

DAILY RECAP



Summary (2026-03-04)

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.013 상승하여 오전 중 지수 하방 요인으로 작용할 확률이 상대적으로 높습니다.
2. 환율과 금리, 글로벌 위험선호도를 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
0.013	0.009	0.008	-0.024	0.002	0.053

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

KR Market

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
KOSPI	5791.91	-7.24	4.34	20.93	34.39
KOSDAQ	1137.70	-4.62	-0.20	12.25	20.32
KOSPI200	859.40	-7.92	4.75	23.49	37.69

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	32885	-8.88	8.82	36.06	51.93
498400	KODEX 200타켓쿼터클러	18300	-7.53	4.60	21.30	33.97
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7030	-10.45	-2.14	12.71	38.11
305720	KODEX 2차전지산업	17660	-9.11	0.12	10.65	30.86
463250	TIGER K방산&우주	50710	16.60	20.92	41.01	65.72
091160	KODEX 반도체	97715	-7.29	7.58	33.81	49.23
292150	TIGER 코리아TOP10	31470	-8.76	5.51	27.76	43.12
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4545	-1.84	0.06	1.99	2.69

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080GO	KODEX 방산TOP10	15365	13.31	35,139,951
0148JO	TIGER 코리아우무노이드로봇산업	13715	-7.39	10,103,616

※ 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 %
463250	TIGER K방산&우주	50710	16.60	20.92	41.01	65.72
449450	PLUS K방산	80350	13.54	17.74	32.07	51.60
490480	SOL K방산	40030	12.10	15.76	31.32	51.57
421320	PLUS 우주항공&UAM	45170	3.55	4.50	33.62	58.02
360150	KODEX 코스닥150롱코스	6065	2.71	-5.19	-8.10	-8.52

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
139260	TIGER 200 IT	83550	-11.32	5.35	27.28	41.65
363580	KODEX 200IT TR	33200	-11.02	5.71	27.70	42.28
488200	KIWOOM K-2차전지복합	14010	-10.74	3.04	16.46	38.30
466930	SOL 자동차TOP3플러스	23480	-10.72	9.17	28.81	53.06
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7030	-10.45	-2.14	12.71	38.11

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level 1 Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	863.59	-0.94	3.43	14.54	23.07
Materials	654.73	-2.69	-1.14	6.21	12.28
Industrials	1482.62	-1.96	0.48	6.35	10.82
Consumer Discr...	1818.86	-0.86	-2.21	-5.54	-4.60
Consumer Stapl...	979.92	-0.97	-0.41	6.52	13.48
Health Care	1824.49	-1.14	-0.22	0.41	0.59
Financials	849.75	-0.18	-2.30	-4.91	-6.99
Information Te...	5357.07	-1.05	-1.91	-4.47	-5.80
Communication ...	449.24	-0.27	-0.47	-1.13	-0.32
Utilities	476.08	-0.65	3.01	7.20	8.46
Real Estate	277.35	-0.59	1.70	5.58	8.69

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	448.68	-0.62	-0.96	-3.78	-4.89
가치(IWD)	222.27	-1.28	-0.71	2.12	4.75
대형(IWL)	167.92	-0.87	-1.12	-1.75	-1.60
중소형(IWM)	259.24	-1.73	-1.42	0.19	4.20
배당(VIG)	225.12	-0.89	-0.94	0.40	2.05
저변동성(USMV)	97.18	-0.52	1.10	2.23	3.76
모멘텀(MTUM)	247.19	-2.57	-2.12	-2.60	-2.19
퀄리티(QUAL)	202.29	-1.07	-0.38	0.25	1.56

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Workday, Inc.	Technology	143.61	7.16	-0.97	-22.56	-30.22
Best Buy Co., ...	Consumer Cyclical	65.91	7.01	0.67	-3.31	-4.73
Target Corpora...	Consumer Defensive	120.84	6.78	5.26	14.14	20.23
Akamai Technol...	Technology	102.08	4.55	2.64	9.42	19.95
Palo Alto Netw...	Technology	156.09	3.96	-0.08	-11.65	-12.98

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Newmont Corpor...	Basic Materials	118.37	-8.05	-3.01	5.29	16.94
Micron Technol...	Technology	379.68	-7.99	-6.52	9.36	20.37
NRG Energy, In...	Utilities	162.04	-7.71	-3.02	1.19	-2.48
Albemarle Corp...	Basic Materials	164.67	-7.58	-4.20	2.42	14.41
Western Digita...	Technology	250.61	-7.21	-9.95	9.93	33.52

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACW1)	143.68	-1.96	-1.87	-0.49	0.84
선진국(URTH)	187.18	-1.58	-1.54	-0.69	0.36
신흥국(EEM)	58.46	-4.94	-4.16	0.98	3.95
미국(S&P500)	6816.63	-0.94	-1.00	-1.10	-0.61
미국(NASDAQ)	22516.69	-1.02	-1.38	-3.14	-3.09
미국(DJIA)	48501.27	-0.83	-1.89	-0.91	0.25
유럽(Eurostoxx50)	5771.73	-3.59	-4.43	-2.47	-2.57
일본(Nikkei225)	56279.05	-3.06	-0.48	5.73	8.58
중국(CSI300)	4655.90	-1.54	-0.90	-0.21	-1.31
홍콩(HangSeng)	25768.08	-1.12	-3.63	-2.40	-2.17
대만(TWSE)	34323.65	-2.20	3.82	12.95	16.95
인도(Nifty 50)	24865.70	-1.24	-2.92	-3.38	-4.90
한국(KOSPI)	5791.91	-7.24	4.34	20.93	34.39

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	4.80	7.00	-5.00	-1.00	-12.00	-29.00
HY Corporate Yield	6.68	2.00	2.00	7.00	5.00	-24.00
High Yield Spread	3.03	-9.00	15.00	11.00	15.00	16.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	4.00	-7.00	5.00	-11.00	-9.00
US T-Bill 3M	3.60	0.50	2.30	-4.00	-40.30	-59.80
US Treasury 10Y	4.06	0.80	-18.50	-0.10	-12.00	-12.40
US Treasury 30Y	4.70	0.40	-17.00	-2.30	-17.20	23.80
2Y-10Y Spread	0.68	4.80	-0.50	8.90	9.00	56.60

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	3.18	13.90	4.20	13.90	70.80	61.40
국고채 10년	3.59	14.80	-1.30	22.60	71.10	88.80
회사채 AA- 3년	3.77	13.20	11.10	28.50	82.60	61.20
CD 91일	2.81	0.00	8.00	0.00	25.00	-8.00

※ 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	99.00	0.64	1.47	0.96	0.59
USD/KRW	1480.12	2.89	2.25	1.76	2.53
USD/EUR	1.16	-1.19	-1.65	-1.23	-1.11
USD/JPY	157.66	0.66	1.59	1.08	0.60
USD/CNY	6.90	0.60	-0.09	-1.00	-1.39

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	73.74	3.52	12.69	20.48	28.65
Brent(ICE EU)	80.75	3.87	14.46	22.97	32.92
Natural Gas(NY...	3.05	3.11	-1.91	-21.32	-15.64

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5106.40	-3.55	1.13	8.48	18.36
Copper(COMEX)	5.84	-0.94	-0.40	1.91	3.53
Silver(COMEX)	82.70	-6.33	0.47	3.87	17.21

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	446.25	3.00	3.60	2.85	2.00
Wheat(CBOT)	574.75	0.04	4.04	8.26	13.47
Soybean(CBOT)	1171.50	1.87	3.64	8.08	13.79
Coffee(ICE US)	282.50	-2.03	-3.69	-16.85	-20.93
Sugar(ICE US)	13.95	0.29	-1.71	-4.57	-4.45

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	68197.14	-0.84	1.28	-13.96	-23.14
Ethereum	1975.75	-2.54	0.12	-21.80	-34.15

자료: Yahoo Finance, SK증권