DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-19)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.021 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
-0.021	0.004	0.007	-0.011	-0.001	0.077

※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	5507.01	-0.28	6.79	21.92	27.78
KOSDAQ	1106.08	-1.77	2.29	13.43	16.97
KOSPI200	814.59	-0.21	7.70	25.06	30.51

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	29320	-0.44	7.78	32.09	35.46
102970	KODEX 증권	26615	8.21	26.01	53.88	70.77
498400	KODEX 200타겟위클리커	17380	0.17	7.18	22.16	27.23
157500	TIGER 증권	18400	8.78	26.81	55.32	72.28
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6815	-3.33	1.34	14.50	33.89
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4600	0.22	1.56	3.44	3.25
305540	TIGER 2차전지테마	20720	-2.86	0.50	8.66	24.82
292150	TIGER 코리아TOP10	29455	0.34	7.77	29.21	33.95
161510	PLUS 고배당주	27790	1.20	13.05	24.66	31.71
395270	HANARO Fn K-반도체	29705	-0.60	8.37	30.06	32.70

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
157500	TIGER 증권	18400	8.78	26.81	55.32	72.28
102970	KODEX 증권	26615	8.21	26.01	53.88	70.77
104530	KIWOOM 고배당	20690	4.23	15.15	26.20	34.05
498860	RISE 코리아금융고배당	21490	3.32	21.77	36.63	43.78
261140	TIGER 우선주	23305	2.78	7.51	20.19	26.86

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
462010	TIGER 2차전지소재Fn	6815	-3.33	1.34	14.50	33.89
464600	SOL 자동차소부장Fn	16205	-3.25	2.57	15.86	19.51
367740	HANARO Fn5G산업	27265	-3.18	7.77	21.44	26.78
455860	SOL 2차전지소부장Fn	6200	-3.12	1.41	13.00	30.39
461950	KODEX 2차전지핵심소재1	6585	-3.02	1.04	12.15	31.18

자료: 한국거래소, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	146.63	0.43	0.47	2.33	2.91
선진국(URTH)	190.39	0.49	0.29	1.61	2.08
신흥국(EEM)	61.19	0.53	2.08	7.90	8.80
미국(S&P500)	6881.31	0.56	-0.46	0.12	0.33
미국(NASDAQ)	22753.63	0.78	-1.88	-2.26	-2.07
미국(DJIA)	49662.66	0.26	0.46	2.12	2.65
유럽(Eurostoxx50)	6103.37	1.35	1.92	4.39	3.03
일본(Nikkei225)	57143.84	1.02	4.33	9.66	10.25
중국(CSI300)	4660.41	-1.25	-0.85	0.35	-1.22
홍콩(HangSeng)	26705.94	0.52	-0.94	1.49	1.40
대만(TWSE)	33605.71	1.61	4.83	13.58	14.50
인도(Nifty 50)	25819.35	0.37	1.07	-0.03	-1.25
한국(KOSPI)	5507.01	-0.28	6.79	21.92	27.78

Fixed Income

US Fixed Income

Instrument	Level(%)	1D(bp)	1M(bp)	3M(bp)	6M(bp)	1Y(bp)
Fed Funds (EFFR)	3.64	0.00	-8.00	-45.00	-69.00	-69.00
US Treasury 2Y	3.40	-7.00	-11.00	-22.00	-35.00	-91.00
US TIPS 10Y	1.77	-3.00	-9.00	-9.00	-18.00	-31.00
IG Corporate Yield	4.73	1.00	-12.00	-14.00	-26.00	-53.00
HY Corporate Yield	6.55	2.00	11.00	-32.00	-24.00	-36.00
High Yield Spread	2.94	0.00	29.00	-23.00	-1.00	32.00
10Y Breakeven Inflation	2.26	-1.00	-7.00	-1.00	-13.00	-17.00
US T-Bill 3M	3.60	1.00	4.60	-17.20	-48.50	-61.00
US Treasury 10Y	4.08	2.70	-15.20	-2.70	-18.10	-46.50
US Treasury 30Y	4.71	2.30	-13.40	-2.60	-17.80	-5.60
2Y-10Y Spread	0.68	9.70	-4.20	19.30	16.90	44.50

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	-50.00
국고채 3년	3.14	-1.20	14.60	19.80	73.80	51.10
국고채 10년	3.57	-4.70	15.30	25.40	78.40	69.90
회사채 AA- 3년	3.71	-1.10	22.40	34.00	80.90	47.80
CD 91일	2.78	0.00	9.00	6.00	28.00	-20.00

※T-Bill 3M, Treasury 10Y, Treasury 30Y를 제외한 나머지 미국 금리는 전 영업일 기준
자료 : FRED, 한국은행, Yahoo Finance, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	838.97	2.00	5.22	15.07	19.57
Materials	666.94	0.77	3.42	11.32	14.38
Industrials	1480.78	0.01	3.28	8.70	10.68
Consumer Discr…	1850.18	1.00	-3.51	-4.17	-2.95
Consumer Stapl…	979.32	-0.53	2.55	8.51	13.41
Health Care	1836.16	0.21	0.86	1.27	1.23
Financials	872.78	0.78	-1.23	-2.59	-4.47
Information Te…	5482.03	0.97	-1.16	-2.72	-3.60
Communication …	439.88	0.31	-4.33	-3.19	-2.39
Utilities	461.99	-1.70	3.88	4.99	5.25
Real Estate	275.17	-1.45	3.73	5.85	7.84

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	452.10	0.61	-1.83	-3.60	-4.17
가치(IWD)	224.24	0.47	1.15	4.30	5.67
대형(IWL)	169.51	0.45	-0.88	-0.73	-0.67
중소형(IWM)	264.03	0.38	0.18	3.25	6.13
배당(VIG)	227.89	0.31	0.80	2.17	3.30
저변동성(USMV)	96.00	0.17	0.68	1.39	2.51
모멘텀(MTUM)	253.52	0.74	-0.49	0.34	0.31
퀄리티(QUAL)	203.45	0.60	0.33	1.44	2.14

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Global Payment…	Industrials	81.25	16.46	12.18	6.61	7.58
Caesars Entert…	Consumer Cyclical	21.42	13.03	1.91	-5.91	-9.08
Garmin Ltd.	Technology	236.95	9.20	14.28	15.58	17.05
MGM Resorts In…	Consumer Cyclical	37.17	8.46	6.28	4.98	1.86
CarMax Inc	Consumer Cyclical	45.65	8.05	0.37	8.11	16.19

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Palo Alto Netw…	Technology	152.35	-6.82	-10.74	-16.52	-15.06
Crown Castle I…	Real Estate	87.43	-4.82	1.75	-0.23	-1.43
Genuine Parts …	Consumer Cyclical	120.89	-3.85	-14.18	-8.75	-2.50
American Tower…	Real Estate	186.62	-3.35	3.96	4.90	6.76
Welltower Inc.	Real Estate	208.53	-3.23	7.68	8.13	11.55

자료: Yahoo Finance, SK증권

Currency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Dollar Index	97.73	0.58	0.49	-0.59	-0.70
USD/KRW	1446.02	0.40	-0.17	-0.84	0.16
USD/EUR	1.18	-0.52	-0.54	0.43	0.32
USD/JPY	154.80	0.77	-0.14	-0.80	-1.23
USD/CNY	6.91	-0.01	-0.42	-1.29	-1.27

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	65.36	4.86	3.61	9.14	14.03
Brent(ICE EU)	70.61	4.73	4.04	10.08	16.23
Natural Gas(NY…	3.04	0.16	-27.34	-26.65	-16.09

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5003.00	2.46	0.64	9.78	15.96
Copper(COMEX)	5.78	2.57	-1.46	2.95	2.45
Silver(COMEX)	77.18	5.08	-12.42	3.21	9.38

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	426.50	0.06	-0.46	-1.62	-2.51
Wheat(CBOT)	554.00	3.02	4.04	5.58	9.38
Soybean(CBOT)	1147.75	1.21	4.86	6.18	11.49
Coffee(ICE US)	285.20	0.21	-11.16	-20.34	-20.18
Sugar(ICE US)	13.77	-0.65	-4.01	-6.36	-5.68

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	66266.80	-1.82	-6.80	-20.94	-25.32
Ethereum	1940.12	-2.61	-8.13	-29.34	-35.34

자료: Yahoo Finance, SK증권