# DAILY RECAP

## ▶ Summary (2026-02-09)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.002 상승하여 오전 중 지수 하방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 순매수 유입에 우호적인 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 0.002 | 0.006 | -0.002 | -0.007 | -0.000 | 0.079 |

※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 | 5089.14 | -1.44 | 1.95 | 15.48 | 18.09 |
| KOSDAQ | 1080.77 | -2.49 | 4.01 | 12.93 | 14.30 |
| KOSPI200 | 748.10 | -1.17 | 2.58 | 18.21 | 19.86 |

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 396500 | TIGER 반도체TOP10 | 28070 | 0.05 | 8.50 | 31.52 | 29.68 |
| 498400 | KODEX 200타겟위클리커 | 16300 | -0.94 | 2.47 | 15.78 | 17.65 |
| 462010 | TIGER 2차전지소재Fn | 6745 | -4.73 | 5.84 | 15.28 | 32.51 |
| 395270 | HANARO Fn K-반도체 | 27965 | -0.18 | 7.00 | 27.23 | 24.93 |
| 228790 | TIGER 화장품 | 3590 | -1.64 | 0.52 | 4.35 | 4.51 |
| 395160 | KODEX AI반도체 | 23740 | -0.25 | 7.34 | 25.84 | 24.55 |
| 091160 | KODEX 반도체 | 84420 | 0.50 | 9.32 | 30.15 | 28.92 |
| 329200 | TIGER 리츠부동산인프라 | 4530 | 0.22 | 0.62 | 2.36 | 1.68 |
| 305720 | KODEX 2차전지산업 | 16560 | -3.64 | 2.24 | 7.33 | 22.71 |

| Code | Instrument | Close | Daily % | Volume |
|---|---|---|---|---|
| 0148J0 | TIGER 코리아휴머노이드로봇산업 | 13440 | -6.01 | 6,809,312 |

※ 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 | 27800 | 3.58 | 16.56 | 23.51 | 31.38 |
| 475300 | SOL 반도체전공정 | 16270 | 2.88 | 14.81 | 31.69 | 30.37 |
| 484880 | SOL 금융지주플러스고배당 | 20570 | 2.70 | 11.02 | 16.79 | 19.71 |
| 091220 | TIGER 은행 | 15565 | 2.60 | 11.30 | 16.27 | 19.40 |
| 360140 | KODEX 200롱코스닥15 | 12705 | 2.58 | -3.62 | 2.06 | -0.43 |

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 476000 | UNICORN 포스트IPO액 | 11750 | -6.37 | -4.29 | -1.96 | 1.16 |
| 469070 | RISE AI&로봇 | 16590 | -5.06 | -2.62 | 18.40 | 21.90 |
| 462900 | KoAct 바이오헬스케어액티 | 21755 | -4.75 | -6.39 | -5.53 | -4.16 |
| 462010 | TIGER 2차전지소재Fn | 6745 | -4.73 | 5.84 | 15.28 | 32.51 |
| 461950 | KODEX 2차전지핵심소재1 | 6455 | -4.65 | 3.77 | 11.35 | 28.59 |

자료: 한국거래소, SK증권

### US Market

US GICS Level I Index

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Energy | 820.14 | 1.89 | 7.84 | 15.06 | 16.88 |
| Materials | 645.93 | 1.77 | 2.92 | 10.29 | 10.78 |
| Industrials | 1465.59 | 2.84 | 4.36 | 9.36 | 9.55 |
| Consumer Discr… | 1871.49 | -0.66 | -4.73 | -3.26 | -1.84 |
| Consumer Stapl… | 986.03 | 1.31 | 6.35 | 11.07 | 14.19 |
| Health Care | 1837.00 | 1.79 | 0.84 | 1.67 | 1.28 |
| Financials | 901.12 | 1.81 | 0.70 | 0.61 | -1.36 |
| Information Te… | 5511.87 | 4.10 | -1.52 | -2.59 | -3.08 |
| Communication … | 457.28 | -1.51 | -1.28 | 1.20 | 1.47 |
| Utilities | 440.28 | 0.52 | 0.66 | 0.22 | 0.30 |
| Real Estate | 266.07 | 1.80 | 2.02 | 3.05 | 4.27 |

US Style Factor ETFs

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| 성장(IWF) | 456.84 | 2.41 | -2.11 | -3.00 | -3.16 |
| 가치(IWD) | 224.57 | 1.69 | 2.27 | 5.56 | 5.83 |
| 대형(IWL) | 171.08 | 1.85 | -0.36 | 0.33 | 0.25 |
| 중소형(IWM) | 265.02 | 3.59 | 0.69 | 4.91 | 6.53 |
| 배당(VIG) | 229.53 | 2.19 | 2.08 | 3.51 | 4.05 |
| 저변동성(USMV) | 96.03 | 1.16 | 1.24 | 1.66 | 2.54 |
| 모멘텀(MTUM) | 253.49 | 3.83 | -0.98 | 0.67 | 0.30 |
| 퀄리티(QUAL) | 203.64 | 2.21 | 0.39 | 2.06 | 2.23 |

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

| Instrument | Sector | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Coinbase Globa… | Financial Services | 165.12 | 13.00 | -22.16 | -31.94 | -30.19 |
| Super Micro Co… | Technology | 34.38 | 11.44 | 11.29 | 7.30 | 11.05 |
| Teradyne, Inc. | Technology | 300.11 | 10.69 | 23.55 | 44.46 | 44.59 |
| United Airline… | Industrials | 115.91 | 9.26 | 5.49 | 8.28 | 2.57 |
| Western Digita… | Technology | 282.58 | 8.61 | 15.24 | 44.65 | 50.55 |

| Instrument | Sector | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Molina Healthc… | Healthcare | 131.72 | -25.51 | -28.62 | -20.74 | -26.19 |
| VeriSign, Inc. | Technology | 224.17 | -7.60 | -9.25 | -9.27 | -6.80 |
| News Corporati… | Communication Services | 25.65 | -6.35 | -14.56 | -13.55 | -13.84 |
| First Solar, I… | Technology | 218.73 | -6.67 | -7.85 | -13.62 | -20.27 |

자료: Yahoo Finance, SK증권

### Global Market Index

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| 전세계(ACWI) | 146.28 | 2.14 | 0.74 | 2.66 | 2.66 |
| 선진국(URTH) | 190.24 | 2.03 | 0.51 | 2.02 | 2.00 |
| 신흥국(EEM) | 60.07 | 2.63 | 2.18 | 7.30 | 6.81 |
| 미국(S&P500) | 6932.30 | 1.97 | 0.07 | 1.14 | 1.08 |
| 미국(NASDAQ) | 23031.21 | 2.18 | -1.68 | -1.10 | -0.88 |
| 미국(DJIA) | 50115.67 | 2.47 | 1.77 | 3.73 | 3.58 |
| 유럽(Eurostoxx50) | 5998.40 | 1.23 | 0.52 | 3.45 | 1.26 |
| 일본(Nikkei225) | 54253.68 | 0.81 | 1.33 | 5.66 | 4.67 |
| 중국(CSI300) | 4643.60 | -0.57 | -1.46 | 0.15 | -1.57 |
| 홍콩(HangSeng) | 26559.95 | -1.21 | -1.30 | 1.13 | 0.84 |
| 대만(TWSE) | 31782.92 | -0.06 | 0.22 | 8.42 | 8.29 |
| 인도(Nifty 50) | 25693.70 | 0.20 | 0.77 | -0.62 | -1.73 |
| 한국(KOSPI) | 5089.14 | -1.44 | 1.95 | 15.48 | 18.09 |

### 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 | 3.47 | -10.00 | 0.00 | -8.00 | -29.00 | -70.00 |
| US TIPS 10Y | 1.89 | -5.00 | -2.00 | 6.00 | 1.00 | -12.00 |
| IG Corporate Yield | 4.81 | -6.00 | -1.00 | -3.00 | -18.00 | -42.00 |
| HY Corporate Yield | 6.69 | 2.00 | 20.00 | -16.00 | -11.00 | -24.00 |
| High Yield Spread | 2.97 | 11.00 | 18.00 | -18.00 | 3.00 | 28.00 |
| 10Y Breakeven Inflation | 2.34 | 2.00 | 7.00 | 6.00 | -5.00 | -8.00 |
| US T-Bill 3M | 3.59 | 1.20 | 7.50 | -16.70 | -54.30 | -62.30 |
| US Treasury 10Y | 4.21 | -0.40 | 6.80 | 11.30 | -7.90 | -23.40 |
| US Treasury 30Y | 4.86 | -0.70 | 4.00 | 15.50 | 0.00 | 20.50 |
| 2Y-10Y Spread | 0.74 | 9.60 | 6.80 | 19.30 | 21.10 | 46.60 |

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 | 3.23 | 2.90 | 32.30 | 33.90 | 82.40 | 65.10 |
| 국고채 10년 | 3.71 | 2.30 | 35.60 | 48.40 | 93.40 | 91.40 |
| 회사채 AA- 3년 | 3.75 | 3.10 | 33.20 | 46.90 | 85.30 | 55.90 |
| CD 91일 | 2.78 | 3.00 | 6.00 | 18.00 | 28.00 | -21.00 |

※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 | -0.14 | -0.30 | -0.94 | -0.75 |
| USD/KRW | 1463.33 | -0.50 | 0.44 | 0.21 | 1.36 |
| USD/EUR | 1.18 | 0.34 | 0.34 | 0.98 | 0.57 |
| USD/JPY | 157.61 | 0.53 | 0.68 | 0.86 | 0.56 |
| USD/CNY | 6.94 | 0.01 | -0.28 | -1.17 | -0.83 |

### Commodity

Energy

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| WTI(NYMEX) | 63.55 | 0.41 | 2.83 | 6.95 | 10.87 |
| Brent(ICE EU) | 68.05 | 0.74 | 2.42 | 7.00 | 12.02 |
| Natural Gas(NY… | 3.42 | -2.48 | -19.37 | -20.42 | -5.42 |

Metals

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Gold(COMEX) | 4979.80 | 2.44 | 2.92 | 11.78 | 15.42 |
| Copper(COMEX) | 5.88 | 1.43 | -0.19 | 6.55 | 4.29 |
| Silver(COMEX) | 76.89 | 0.48 | -15.82 | 7.39 | 8.98 |

Agriculture

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Corn(CBOT) | 430.25 | -1.09 | 0.68 | -0.91 | -1.66 |
| Wheat(CBOT) | 529.75 | -1.03 | 1.36 | 1.04 | 4.59 |
| Soybean(CBOT) | 1115.25 | 0.27 | 4.81 | 3.15 | 8.33 |
| Coffee(ICE US) | 294.00 | -4.67 | -14.16 | -20.79 | -17.72 |
| Sugar(ICE US) | 14.14 | -0.91 | -3.49 | -4.37 | -3.15 |

Cryptocurrency

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Bitcoin | 70783.23 | 2.17 | -12.82 | -18.81 | -20.23 |
| Ethereum | 2103.93 | 0.64 | -18.40 | -27.76 | -29.88 |

자료: Yahoo Finance, SK증권