

DAILY RECAP



Summary (2026-03-05)

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.027 하락하여 오전 증 지수 상방 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
-0.027	-0.007	0.003	-0.021	0.003	0.056

※ 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	5093.54	-12.06	-8.13	5.91	18.19
KOSDAQ	978.44	-14.00	-13.47	-3.55	3.48
KOSPI200	756.79	-11.94	-7.71	8.22	21.25

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	29110	-11.48	-3.79	19.53	34.49
498400	KODEX 200타켓위클리	15970	-12.73	-8.59	5.45	16.91
305720	KODEX 2차전지산업	15035	-14.86	-13.99	-5.77	11.41
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5850	-16.79	-17.60	-6.25	14.93
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4375	-3.74	-3.55	-1.83	-1.15
091160	KODEX 반도체	84900	-13.11	-6.53	15.50	29.66
395160	KODEX AI반도체	23750	-12.56	-6.17	12.98	24.61
292150	TIGER 코리아TOP10	27800	-11.66	-6.79	12.15	26.43
455850	SOL AI반도체소부장	22830	-10.94	-2.04	15.81	27.08

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0080GO	KODEX 방산TOP10	12650	-17.67	31,035,339

※ 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 %
360140	KODEX 200로코스닥15	13810	2.33	5.84	7.52	8.23
494420	PLUS 미국배당증가성장주데	9625	-0.05	0.38	0.04	1.84
360150	KODEX 코스닥150로코스	5950	-1.90	-6.08	-9.45	-10.26
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4375	-3.74	-3.55	-1.83	-1.15
244660	KODEX 쉐리티Plus	9425	-6.36	-7.85	-1.79	2.50

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
463250	TIGER K방산&우주	41900	-17.37	-0.07	15.67	36.93
449450	PLUS K방산	66430	-17.32	-2.45	8.61	25.34
469070	RISE AI&로봇	13580	-16.97	-20.85	-11.37	-0.22
462010	TIGER 2차전지소재Fn	5850	-16.79	-17.60	-6.25	14.93
488200	KIWOOM K-2차전지복미	11675	-16.67	-13.59	-3.04	15.25

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level 1 Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	857.27	-0.73	2.30	13.30	22.17
Materials	654.30	-0.07	-1.31	5.86	12.21
Industrials	1487.40	0.32	0.61	6.47	11.18
Consumer Discr...	1859.69	2.24	0.25	-3.36	-2.45
Consumer Stapl...	974.74	-0.53	-1.01	5.76	12.88
Health Care	1827.98	0.19	-0.12	0.57	0.78
Financials	854.64	0.58	-1.55	-4.30	-6.45
Information Te...	5425.28	1.27	-0.60	-3.16	-4.60
Communication ...	451.85	0.58	0.35	-0.54	0.26
Utilities	478.03	0.41	3.00	7.49	8.90
Real Estate	277.71	0.13	1.47	5.59	8.83

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	453.01	0.97	0.07	-2.77	-3.97
가치(IWD)	223.23	0.43	-0.31	2.46	5.20
대형(IWL)	169.48	0.93	-0.15	-0.82	-0.69
중소형(IWM)	261.74	0.96	-0.45	1.09	5.21
배당(VIG)	225.54	0.16	-0.77	0.55	2.24
저변동성(USMV)	97.37	0.16	1.17	2.39	3.97
모멘텀(MTUM)	250.78	1.53	-0.58	-1.18	-0.77
퀄리티(QUAL)	203.40	0.55	0.12	0.76	2.11

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Moderna, Inc.	Healthcare	57.80	15.99	23.05	44.83	87.30
Coinbase Globa...	Financial Services	208.93	14.57	23.80	-2.78	-11.67
Applavin Corpo...	Communication Services	482.81	10.01	15.53	-13.76	-21.92
Arista Network...	Technology	134.84	8.21	0.15	1.37	0.92
Robinhood Mark...	Financial Services	82.21	8.07	6.02	-19.82	-28.64

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Brown Forman I...	Consumer Defensive	26.27	-6.61	-10.25	-6.77	0.50
Royal Caribbea...	Consumer Cyclical	287.22	-4.68	-10.29	-4.06	1.40
Rockwell Autom...	Industrials	383.10	-3.86	-4.76	-5.76	-3.88
The Campbell's...	Consumer Defensive	25.09	-3.69	-9.28	-9.08	-9.46
Rollins, Inc.	Consumer Cyclical	58.00	-3.61	-5.44	-5.23	-1.71

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	145.00	0.92	-0.95	0.39	1.76
선진국(URTH)	188.74	0.82	-0.71	0.12	1.20
신흥국(EEM)	59.07	1.11	-3.11	1.89	5.03
미국(S&P500)	6869.50	0.78	-0.19	-0.33	0.16
미국(NASDAQ)	22807.48	1.29	-0.01	-1.84	-1.84
미국(DJIA)	48739.41	0.49	-1.36	-0.46	0.74
유럽(Eurostoxx50)	5870.92	1.72	-2.71	-0.84	-0.89
일본(Nikkei225)	54245.54	-3.61	-4.21	1.75	4.65
중국(CSI300)	4602.62	-1.14	-1.93	-1.38	-2.44
홍콩(HangSeng)	25249.48	-2.01	-5.19	-4.31	-4.13
대만(TWSE)	32828.88	-4.35	-0.84	7.71	11.85
인도(Nifty 50)	24480.50	-1.55	-4.19	-4.78	-6.37
한국(KOSPI)	5093.54	-12.06	-8.13	5.91	18.19

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	3.47	9.00	-5.00	-4.00	-14.00	-52.00
US TIPS 10Y	1.76	4.00	-14.00	-9.00	-6.00	-10.00
IG Corporate Yield	4.81	1.00	-4.00	2.00	-5.00	-25.00
HY Corporate Yield	6.75	7.00	9.00	21.00	21.00	-20.00
High Yield Spread	3.08	5.00	20.00	19.00	24.00	14.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	0.00	-7.00	5.00	-9.00	-7.00
US T-Bill 3M	3.60	0.00	1.70	-1.70	-31.50	-60.00
US Treasury 10Y	4.08	2.40	-19.50	-2.80	-0.60	-13.00
US Treasury 30Y	4.72	1.40	-19.30	-4.90	-5.90	19.90
2Y-10Y Spread	0.61	-6.60	-14.50	1.20	13.40	39.00

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	3.22	4.30	7.10	19.80	76.30	68.20
국고채 10년	3.63	3.80	2.90	25.60	77.70	92.90
회사채 AA- 3년	3.80	3.10	13.20	32.60	86.90	66.80
CD 91일	2.81	0.00	7.00	0.00	24.00	-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	98.76	-0.30	1.14	0.72	0.34
USD/KRW	1462.18	0.68	1.06	0.57	1.28
USD/EUR	1.16	-0.48	-1.42	-1.05	-0.93
USD/JPY	157.05	-0.13	1.17	0.68	0.21
USD/CNY	6.90	0.21	-0.08	-1.00	-1.43

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	75.19	0.84	13.79	22.31	31.18
Brent(ICE EU)	81.61	0.26	14.47	23.68	34.34
Natural Gas(NY...	2.92	-4.32	-5.50	-23.97	-19.24

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5146.30	0.76	1.67	8.96	19.28
Copper(COMEX)	5.89	2.09	0.74	2.71	4.50
Silver(COMEX)	83.44	0.62	1.33	4.21	18.26

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	443.75	2.19	2.98	2.29	1.43
Wheat(CBOT)	567.75	-0.79	2.43	6.86	12.09
Soybean(CBOT)	1166.25	0.91	2.79	7.54	13.28
Coffee(ICE US)	285.85	-0.38	-2.10	-15.35	-20.00
Sugar(ICE US)	13.71	-1.58	-3.08	-6.08	-6.10

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	72915.93	6.77	7.74	-7.66	-17.82
Ethereum	2151.42	8.51	8.44	-14.30	-28.30

자료: Yahoo Finance, SK증권