DAILY RECAP

▶ Summary (2026-02-23)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.002 상승하여 오전 중 지수 하방 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
0.002	-0.038	0.003	-0.015	-0.010	0.078

※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	5808.53	2.31	10.81	26.93	34.78
KOSDAQ	1154.00	-0.58	4.93	17.24	22.04
KOSPI200	859.59	2.30	11.61	30.03	37.72

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	30570	1.63	9.79	35.20	41.23
102970	KODEX 증권	30505	1.46	36.20	71.29	95.73
157500	TIGER 증권	21025	2.24	36.65	72.32	96.86
498400	KODEX 200타겟위클리커	18265	2.32	10.75	26.73	33.71
305720	KODEX 2차전지산업	17860	-0.17	4.44	14.51	32.35
161510	PLUS 고배당주	29620	3.46	17.47	31.18	40.39
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4625	0.33	1.87	3.77	3.82

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0091P0	TIGER 코리아원자력	17935	4.82	11,738,634
0080G0	KODEX K방산TOP10	13500	5.80	6,607,190
0098F0	KODEX K원자력SMR	17870	4.41	5,713,573

※ 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 %
140700	KODEX 보험	17875	9.90	24.21	35.84	39.81
449450	PLUS K방산	70535	5.75	5.30	20.44	33.08
490480	SOL K방산	35580	5.08	4.70	21.51	34.72
463250	TIGER K방산&우주	42840	5.06	5.08	24.94	40.00
494670	TIGER 조선TOP10	31290	5.00	6.24	11.07	21.70

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
457990	PLUS 태양광&ESS	31780	-2.99	19.47	35.63	50.19
360150	KODEX 코스닥150룽코스	6180	-2.98	-5.00	-8.20	-6.79
462900	KoAct 바이오헬스케어액티	23075	-2.31	-0.80	-0.21	1.65
476000	UNICORN 포스트IPO액	11940	-2.25	-3.82	-1.16	2.80
475050	ACE KPOP포커스	12400	-1.82	2.24	7.87	-1.59

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level I Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	838.29	-0.71	3.96	14.13	19.47
Materials	667.30	0.26	2.81	10.60	14.44
Industrials	1498.92	0.45	3.89	9.39	12.04
Consumer Discr…	1863.80	1.27	-2.23	-3.55	-2.24
Consumer Stapl…	976.59	0.10	1.64	7.76	13.09
Health Care	1825.23	-0.32	0.35	0.58	0.63
Financials	870.85	0.64	-1.19	-2.86	-4.68
Information Te…	5484.42	0.58	-0.96	-2.68	-3.56
Communication …	451.34	2.65	-1.64	-0.80	0.15
Utilities	469.35	0.45	4.77	6.48	6.92
Real Estate	276.41	0.79	3.63	6.06	8.32

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	453.86	0.69	-1.19	-3.20	-3.79
가치(IWD)	225.27	0.58	1.38	4.41	6.16
대형(IWL)	170.34	0.73	-0.34	-0.36	-0.18
중소형(IWM)	264.61	0.00	0.56	3.05	6.36
배당(VIG)	227.57	0.20	0.51	1.82	3.16
저변동성(USMV)	96.19	0.15	0.71	1.48	2.71
모멘텀(MTUM)	254.78	0.58	0.08	0.63	0.81
퀄리티(QUAL)	204.39	0.67	0.72	1.69	2.61

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corning Incorp…	Technology	139.51	7.32	17.94	41.91	53.87
Enphase Energy…	Technology	46.56	5.22	6.31	27.84	37.96
Extra Space St…	Real Estate	152.75	4.56	7.73	11.65	16.63
Expand Energy …	Energy	108.06	4.05	1.11	-1.44	-1.56
Alphabet Inc.	Communication Services	314.98	4.01	-2.64	-1.55	-0.05

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Akamai Technol…	Technology	94.17	-14.07	-5.08	2.34	10.66
CrowdStrike Ho…	Technology	388.60	-7.95	-8.78	-16.34	-14.33
Oracle Corpora…	Technology	148.08	-5.40	-7.06	-19.69	-24.34
Paycom Softwar…	Technology	114.71	-4.98	-11.79	-23.45	-24.73
Datadog, Inc.	Technology	115.66	-4.10	-7.06	-14.43	-13.54

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	147.63	0.88	0.98	2.77	3.61
선진국(URTH)	191.19	0.68	0.58	1.81	2.51
신흥국(EEM)	62.34	2.13	3.45	9.38	10.85
미국(S&P500)	6909.51	0.69	-0.04	0.38	0.74
미국(NASDAQ)	22886.07	0.90	-1.08	-1.77	-1.50
미국(DJIA)	49625.97	0.47	0.33	1.80	2.57
유럽(Eurostoxx50)	6131.31	1.18	2.14	4.55	3.50
일본(Nikkei225)	56825.70	-1.12	3.01	8.50	9.63
중국(CSI300)	4660.41	-1.25	-0.85	0.35	-1.22
홍콩(HangSeng)	26413.35	-1.10	-2.02	0.34	0.28
대만(TWSE)	33605.71	1.61	4.83	13.58	14.50
인도(Nifty 50)	25571.25	0.46	-0.02	-0.94	-2.20
한국(KOSPI)	5808.53	2.31	10.81	26.93	34.78

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	3.47	0.00	-13.00	-4.00	-21.00	-81.00
US TIPS 10Y	1.79	-1.00	-18.00	-3.00	-6.00	-29.00
IG Corporate Yield	4.74	0.00	-15.00	-8.00	-17.00	-54.00
HY Corporate Yield	6.51	1.00	-3.00	-30.00	-13.00	-49.00
High Yield Spread	2.88	2.00	15.00	-31.00	0.00	20.00
10Y Breakeven Inflation	2.28	-1.00	-6.00	4.00	-13.00	-17.00
US T-Bill 3M	3.60	0.00	0.70	-14.50	-49.30	-61.00
US Treasury 10Y	4.09	1.10	-16.70	2.30	-17.40	-41.40
US Treasury 30Y	4.72	2.10	-14.60	1.00	-15.90	-1.30
2Y-10Y Spread	0.62	1.10	-3.70	6.30	3.60	39.60

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	-50.00
국고채 3년	3.14	-3.50	0.50	27.10	68.70	51.50
국고채 10년	3.54	-4.80	-6.20	26.90	68.00	65.20
회사채 AA- 3년	3.72	-1.70	9.40	41.00	78.60	50.60
CD 91일	2.79	1.00	11.00	3.00	26.00	-15.00

※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	97.79	-0.14	0.63	-0.45	-0.64
USD/KRW	1444.55	-0.22	-0.11	-0.85	0.06
USD/EUR	1.18	0.28	-0.48	0.45	0.44
USD/JPY	155.16	0.30	0.37	-0.51	-1.00
USD/CNY	6.91	-0.01	-0.29	-1.16	-1.27

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	66.48	0.08	4.33	10.53	15.98
Brent(ICE EU)	71.30	-0.50	4.03	10.68	17.37
Natural Gas(NY…	2.98	-0.40	-25.02	-27.00	-17.52

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5080.90	2.11	1.90	10.72	17.77
Copper(COMEX)	5.84	1.90	-0.52	3.54	3.53
Silver(COMEX)	82.34	6.16	-5.05	8.67	16.71

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	439.75	3.29	2.39	1.38	0.51
Wheat(CBOT)	580.25	3.71	7.86	10.31	14.56
Soybean(CBOT)	1153.25	1.07	4.64	6.64	12.02
Coffee(ICE US)	287.65	0.09	-8.72	-18.78	-19.49
Sugar(ICE US)	13.86	-1.49	-2.92	-5.63	-5.07

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	67384.40	-0.91	-1.92	-18.28	-24.06
Ethereum	1941.08	-1.65	-3.72	-27.51	-35.31

자료: Yahoo Finance, SK증권