

# DAILY RECAP



SK증권 Quant 황지우

## Summary (2026-02-25)

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.026 하락하여 오전 중 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.

### Pre-market volatility

전일 대비	vs 1주 평균	vs 1개월 평균	vs 3개월 평균	vs 6개월 평균	vs 1년 평균
-0.026	-0.018	-0.000	-0.016	-0.009	0.084

※ 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	5969.64	2.11	11.80	28.53	38.52
KOSDAQ	1165.00	1.13	4.06	17.17	23.21
KOSPI200	886.88	2.47	12.84	31.93	42.09

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	31600	3.17	10.72	36.89	45.99
102970	KODEX 증권	28650	-2.25	21.59	56.63	83.83
305720	KODEX 2차전지산업	18315	4.27	5.73	16.57	35.72
498400	KODEX 200타켓위클리커	18820	2.34	11.97	28.66	37.77
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4635	0.11	1.82	3.76	4.04
487240	KODEX AI전력핵심설비	33725	1.64	16.28	30.51	40.29
462010	TIGER 2차전지소재Fn	7370	2.79	4.89	21.02	44.79
395160	KODEX AI반도체	26345	3.37	9.14	30.89	38.22

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148JO	TIGER 코리아휴머노이드로봇산업	13910	4.19	6,475,488
0117VO	TIGER 코리아AI전력기TOP3플	17940	1.36	5,553,731

※ 거래대금 상위이나 최근 상승 등의 이유로 시계열 데이터가 부재한 ETF

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

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
475310	SOL 반도체후공정	25520	6.05	8.38	25.73	33.40
474590	WON 반도체밸류체인액티브	29605	5.56	15.24	37.22	43.71
476260	HANARO 반도체핵심공정주	12645	5.29	9.21	31.73	39.03
494220	UNICORN SK하이닉스벨	33095	5.23	13.40	38.41	46.05
139260	TIGER 200 IT	86620	4.49	15.40	37.54	46.86

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
140700	KODEX 보험	17055	-2.90	15.04	27.87	33.40
460280	KIWOOM Fn유전자역신기	14210	-2.80	6.86	11.04	11.98
157500	TIGER 증권	19570	-2.69	20.91	56.15	83.24
498860	RISE 코리아금융고배당	22150	-2.68	15.95	35.89	48.20
498410	KODEX 금융고배당TOP1	14735	-2.58	9.68	19.34	26.99

자료: 한국거래소, SK증권

### US Market

US GICS Level 1 Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	842.36	-0.11	3.36	13.82	20.05
Materials	673.89	0.79	3.21	10.95	15.57
Industrials	1496.44	1.23	3.03	8.65	11.85
Consumer Discr...	1852.60	1.58	-2.08	-4.07	-2.83
Consumer Stapl...	997.67	0.69	3.06	9.56	15.54
Health Care	1836.40	-0.53	0.95	1.17	1.25
Financials	845.78	0.47	-3.59	-5.57	-7.42
Information Te...	5487.20	1.17	-0.59	-2.54	-3.51
Communication ...	446.19	0.22	-2.41	-1.88	-0.99
Utilities	477.89	1.09	5.70	8.20	8.87
Real Estate	277.59	0.23	3.41	6.27	8.79

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	452.67	1.04	-1.03	-3.33	-4.05
가치(IWD)	224.35	0.58	0.74	3.69	5.73
대형(IWL)	169.82	0.77	-0.48	-0.68	-0.49
중소형(IWM)	263.33	1.09	0.16	2.29	5.85
배당(VIG)	226.75	0.43	0.04	1.34	2.79
저변동성(USMV)	96.37	0.59	0.80	1.60	2.90
모멘텀(MTUM)	252.26	1.00	-0.71	-0.47	-0.19
퀄리티(QUAL)	203.93	0.83	0.50	1.32	2.38

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Keysight Techn...	Technology	301.62	23.11	28.98	39.38	46.00
Advanced Micro...	Technology	213.84	8.77	-1.84	-2.36	-4.31
PayPal Holding...	Financial Services	47.02	6.74	5.67	-13.66	-19.13
Constellation ...	Utilities	312.64	6.41	11.30	-3.48	-14.64
FactSet Resear...	Financial Services	201.50	5.91	-7.19	-23.77	-29.27

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Expeditors Int...	Industrials	138.75	-7.27	-11.24	-10.27	-8.63
ONEOK, Inc.	Energy	82.89	-5.08	0.47	8.07	11.50
Molina Healthc...	Healthcare	148.35	-5.03	-4.43	-10.51	-16.87
Fair Isaac Cor...	Technology	1227.62	-4.21	-11.30	-22.92	-25.29
CVS Health Cor...	Healthcare	74.18	-3.66	-2.60	-5.32	-7.43

자료: Yahoo Finance, SK증권

### Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	147.33	0.73	0.68	2.37	3.40
선진국(URTH)	190.75	0.66	0.31	1.44	2.27
신흥국(EEM)	62.60	1.54	3.36	9.30	11.31
미국(S&P500)	6890.07	0.77	-0.23	0.04	0.46
미국(NASDAQ)	22863.68	1.04	-0.83	-1.84	-1.60
미국(DJIA)	49174.50	0.76	-0.53	0.72	1.64
유럽(Eurostoxx50)	6116.60	0.04	1.66	3.95	3.26
일본(Nikkei225)	57321.09	0.87	3.59	9.14	10.59
중국(CSI300)	4707.54	1.01	0.18	1.31	-0.22
홍콩(HangSeng)	26590.32	-1.82	-1.44	0.84	0.96
대만(TWSE)	34700.82	2.75	7.20	16.29	18.23
인도(Nifty 50)	25424.65	-1.12	-0.77	-1.43	-2.76
한국(KOSPI)	5969.64	2.11	11.80	28.53	38.52

### 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	3.48	1.00	-12.00	-3.00	-20.00	-80.00
US TIPS 10Y	1.80	1.00	-12.00	-2.00	-5.00	-25.00
IG Corporate Yield	4.71	-3.00	-12.00	-4.00	-18.00	-50.00
HY Corporate Yield	6.52	4.00	6.00	-16.00	4.00	-48.00
High Yield Spread	2.95	9.00	27.00	-15.00	17.00	17.00
10Y Breakeven Inflation	2.26	-2.00	-6.00	4.00	-17.00	-16.00
US T-Bill 3M	3.59	0.00	0.60	-16.50	-48.40	-60.20
US Treasury 10Y	4.03	0.40	-20.60	3.50	-17.40	-36.00
US Treasury 30Y	4.69	-0.70	-14.40	4.50	-18.50	4.10
2Y-10Y Spread	0.55	-0.60	-8.60	6.50	2.60	44.00

### 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	3.16	0.40	2.10	26.30	74.20	54.80
국고채 10년	3.59	1.50	0.30	34.20	77.80	76.80
회사채 AA- 3년	3.73	0.50	8.60	40.20	83.20	53.90
CD 91일	2.80	0.00	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	97.85	0.15	0.64	-0.32	-0.58
USD/KRW	1442.49	-0.07	-0.26	-0.97	-0.08
USD/EUR	1.18	-0.46	-0.64	0.23	0.25
USD/JPY	155.86	0.99	0.80	-0.04	-0.56
USD/CNY	6.88	-0.37	-0.60	-1.47	-1.62

### Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	66.35	0.06	3.25	9.84	15.75
Brent(ICE EU)	71.27	-0.31	3.10	10.14	17.32
Natural Gas(NY...	2.85	-4.62	-22.45	-29.46	-21.31

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5181.60	-0.44	3.59	12.05	20.10
Copper(COMEX)	5.97	3.39	1.83	5.29	5.82
Silver(COMEX)	87.32	0.93	3.20	13.43	23.77

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	439.00	2.69	2.27	1.18	0.34
Wheat(CBOT)	572.75	0.57	5.65	8.58	13.08
Soybean(CBOT)	1154.50	1.79	4.07	6.71	12.14
Coffee(ICE US)	284.25	1.10	-7.74	-18.77	-20.45
Sugar(ICE US)	13.99	-3.18	-1.79	-4.65	-4.18

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	64275.42	-0.53	-5.10	-21.33	-27.56
Ethereum	1852.25	-0.18	-6.63	-29.91	-38.27

자료: Yahoo Finance, SK증권