51	1.00	0.78	3.99	1.41
일본(Nikkei225)	52655.18	-1.25	-0.76	3.02	1.59
중국(CSI300)	4605.98	-2.13	-2.66	-0.66	-2.37
홍콩(HangSeng)	26775.57	-2.23	-0.21	2.02	1.66
대만(TWSE)	31624.03	-1.37	0.74	8.92	7.75
인도(Nifty 50)	25088.40	-0.92	-2.00	-2.93	-4.05
한국(KOSPI)	4949.67	-5.26	1.91	14.38	14.85

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	4.85	3.00	1.00	3.00	-9.00	-46.00
HY Corporate Yield	6.66	12.00	13.00	-1.00	-15.00	-32.00
High Yield Spread	2.88	8.00	7.00	-6.00	-14.00	20.00
10Y Breakeven Inflation	2.36	1.00	11.00	6.00	3.00	-2.00
US T-Bill 3M	3.58	0.60	4.50	-21.50	-55.50	-61.00
US Treasury 10Y	4.28	3.40	8.80	18.60	5.50	-29.40
US Treasury 30Y	4.91	3.70	4.50	23.90	9.80	9.60
2Y-10Y Spread	0.75	6.40	0.80	25.60	21.50	38.60

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	3.15	1.40	21.70	42.30	72.20	57.90
국고채 10년	3.60	-0.40	21.70	52.10	82.40	74.40
회사채 AA- 3년	3.67	1.00	20.90	53.20	75.00	46.40
CD 91일	2.74	1.00	-3.00	17.00	24.00	-29.00

※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	97.62	0.65	-0.56	-1.14	-0.81
USD/KRW	1451.83	1.61	-0.18	-0.57	0.57
USD/EUR	1.18	-1.42	0.45	0.96	0.38
USD/JPY	155.56	1.57	-0.72	-0.32	-0.75
USD/CNY	6.95	-0.03	-0.33	-1.27	-0.72

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	62.24	-4.55	2.87	5.22	8.58
Brent(ICE EU)	66.39	-6.08	2.06	4.88	9.28
Natural Gas(NY…	3.25	-25.26	-23.43	-25.35	-10.06

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4687.00	-0.57	-1.32	6.62	8.64
Copper(COMEX)	5.83	-1.13	-1.02	6.78	3.38
Silver(COMEX)	80.02	2.21	-11.98	15.07	13.41

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	425.50	-0.64	-1.10	-1.99	-2.74
Wheat(CBOT)	527.50	-1.95	1.53	0.50	4.15
Soybean(CBOT)	1060.00	-0.40	0.55	-2.03	2.96
Coffee(ICE US)	335.25	0.90	-5.62	-11.29	-6.17
Sugar(ICE US)	14.26	-0.07	-3.32	-3.47	-2.33

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	78068.59	1.42	-11.81	-12.49	-12.02
Ethereum	2329.42	2.71	-20.83	-22.86	-22.36

자료: Yahoo Finance, SK증권