DAILY RECAP

▶ Summary (2026-03-11)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.050 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
0.050	0.016	-0.006	-0.031	0.008	0.054

※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	5532.59	5.35	-1.21	12.78	28.38
KOSDAQ	1137.68	3.21	0.75	10.69	20.32
KOSPI200	823.02	6.15	-0.81	15.03	31.86

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	33570	6.98	7.90	32.40	55.09
498400	KODEX 200타겟위클리커	17500	5.96	-0.87	13.27	28.11
305720	KODEX 2차전지산업	16755	1.95	-3.72	4.41	24.16
091160	KODEX 반도체	99220	6.40	6.40	30.05	51.53
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6800	1.49	-3.37	7.70	33.60
455850	SOL AI반도체소부장	27190	3.29	12.31	33.36	51.35
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4490	0.56	-1.15	0.57	1.45
395270	HANARO Fn K-반도체	33900	7.08	6.21	30.20	51.44

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080G0	KODEX 방산TOP10	14505	-1.23	9,559,549
0091P0	TIGER 코리아원자력	19470	7.48	5,615,585

※ 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 %
367760	RISE 네트워크인프라	32615	9.24	5.02	22.95	37.50
487750	BNK 온디바이스AI	21085	8.41	2.39	21.73	38.22
363580	KODEX 200IT TR	32420	8.25	1.57	20.58	38.93
315960	RISE 대형고배당10TR	56855	8.19	-0.69	18.30	38.54
289250	TIGER MSCI KORE	24655	7.88	-0.57	15.94	32.55

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6415	-3.97	2.50	-1.47	-3.24
449450	PLUS K방산	76350	-1.81	9.20	20.90	44.06
463250	TIGER K방산&우주	49225	-1.25	13.18	30.36	60.87
445150	KODEX 친환경조선해운액티	34330	-0.78	-0.82	4.05	18.22
466920	SOL 조선TOP3플러스	35835	-0.26	-1.49	-0.30	11.58

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	848.40	-1.32	0.23	10.54	20.91
Materials	628.39	-0.14	-4.76	0.78	7.77
Industrials	1436.01	-0.57	-2.79	2.12	7.34
Consumer Discr…	1829.99	-0.01	-0.82	-4.64	-4.01
Consumer Stapl…	958.01	-0.13	-2.28	3.27	10.94
Health Care	1781.59	-0.73	-2.29	-2.07	-1.77
Financials	829.74	-0.55	-3.16	-6.73	-9.18
Information Te…	5446.56	0.08	-0.11	-2.31	-4.22
Communication …	450.38	0.26	0.64	-0.76	-0.06
Utilities	470.38	-0.65	-0.09	5.14	7.16
Real Estate	272.13	-0.16	-1.18	3.04	6.65

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	451.37	-0.24	-0.14	-2.73	-4.32
가치(IWD)	218.07	-0.30	-2.23	-0.18	2.77
대형(IWL)	167.80	-0.10	-0.83	-1.67	-1.67
중소형(IWM)	253.36	-0.10	-3.02	-2.19	1.84
배당(VIG)	221.66	-0.49	-2.02	-1.20	0.48
저변동성(USMV)	95.92	-0.75	-0.55	0.68	2.42
모멘텀(MTUM)	248.28	0.42	-1.22	-1.96	-1.76
퀄리티(QUAL)	200.28	-0.21	-1.24	-0.83	0.55

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Vertex Pharmac…	Healthcare	499.17	8.31	4.88	7.14	10.40
Ciena Corporat…	Technology	337.36	5.91	4.29	25.63	37.10
Corning Incorp…	Technology	136.22	5.56	-2.33	23.81	50.24
Sandisk Corpor…	Technology	618.89	5.12	1.72	34.62	124.85
Micron Technol…	Technology	403.11	3.54	-0.76	12.16	27.80

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Centene Corpor…	Healthcare	36.40	-15.97	-14.08	-14.45	-12.88
Fair Isaac Cor…	Technology	1285.15	-10.83	-6.37	-16.10	-21.79
Applovin Corpo…	Communication Services	477.39	-7.70	9.32	-12.64	-22.79
Paramount Skyd…	Communication Services	10.33	-7.69	-8.14	-13.72	-21.62
West Pharmaceu…	Healthcare	233.83	-5.74	-5.04	-8.75	-15.40

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	143.05	0.00	-1.92	-0.99	0.39
선진국(URTH)	186.36	-0.05	-1.63	-1.14	-0.08
신흥국(EEM)	58.68	0.39	-3.29	0.84	4.34
미국(S&P500)	6781.48	-0.21	-1.16	-1.54	-1.12
미국(NASDAQ)	22697.10	0.01	-0.23	-2.05	-2.32
미국(DJIA)	47706.51	-0.07	-2.69	-2.55	-1.40
유럽(Eurostoxx50)	5837.17	2.67	-2.46	-1.46	-1.46
일본(Nikkei225)	54248.39	2.88	-4.27	1.25	4.66
중국(CSI300)	4674.76	1.28	-0.19	0.03	-0.91
홍콩(HangSeng)	25959.90	2.17	-1.62	-1.55	-1.44
대만(TWSE)	32771.87	2.06	-1.37	6.24	11.66
인도(Nifty 50)	24261.60	0.97	-4.02	-5.25	-7.21
한국(KOSPI)	5532.59	5.35	-1.21	12.78	28.38

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	3.56	0.00	6.00	-5.00	2.00	-43.00
US TIPS 10Y	1.78	-2.00	-10.00	-14.00	9.00	-21.00
IG Corporate Yield	4.86	-3.00	4.00	-2.00	10.00	-32.00
HY Corporate Yield	6.90	3.00	29.00	22.00	42.00	-19.00
High Yield Spread	3.19	6.00	32.00	30.00	35.00	22.00
10Y Breakeven Inflation	2.33	-1.00	-1.00	8.00	-1.00	2.00
US T-Bill 3M	3.60	0.20	0.50	0.20	-33.30	-59.00
US Treasury 10Y	4.14	0.00	-7.00	-2.80	12.50	-7.70
US Treasury 30Y	4.77	3.10	-8.40	-2.60	12.00	23.20
2Y-10Y Spread	0.58	0.00	-13.00	2.20	10.50	35.30

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	3.28	-13.70	5.00	18.80	86.30	68.70
국고채 10년	3.63	-11.00	-8.10	25.80	81.60	82.80
회사채 AA- 3년	3.87	-12.30	11.90	30.00	98.20	70.80
CD 91일	2.83	-1.00	5.00	0.00	29.00	-1.00

※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	98.93	-0.25	0.99	0.89	0.52
USD/KRW	1473.25	-0.72	1.59	1.28	2.05
USD/EUR	1.16	0.77	-1.27	-1.26	-1.18
USD/JPY	158.05	-0.24	1.66	1.23	0.84
USD/CNY	6.88	-0.30	-0.26	-1.13	-1.72

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	86.50	-8.73	22.01	36.38	50.91
Brent(ICE EU)	87.68	-11.40	15.65	29.16	44.33
Natural Gas(NY…	3.05	-2.12	0.68	-18.05	-15.59

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5202.40	2.18	2.08	8.74	20.58
Copper(COMEX)	5.92	1.98	1.32	2.52	4.88
Silver(COMEX)	88.82	5.70	6.70	8.66	25.89

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	453.75	3.71	4.76	4.52	3.71
Wheat(CBOT)	593.00	-0.84	4.50	10.76	17.08
Soybean(CBOT)	1203.25	1.93	4.71	10.37	16.88
Coffee(ICE US)	294.70	-2.34	1.31	-10.95	-17.52
Sugar(ICE US)	14.32	-1.85	1.38	-1.63	-1.92

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	70290.34	2.76	3.82	-8.25	-20.78
Ethereum	2043.36	2.53	3.19	-14.60	-31.90

자료: Yahoo Finance, SK증권