DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-06)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.020 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
0.020	-0.010	-0.001	-0.024	0.003	0.060

※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	5583.90	9.63	0.38	15.47	29.57
KOSDAQ	1116.41	14.10	-1.12	9.71	18.07
KOSPI200	831.22	9.83	0.98	18.12	33.17

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	34140	17.28	12.03	38.69	57.73
498400	KODEX 200타겟위클리커	17645	10.49	0.67	15.87	29.17
305720	KODEX 2차전지산업	16725	11.24	-4.15	4.68	23.93
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6650	13.68	-6.04	6.30	30.65
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4545	3.89	0.13	1.91	2.69
292150	TIGER 코리아TOP10	30635	10.20	2.31	22.63	39.32
091160	KODEX 반도체	100585	18.47	9.98	35.50	53.61
487240	KODEX AI전력핵심설비	30720	11.67	0.73	14.65	27.79
463250	TIGER K방산&우주	49290	17.64	16.53	34.65	61.08

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080G0	KODEX 방산TOP10	14575	15.22	20,506,612

※ 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 %
261060	TIGER 코스닥150IT	25995	24.38	10.63	32.90	48.20
471760	TIGER AI반도체핵심공정	20310	22.20	19.64	44.24	62.22
455850	SOL AI반도체소부장	27670	21.20	17.72	39.15	54.02
475310	SOL 반도체후공정	31050	21.15	22.54	45.99	62.31
476260	HANARO 반도체핵심공정주	12815	20.84	6.83	28.04	40.90

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	13165	-4.67	0.37	2.25	3.17
494420	PLUS 미국배당증가성장주데	9655	0.31	0.58	0.33	2.16
244660	KODEX 퀄리티Plus	9535	1.17	-6.66	-0.69	3.70
438900	HANARO Fn K-푸드	11455	2.46	-6.72	-3.64	-1.59
314700	HANARO 농업융복합산업	11220	3.55	-4.79	-0.27	5.01

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	862.31	0.59	2.60	13.56	22.89
Materials	639.46	-2.27	-3.45	3.22	9.67
Industrials	1454.59	-2.21	-1.68	3.93	8.73
Consumer Discr…	1864.51	0.26	0.69	-3.06	-2.20
Consumer Stapl…	951.08	-2.43	-3.31	3.04	10.14
Health Care	1791.80	-1.98	-2.02	-1.43	-1.21
Financials	850.41	-0.49	-1.77	-4.70	-6.92
Information Te…	5446.29	0.39	-0.27	-2.69	-4.23
Communication …	448.92	-0.65	-0.12	-1.14	-0.39
Utilities	474.38	-0.76	1.81	6.52	8.07
Real Estate	274.90	-1.01	0.22	4.41	7.73

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	452.97	-0.02	0.07	-2.68	-3.98
가치(IWD)	220.58	-1.20	-1.45	1.17	3.95
대형(IWL)	168.55	-0.47	-0.64	-1.34	-1.23
중소형(IWM)	256.78	-1.90	-2.27	-0.86	3.22
배당(VIG)	223.42	-0.93	-1.63	-0.40	1.28
저변동성(USMV)	96.85	-0.52	0.54	1.80	3.42
모멘텀(MTUM)	247.19	-1.40	-2.00	-2.56	-2.19
퀄리티(QUAL)	201.72	-0.85	-0.71	-0.09	1.27

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
The Trade Desk…	Communication Services	29.79	18.36	15.68	-8.67	-20.94
Expedia Group,…	Consumer Cyclical	251.54	13.44	15.58	-2.93	-11.10
Booking Holdin…	Consumer Cyclical	4613.28	8.46	9.43	-5.97	-13.34
LyondellBasell…	Basic Materials	65.89	6.41	14.55	30.39	48.43
Intuit Inc.	Technology	466.79	6.05	14.86	-13.64	-25.84

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Ciena Corporat…	Technology	299.06	-12.95	-5.56	13.49	21.54
Corning Incorp…	Technology	134.71	-6.99	-2.64	24.60	48.57
Southwest Airl…	Industrials	43.91	-6.87	-13.86	-3.49	6.32
Moderna, Inc.	Healthcare	53.83	-6.87	13.26	33.43	74.43
Comfort System…	Industrials	1346.25	-5.88	-1.04	17.37	34.14

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	143.32	-1.16	-2.04	-0.79	0.58
선진국(URTH)	187.14	-0.89	-1.50	-0.74	0.34
신흥국(EEM)	57.67	-2.35	-5.33	-0.61	2.53
미국(S&P500)	6830.71	-0.56	-0.72	-0.89	-0.40
미국(NASDAQ)	22748.99	-0.26	-0.23	-2.03	-2.09
미국(DJIA)	47954.74	-1.61	-2.80	-2.06	-0.88
유럽(Eurostoxx50)	5782.89	-1.50	-4.06	-2.36	-2.38
일본(Nikkei225)	55278.06	1.90	-2.43	3.51	6.65
중국(CSI300)	4647.69	0.98	-0.89	-0.44	-1.48
홍콩(HangSeng)	25321.34	0.28	-4.66	-4.01	-3.86
대만(TWSE)	33672.94	2.57	1.47	10.11	14.73
인도(Nifty 50)	24765.90	1.17	-2.88	-3.59	-5.28
한국(KOSPI)	5583.90	9.63	0.38	15.47	29.57

Fixed Income

US Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
Fed Funds (EFFR)	3.64	0.00	0.00	-24.00	-69.00	-69.00
US Treasury 2Y	3.51	4.00	-1.00	2.00	-8.00	-45.00
US TIPS 10Y	1.77	1.00	-13.00	-5.00	-2.00	-3.00
IG Corporate Yield	4.82	1.00	-5.00	1.00	3.00	-28.00
HY Corporate Yield	6.67	-8.00	4.00	10.00	19.00	-34.00
High Yield Spread	2.97	-11.00	16.00	9.00	14.00	-2.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	0.00	-6.00	3.00	-8.00	-6.00
US T-Bill 3M	3.59	-0.70	-0.20	-1.50	-32.20	-61.70
US Treasury 10Y	4.15	6.60	-12.80	0.70	6.00	-11.90
US Treasury 30Y	4.75	3.60	-15.40	-4.00	-2.30	19.50
2Y-10Y Spread	0.64	2.60	-11.80	-1.30	14.00	33.10

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	-25.00
국고채 3년	3.19	-3.40	0.00	19.50	72.90	62.40
국고채 10년	3.59	-4.30	-7.20	23.10	73.40	81.60
회사채 AA- 3년	3.78	-2.30	6.90	32.40	84.60	62.60
CD 91일	2.81	0.00	7.00	-2.00	24.00	-3.00

※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	99.04	0.27	1.36	1.00	0.63
USD/KRW	1481.03	-0.14	2.21	1.83	2.59
USD/EUR	1.16	-0.02	-1.59	-1.31	-1.19
USD/JPY	157.50	-0.18	1.41	0.94	0.49
USD/CNY	6.89	-0.13	-0.14	-1.04	-1.51

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	79.73	6.79	19.39	29.02	39.10
Brent(ICE EU)	84.55	3.87	17.37	27.47	39.18
Natural Gas(NY…	2.99	2.64	-2.42	-21.32	-17.25

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5084.40	-0.70	0.31	7.33	17.85
Copper(COMEX)	5.82	-0.51	-0.41	1.39	3.28
Silver(COMEX)	82.18	-0.55	-0.03	2.15	16.47

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	453.50	5.04	5.10	4.52	3.66
Wheat(CBOT)	585.25	3.26	5.05	9.99	15.55
Soybean(CBOT)	1179.00	2.12	3.57	8.61	14.52
Coffee(ICE US)	295.40	1.62	1.32	-12.07	-17.32
Sugar(ICE US)	13.71	-0.15	-2.83	-5.97	-6.10

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	71300.07	-1.94	5.18	-9.32	-19.65
Ethereum	2094.84	-1.49	5.53	-15.95	-30.18

자료: Yahoo Finance, SK증권