DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-04)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.023 상승하여 오전 중 지수 하방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 차익 실현 또는 관망 가능성이 높은 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
0.023	-0.024	-0.012	-0.005	-0.008	0.089

※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	5288.08	6.84	8.03	21.60	22.70
KOSDAQ	1144.33	4.19	12.83	21.02	21.02
KOSPI200	779.54	7.45	9.12	25.09	24.89

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	29600	8.68	17.85	41.98	36.75
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7160	4.68	17.52	23.89	40.67
102970	KODEX 증권	23050	12.93	25.93	42.16	47.90
395160	KODEX AI반도체	25045	8.58	16.50	35.39	31.40
228790	TIGER 화장품	3735	0.67	5.86	8.86	8.73
395270	HANARO Fn K-반도체	29525	8.83	16.04	37.21	31.90
498400	KODEX 200타겟위클리커	16880	6.87	8.15	21.48	21.83
305720	KODEX 2차전지산업	17200	4.12	9.69	11.94	27.45
487240	KODEX AI전력핵심설비	28065	8.95	6.17	13.52	16.74

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14930	4.19	5,441,339

※ 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 %
157500	TIGER 증권	15895	13.90	26.59	43.33	48.83
102970	KODEX 증권	23050	12.93	25.93	42.16	47.90
421320	PLUS 우주항공&UAM	45350	9.41	19.33	61.46	58.65
091160	KODEX 반도체	88780	9.27	18.61	39.79	35.58
486240	DAISHIN343 AI반도	19800	9.15	14.38	29.91	28.03

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6815	-2.78	7.49	-0.63	2.79
395280	HANARO Fn K-게임	4005	-1.84	1.15	2.89	4.03
300950	KODEX 게임산업	6540	-0.91	2.14	3.75	4.56
364990	TIGER 게임TOP10	5400	-0.64	0.82	2.98	3.85
215620	HK S&P코리아로우볼	17285	-0.46	3.91	5.13	5.75

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	795.89	3.29	6.99	12.68	13.43
Materials	641.08	2.00	3.28	10.42	9.94
Industrials	1430.35	0.89	2.77	7.31	6.91
Consumer Discr…	1956.51	-0.95	-0.97	1.01	2.62
Consumer Stapl…	960.74	1.71	5.58	9.00	11.26
Health Care	1795.38	-1.01	-1.69	-0.32	-1.01
Financials	888.99	-0.88	-1.25	-0.64	-2.69
Information Te…	5491.94	-2.17	-2.63	-3.26	-3.43
Communication …	473.60	-1.28	2.49	5.22	5.09
Utilities	439.43	1.54	0.79	-0.14	0.11
Real Estate	258.36	-0.29	-0.49	0.15	1.25

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	459.24	-1.76	-2.32	-2.73	-2.65
가치(IWD)	221.92	0.11	1.54	4.76	4.58
대형(IWL)	171.33	-1.02	-0.43	0.50	0.40
중소형(IWM)	262.77	0.23	0.06	4.40	5.62
배당(VIG)	225.31	-0.41	0.45	1.86	2.14
저변동성(USMV)	94.91	-0.49	0.21	0.61	1.35
모멘텀(MTUM)	256.65	-0.66	-0.20	1.90	1.55
퀄리티(QUAL)	201.38	-1.16	-0.79	1.11	1.10

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
DaVita Inc.	Healthcare	134.89	21.31	23.30	17.10	17.80
Teradyne, Inc.	Technology	282.98	13.41	20.79	39.45	36.34
The AES Corpor…	Utilities	16.09	9.27	10.75	13.78	8.60
Ball Corporati…	Consumer Cyclical	61.76	8.94	9.84	18.85	15.76
Western Digita…	Technology	290.24	7.40	23.53	52.63	54.63

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gartner, Inc.	Technology	160.03	-20.93	-29.90	-31.59	-32.49
PayPal Holding…	Financial Services	41.70	-20.31	-24.88	-29.95	-28.28
CoStar Group, …	Real Estate	51.73	-15.45	-17.66	-21.26	-21.25
Expedia Group,…	Consumer Cyclical	234.46	-15.26	-16.28	-13.75	-17.13
EPAM Systems, …	Technology	183.71	-12.69	-13.88	-8.83	-8.35

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.54	-0.53	0.31	2.31	2.14
선진국(URTH)	189.43	-0.65	0.09	1.73	1.57
신흥국(EEM)	59.60	0.55	1.95	6.87	5.98
미국(S&P500)	6917.81	-0.84	-0.26	1.01	0.87
미국(NASDAQ)	23255.19	-1.43	-1.17	-0.22	0.08
미국(DJIA)	49240.99	-0.34	0.08	2.17	1.77
유럽(Eurostoxx50)	5995.35	-0.20	0.53	3.68	1.21
일본(Nikkei225)	54720.66	3.92	2.86	6.95	5.57
중국(CSI300)	4660.11	1.18	-1.38	0.51	-1.22
홍콩(HangSeng)	26834.77	0.22	-0.01	2.22	1.88
대만(TWSE)	32195.36	1.81	2.29	10.60	9.70
인도(Nifty 50)	25727.55	2.55	0.62	-0.47	-1.60
한국(KOSPI)	5288.08	6.84	8.03	21.60	22.70

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	3.52	-1.00	5.00	-8.00	-17.00	-66.00
US TIPS 10Y	1.90	1.00	-3.00	9.00	0.00	-24.00
IG Corporate Yield	4.87	2.00	2.00	3.00	-7.00	-44.00
HY Corporate Yield	6.63	-3.00	8.00	-22.00	-15.00	-35.00
High Yield Spread	2.81	-7.00	-2.00	-32.00	-17.00	13.00
10Y Breakeven Inflation	2.35	-1.00	10.00	6.00	1.00	-7.00
US T-Bill 3M	3.59	1.20	5.70	-19.80	-54.80	-60.00
US Treasury 10Y	4.27	-0.10	8.70	11.70	3.00	-26.90
US Treasury 30Y	4.91	-0.30	4.20	17.00	9.00	13.50
2Y-10Y Spread	0.75	0.90	3.70	19.70	20.00	39.10

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	3.19	3.70	25.40	42.20	78.10	61.70
국고채 10년	3.66	5.80	27.50	53.60	88.90	82.60
회사채 AA- 3년	3.71	4.00	24.90	53.90	80.70	51.20
CD 91일	2.74	0.00	-3.00	17.00	24.00	-28.00

※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	97.38	-0.23	-0.76	-1.34	-1.06
USD/KRW	1451.11	0.16	-0.24	-0.62	0.52
USD/EUR	1.18	-0.20	0.65	1.18	0.64
USD/JPY	155.71	0.33	-0.58	-0.24	-0.65
USD/CNY	6.94	-0.20	-0.42	-1.35	-0.84

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	64.14	3.22	5.51	8.30	11.90
Brent(ICE EU)	68.27	2.97	4.44	7.72	12.38
Natural Gas(NY…	3.35	3.58	-20.93	-22.82	-7.32

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	4961.90	7.34	3.97	12.48	15.01
Copper(COMEX)	6.09	4.97	3.27	11.16	7.98
Silver(COMEX)	84.49	10.04	-7.32	20.52	19.74

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	428.75	0.70	-0.16	-1.22	-2.00
Wheat(CBOT)	529.25	0.28	1.70	0.92	4.49
Soybean(CBOT)	1066.75	0.61	1.09	-1.32	3.62
Coffee(ICE US)	315.20	-5.42	-10.69	-16.23	-11.78
Sugar(ICE US)	14.63	2.59	-0.77	-1.02	0.21

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	76570.98	-2.69	-12.53	-13.97	-13.71
Ethereum	2303.28	-1.75	-20.31	-23.43	-23.23

자료: Yahoo Finance, SK증권