DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-10)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.014 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
0.014	0.005	-0.011	-0.008	0.002	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	5298.04	4.10	5.43	19.71	22.93
KOSDAQ	1127.55	4.33	7.59	17.36	19.25
KOSPI200	780.94	4.39	6.30	22.77	25.12

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	29125	3.76	11.30	35.41	34.56
498400	KODEX 200타겟위클리커	16950	3.99	5.85	19.88	22.34
228790	TIGER 화장품	3800	5.85	5.73	10.23	10.63
102970	KODEX 증권	23300	6.98	18.90	39.64	49.50
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6960	3.19	7.85	18.56	36.74
487240	KODEX AI전력핵심설비	29285	7.63	7.52	17.50	21.82
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4530	0.00	0.53	2.27	1.68
395270	HANARO Fn K-반도체	29260	4.63	10.80	32.15	30.71
305720	KODEX 2차전지산업	17050	2.96	4.32	10.42	26.34
395160	KODEX AI반도체	24640	3.79	10.21	29.78	29.28

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
476260	HANARO 반도체핵심공정주	12240	9.73	17.12	33.89	34.58
421320	PLUS 우주항공&UAM	44825	8.40	12.22	51.95	56.81
157500	TIGER 증권	16170	8.23	20.22	41.62	51.40
491820	HANARO 전력설비투자	35370	7.85	7.65	17.71	22.11
487240	KODEX AI전력핵심설비	29285	7.63	7.52	17.50	21.82

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	12495	-1.65	-4.76	0.32	-2.08
364990	TIGER 게임TOP10	5375	-0.92	-0.64	2.61	3.37
300950	KODEX 게임산업	6500	-0.46	0.08	3.23	3.92
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4530	0.00	0.53	2.27	1.68
395280	HANARO Fn K-게임	3990	0.38	-0.36	2.61	3.64

자료: 한국거래소, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	147.41	0.77	1.42	3.39	3.45
선진국(URTH)	191.72	0.78	1.24	2.76	2.79
신흥국(EEM)	60.50	0.72	2.62	7.91	7.57
미국(S&P500)	6964.82	0.47	0.55	1.59	1.55
미국(NASDAQ)	23238.67	0.90	-0.70	-0.19	0.01
미국(DJIA)	50135.87	0.04	1.75	3.69	3.62
유럽(Eurostoxx50)	6059.01	1.01	1.50	4.35	2.28
일본(Nikkei225)	56363.94	3.89	4.84	9.57	8.74
중국(CSI300)	4719.06	1.62	0.22	1.77	0.03
홍콩(HangSeng)	27027.16	1.76	0.35	2.90	2.61
대만(TWSE)	32404.62	1.96	1.88	10.26	10.41
인도(Nifty 50)	25867.30	0.68	1.45	0.05	-1.07
한국(KOSPI)	5298.04	4.10	5.43	19.71	22.93

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	4.82	1.00	1.00	-2.00	-17.00	-43.00
HY Corporate Yield	6.61	-8.00	13.00	-24.00	-19.00	-31.00
High Yield Spread	2.87	-10.00	8.00	-28.00	-7.00	21.00
10Y Breakeven Inflation	2.34	2.00	7.00	6.00	-5.00	-8.00
US T-Bill 3M	3.59	0.30	8.00	-19.00	-51.70	-63.50
US Treasury 10Y	4.20	-0.80	2.70	7.80	-4.00	-28.90
US Treasury 30Y	4.85	-0.70	2.90	13.80	2.00	15.80
2Y-10Y Spread	0.73	9.20	2.70	15.80	25.00	41.10

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	3.27	3.40	32.50	43.60	85.00	63.20
국고채 10년	3.75	4.40	36.80	55.30	94.50	91.80
회사채 AA- 3년	3.79	3.20	34.20	55.10	88.00	54.50
CD 91일	2.78	0.00	8.00	18.00	27.00	-21.00

※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	826.99	0.84	7.96	15.68	17.86
Materials	655.24	1.44	4.04	11.56	12.37
Industrials	1470.44	0.33	4.34	9.50	9.91
Consumer Discr…	1865.04	-0.34	-4.69	-3.51	-2.17
Consumer Stapl…	977.57	-0.86	4.90	9.88	13.21
Health Care	1821.17	-0.86	0.01	0.74	0.41
Financials	895.58	-0.61	0.25	-0.03	-1.97
Information Te…	5599.32	1.59	0.12	-0.99	-1.54
Communication …	460.94	0.80	-0.49	1.91	2.28
Utilities	441.63	0.31	0.86	0.58	0.61
Real Estate	267.63	0.59	2.39	3.62	4.88

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	461.07	0.93	-1.04	-2.03	-2.27
가치(IWD)	224.60	0.01	2.12	5.43	5.84
대형(IWL)	172.09	0.59	0.26	0.91	0.84
중소형(IWM)	266.85	0.69	1.26	5.48	7.26
배당(VIG)	229.74	0.09	2.06	3.52	4.14
저변동성(USMV)	95.93	-0.10	1.07	1.52	2.43
모멘텀(MTUM)	257.39	1.54	0.54	2.18	1.84
퀄리티(QUAL)	204.06	0.21	0.60	2.20	2.44

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Oracle Corpora…	Technology	156.61	9.65	-9.26	-18.70	-19.98
Corning Incorp…	Technology	131.37	7.54	28.56	43.46	44.89
Viatris Inc.	Healthcare	15.56	6.72	15.83	28.42	24.88
Amphenol Corpo…	Technology	144.17	5.83	-2.30	2.89	3.19
MarketAxess Ho…	Financial Services	171.23	5.48	1.22	-0.35	-4.10

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Waters Corpora…	Healthcare	328.14	-13.94	-14.51	-15.28	-14.09
Willis Towers …	Financial Services	290.09	-12.10	-10.08	-10.57	-11.09
Arthur J. Gall…	Financial Services	217.80	-9.84	-12.57	-13.53	-14.92
Aon plc	Financial Services	310.44	-9.24	-8.89	-10.53	-9.83
Brown & Brown,…	Financial Services	68.66	-6.94	-9.38	-12.64	-11.54

자료: Yahoo Finance, SK증권

Currency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Dollar Index	96.86	-0.79	-1.02	-1.73	-1.59
USD/KRW	1457.79	-0.88	0.08	-0.16	0.98
USD/EUR	1.19	1.19	1.15	1.82	1.42
USD/JPY	155.88	-0.58	-0.37	-0.23	-0.54
USD/CNY	6.92	-0.23	-0.51	-1.41	-1.07

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	64.33	1.23	3.66	8.16	12.23
Brent(ICE EU)	69.00	1.40	3.41	8.39	13.58
Natural Gas(NY…	3.13	-8.53	-26.21	-26.80	-13.49

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5105.40	3.11	4.88	14.19	18.33
Copper(COMEX)	5.97	1.89	1.30	7.93	5.93
Silver(COMEX)	83.74	9.13	-8.56	16.06	18.69

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	428.50	-0.41	0.47	-1.30	-2.06
Wheat(CBOT)	528.25	-0.28	0.97	0.78	4.29
Soybean(CBOT)	1109.75	-0.49	3.99	2.64	7.80
Coffee(ICE US)	293.10	-1.16	-13.64	-20.58	-17.97
Sugar(ICE US)	14.31	1.42	-2.12	-3.23	-1.99

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70661.86	0.57	-11.98	-18.60	-20.36
Ethereum	2121.84	1.58	-16.36	-26.67	-29.28

자료: Yahoo Finance, SK증권