

DAILY RECAP



Summary (2026-02-26)

1. 전일 Pre-market 변동성은 -0.011 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.

SK증권 Quant 황지우

Pre-market volatility

전일 대비	vs 1주 평균	vs 1개월 평균	vs 3개월 평균	vs 6개월 평균	vs 1년 평균
-0.011	-0.004	-0.001	-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://bully.kr/6Mo7JaP>

KR Market

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
KOSPI	6083.86	1.91	12.79	29.95	41.17
KOSDAQ	1165.25	0.02	3.29	16.59	23.23
KOSPI200	903.83	1.91	13.72	33.26	44.81

업종&테마 ETF 거래대금 Top 10 (레버리지·인버스 제외)

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
396500	TIGER 반도체TOP10	31920	1.01	10.39	36.84	47.47
305720	KODEX 2차전자산업	18940	3.41	8.52	19.97	40.35
498400	KODEX 200타겟위클리	19170	1.86	12.87	30.02	40.34
102970	KODEX 증권	29540	3.11	22.57	59.30	89.54
462010	TIGER 2차전자소재Fn	7600	3.12	7.02	23.92	49.31
487240	KODEX AI전력핵심설비	34090	1.08	16.06	30.96	41.81
329200	TIGER 리츠부동산인프라	4640	0.11	1.80	3.75	4.15

Code	Instrument	Close	Daily %	Volume
0148JO	TIGER 코리아휴먼노이드로봇산업	14755	6.07	11,633,991
0091PO	TIGER 코리아원자력	19400	4.58	8,231,100
0117VO	TIGER 코리아AI전력기TOP3플	18160	1.23	7,642,210

※ 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 %
138540	TIGER 현대차그룹플러스	66810	7.97	14.94	34.35	57.40
387280	TIGER 퓨처모빌리티택티브	13260	7.02	11.42	26.13	38.27
466930	SOL 자동차TOP3플러스	24085	6.62	16.18	36.54	57.01
091180	KODEX 자동차	36200	6.47	11.79	28.51	45.39
139220	TIGER 200 건설	7800	6.41	20.62	43.77	70.87

Code	Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
464610	SOL 의료기기소부장Fn	11365	-2.53	-1.46	5.60	10.07
360150	KODEX 코스닥150롱코스	5850	-2.09	-10.38	-12.26	-11.76
253280	RISE 헬스케어	19030	-2.03	1.54	7.69	11.16
307510	TIGER 의료기기	20305	-1.93	-2.22	4.22	5.56
476260	HANARO 반도체핵심공정주	12430	-1.70	5.88	28.48	36.67

자료: 한국거래소, SK증권

US Market

US GICS Level 1 Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Energy	838.84	-0.42	2.47	12.93	19.55
Materials	670.97	-0.43	2.47	10.13	15.07
Industrials	1484.67	-0.79	1.91	7.55	10.98
Consumer Discr...	1861.50	0.48	-1.28	-3.58	-2.36
Consumer Stapl...	991.86	-0.58	2.10	8.69	14.86
Health Care	1836.02	-0.02	0.86	1.16	1.23
Financials	859.97	1.68	-1.86	-3.95	-5.87
Information Te...	5585.52	1.79	1.33	-0.77	-1.78
Communication ...	450.50	0.97	-1.31	-0.92	-0.04
Utilities	479.60	0.36	5.63	8.49	9.26
Real Estate	275.66	-0.70	2.41	5.43	8.03

US Style Factor ETFs

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
성장(IWF)	458.46	1.28	0.41	-2.03	-2.82
가치(IWD)	225.01	0.28	0.90	3.87	6.04
대형(IWL)	171.39	0.95	0.50	0.22	0.43
중소형(IWM)	264.57	0.47	0.64	2.66	6.35
배당(VIG)	227.67	0.40	0.37	1.70	3.20
저변동성(USMV)	96.40	0.01	0.78	1.61	2.94
모멘텀(MTUM)	256.38	1.68	0.99	1.10	1.44
퀄리티(QUAL)	205.41	0.71	1.19	1.99	3.12

S&P500: 일간수익률 Top & Bottom 5

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Axon Enterpris...	Industrials	520.18	17.55	15.56	-3.86	-7.68
Coinbase Globa...	Financial Services	183.94	13.52	7.80	-17.07	-22.23
Super Micro Co...	Technology	33.58	7.87	6.86	6.67	8.46
Western Digma...	Technology	290.95	7.53	4.63	31.87	55.01
Seagate Techno...	Technology	421.85	6.52	0.45	24.14	46.71

Instrument	Sector	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
GoDaddy Inc.	Technology	79.14	-14.26	-15.31	-28.68	-33.23
First Solar, I...	Technology	210.12	-13.61	-8.98	-15.18	-23.41
CoStar Group, ...	Real Estate	44.78	-8.89	-13.07	-26.54	-31.83
Brown Forman I...	Consumer Defensive	28.09	-7.66	-3.25	-0.77	7.46
Builders First...	Industrials	102.64	-6.42	-11.97	-9.70	-1.90

자료: Yahoo Finance, SK증권

Global Market Index

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
전세계(ACWI)	148.65	0.90	1.53	3.20	4.32
선진국(URTH)	192.40	0.85	1.15	2.24	3.16
신흥국(EEM)	63.31	1.11	4.29	10.25	12.58
미국(S&P500)	6946.13	0.81	0.61	0.82	1.28
미국(NASDAQ)	23152.08	1.26	0.57	-0.60	-0.36
미국(DJIA)	49482.15	0.63	0.04	1.28	2.27
유럽(Eurostoxx50)	6173.32	0.93	2.40	4.73	4.21
일본(Nikkei225)	58583.12	2.20	5.32	11.20	13.02
중국(CSI300)	4735.89	0.60	0.76	1.82	0.38
홍콩(HangSeng)	26765.72	0.66	-0.80	1.45	1.62
대만(TWSE)	35413.07	2.05	8.77	18.15	20.66
인도(Nifty 50)	25482.50	0.23	-0.57	-1.16	-2.54
한국(KOSPI)	6083.86	1.91	12.79	29.95	41.17

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	-5.00	-17.00	0.00	-16.00	-76.00
US TIPS 10Y	1.77	-3.00	-15.00	-2.00	-4.00	-23.00
IG Corporate Yield	4.73	2.00	-10.00	0.00	-15.00	-46.00
HY Corporate Yield	6.55	3.00	9.00	-3.00	11.00	-43.00
High Yield Spread	2.97	2.00	29.00	-3.00	22.00	19.00
10Y Breakeven Inflation	2.26	0.00	-6.00	3.00	-15.00	-16.00
US T-Bill 3M	3.59	0.00	1.30	-16.50	-45.50	-59.40
US Treasury 10Y	4.05	1.50	-16.50	5.00	-17.90	-25.00
US Treasury 30Y	4.69	0.50	-11.10	5.00	-22.30	13.70
2Y-10Y Spread	0.62	6.50	0.50	5.00	-1.90	51.00

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	3.12	-3.40	2.80	11.10	69.80	52.80
국고채 10년	3.56	-3.70	1.20	20.50	74.10	75.90
회사채 AA- 3년	3.71	-2.50	9.40	25.90	79.90	52.70
CD 91일	2.80	0.00	10.00	0.00	27.00	-5.00

※ 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	97.70	-0.18	0.41	-0.44	-0.73
USD/KRW	1426.10	-1.12	-1.37	-2.05	-1.21
USD/EUR	1.18	0.14	-0.30	0.45	0.51
USD/JPY	156.43	1.16	1.08	0.34	-0.19
USD/CNY	6.87	-0.57	-0.76	-1.63	-1.82

Commodity

Energy

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
WTI(NYMEX)	65.48	-0.23	1.71	8.21	14.24
Brent(ICE EU)	70.74	-0.04	2.14	9.12	16.44
Natural Gas(NY...	2.88	-1.03	-16.88	-28.05	-20.26

Metals

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Gold(COMEX)	5194.70	0.75	3.76	11.93	20.40
Copper(COMEX)	6.04	1.93	2.86	6.23	7.05
Silver(COMEX)	89.80	2.68	7.11	15.72	27.27

Agriculture

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Corn(CBOT)	442.00	3.33	2.91	1.88	1.03
Wheat(CBOT)	570.25	0.48	4.78	7.99	12.59
Soybean(CBOT)	1165.25	2.26	4.65	7.67	13.19
Coffee(ICE US)	284.40	-1.34	-6.49	-18.25	-20.40
Sugar(ICE US)	13.98	-3.92	-1.76	-4.65	-4.25

Cryptocurrency

Instrument	Close	Daily %	MA20 %	MA60 %	YTD %
Bitcoin	69212.69	8.01	1.71	-14.96	-22.00
Ethereum	2075.68	12.02	3.96	-21.02	-30.82

자료: Yahoo Finance, SK증권