DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-11)

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 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
0.014	-0.015	-0.016	-0.010	0.002	0.086

※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	5301.69	0.07	4.86	19.28	23.02
KOSDAQ	1115.20	-1.10	5.57	15.68	17.94
KOSPI200	780.76	-0.02	5.55	22.13	25.09

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	28585	-1.85	8.13	31.94	32.06
498400	KODEX 200타겟위클리커	16950	0.00	5.20	19.37	22.34
102970	KODEX 증권	23880	2.49	19.59	42.05	53.22
487240	KODEX AI전력핵심설비	28910	-1.28	5.46	15.77	20.26
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6885	-1.08	5.70	16.97	35.27
091170	KODEX 은행	15900	3.11	15.86	22.87	26.36
228790	TIGER 화장품	3810	0.26	5.27	10.31	10.92
305720	KODEX 2차전지산업	16985	-0.38	3.27	9.98	25.86
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4540	0.22	0.63	2.41	1.91

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	14075	0.75	4,554,884

※ 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 %
244670	KODEX 밸류Plus	12580	4.66	12.80	18.20	22.37
140710	KODEX 운송	7065	4.36	5.79	15.20	20.67
266390	KODEX 경기소비재	11720	4.32	8.65	13.22	15.35
498860	RISE 코리아금융고배당	19685	4.15	16.73	27.28	31.37
498410	KODEX 금융고배당TOP1	13980	3.79	13.54	16.45	20.49

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
475300	SOL 반도체전공정	16210	-5.04	10.95	29.65	29.89
421320	PLUS 우주항공&UAM	42770	-4.58	6.26	43.33	49.62
476260	HANARO 반도체액심공정주	11755	-3.96	11.13	28.03	29.25
475310	SOL 반도체후공정	23840	-3.87	7.86	22.12	24.62
455850	SOL AI반도체소부장	22350	-3.83	7.63	21.72	24.41

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	826.33	-0.08	7.07	15.22	17.76
Materials	663.69	1.29	4.98	12.67	13.82
Industrials	1472.17	0.12	4.12	9.40	10.04
Consumer Discr…	1873.47	0.45	-3.91	-3.02	-1.73
Consumer Stapl…	971.44	-0.63	3.81	8.97	12.50
Health Care	1809.78	-0.63	-0.55	0.08	-0.22
Financials	888.82	-0.75	-0.34	-0.78	-2.71
Information Te…	5567.05	-0.58	-0.33	-1.48	-2.11
Communication …	457.06	-0.84	-1.28	0.96	1.42
Utilities	448.64	1.59	2.27	2.20	2.21
Real Estate	271.36	1.39	3.53	4.99	6.34

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	459.26	-0.37	-1.24	-2.35	-2.65
가치(IWD)	224.30	-0.14	1.83	5.15	5.70
대형(IWL)	171.51	-0.30	-0.03	0.56	0.50
중소형(IWM)	266.20	-0.26	0.92	5.06	7.00
배당(VIG)	229.03	-0.29	1.67	3.13	3.82
저변동성(USMV)	95.89	-0.01	0.97	1.46	2.39
모멘텀(MTUM)	254.99	-0.95	-0.32	1.20	0.89
퀄리티(QUAL)	203.53	-0.25	0.35	1.88	2.18

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Datadog, Inc.	Technology	129.67	13.74	4.19	-8.16	-3.06
Masco Corporat…	Industrials	77.82	8.67	11.76	18.34	20.71
Marriott Inter…	Consumer Cyclical	359.35	8.50	11.25	15.86	14.66
Hasbro, Inc.	Consumer Cyclical	104.00	7.48	14.30	22.51	25.35
Quest Diagnost…	Healthcare	205.26	7.33	9.73	12.06	18.11

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Becton, Dickin…	Healthcare	171.62	-17.25	-15.60	-13.40	-11.96
S&P Global Inc.	Financial Services	401.11	-9.70	-20.94	-21.08	-21.76
Raymond James …	Financial Services	158.40	-8.79	-6.18	-3.42	-3.18
Incyte Corpora…	Healthcare	100.05	-8.24	-3.33	-2.12	-1.35
Western Digita…	Technology	262.56	-8.19	4.19	32.01	39.88

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	147.31	-0.07	1.29	3.26	3.38
선진국(URTH)	191.52	-0.17	1.09	2.60	2.69
신흥국(EEM)	60.63	0.20	2.61	7.98	7.81
미국(S&P500)	6941.80	-0.33	0.24	1.23	1.21
미국(NASDAQ)	23102.47	-0.59	-1.15	-0.75	-0.57
미국(DJIA)	50188.14	0.10	1.79	3.73	3.73
유럽(Eurostoxx50)	6047.06	-0.20	1.28	4.03	2.08
일본(Nikkei225)	57650.54	2.28	6.83	11.83	11.22
중국(CSI300)	4724.30	0.11	0.37	1.85	0.14
홍콩(HangSeng)	27183.15	0.58	0.87	3.49	3.21
대만(TWSE)	33072.97	2.06	3.60	12.17	12.69
인도(Nifty 50)	25935.15	0.26	1.67	0.31	-0.81
한국(KOSPI)	5301.69	0.07	4.86	19.28	23.02

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	3.50	3.00	3.00	-5.00	-26.00	-71.00
US TIPS 10Y	1.88	-1.00	0.00	5.00	0.00	-15.00
IG Corporate Yield	4.81	-1.00	-2.00	-4.00	-9.00	-50.00
HY Corporate Yield	6.57	-4.00	8.00	-18.00	-12.00	-42.00
High Yield Spread	2.84	-3.00	10.00	-18.00	-6.00	17.00
10Y Breakeven Inflation	2.35	1.00	7.00	6.00	-2.00	-7.00
US T-Bill 3M	3.59	-0.30	7.70	-18.80	-52.20	-63.80
US Treasury 10Y	4.15	-5.10	-2.40	8.20	-14.60	-34.60
US Treasury 30Y	4.79	-6.00	-3.10	12.70	-9.50	7.70
2Y-10Y Spread	0.65	-8.10	-5.40	13.20	11.40	36.40

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	3.22	-4.30	28.20	30.10	82.00	58.60
국고채 10년	3.68	-7.30	29.50	39.90	89.40	85.10
회사채 AA- 3년	3.76	-2.80	31.40	42.80	86.30	52.00
CD 91일	2.78	0.00	8.00	17.00	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	96.83	0.01	-0.94	-1.71	-1.61
USD/KRW	1457.15	-0.36	0.05	-0.20	0.94
USD/EUR	1.19	0.62	0.93	1.63	1.26
USD/JPY	154.34	-1.84	-1.28	-1.22	-1.52
USD/CNY	6.91	-0.41	-0.64	-1.53	-1.23

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	64.18	-0.28	3.02	7.74	11.97
Brent(ICE EU)	68.97	-0.10	2.97	8.16	13.53
Natural Gas(NY…	3.13	-0.29	-26.00	-26.43	-13.52

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5057.00	0.12	3.46	12.77	17.21
Copper(COMEX)	5.91	-0.61	0.28	6.49	4.77
Silver(COMEX)	80.74	-1.61	-11.57	11.24	14.43

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	428.75	0.00	0.45	-1.21	-2.00
Wheat(CBOT)	529.50	0.14	1.03	1.03	4.54
Soybean(CBOT)	1123.25	1.13	4.81	3.89	9.11
Coffee(ICE US)	290.45	-3.13	-13.67	-20.92	-18.71
Sugar(ICE US)	14.11	-1.67	-3.26	-4.54	-3.36

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	68886.49	-1.76	-13.06	-20.31	-22.37
Ethereum	2014.88	-4.22	-19.01	-29.93	-32.85

자료: Yahoo Finance, SK증권