DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-09)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.003 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
-0.003	-0.000	0.001	-0.031	0.010	0.053

※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	5584.87	0.02	-0.17	14.88	29.59
KOSDAQ	1154.67	3.43	2.01	13.05	22.11
KOSPI200	828.83	-0.29	0.06	17.06	32.79

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	34220	0.23	11.02	37.54	58.10
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7000	5.26	-1.20	11.49	37.52
455850	SOL AI반도체소부장	28560	3.22	19.74	42.32	58.98
498400	KODEX 200타겟위클리커	17625	-0.11	-0.03	15.12	29.03
463250	TIGER K방산&우주	51490	4.46	20.05	39.11	68.27
305720	KODEX 2차전지산업	17215	2.93	-1.54	7.55	27.57
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4515	-0.66	-0.61	1.18	2.01
091160	KODEX 반도체	102335	1.74	10.62	36.49	56.28

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080G0	KODEX 방산TOP10	15295	4.94	18,814,507
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	13230	2.44	7,344,480

※ 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 %
457990	PLUS 태양광&ESS	32235	10.19	7.11	29.23	52.34
385510	KODEX 신재생에너지액티브	40590	8.88	6.57	21.99	40.35
381570	HANARO Fn친환경에너지	11445	8.23	6.03	22.58	46.08
377990	TIGER Fn신재생에너지	24670	7.07	5.52	21.98	39.34
422420	RISE 2차전지액티브	8885	5.90	1.66	13.61	34.83

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	12485	-5.17	-5.07	-3.16	-2.16
337120	KODEX 멀티팩터	27000	-3.19	-3.02	12.76	27.96
140710	KODEX 운송	6910	-1.50	-3.42	5.95	18.02
385590	ACE ESG액티브	17585	-1.43	-1.70	13.91	26.97
484880	SOL 금융지주플러스고배당	21000	-1.41	-5.51	9.98	22.48

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	863.42	0.13	2.38	13.27	23.05
Materials	627.35	-1.89	-5.23	1.04	7.59
Industrials	1436.29	-1.26	-2.96	2.46	7.36
Consumer Discr…	1828.00	-1.96	-1.13	-4.89	-4.12
Consumer Stapl…	953.87	0.29	-2.93	3.17	10.46
Health Care	1777.87	-0.78	-2.71	-2.21	-1.98
Financials	838.73	-1.37	-2.86	-5.92	-8.19
Information Te…	5346.05	-1.84	-2.15	-4.34	-5.99
Communication …	444.17	-1.06	-0.95	-2.16	-1.44
Utilities	472.57	-0.38	1.04	5.95	7.66
Real Estate	271.94	-1.08	-1.05	3.19	6.57

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	447.06	-1.32	-1.25	-3.85	-5.24
가치(IWD)	217.72	-1.30	-2.66	-0.21	2.60
대형(IWL)	166.54	-1.22	-1.79	-2.47	-2.41
중소형(IWM)	250.89	-2.29	-4.42	-3.13	0.85
배당(VIG)	221.52	-0.86	-2.40	-1.26	0.42
저변동성(USMV)	96.65	-0.17	0.24	1.54	3.20
모멘텀(MTUM)	241.48	-2.25	-4.21	-4.74	-4.45
퀄리티(QUAL)	198.66	-1.50	-2.20	-1.60	-0.27

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
CF Industries …	Basic Materials	115.78	4.51	16.82	30.46	44.49
Boeing Company…	Industrials	231.11	4.08	-1.30	0.54	1.47
Kroger Company…	Consumer Defensive	74.11	3.55	7.36	14.45	17.71
ServiceNow, In…	Technology	124.34	3.29	15.48	-4.81	-15.67
Broadridge Fin…	Technology	196.88	3.14	9.28	-3.89	-10.70

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Teradyne, Inc.	Technology	273.05	-10.65	-13.05	8.69	31.55
Corning Incorp…	Technology	123.29	-8.50	-11.23	13.43	35.98
Old Dominion F…	Industrials	193.97	-7.93	-2.29	8.54	21.85
BlackRock, Inc.	Financial Services	955.45	-7.69	-10.43	-12.07	-11.94
Lam Research C…	Technology	199.33	-7.15	-14.10	-5.13	7.71

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	141.68	-1.14	-3.11	-1.92	-0.57
선진국(URTH)	184.98	-1.13	-2.60	-1.88	-0.82
신흥국(EEM)	57.32	-0.54	-5.80	-1.28	1.92
미국(S&P500)	6740.02	-1.33	-2.00	-2.18	-1.73
미국(NASDAQ)	22387.68	-1.59	-1.78	-3.51	-3.65
미국(DJIA)	47501.55	-0.95	-3.58	-2.98	-1.82
유럽(Eurostoxx50)	5719.90	-1.09	-4.88	-3.42	-3.44
일본(Nikkei225)	55620.84	0.62	-1.94	4.01	7.31
중국(CSI300)	4660.44	0.27	-0.52	-0.20	-1.21
홍콩(HangSeng)	25757.29	1.72	-2.82	-2.35	-2.21
대만(TWSE)	33599.54	-0.22	1.05	9.51	14.48
인도(Nifty 50)	24450.45	-1.27	-3.90	-4.72	-6.49
한국(KOSPI)	5584.87	0.02	-0.17	14.88	29.59

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	3.57	3.00	0.00	1.00	6.00	-42.00
US TIPS 10Y	1.82	2.00	-10.00	-6.00	9.00	-12.00
IG Corporate Yield	4.86	4.00	0.00	2.00	7.00	-28.00
HY Corporate Yield	6.75	8.00	9.00	18.00	27.00	-23.00
High Yield Spread	3.00	3.00	15.00	15.00	17.00	12.00
10Y Breakeven Inflation	2.35	4.00	0.00	9.00	-2.00	1.00
US T-Bill 3M	3.57	-1.80	-2.50	-3.30	-34.00	-62.70
US Treasury 10Y	4.13	-1.30	-14.20	-0.60	4.70	-15.30
US Treasury 30Y	4.76	0.30	-16.00	-3.70	-2.00	17.50
2Y-10Y Spread	0.56	-4.30	-14.20	-1.60	-1.30	26.70

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	-25.00
국고채 3년	3.23	3.80	1.50	23.30	76.70	63.30
국고채 10년	3.62	2.70	-9.60	25.80	76.10	81.00
회사채 AA- 3년	3.81	3.80	8.40	36.20	88.40	64.10
CD 91일	2.81	0.00	6.00	-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	98.86	-0.47	1.10	0.81	0.44
USD/KRW	1481.09	0.11	2.19	1.83	2.59
USD/EUR	1.16	-0.45	-1.89	-1.76	-1.66
USD/JPY	158.07	0.34	1.74	1.28	0.85
USD/CNY	6.90	-0.01	-0.00	-0.88	-1.43

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	90.90	12.21	33.23	45.79	58.58
Brent(ICE EU)	92.69	8.52	26.39	38.66	52.58
Natural Gas(NY…	3.19	6.09	4.37	-15.64	-11.94

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5158.70	1.84	1.50	8.54	19.57
Copper(COMEX)	5.81	0.94	-0.66	0.97	2.96
Silver(COMEX)	84.31	3.21	2.11	4.24	19.50

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	460.50	4.30	6.55	6.09	5.26
Wheat(CBOT)	616.75	5.83	9.92	15.62	21.77
Soybean(CBOT)	1200.75	3.18	5.14	10.46	16.63
Coffee(ICE US)	297.60	1.57	2.31	-10.97	-16.71
Sugar(ICE US)	14.09	2.70	-0.08	-3.28	-3.49

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	67230.42	-0.06	-0.44	-13.08	-24.23
Ethereum	1959.50	-0.51	-0.87	-19.33	-34.69

자료: Yahoo Finance, SK증권