# DAILY RECAP

## ▶ Summary (2026-02-24)

SK증권 Quant 황지우

1. 전일 Pre-market 변동성은 0.050 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 0.050 | -0.025 | 0.002 | -0.012 | -0.006 | 0.086 |

※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 | 5846.09 | 0.65 | 10.54 | 26.83 | 35.65 |
| KOSDAQ | 1151.99 | -0.17 | 3.80 | 16.47 | 21.83 |
| KOSPI200 | 865.49 | 0.69 | 11.28 | 29.86 | 38.66 |

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 396500 | TIGER 반도체TOP10 | 30630 | 0.20 | 8.71 | 34.11 | 41.51 |
| 498400 | KODEX 200타겟위클리커 | 18390 | 0.68 | 10.49 | 26.68 | 34.63 |
| 102970 | KODEX 증권 | 29310 | -3.92 | 27.40 | 62.32 | 88.07 |
| 329200 | TIGER 리츠부동산인프라 | 4630 | 0.11 | 1.85 | 3.76 | 3.93 |
| 462010 | TIGER 2차전지소재Fn | 7170 | -1.78 | 2.98 | 18.51 | 40.86 |
| 395160 | KODEX AI반도체 | 25485 | 0.24 | 6.78 | 27.75 | 33.71 |
| 472150 | TIGER 배당커버드콜액티브 | 18330 | 0.60 | 10.27 | 26.98 | 34.67 |
| 487240 | KODEX AI전력핵심설비 | 33180 | 6.01 | 15.83 | 29.36 | 38.02 |

| Code | Instrument | Close | Daily % | Volume |
|---|---|---|---|---|
| 0091P0 | TIGER 코리아원자력 | 18370 | 2.43 | 8,639,677 |
| 0117V0 | TIGER 코리아AI전력기기TOP3플 | 17700 | 5.36 | 6,509,207 |

※ 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 % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 491820 | HANARO 전력설비투자 | 40025 | 6.20 | 15.78 | 29.38 | 38.18 |
| 487240 | KODEX AI전력핵심설비 | 33180 | 6.01 | 15.83 | 29.36 | 38.02 |
| 365000 | TIGER 인터넷TOP10 | 5245 | 5.75 | 6.15 | 9.99 | 9.96 |
| 483020 | KIWOOM 의료AI | 14490 | 5.54 | 6.18 | 6.71 | 7.65 |
| 380340 | ACE 코리아AI테크핵심산업 | 19345 | 4.88 | 10.02 | 18.07 | 19.19 |

| Code | Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 157500 | TIGER 증권 | 20110 | -4.35 | 27.23 | 62.54 | 88.30 |
| 421320 | PLUS 우주항공&UAM | 41810 | -3.98 | -0.37 | 30.96 | 46.27 |
| 102970 | KODEX 증권 | 29310 | -3.92 | 27.40 | 62.32 | 88.07 |
| 498860 | RISE 코리아금융고배당 | 22760 | -3.15 | 21.18 | 40.80 | 52.28 |
| 476260 | HANARO 반도체핵심공정주 | 12010 | -2.87 | 5.31 | 26.15 | 32.05 |

자료: 한국거래소, SK증권

### US Market

US GICS Level I Index

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Energy | 843.32 | 0.60 | 4.03 | 14.38 | 20.19 |
| Materials | 668.58 | 0.19 | 2.71 | 10.44 | 14.66 |
| Industrials | 1478.33 | -1.37 | 2.15 | 7.61 | 10.50 |
| Consumer Discr… | 1823.70 | -2.15 | -3.92 | -5.60 | -4.34 |
| Consumer Stapl… | 990.87 | 1.46 | 2.76 | 9.07 | 14.75 |
| Health Care | 1846.25 | 1.15 | 1.47 | 1.71 | 1.79 |
| Financials | 841.82 | -3.33 | -4.27 | -6.06 | -7.86 |
| Information Te… | 5423.58 | -1.11 | -1.89 | -3.71 | -4.63 |
| Communication … | 445.21 | -1.36 | -2.83 | -2.13 | -1.21 |
| Utilities | 472.72 | 0.72 | 5.05 | 7.15 | 7.69 |
| Real Estate | 276.95 | 0.20 | 3.51 | 6.14 | 8.54 |

US Style Factor ETFs

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| 성장(IWF) | 448.04 | -1.28 | -2.24 | -4.38 | -5.03 |
| 가치(IWD) | 223.09 | -0.97 | 0.29 | 3.25 | 5.13 |
| 대형(IWL) | 168.57 | -1.04 | -1.29 | -1.40 | -1.22 |
| 중소형(IWM) | 260.51 | -1.55 | -0.92 | 1.31 | 4.72 |
| 배당(VIG) | 225.74 | -0.80 | -0.36 | 0.94 | 2.33 |
| 저변동성(USMV) | 95.81 | -0.40 | 0.26 | 1.04 | 2.31 |
| 모멘텀(MTUM) | 249.79 | -1.96 | -1.78 | -1.39 | -1.17 |
| 퀄리티(QUAL) | 202.25 | -1.05 | -0.33 | 0.55 | 1.54 |

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

| Instrument | Sector | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| PayPal Holding… | Financial Services | 44.05 | 5.76 | -2.06 | -19.46 | -24.23 |
| Albemarle Corp… | Basic Materials | 177.40 | 5.33 | 3.35 | 14.17 | 23.25 |
| Akamai Technol… | Technology | 98.75 | 4.87 | -0.65 | 7.12 | 16.05 |
| Eli Lilly and … | Healthcare | 1058.41 | 4.84 | 2.10 | 0.75 | -2.03 |
| Corning Incorp… | Technology | 145.27 | 4.13 | 20.17 | 46.21 | 60.22 |

| Instrument | Sector | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|---|
| International … | Technology | 223.37 | -13.14 | -20.59 | -24.51 | -23.37 |
| Datadog, Inc. | Technology | 102.61 | -11.28 | -16.62 | -23.55 | -23.29 |
| CrowdStrike Ho… | Technology | 350.33 | -9.85 | -16.77 | -24.15 | -22.76 |
| Zebra Technolo… | Technology | 231.32 | -9.43 | -6.75 | -8.36 | -6.84 |
| KKR & Co. Inc. | Financial Services | 92.22 | -8.86 | -13.37 | -24.52 | -28.46 |

자료: Yahoo Finance, SK증권

### Global Market Index

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| 전세계(ACWI) | 146.26 | -0.93 | 0.01 | 1.72 | 2.65 |
| 선진국(URTH) | 189.51 | -0.88 | -0.32 | 0.84 | 1.61 |
| 신흥국(EEM) | 61.66 | -1.09 | 2.10 | 7.93 | 9.64 |
| 미국(S&P500) | 6837.75 | -1.04 | -1.03 | -0.69 | -0.30 |
| 미국(NASDAQ) | 22627.27 | -1.13 | -2.01 | -2.87 | -2.62 |
| 미국(DJIA) | 48804.06 | -1.66 | -1.31 | 0.03 | 0.87 |
| 유럽(Eurostoxx50) | 6113.92 | -0.28 | 1.72 | 4.08 | 3.21 |
| 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) | 27081.91 | 2.53 | 0.37 | 2.76 | 2.82 |
| 대만(TWSE) | 33773.26 | 0.50 | 4.87 | 13.70 | 15.07 |
| 인도(Nifty 50) | 25713.00 | 0.55 | 0.40 | -0.36 | -1.66 |
| 한국(KOSPI) | 5846.09 | 0.65 | 10.54 | 26.83 | 35.65 |

### 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 | -11.00 | -8.00 | -17.00 | -53.00 |
| HY Corporate Yield | 6.48 | -3.00 | 0.00 | -33.00 | -16.00 | -48.00 |
| High Yield Spread | 2.86 | -2.00 | 17.00 | -33.00 | -2.00 | 20.00 |
| 10Y Breakeven Inflation | 2.28 | -1.00 | -6.00 | 4.00 | -13.00 | -17.00 |
| US T-Bill 3M | 3.59 | -0.70 | 0.60 | -14.40 | -47.20 | -60.90 |
| US Treasury 10Y | 4.03 | -5.70 | -21.00 | 2.70 | -20.90 | -39.10 |
| US Treasury 30Y | 4.70 | -2.90 | -13.70 | 3.80 | -21.70 | 2.70 |
| 2Y-10Y Spread | 0.56 | -5.70 | -8.00 | 6.70 | 0.10 | 41.90 |

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 | 3.15 | 1.10 | 1.70 | 25.20 | 75.20 | 53.60 |
| 국고채 10년 | 3.58 | 3.80 | -1.20 | 31.40 | 75.30 | 72.20 |
| 회사채 AA- 3년 | 3.73 | 0.70 | 8.10 | 39.10 | 83.80 | 52.50 |
| CD 91일 | 2.80 | 1.00 | 11.00 | 4.00 | 27.00 | -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 | 97.73 | -0.07 | 0.56 | -0.47 | -0.70 |
| USD/KRW | 1445.14 | -0.18 | -0.07 | -0.81 | 0.10 |
| USD/EUR | 1.18 | 0.22 | -0.53 | 0.39 | 0.38 |
| USD/JPY | 154.69 | -0.30 | 0.08 | -0.79 | -1.30 |
| USD/CNY | 6.91 | -0.01 | -0.29 | -1.16 | -1.27 |

### Commodity

Energy

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| WTI(NYMEX) | 66.45 | 0.09 | 3.86 | 10.25 | 15.93 |
| Brent(ICE EU) | 71.27 | -0.68 | 3.54 | 10.39 | 17.32 |
| Natural Gas(NY… | 2.92 | -4.23 | -24.51 | -28.15 | -19.35 |

Metals

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Gold(COMEX) | 5253.50 | 3.84 | 5.09 | 14.01 | 21.77 |
| Copper(COMEX) | 5.80 | -0.59 | -1.14 | 2.54 | 2.77 |
| Silver(COMEX) | 88.64 | 7.72 | 2.93 | 15.99 | 25.62 |

Agriculture

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Corn(CBOT) | 440.75 | 3.10 | 2.64 | 1.59 | 0.74 |
| Wheat(CBOT) | 574.00 | 0.09 | 6.33 | 8.96 | 13.33 |
| Soybean(CBOT) | 1150.25 | 1.12 | 4.05 | 6.34 | 11.73 |
| Coffee(ICE US) | 278.25 | -3.49 | -10.69 | -20.96 | -22.12 |
| Sugar(ICE US) | 14.01 | -2.03 | -1.77 | -4.57 | -4.04 |

Cryptocurrency

| Instrument | Close | Daily % | MA20 % | MA60 % | YTD % |
|---|---|---|---|---|---|
| Bitcoin | 64557.26 | -4.58 | -5.29 | -21.35 | -27.24 |
| Ethereum | 1863.81 | -4.80 | -6.75 | -29.95 | -37.88 |

자료: Yahoo Finance, SK증권