# DAILY RECAP

## ▶ Summary (2026-02-13)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.040 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 0.040 | 0.001 | -0.010 | -0.011 | 0.003 | 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 | 5522.27 | 3.13 | 7.78 | 22.96 | 28.14 |
| KOSDAQ | 1125.99 | 1.00 | 4.87 | 15.92 | 19.08 |
| KOSPI200 | 816.28 | 3.49 | 8.72 | 26.15 | 30.78 |

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 396500 | TIGER 반도체TOP10 | 29450 | 4.62 | 9.30 | 33.81 | 36.06 |
| 498400 | KODEX 200타겟위클리커 | 17350 | 2.91 | 7.72 | 22.66 | 27.01 |
| 462010 | TIGER 2차전지소재Fn | 7050 | 3.68 | 5.96 | 18.94 | 38.51 |
| 102970 | KODEX 증권 | 24595 | 3.95 | 18.99 | 43.86 | 57.81 |
| 329200 | TIGER 리츠부동산인프라 | 4590 | 0.66 | 1.47 | 3.33 | 3.03 |
| 305720 | KODEX 2차전지산업 | 17415 | 2.99 | 4.28 | 12.49 | 29.05 |
| 364980 | TIGER 2차전지TOP10 | 10685 | 3.19 | 4.53 | 10.64 | 24.82 |
| 228790 | TIGER 화장품 | 3785 | -0.13 | 3.35 | 9.18 | 10.19 |
| 487240 | KODEX AI전력핵심설비 | 30110 | 0.96 | 8.43 | 19.72 | 25.25 |
| 091160 | KODEX 반도체 | 89400 | 4.17 | 10.73 | 33.82 | 36.53 |

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

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 475300 | SOL 반도체전공정 | 17060 | 6.73 | 13.66 | 34.78 | 36.70 |
| 367740 | HANARO Fn5G산업 | 28160 | 6.55 | 12.27 | 26.14 | 30.95 |
| 469150 | ACE AI반도체포커스 | 39210 | 5.86 | 9.87 | 32.49 | 34.79 |
| 476260 | HANARO 반도체액심공정주 | 12170 | 5.19 | 12.43 | 31.17 | 33.81 |
| 494330 | ACE 라이프자산주주가치액티 | 21365 | 5.01 | 13.12 | 28.20 | 33.78 |

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 360150 | KODEX 코스닥150룽코스 | 6235 | -2.20 | -3.56 | -8.10 | -5.96 |
| 322400 | HANARO e커머스 | 13740 | -1.43 | 5.17 | 10.15 | 11.84 |
| 388280 | RISE K엔터&여행레저 | 8895 | -1.22 | 7.50 | 13.60 | 15.00 |
| 300640 | RISE 게임테마 | 8255 | -1.20 | 1.41 | 5.65 | 6.72 |
| 266390 | KODEX 경기소비재 | 12120 | -1.06 | 10.37 | 16.18 | 19.29 |

자료: 한국거래소, SK증권

### Global Market Index

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| 전세계(ACWI) | 145.65 | -1.39 | 0.01 | 1.94 | 2.22 |
| 선진국(URTH) | 189.05 | -1.45 | -0.28 | 1.15 | 1.36 |
| 신흥국(EEM) | 60.86 | -1.14 | 2.38 | 7.98 | 8.21 |
| 미국(S&P500) | 6832.76 | -1.57 | -1.25 | -0.43 | -0.37 |
| 미국(NASDAQ) | 22597.15 | -2.03 | -3.00 | -2.92 | -2.75 |
| 미국(DJIA) | 49451.98 | -1.34 | 0.17 | 2.03 | 2.21 |
| 유럽(Eurostoxx50) | 6011.29 | -0.40 | 0.68 | 3.25 | 1.48 |
| 일본(Nikkei225) | 57639.84 | -0.02 | 6.48 | 11.57 | 11.20 |
| 중국(CSI300) | 4719.58 | 0.12 | 0.33 | 1.65 | 0.04 |
| 홍콩(HangSeng) | 27032.54 | -0.86 | 0.24 | 2.83 | 2.64 |
| 대만(TWSE) | 33605.71 | 1.61 | 4.83 | 13.58 | 14.50 |
| 인도(Nifty 50) | 25807.20 | -0.57 | 1.12 | -0.18 | -1.30 |
| 한국(KOSPI) | 5522.27 | 3.13 | 7.78 | 22.96 | 28.14 |

### 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 | 3.45 | -3.00 | -9.00 | -11.00 | -29.00 | -83.00 |
| US TIPS 10Y | 1.84 | -3.00 | -6.00 | 3.00 | -6.00 | -23.00 |
| IG Corporate Yield | 4.81 | 3.00 | -3.00 | -6.00 | -15.00 | -52.00 |
| HY Corporate Yield | 6.57 | 2.00 | 8.00 | -25.00 | -15.00 | -43.00 |
| High Yield Spread | 2.84 | -2.00 | 10.00 | -25.00 | -4.00 | 18.00 |
| 10Y Breakeven Inflation | 2.32 | 0.00 | 3.00 | 4.00 | -6.00 | -14.00 |
| US T-Bill 3M | 3.60 | -0.20 | 3.80 | -19.00 | -51.40 | -63.00 |
| US Treasury 10Y | 4.10 | -6.80 | -6.70 | -4.40 | -22.40 | -53.30 |
| US Treasury 30Y | 4.73 | -8.30 | -9.70 | -1.60 | -19.50 | -10.40 |
| 2Y-10Y Spread | 0.65 | -3.80 | 2.30 | 6.60 | 6.60 | 29.70 |

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 | 3.15 | -4.60 | 15.10 | 21.00 | 75.00 | 50.30 |
| 국고채 10년 | 3.62 | -2.10 | 20.60 | 30.10 | 83.10 | 73.90 |
| 회사채 AA- 3년 | 3.72 | -3.00 | 23.00 | 35.10 | 82.00 | 47.80 |
| CD 91일 | 2.78 | 0.00 | 9.00 | 6.00 | 28.00 | -20.00 |

※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 | 829.39 | -2.17 | 5.99 | 14.89 | 18.20 |
| Materials | 662.28 | -1.49 | 3.93 | 11.70 | 13.58 |
| Industrials | 1461.95 | -1.20 | 2.81 | 8.15 | 9.28 |
| Consumer Discr… | 1833.67 | -1.58 | -5.26 | -5.02 | -3.82 |
| Consumer Stapl… | 997.71 | 1.29 | 5.69 | 11.37 | 15.54 |
| Health Care | 1817.59 | -0.17 | -0.03 | 0.42 | 0.21 |
| Financials | 858.15 | -1.99 | -3.41 | -4.17 | -6.07 |
| Information Te… | 5431.01 | -2.65 | -2.49 | -3.77 | -4.50 |
| Communication … | 444.51 | -1.46 | -3.72 | -2.01 | -1.37 |
| Utilities | 459.32 | 1.50 | 4.26 | 4.58 | 4.64 |
| Real Estate | 272.34 | 0.31 | 3.44 | 5.18 | 6.73 |

US Style Factor ETFs

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| 성장(IWF) | 448.80 | -1.99 | -3.08 | -4.45 | -4.87 |
| 가치(IWD) | 222.15 | -1.19 | 0.60 | 3.85 | 4.69 |
| 대형(IWL) | 168.59 | -1.57 | -1.59 | -1.18 | -1.21 |
| 중소형(IWM) | 259.56 | -2.03 | -1.59 | 2.11 | 4.33 |
| 배당(VIG) | 226.57 | -1.22 | 0.43 | 1.86 | 2.70 |
| 저변동성(USMV) | 95.23 | -0.83 | 0.16 | 0.71 | 1.69 |
| 모멘텀(MTUM) | 250.36 | -1.88 | -1.96 | -0.72 | -0.94 |
| 퀄리티(QUAL) | 200.71 | -1.51 | -1.00 | 0.34 | 0.76 |

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

| Instrument | Sector | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Equinix, Inc. | Real Estate | 957.87 | 10.41 | 16.41 | 22.66 | 25.36 |
| Akamai Technol… | Technology | 104.61 | 10.35 | 9.17 | 15.67 | 22.93 |
| Zebra Technolo… | Technology | 274.15 | 8.57 | 11.35 | 9.41 | 10.41 |
| Motorola Solut… | Technology | 453.27 | 7.63 | 10.78 | 17.30 | 18.96 |
| Exelon Corpora… | Utilities | 47.55 | 6.97 | 6.71 | 7.16 | 8.27 |

| Instrument | Sector | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Baxter Interna… | Healthcare | 18.70 | -16.01 | -8.10 | -4.00 | -4.08 |
| Tyler Technolo… | Technology | 287.29 | -15.32 | -25.65 | -33.76 | -34.08 |
| C.H. Robinson … | Industrials | 167.78 | -14.54 | -10.46 | -1.15 | 2.48 |
| Expeditors Int… | Industrials | 140.45 | -13.24 | -12.61 | -8.73 | -7.51 |
| Cisco Systems, … | Technology | 75.00 | -12.32 | -5.27 | -3.46 | -1.37 |

자료: Yahoo Finance, SK증권

### Currency

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Dollar Index | 96.92 | 0.09 | -0.62 | -1.54 | -1.52 |
| USD/KRW | 1440.25 | -1.04 | -0.98 | -1.34 | -0.23 |
| USD/EUR | 1.19 | -0.13 | 0.51 | 1.33 | 1.05 |
| USD/JPY | 152.68 | -1.17 | -2.07 | -2.28 | -2.58 |
| USD/CNY | 6.90 | -0.15 | -0.69 | -1.57 | -1.37 |

### Commodity

Energy

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| WTI(NYMEX) | 62.87 | -2.72 | 0.59 | 5.29 | 9.68 |
| Brent(ICE EU) | 67.58 | -2.62 | 0.53 | 5.72 | 11.24 |
| Natural Gas(NY… | 3.22 | 1.84 | -23.76 | -23.50 | -11.08 |

Metals

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Gold(COMEX) | 4939.80 | -2.60 | 0.30 | 9.47 | 14.50 |
| Copper(COMEX) | 5.76 | -3.09 | -1.94 | 3.41 | 2.22 |
| Silver(COMEX) | 74.93 | -10.54 | -17.10 | 1.96 | 6.19 |

Agriculture

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Corn(CBOT) | 431.25 | 0.88 | 0.83 | -0.59 | -1.43 |
| Wheat(CBOT) | 552.00 | 2.75 | 4.67 | 5.24 | 8.98 |
| Soybean(CBOT) | 1136.50 | 1.11 | 5.04 | 5.09 | 10.39 |
| Coffee(ICE US) | 299.05 | 1.44 | -9.52 | -17.81 | -16.30 |
| Sugar(ICE US) | 13.53 | -2.24 | -6.54 | -8.25 | -7.33 |

Cryptocurrency

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Bitcoin | 65432.30 | -2.33 | -14.91 | -23.63 | -26.26 |
| Ethereum | 1917.79 | -1.18 | -19.61 | -32.40 | -36.08 |

자료: Yahoo Finance, SK증권