SAMSUNG FUTURES

Global Equity Index Futures

미국 – 이란 협상 재개 기대에 안도 랠리

Daily | 2026. 4. 15. (수)

삼성선물 리서치센터
ssfresearch@samsung.com

글로벌 지수

미국 증시	종가	등락률
S&P 500	6,967.38	+1.2%
NASDAQ	23,639.08	+2.0%
Dow Jones	48,535.99	+0.7%
VIX	18.36	-4.0%
유럽, 아시아 증시	**종가**	**등락률**
EURO STOXX 50	5,984.51	+1.3%
DAX	24,044.22	+1.3%
Nikkei 225	57,877.39	+2.4%
Hang Seng	25,872.32	+0.8%
국내 증시	**종가**	**등락률**
KOSPI	5,967.75	+2.7%
KOSDAQ	1,121.88	+2.0%
VKOSPI	49.87	-0.5%

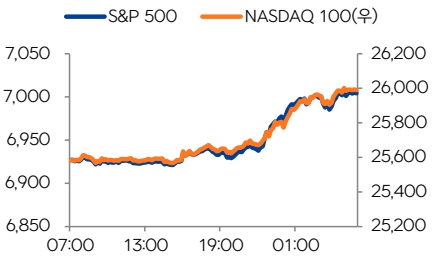
FICC

종류	전일	등락폭/률
달러지수	98.12	▼ 0.24
USD/KRW	1,472.70	▼ 10.00
미 국채 10년물 (%)	4.249	-4.5bp
미 국채 2년물 (%)	3.747	-2.8bp
국고채 10년물 (%)	3.652	-6.0bp
국고채 3년물 (%)	3.337	-4.3bp
WTI 선물 ($/배럴)	91.28	-7.9%
금 선물 ($/oz)	4,850.10	+1.7%

KOSPI 200 선물 야간시장 동향

일자	종가	등락폭	거래량	미결제약정	미결증감
04/15	929.35	+27.45	20,672	203,160	+56
04/14	899.95	+27.95	21,606	199,356	+692
04/13	888.45	+4.95	15,388	201,118	-271

일중 미국 지수 선물 변동



전일 동향 – 지정학적 긴장 완화에 강세 확대

전일 국내 증시는 코스피 지수가 장중 한때 6,000선 돌파하는 등 강세 마감(KOSPI 200 F +3.43%, KOSPI +2.74%, KOSDAQ + 2.00%). 코스피200 지수 선물은 900선 위에서 출발한 이후 외국인 매수 우위에 상승폭을 확대. 다만, 910선 부근에서 외국인 매수세 둔화되며 반락했으나 낙폭 제한되며 근월물 기준 이란 전쟁 발발 이후 처음으로 900선 위에서 마감하는데 성공. 거래량 또한 일부 회복(12.35만 계약)된 가운데 베이시스가 장중 평균치 기준 4pt대 기록했고, VKOSPI 지수는 막판 상승세에도 불구하고 이틀만에 재차 50%선 하회하며 마감. 외국인 프로그램 비차익 순매수가 미국과 이란의 2주 휴전안 수용 직후(8일) 제외하면 한 달 만에 최대 규모 기록해 지수에 긍정적으로 작용. 23일 실적 발표를 앞두고 기대감 확대된 SK하이닉스를 중심으로 한 반도체 업종, 글로벌 증시 호조 기대 영향으로 인한 증권 업종과 더불어 스페이스X IPO 기대감 지속되며 관련주의 상승세가 돋보이게 나타남. 야간 거래에서 코스피 선물은 미국 증시 강세 흐름 연동되어 상승폭을 더욱 확대하며 930선 소폭 하회하며 마감. 금일 지수 선물은 반도체 종목 중심으로 외국인의 순매수 지속 여부 및 장중 ASML 실적 발표 주목하며 추가 상승 시도할 전망.

미국 증시는 미국과 이란간 협상 재개 기대감에 강세 마감(S&P 500 +1.18%, NASDAQ +1.96%, DOW +0.66%). 정규장 개장 전 지수 선물은 파키스탄에서 미국 – 이란간 협상이 주 후반 재개 예정이라는 소식에 상승 우위 나타남. 또한, 3월 PPI 지표 또한 예상치를 하회하며 인플레이션 우려를 부분적으로 완화. 정규장 개장 전 실적 발표에서는 대형 은행주들의 종목별 차별화 나타났는데, 씨티그룹이 비교적 견조한 실적 발표하며 강세 두드러진 반면, 순이자수익 가이던스 하향 조정한 JP모간은 월요일 상승분을 일부 반납했으며, 웰스파고의 경우 매출 예상치 하회 등 영향에 급락. 다만, 올해 초 시장이 우려했던 사모신용 위기에 대해서는 예상보다 낮았던 충당금 공개 및 경영진의 긍정적인 발언으로 안도감 형성되는 모습. 금일 정규장 개장 전 뱅크오브아메리카 및 모간스탠리의 실적 발표로 대형 은행주들의 분기 실적 발표는 마무리될 예정. 한편, 월요일 하락 마감했던 러셀 2000 지수 또한 상승 전환하며 강세 심리 확산되는 모습 나타나기도.

증시 이슈 – 옵션 시장 추격 매수에 나스닥 지수 10일 연속 상승

전일 빅테크 종목들의 상승세 이어진 가운데 옵션 시장 투자자들은 기존 포지션 수익 실현에 나섬과 동시에 상방 이익 극대화를 위해 추가 매수에 나서는 모습. 특히, 아마존이 스페이스X와의 경쟁을 위해 위성 통신 기업 글로벌스타 인수에 합의했다고 발표하며 필라델피아 반도체 지수의 최고치 경신 랠리 확대 주도한 엔비디아와 더불어 지수 강세를 주도. 이에 나스닥 100 지수가 '21년 이후 최장 기록인 10일 연속 상승한 가운데 해당 기록 이어갈 수 있을지 여부에 주목.

현물 시세

	시가	고가	저가	종가	등락폭	1D 등락률	5D 등락률	1M 등락률	YTD 등락률	거래량(천주)	거래대금
S&P 500	6,910.20	6,969.42	6,905.17	6,967.38	+81.14	+1.2%	+5.3%	+5.1%	+1.8%	824,504	$120.57B
NASDAQ	23,331.50	23,639.08	23,331.50	23,639.08	+455.34	+2.0%	+7.4%	+6.9%	+1.7%	1,495,941	$106.64B
Dow Jones	48,272.03	48,592.29	48,192.30	48,535.99	+317.74	+0.7%	+4.2%	+4.2%	+1.0%	139,828	$28.84B
Russell 2000	2,679.71	2,711.92	2,679.71	2,705.67	+35.18	+1.3%	+6.3%	+9.1%	+9.0%	752,444	$17.83B
KOSPI	5,960.00	6,026.52	5,938.33	5,967.75	+159.13	+2.7%	+8.6%	+8.8%	+41.6%	889,491	₩27.13T
KOSDAQ	1,120.61	1,125.92	1,118.05	1,121.88	+22.04	+2.0%	+8.2%	-2.7%	+21.2%	1,350,476	₩14.49T
KOSPI 200	895.98	907.40	891.74	897.00	+26.22	+3.0%	+9.2%	+10.3%	+48.0%	187,156	₩22.48T

* 미국 지수 거래량 및 거래대금은 2거래일 전 수치

주요 경제지표 및 실적 발표

전일 발표	실제	예상치	이전
PPI MoM (3월)	0.5%	1.2%	0.7%
제이피모간체이스 (JPM)	EPS $5.94	EPS $5.44	EPS $4.63
존슨앤드존슨 (JNJ)	EPS $2.70	EPS $2.67	EPS $2.46

금일 예정	발표 시각(한국 기준)	예상치	이전
ASML (ASML)	14:00	EPS $7.45	EPS $8.60
뱅크오브아메리카 (BAC)	19:45	EPS $1.01	EPS $0.98
모간스탠리 (MS)	20:30	EPS $3.00	EPS $2.68

KOSPI - 투자주체별 동향

KOSPI	04월 14일		순매수 추이 (억원)		
	매수	매도	전거래일	5일 누적	3개월 누적
외국인	96,401	88,125	**8,276**	51,904	-561,343
기관계	66,894	54,349	**12,545**	5,958	186,720
금융투자	28,434	14,921	**13,513**	44,567	278,938
은행	127	256	**-129**	-31,196	-30,544
투신	4,319	4,671	**-353**	-2,691	-15,801
사모펀드	3,908	3,452	**456**	624	-15,801
보험	943	1,596	**-652**	-1,476	-40,004
연기금	29,103	29,358	**-256**	-4,439	466
기타법인	5,790	2,692	**3,098**	22,375	161,639
개인	102,201	126,120	**-23,919**	-80,237	212,984

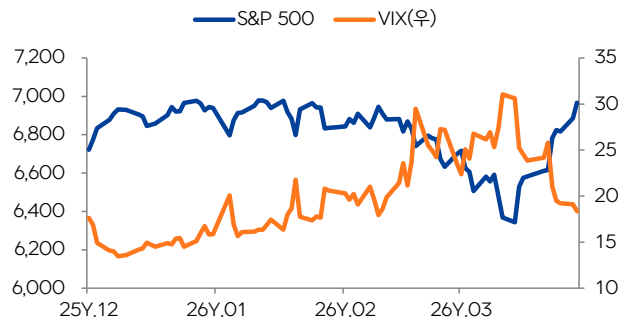
출처 : Infomax, 삼성선물

KOSDAQ - 투자주체별 동향

KOSDAQ	04월 14일		순매수 추이 (억원)		
	매수	매도	전거래일	5일 누적	3개월 누적
외국인	30,203	30,266	**-64**	-3,426	26,992
기관계	7,796	9,083	**-1,288**	-2,630	114,624
금융투자	2,364	3,818	**-1,453**	-2,659	129,178
은행	8	5	**4**	-23	-214
투신	2,804	2,492	**312**	749	2,449
사모펀드	1,079	1,257	**-179**	326	-9,182
보험	210	181	**30**	143	-918
연기금	1,308	1,162	**146**	-778	763
기타법인	1,364	1,173	**191**	-348	-32,023
개인	105,488	104,328	**1,160**	6,404	-109,594

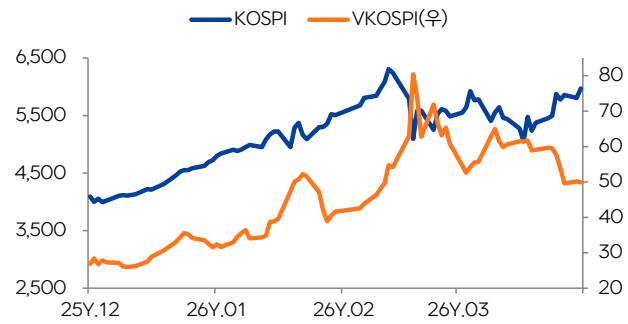
출처 : Infomax, 삼성선물

S&P 500, VIX 지수 추이



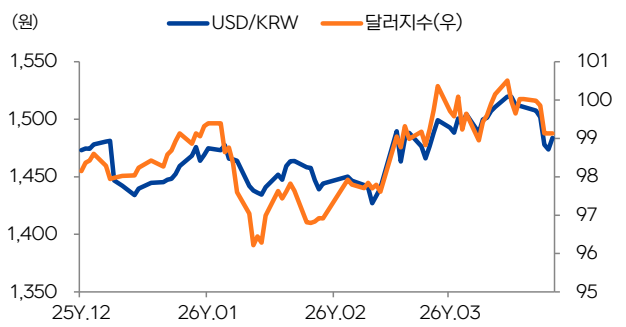
출처 : Bloomberg, 삼성선물

KOSPI, VKOSPI 지수 추이



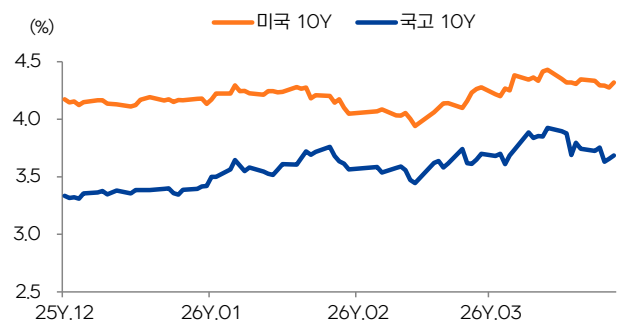
출처 : Bloomberg, 삼성선물

달러/원 환율 및 달러지수 추이



출처 : Bloomberg, 삼성선물

한국, 미국 채권 10년물 금리 추이



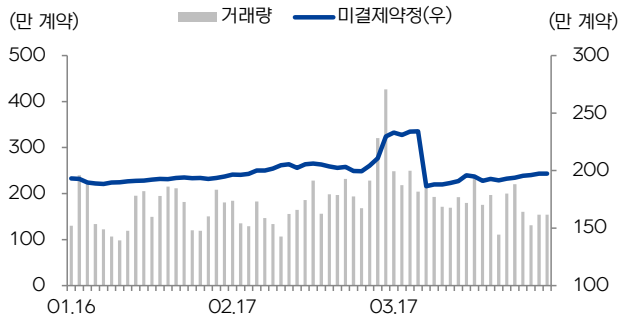
출처 : Bloomberg, 삼성선물

미국 지수선물 시세

	월물	시가	고가	저가	정산가	등락폭	등락률	거래량	미결제약정	미결제약정 증감	베이시스	잔존만기
E-mini S&P 500	JUN	6,925.25	7,008.00	6,920.25	7,004.75	+82.00	+1.2%	1,243,086	1,954,184	+11,349	37.37	64
	SEP	6,979.25	7,060.75	6,974.00	7,059.00	+83.00	+1.2%	1,210	18,313	+681	91.62	156
E-mini NASDAQ 100	JUN	25,575.25	26,003.25	25,560.00	25,996.75	+453.25	+1.8%	461,436	254,853	+5,248	154.75	64
	SEP	25,802.25	26,242.75	25,800.00	26,233.50	+458.25	+1.8%	603	827	+12	391.50	156

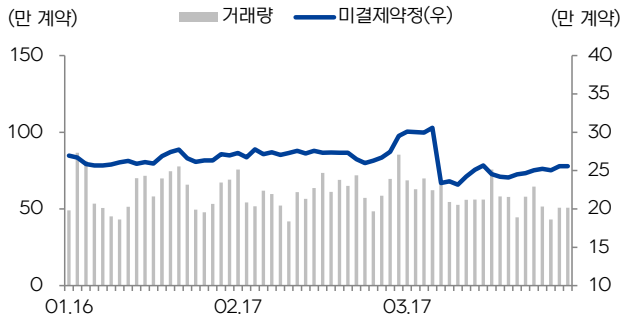
* 미결제약정은 2거래일 전 수치

E-mini S&P 500 선물 거래량과 미결제약정 추이



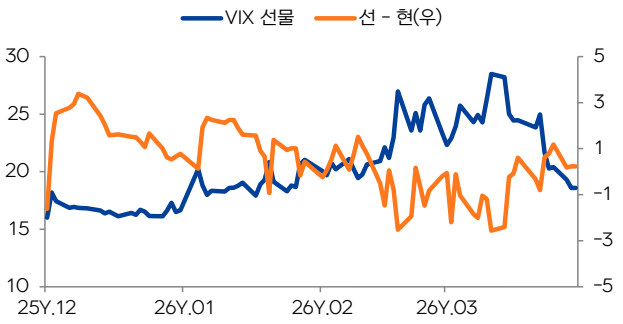
출처 : Bloomberg, 삼성선물

E-mini NASDAQ 100 선물 거래량과 미결제약정 추이



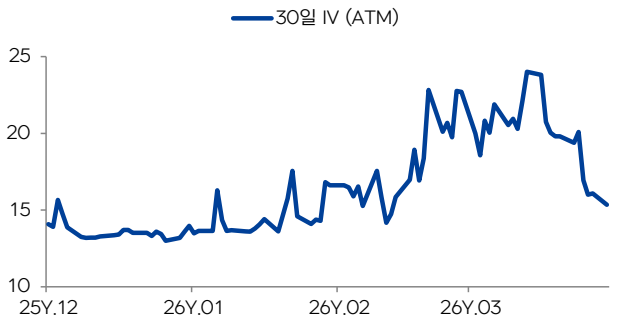
출처 : Bloomberg, 삼성선물

VIX 선물



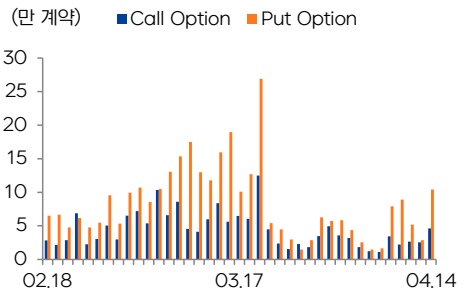
출처 : Bloomberg, 삼성선물

E-mini S&P 500 선물옵션 내재변동성 추이



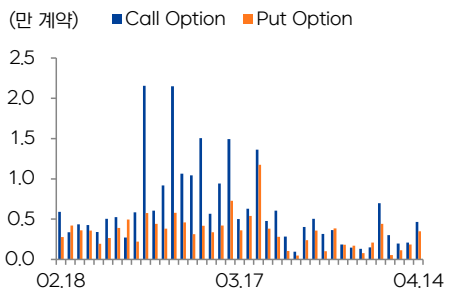
출처 : Bloomberg, 삼성선물

S&P 500 선물 콜, 풋 옵션 거래량



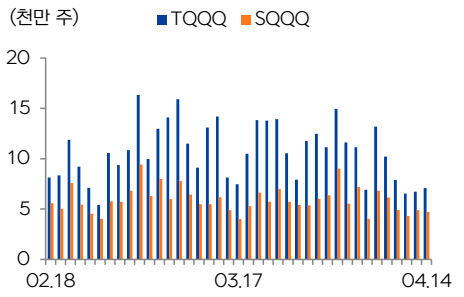
출처 : Bloomberg, 삼성선물

NASDAQ 100 선물 콜, 풋 옵션 거래량



출처 : Bloomberg, 삼성선물

주요 파생상품 ETF 거래량



출처 : Bloomberg, 삼성선물

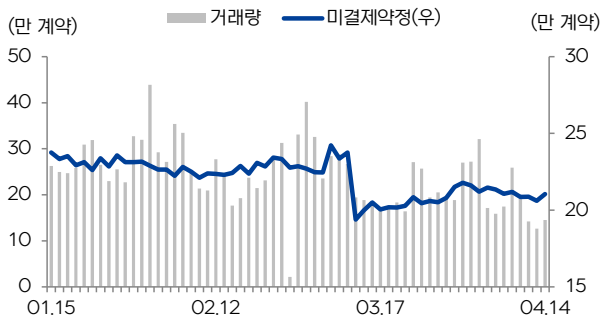
Technical Analysis

			PIVOT POINT					DEMARK		Moving Average			
현물	종가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
S&P 500	6,967.38	+81.14	6,883.07	6,925.23	6,947.32	6,989.48	7,011.57	7,000.53	6,936.28	6,855.60	6,719.32	6,628.30	6,788.34
NASDAQ	23,639.08	+455.34	23,228.97	23,434.03	23,536.55	23,741.61	23,844.13	23,792.87	23,485.29	23,036.62	22,450.81	22,083.39	22,663.31
선물 (E-mini)	정산가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
S&P 500	7,004.75	+82.00	6,889.92	6,947.33	6,977.67	7,035.08	7,065.42	7,050.25	6,962.50	6,893.95	6,763.98	6,662.37	6,806.98
NASDAQ 100	25,996.75	+453.25	25,410.08	25,703.42	25,853.33	26,146.67	26,296.58	26,221.63	25,778.38	25,429.45	24,850.75	24,438.25	24,916.28

국내 지수선물 시세 (주간 거래)

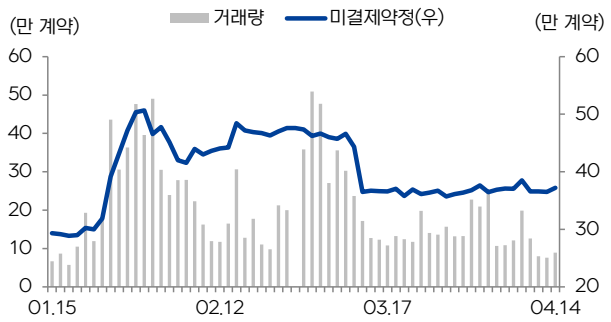
	월물	시가	고가	저가	정산가	등락폭	등락률	거래량	미결제약정	미결제약정	베이시스	잔존만기
KOSPI 200	JUN	900.15	911.70	894.85	901.90	+29.90	+3.4%	123,530	203,104	+56	4.90	57
	SEP	905.00	915.75	899.60	903.95	+27.40	+3.1%	90	1,698	-	6.95	148
KOSPI 200 Spread		4.00	4.15	3.95	4.05	+0.10		227				
MINI KOSPI 200	MAY	899.12	910.04	893.44	900.24	+29.38	+3.4%	119,684	21,656	+689	3.24	29
	JUN	900.34	911.70	894.98	901.90	+29.90	+3.4%	1,223	2,229	+24	4.90	57
KOSDAQ 150	JUN	1,916.20	1,922.70	1,879.10	1,893.00	+18.60	+1.0%	87,756	371,792	+11	10.46	57

KOSPI 200 선물 거래량과 미결제약정 추이



출처 : Bloomberg, 삼성선물

KOSDAQ 150 선물 거래량과 미결제약정 추이



출처 : Bloomberg, 삼성선물

KOSPI 200 선물 투자자 동향

KOSPI 200	04월 14일		순매수 추이 (계약)		
	매수	매도	전거래일	5일 누적	만기일 후 누적
외국인	102,515	95,365	**7,150**	17,132	19,054
기관계	15,510	23,456	**-7,946**	-20,066	-18,404
금융투자	8,672	18,611	**-9,939**	-22,379	-23,322
은행	125	108	**17**	-25	-13
투신	5,284	3,362	**1,922**	1,447	4,234
보험	298	113	**185**	719	762
연기금	1,129	1,262	**-133**	172	-60
기타법인	901	954	**-53**	204	194
개인	26,779	25,930	**849**	2,730	-844

출처 : Infomax, 삼성선물

전거래일 거래량 상위 개별주식선물

	선물가	등락률	거래량	미결제약정	기초자산
삼성전자	207,500	+3.0%	1,449,355	4,069,193	206,500
대우건설	23,300	-1.5%	515,405	314,333	23,500
SK하이닉스	1,110,000	+6.3%	449,072	1,025,027	1,103,000
미래에셋증권	72,400	+10.5%	342,463	290,836	72,400
한화솔루션	41,950	+5.9%	283,740	155,128	42,150
GS건설	37,400	+3.3%	167,661	114,741	37,450
삼성E&A	52,100	+4.8%	151,273	81,823	51,800
한국전력	44,650	+5.9%	146,754	175,796	44,350
삼성중공업	28,000	+0.9%	101,827	343,131	27,900
DL이앤씨	99,500	+5.0%	97,492	56,118	99,000

출처 : Infomax, 삼성선물

전거래일 지수옵션 투자자 동향

콜옵션		구분	풋옵션	
거래수량	거래대금		거래수량	거래대금
순매수 (계약)	순매수 (백만원)		순매수 (계약)	순매수 (백만원)
711	2,737	외국인	7,611	9,044
-527	-2,270	기관계	246	-2,112
-59	-1,074	금융투자	319	-2,111
-165	-310	개인	-7,033	-6,335

출처 : Infomax, 삼성선물

KOSPI 프로그램 매매 동향

	전거래일 (백만원)			누적 5일 (백만원)	
	차익	비차익	총합	차익	비차익
외국인	-	836,206	836,206	-	1,366,667
금융투자	121,472	-58,259	63,213	523,836	-29,666
투신	-58,259	36,212	-22,047	-29,666	39,774
연기금	9,083	-31,999	-22,916	18,508	-161,544
총합	166,800	617,807	784,607	582,269	596,657

출처 : Infomax, 삼성선물

Technical Analysis

			PIVOT POINT					DEMARK		Moving Average			
현물	종가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
KOSPI	5,967.75	+159.13	5,889.34	5,928.55	5,977.53	6,016.74	6,065.72	6,041.23	5,953.04	5,857.12	5,632.08	5,581.06	5,450.74
KOSDAQ	1,121.88	+22.04	1,114.08	1,117.98	1,121.95	1,125.85	1,129.82	1,127.84	1,119.97	1,096.24	1,080.16	1,104.32	1,102.27
선물	정산가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
KOSPI 200	901.90	+29.90	885.97	893.93	902.82	910.78	919.67	915.23	898.38	890.76	855.76	835.95	811.62
KOSDAQ 150	1,893.00	+18.60	1,854.67	1,873.83	1,898.27	1,917.43	1,941.87	1,907.85	1,864.25	1,885.08	1,853.44	1,907.77	1,920.63