DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-20)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.004 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
0.004	-0.010	0.002	-0.012	-0.007	0.076

※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	5677.25	3.09	9.27	24.88	31.73
KOSDAQ	1160.71	4.94	6.40	18.44	22.75
KOSPI200	840.24	3.15	10.17	28.06	34.62

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	30080	2.59	9.39	34.26	38.97
102970	KODEX 증권	30065	12.96	38.26	71.30	92.91
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7315	7.34	7.40	22.21	43.71
395270	HANARO Fn K-반도체	31200	5.03	12.52	35.33	39.38
498400	KODEX 200타겟위클리커	17850	2.70	9.23	24.66	30.67
157500	TIGER 증권	20565	11.77	37.71	71.07	92.56
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4610	0.22	1.66	3.55	3.48
305720	KODEX 2차전지산업	17890	5.42	5.39	15.01	32.57
228790	TIGER 화장품	3800	1.06	2.50	9.20	10.63

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148J0	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	13885	2.59	6,127,324

※ 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 %
102970	KODEX 증권	30065	12.96	38.26	71.30	92.91
157500	TIGER 증권	20565	11.77	37.71	71.07	92.56
457990	PLUS 태양광&ESS	32760	10.01	25.21	40.74	54.82
381570	HANARO Fn친환경에너지	11405	8.31	13.91	29.01	45.56
261070	TIGER 코스닥150바이오	20950	8.10	6.00	11.65	15.43

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
360140	KODEX 200롱코스닥15	12935	-4.15	0.69	2.93	1.37
422260	VITA MZ소비액티브	11175	-1.02	3.49	8.87	13.16
421320	PLUS 우주항공&UAM	42895	-0.94	3.15	37.32	50.06
228800	TIGER 여행레저	3720	-0.80	4.78	7.88	8.45
438900	HANARO Fn K-푸드	12675	-0.74	5.48	7.17	8.89

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	844.32	0.64	5.27	15.36	20.33
Materials	665.56	-0.21	2.87	10.68	14.14
Industrials	1492.22	0.77	3.78	9.22	11.54
Consumer Discr…	1840.45	-0.53	-3.74	-4.72	-3.46
Consumer Stapl…	975.60	-0.38	1.85	7.87	12.98
Health Care	1831.07	-0.28	0.62	0.93	0.95
Financials	865.27	-0.86	-1.96	-3.46	-5.29
Information Te…	5452.75	-0.53	-1.61	-3.23	-4.12
Communication …	439.69	-0.04	-4.25	-3.29	-2.44
Utilities	467.23	1.13	4.71	6.09	6.44
Real Estate	274.25	-0.33	3.15	5.36	7.48

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	450.66	-0.33	-2.02	-3.90	-4.47
가치(IWD)	224.01	-0.13	0.94	4.00	5.57
대형(IWL)	169.15	-0.21	-1.06	-1.00	-0.88
중소형(IWM)	264.63	0.24	0.46	3.25	6.37
배당(VIG)	227.13	-0.36	0.39	1.72	2.96
저변동성(USMV)	96.03	-0.00	0.62	1.36	2.54
모멘텀(MTUM)	253.25	-0.09	-0.55	0.14	0.21
퀄리티(QUAL)	202.99	-0.25	0.07	1.09	1.91

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Omnicom Group …	Communication Services	80.97	15.41	10.32	6.29	-0.43
Deere & Company	Industrials	662.17	11.61	17.22	29.96	41.85
Texas Pacific …	Energy	486.72	10.44	28.87	49.29	63.35
Occidental Pet…	Energy	51.52	9.36	12.64	19.91	21.57
Super Micro Co…	Technology	32.17	8.27	2.63	2.02	3.90

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
EPAM Systems, …	Technology	139.30	-16.93	-26.94	-30.56	-30.51
Pool Corporati…	Industrials	218.36	-14.48	-15.80	-11.97	-4.94
Booking Holdin…	Consumer Cyclical	4007.45	-6.15	-13.38	-20.43	-24.72
United Airline…	Industrials	110.05	-5.88	0.19	0.37	-2.62
Apollo Global …	Financial Services	118.35	-5.59	-9.16	-14.54	-19.28

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	146.34	-0.20	0.19	2.00	2.70
선진국(URTH)	189.93	-0.25	-0.01	1.25	1.83
신흥국(EEM)	61.06	-0.21	1.63	7.42	8.57
미국(S&P500)	6861.89	-0.28	-0.74	-0.24	0.05
미국(NASDAQ)	22682.73	-0.31	-2.07	-2.60	-2.38
미국(DJIA)	49395.16	-0.54	-0.12	1.45	2.09
유럽(Eurostoxx50)	6059.62	-0.72	1.10	3.49	2.29
일본(Nikkei225)	57467.83	0.57	4.47	9.97	10.87
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)	25454.35	-1.41	-0.42	-1.41	-2.65
한국(KOSPI)	5677.25	3.09	9.27	24.88	31.73

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	3.43	3.00	-16.00	-15.00	-36.00	-83.00
US TIPS 10Y	1.79	2.00	-12.00	-7.00	-15.00	-25.00
IG Corporate Yield	4.74	1.00	-11.00	-10.00	-17.00	-56.00
HY Corporate Yield	6.50	-5.00	7.00	-33.00	-14.00	-47.00
High Yield Spread	2.86	-8.00	21.00	-31.00	-2.00	24.00
10Y Breakeven Inflation	2.29	3.00	-4.00	5.00	-12.00	-16.00
US T-Bill 3M	3.60	-0.80	2.30	-14.50	-49.30	-62.30
US Treasury 10Y	4.07	-0.40	-22.00	1.20	-18.50	-46.00
US Treasury 30Y	4.70	-0.20	-21.60	-1.10	-18.00	-6.10
2Y-10Y Spread	0.64	-3.40	-6.00	16.20	17.50	37.00

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	-50.00
국고채 3년	3.18	3.60	-1.30	30.60	72.20	54.80
국고채 10년	3.59	1.70	-6.50	31.70	72.80	71.50
회사채 AA- 3년	3.73	3.00	8.20	42.70	80.30	52.10
CD 91일	2.78	0.00	10.00	2.00	25.00	-17.00

※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	97.88	0.19	0.70	-0.40	-0.55
USD/KRW	1449.55	0.67	0.14	-0.56	0.41
USD/EUR	1.18	-0.67	-0.73	0.26	0.19
USD/JPY	155.08	1.26	0.20	-0.58	-1.05
USD/CNY	6.91	0.00	-0.38	-1.23	-1.26

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	66.70	2.32	5.24	11.15	16.36
Brent(ICE EU)	71.94	2.26	5.50	11.92	18.42
Natural Gas(NY…	2.93	-2.59	-28.11	-28.69	-18.93

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5020.20	0.68	0.81	9.78	16.36
Copper(COMEX)	5.76	-0.53	-1.76	2.44	2.18
Silver(COMEX)	78.40	1.16	-10.34	4.19	11.12

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	426.25	-0.18	-0.58	-1.68	-2.57
Wheat(CBOT)	569.25	4.07	6.36	8.36	12.39
Soybean(CBOT)	1156.50	2.03	5.28	6.96	12.34
Coffee(ICE US)	285.85	-0.59	-10.13	-19.71	-20.00
Sugar(ICE US)	13.72	-3.18	-4.15	-6.64	-6.03

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	67072.10	0.97	-4.53	-19.64	-24.41
Ethereum	1951.12	-0.15	-5.97	-28.49	-34.97

자료: Yahoo Finance, SK증권