DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-12)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.002 하락하여 오전 중 지수 상방 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
-0.002	-0.009	-0.006	-0.009	-0.001	0.081

※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	5354.49	1.00	5.25	19.86	24.24
KOSDAQ	1114.87	-0.03	4.69	15.22	17.90
KOSPI200	788.75	1.02	5.90	22.66	26.37

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	28150	-1.52	5.58	28.94	30.05
498400	KODEX 200타겟위클리커	17100	0.88	5.45	19.82	23.42
487240	KODEX AI전력핵심설비	29825	3.16	8.12	19.00	24.06
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4560	0.44	0.95	2.76	2.36
102970	KODEX 증권	23660	-0.92	16.52	39.63	51.81
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6800	-1.23	3.34	15.17	33.60
228790	TIGER 화장품	3790	-0.52	4.11	9.52	10.33
395160	KODEX AI반도체	23760	-1.47	4.51	23.59	24.66

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	16220	4.54	4,108,617
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	13980	-0.67	2,959,830

※ 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 %
138530	TIGER LG그룹플러스	9790	6.41	7.44	9.64	14.64
466930	SOL 자동차TOP3플러스	20915	4.52	3.89	25.92	36.34
266390	KODEX 경기소비재	12250	4.52	12.48	17.86	20.57
138540	TIGER 현대차그룹플러스	58500	4.45	2.90	24.27	37.83
091220	TIGER 은행	17265	4.41	19.03	27.44	32.44

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
471760	TIGER AI반도체핵심공정	15845	-2.28	4.88	23.23	26.56
475310	SOL 반도체후공정	23350	-2.06	4.90	18.96	22.06
422260	VITA MZ소비액티브	11385	-1.81	7.48	11.62	15.29
455850	SOL AI반도체소부장	21995	-1.59	5.09	19.21	22.43
482030	KoAct 반도체&2차전지액	11795	-1.59	4.36	19.30	31.71

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	847.77	2.59	8.97	17.78	20.82
Materials	672.30	1.30	5.89	13.76	15.30
Industrials	1479.68	0.51	4.32	9.70	10.60
Consumer Discr…	1863.05	-0.55	-4.09	-3.53	-2.28
Consumer Stapl…	985.05	1.40	4.81	10.24	14.07
Health Care	1820.63	0.60	0.07	0.64	0.38
Financials	875.61	-1.49	-1.68	-2.24	-4.16
Information Te…	5578.65	0.21	-0.01	-1.24	-1.90
Communication …	451.09	-1.31	-2.45	-0.47	0.09
Utilities	452.53	0.87	2.96	3.08	3.09
Real Estate	271.50	0.05	3.33	4.95	6.40

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	457.85	-0.36	-1.36	-2.60	-2.95
가치(IWD)	224.76	0.19	1.87	5.21	5.92
대형(IWL)	171.48	0.07	0.00	0.51	0.49
중소형(IWM)	264.96	-0.45	0.39	4.38	6.50
배당(VIG)	229.27	0.08	1.67	3.15	3.93
저변동성(USMV)	96.00	0.07	1.00	1.54	2.51
모멘텀(MTUM)	255.18	0.05	-0.17	1.22	0.97
퀄리티(QUAL)	203.77	0.07	0.46	1.93	2.30

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Generac Holdi…	Industrials	214.73	17.79	23.59	36.39	52.18
Micron Technol…	Technology	410.34	9.94	4.54	33.58	30.09
Smurfit WestRo…	Consumer Cyclical	50.25	9.84	16.27	27.77	26.89
Universal Heal…	Healthcare	231.24	8.68	11.76	5.40	5.17
HCA Healthcare…	Healthcare	531.41	5.85	8.72	9.79	12.97

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
CBRE Group Inc	Real Estate	149.62	-12.16	-10.91	-8.17	-6.60
Leidos Holding…	Technology	173.01	-11.15	-8.80	-8.41	-5.70
Assurant, Inc.	Financial Services	216.01	-8.65	-8.71	-7.49	-9.13
Charles River …	Healthcare	165.85	-8.49	-20.09	-15.78	-18.07
Intercontinent…	Financial Services	151.94	-7.81	-10.75	-6.84	-5.03

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	147.71	0.27	1.46	3.45	3.66
선진국(URTH)	191.75	0.08	1.15	2.65	2.81
신흥국(EEM)	61.58	1.61	3.85	9.44	9.49
미국(S&P500)	6941.47	-0.00	0.25	1.18	1.21
미국(NASDAQ)	23066.47	-0.16	-1.17	-0.92	-0.73
미국(DJIA)	50121.40	-0.13	1.56	3.50	3.59
유럽(Eurostoxx50)	6035.64	-0.19	1.07	3.74	1.89
일본(Nikkei225)	57650.54	2.28	6.83	11.83	11.22
중국(CSI300)	4713.82	-0.22	0.17	1.58	-0.08
홍콩(HangSeng)	27266.38	0.31	1.13	3.76	3.52
대만(TWSE)	33605.71	1.61	4.83	13.58	14.50
인도(Nifty 50)	25953.85	0.07	1.71	0.38	-0.74
한국(KOSPI)	5354.49	1.00	5.25	19.86	24.24

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	3.48	-2.00	-6.00	-10.00	-19.00	-81.00
US TIPS 10Y	1.87	-1.00	-3.00	3.00	0.00	-20.00
IG Corporate Yield	4.78	-3.00	-5.00	-4.00	-16.00	-53.00
HY Corporate Yield	6.55	-2.00	6.00	-16.00	-17.00	-43.00
High Yield Spread	2.86	2.00	12.00	-16.00	-3.00	20.00
10Y Breakeven Inflation	2.32	-3.00	4.00	5.00	-7.00	-12.00
US T-Bill 3M	3.60	1.00	6.70	-19.30	-51.20	-62.50
US Treasury 10Y	4.17	2.50	-1.50	6.00	-15.60	-36.50
US Treasury 30Y	4.81	2.60	-2.60	11.20	-11.20	6.40
2Y-10Y Spread	0.69	4.50	4.50	16.00	3.40	44.50

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	3.20	-2.40	22.00	26.80	79.60	56.70
국고채 10년	3.64	-4.20	24.70	37.20	85.20	79.00
회사채 AA- 3년	3.75	-1.30	27.70	40.10	85.00	51.80
CD 91일	2.78	0.00	9.00	8.00	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	96.89	0.09	-0.77	-1.61	-1.55
USD/KRW	1445.48	-0.90	-0.66	-1.00	0.13
USD/EUR	1.19	-0.24	0.63	1.39	1.06
USD/JPY	153.25	-1.85	-1.85	-1.93	-2.22
USD/CNY	6.91	-0.14	-0.57	-1.46	-1.20

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	65.00	1.63	4.04	8.93	13.40
Brent(ICE EU)	69.77	1.41	3.84	9.23	14.85
Natural Gas(NY…	3.18	2.18	-24.50	-24.72	-12.02

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5113.20	2.19	4.11	13.66	18.51
Copper(COMEX)	5.98	1.36	1.42	7.42	5.96
Silver(COMEX)	84.38	5.18	-7.49	15.44	19.59

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	427.75	-0.23	0.12	-1.39	-2.23
Wheat(CBOT)	537.00	1.66	2.21	2.46	6.02
Soybean(CBOT)	1123.50	0.09	4.35	3.92	9.13
Coffee(ICE US)	292.50	-0.58	-12.22	-19.97	-18.14
Sugar(ICE US)	13.53	-4.18	-6.81	-8.37	-7.33

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	67430.59	-1.98	-13.69	-21.65	-24.01
Ethereum	1950.95	-3.39	-19.98	-31.69	-34.98

자료: Yahoo Finance, SK증권