

DAILY RECAP



Summary (2026-03-03)

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.031 하락하여 오전 증 지수 상방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험 선호도를 종합했을 때 금일 외국인 수급은 차이 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.

SK증권 Quant 황지우

Pre-market volatility

전일 대비	vs 1주 평균	vs 1개월 평균	vs 3개월 평균	vs 6개월 평균	vs 1년 평균
-0.031	0.010	0.005	-0.021	0.002	0.053

※ 본 지표는 전일 글로벌 시장 변화가 금일 코스피 변동성에 미치는 잠재적 영향을 과거 데이터 기반으로 추정합니다.
※ 모델 관련 보고서 참고 링크: <https://bully.kr/6Mo7JaP>

KR Market

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
KOSPI	6244.13	-1.00	13.12	31.22	44.89
KOSDAQ	1192.78	0.39	4.65	18.12	26.14
KOSPI200	933.34	-1.13	14.47	35.11	49.53

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	36090	2.27	20.48	50.88	66.74
498400	KODEX 200터켓쿼터클러	19790	-0.75	13.77	32.04	44.88
305720	KODEX 2차전지산업	19430	1.49	9.96	22.07	43.98
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7850	1.03	8.95	26.39	54.22
487240	KODEX AI전력핵심설비	34820	-1.98	15.26	31.77	44.84
292150	TIGER 코리아TOP10	34490	-0.83	16.41	41.26	56.85
395270	HANARO Fn K-반도체	36815	-0.45	20.43	49.29	64.46
091160	KODEX 반도체	105400	0.20	16.99	45.73	60.97
455850	SOL AI반도체소부장	27015	4.95	16.89	38.63	50.38

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091PO	TIGER 코리아원자력	20145	1.79	7,781,199

※ 거래대금 상위이나 최근 상승 등의 이유로 시계열 데이터가 부재한 ETF

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
471990	KODEX AI반도체핵심장비	26160	6.58	25.20	46.56	61.28
471760	TIGER AI반도체핵심공정	19910	5.37	19.63	44.94	59.03
475310	SOL 반도체후공정	30100	5.06	22.07	44.86	57.34
455850	SOL AI반도체소부장	27015	4.95	16.89	38.63	50.38
138540	TIGER 현대차그룹플러스	73900	4.76	23.87	45.33	74.11

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
140700	KODEX 보험	16445	-4.97	6.85	21.16	28.63
498860	RISE 코리아금융고배당	21430	-4.14	7.51	28.45	43.38
498410	KODEX 금융고배당TOP1	13745	-3.81	1.17	11.66	19.98
227560	TIGER 200 생활소비재	14180	-3.64	0.59	9.07	18.02
466940	TIGER 은행고배당플러스T	27330	-3.27	4.18	19.06	29.61

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level 1 Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	871.79	1.95	5.00	16.05	24.24
Materials	672.83	-0.42	1.79	9.43	15.39
Industrials	1512.33	0.98	2.72	8.72	13.04
Consumer Discr...	1834.67	-1.08	-1.77	-4.81	-3.77
Consumer Stapl...	989.51	-1.35	0.74	7.76	14.59
Health Care	1845.50	-1.01	0.96	1.58	1.75
Financials	851.30	-0.29	-2.39	-4.81	-6.82
Information Te...	5414.06	0.91	-1.10	-3.56	-4.80
Communication ...	450.47	-0.68	-0.53	-0.88	-0.04
Utilities	479.18	-0.77	4.17	8.03	9.16
Real Estate	279.00	0.23	2.65	6.34	9.34

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	451.47	0.28	-0.55	-3.28	-4.30
가치(IWD)	225.15	-0.16	0.59	3.54	6.10
대형(IWL)	169.39	0.01	-0.41	-0.92	-0.74
중소형(IWM)	263.81	0.92	0.26	2.02	6.04
배당(VIG)	227.15	-0.24	-0.08	1.33	2.97
저변동성(USMV)	97.68	-0.13	1.72	2.81	4.30
모멘텀(MTUM)	253.70	0.29	0.24	-0.06	0.38
퀄리티(QUAL)	204.47	-0.19	0.66	1.35	2.65

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Northrop Grumm...	Industrials	768.02	6.02	8.24	19.93	31.14
Marathon Petro...	Energy	209.82	5.86	5.87	14.49	27.06
Palantir Techno...	Technology	145.17	5.82	5.96	-11.48	-13.52
Enphase Energy...	Technology	44.71	5.77	-2.78	16.90	32.47
Axon Enterpris...	Industrials	572.02	5.46	25.38	5.55	1.52

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
The AES Corpor...	Utilities	14.21	-17.77	-11.64	-4.09	-4.12
Norwegian Crui...	Consumer Cyclical	22.18	-10.53	-5.07	-0.77	-2.63
Estee Lauder C...	Consumer Defensive	100.19	-8.48	-8.24	-8.48	-6.15
Elevance Healt...	Healthcare	294.07	-8.10	-11.84	-15.39	-16.99
TE Connectiv...	Technology	211.98	-7.89	-7.19	-8.07	-9.11

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	146.55	-0.56	-0.00	1.52	2.85
선진국(URTH)	190.18	-0.35	-0.06	0.91	1.97
신흥국(EEM)	61.50	-1.73	0.76	6.36	9.35
미국(S&P500)	6881.62	0.04	-0.17	-0.16	0.34
미국(NASDAQ)	22748.86	0.36	-0.60	-2.21	-2.09
미국(DJIA)	48904.78	-0.15	-1.17	-0.07	1.08
유럽(Eurostoxx50)	5986.93	-2.47	-1.05	1.20	1.07
일본(Nikkei225)	58057.24	-1.35	2.94	9.31	12.01
중국(CSI300)	4728.67	0.38	0.59	1.40	0.23
홍콩(HangSeng)	26059.85	-2.14	-2.94	-1.31	-1.06
대만(TWSE)	35095.09	-0.90	6.56	15.96	19.58
인도(Nifty 50)	24865.70	-1.24	-2.92	-3.38	-4.90
한국(KOSPI)	6244.13	-1.00	13.12	31.22	44.89

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	3.38	-4.00	-18.00	-9.00	-21.00	-69.00
US TIPS 10Y	1.72	-2.00	-18.00	-7.00	-10.00	-20.00
IG Corporate Yield	4.73	2.00	-9.00	-5.00	-19.00	-36.00
HY Corporate Yield	6.66	5.00	14.00	10.00	8.00	-26.00
High Yield Spread	3.12	2.00	35.00	20.00	28.00	25.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	4.00	-7.00	5.00	-11.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.59	1.20	1.80	-8.20	-42.80	-60.30
US Treasury 10Y	4.05	8.60	-19.30	-3.80	-16.30	-18.30
US Treasury 30Y	4.70	6.50	-17.40	-4.30	-19.40	18.20
2Y-10Y Spread	0.67	12.60	-1.30	5.20	4.70	50.70

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	3.04	-2.10	-2.60	5.00	61.50	44.90
국고채 10년	3.45	-2.40	-7.20	10.20	63.10	69.20
회사채 AA- 3년	3.64	-1.60	4.80	20.90	73.10	46.50
CD 91일	2.81	0.00	11.00	1.00	28.00	-4.00

※ 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	98.56	0.97	1.07	0.51	0.14
USD/KRW	1453.25	1.46	0.44	-0.09	0.67
USD/EUR	1.17	-0.92	-1.06	-0.58	-0.48
USD/JPY	157.39	0.98	1.46	0.93	0.42
USD/CNY	6.88	0.59	-0.39	-1.30	-1.64

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	71.03	5.98	9.53	16.53	23.92
Brent(ICE EU)	77.66	7.15	11.23	18.81	27.84
Natural Gas(NY...	2.98	4.23	-4.54	-23.82	-17.63

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5335.90	2.02	6.14	13.70	23.68
Copper(COMEX)	5.96	-0.67	1.71	4.24	5.75
Silver(COMEX)	89.61	-3.31	9.17	13.10	27.01

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	445.25	1.48	3.47	2.63	1.77
Wheat(CBOT)	576.25	-2.54	4.74	8.66	13.77
Soybean(CBOT)	1161.75	0.39	3.23	7.25	12.85
Coffee(ICE US)	284.00	-0.21	-3.93	-16.88	-20.51
Sugar(ICE US)	13.90	-2.80	-	-	-2.80

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	69353.79	5.50	3.04	-12.90	-21.84
Ethereum	2050.82	5.76	3.95	-19.45	-31.65

자료: Yahoo Finance, SK증권