SAMSUNG FUTURES

Global Equity Index Futures

일부 우려 불구 낙관론 유지되며 재차 상승

Daily | 2026. 4. 17. (금)

삼성선물 리서치센터
ssfresearch@samsung.com

글로벌 지수

미국 증시	종가	등락률
S&P 500	7,041.28	+0.3%
NASDAQ	24,102.70	+0.4%
Dow Jones	48,578.72	+0.2%
VIX	17.94	-1.3%
유럽, 아시아 증시	**종가**	**등락률**
EURO STOXX 50	5,933.28	-0.1%
DAX	24,154.47	+0.4%
Nikkei 225	59,518.34	+2.4%
Hang Seng	26,394.26	+1.7%
국내 증시	**종가**	**등락률**
KOSPI	6,226.05	+2.2%
KOSDAQ	1,162.97	+0.9%
VKOSPI	50.47	-2.9%

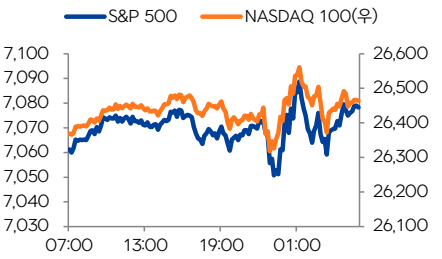
FICC

종류	전일	등락폭/률
달러지수	98.21	△ 0.15
USD/KRW	1,479.20	△ 3.70
미 국채 10년물 (%)	4.313	+2.8bp
미 국채 2년물 (%)	3.778	+1.3bp
국고채 10년물 (%)	3.672	+1.7bp
국고채 3년물 (%)	3.337	+0.4bp
WTI 선물 ($/배럴)	94.69	+3.7%
금 선물 ($/oz)	4,808.30	-0.3%

KOSPI 200 선물 야간시장 동향

일자	종가	등락폭	거래량	미결제약정	미결증감
04/17	945.95	+2.15	24,307	200,598	-331
04/16	923.00	-1.75	20,157	200,448	-654
04/15	929.35	+27.45	20,672	203,160	+56

일중 미국 지수 선물 변동



전일 동향 – 기술주 주도 강세로 최고치 랠리 지속

전일 국내 증시는 코스피 지수 사상 최고치 레벨 근접하며 강세 마감(KOSPI 200 F +2.06%, KOSPI +2. 21%, KOSDAQ +0.91 %). 코스피200 지수 선물은 야간 거래에서의 막판 상승세 이어가며 개장 초반 강보합권에서 머무름. 이후 약 5천 계약 규모의 대규모 외국인 순매수 유입되며 상승폭을 확대하며 초반 주춤했던 반도체 업종이 SK하이닉스의 ADR 상장 일정 구체화 및 삼성전자 – 테슬라 협력 기대감 확대에 상승 전환하며 코스피 선물은 940선을 돌파. TSMC의 분기 실적 발표에 대한 기대감 또한 지수 움직임에 긍정적으로 작용한 것으로 판단. 이에 장중 평균치 기준 베이시스 축소되었으나, 여전히 4pt 상회하며 높은 레벨 유지한 가운데 사흘 연속으로 프로그램 차익거래 순매수 꾸준히 유입되었고, 코스피 지수는 6,200선 안착하며 마감. HD현대중공업 신규 수주 발표 전후로 급등한 조선 업종과 더불어 현대차 중심으로 피지컬AI 기대 재부상하며 지수 강세를 주도. 한편, 코스닥 지수는 공시 위반 심의 회부 소식에 급락한 삼천당제약 하방 압력에 상대적 약세를 보임. 야간 거래에서 코스피 선물은 미국 증시 최고치 랠리 연동되어 소폭 상승. 금일 지수 선물은 주말간 이란 관련 불확실성 경계 속 외국인 매수세 지속 여부 주목하며 제한된 움직임 속 추가 상승 시도할 전망.

미국 증시는 나스닥의 '09년 이후 최장 기간 연속 상승 속 강세 마감(S&P 500 +0.26%, NASDAQ +0.36%, DOW +0.24%). 정규장 개장 전 지수 선물은 사상 최대 순이익 기록하며 '26년 매출 성장률 전망치 상향 조정(약 30% → 30% 이상)한 TSMC 실적 소화하며 상승세를 이어감. 다만, 설비투자 규모를 1월 제시했던 범위의 상단인 $560억으로 발표한 점이 마진 감소 우려로 이어지며 동사 주가 하락세 보였고, 이란 의회가 호르무즈 해협에 강제 통행료를 부과하는 법안을 추진한다는 소식 등에 상승 전환한 국제유가가 부담으로 작용하기도. 한편, 이스라엘과 레바논이 10일간 휴전에 합의했다는 소식이 일부 안도감을 제공했으나, 걸프 지역 및 유럽 일부 국가들이 미국과 이란간 합의까지 6개월 소요를 예측하고 있다는 소식에 지수는 하방 압력에 노출되기도. 이에 최근 마이크로소프트와 오라클이 각각 신규 파트너십 체결 발표한 가운데 낙폭 과대했던 소프트웨어 업종을 중심으로 에너지 섹터가 지수 상승을 견인하며 S&P 500과 나스닥 지수는 이틀 연속으로 사상 최고치를 경신.

증시 이슈 – 유가 영향 제한되며 낙관론 유지 속 변동성 상승 대비 필요

블룸버그 분석에 따르면 3월 이후 나타났던 지수와 유가간 강한 역의 상관관계는 전주 미국 – 이란간 휴전 발표 이후 급격히 약화되고 있는 추세. 이는 호르무즈 해협 관련 불확실성 지속되고 있음에도 미국과 이란이 곧 협상을 재개할 것이라는 기대감 속 시장의 낙관론이 유지되고 있음을 시사. 한편, 미국 지수 선물은 2분기 가이던스 실망에 급락한 넷플릭스 실적 영향에 하락 출발한 가운데 금일 옵션 만기 예정되어 있어 향후 변동성 상승 전환에 대비할 필요.

현물 시세

	시가	고가	저가	종가	등락폭	1D 등락률	5D 등락률	1M 등락률	YTD 등락률	거래량(천주)	거래대금
S&P 500	7,037.78	7,051.23	7,008.52	7,041.28	+18.33	+0.3%	+3.2%	+5.1%	+2.9%	829,029	$121.06B
NASDAQ	24,062.45	24,156.18	23,894.91	24,102.70	+86.68	+0.4%	+5.6%	+7.7%	+3.7%	1,568,449	$105.86B
Dow Jones	48,557.82	48,683.45	48,337.38	48,578.72	+115.00	+0.2%	+0.8%	+3.5%	+1.1%	129,958	$28.28B
Russell 2000	2,713.99	2,720.05	2,700.94	2,719.60	+5.94	+0.2%	+3.2%	+8.6%	+9.6%	803,781	$18.21B
KOSPI	6,149.49	6,231.03	6,126.06	6,226.05	+134.66	+2.2%	+7.8%	+10.4%	+47.7%	925,695	₩27.05T
KOSDAQ	1,163.00	1,168.77	1,156.31	1,162.97	+10.54	+0.9%	+8.1%	+2.3%	+25.7%	1,781,619	₩16.85T
KOSPI 200	925.05	938.87	920.93	937.87	+21.27	+2.3%	+8.3%	+11.5%	+54.8%	217,984	₩21.87T

* 미국 지수 거래량 및 거래대금은 2거래일 전 수치

주요 경제지표 및 실적 발표

전일 발표	실제	예상치	이전
넷플릭스 (NFLX)	EPS $1.23	EPS $0.76	EPS $0.56
펩시코 (PEP)	EPS $1.61	EPS $1.55	EPS $2.26

금일 예정	발표 시각(한국 기준)	예상치	이전

KOSPI - 투자주체별 동향

KOSPI	04월 16일		순매수 추이 (억원)		
	매수	매도	전거래일	5일 누적	3개월 누적
외국인	86,581	81,767	**4,814**	24,126	-559,356
기관계	64,161	53,378	**10,783**	14,966	181,883
금융투자	21,833	9,372	**12,460**	30,241	279,921
은행	165	172	**-7**	-137	-30,472
투신	3,700	4,283	**-583**	-5,256	-19,531
사모펀드	3,483	3,672	**-189**	-3,096	-19,531
보험	559	1,006	**-447**	-3,068	-40,840
연기금	34,371	34,670	**-299**	-3,819	265
기타법인	5,851	3,399	**2,453**	17,384	164,322
개인	113,875	131,924	**-18,050**	-56,476	213,152

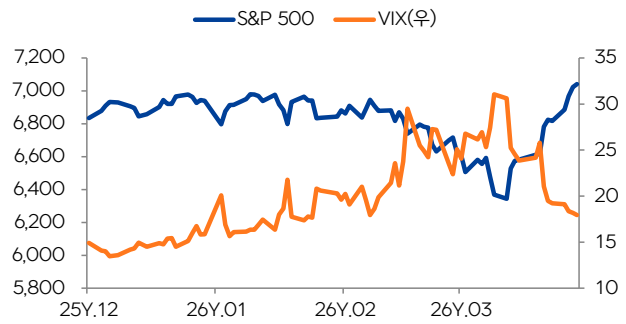
출처 : Infomax, 삼성선물

KOSDAQ - 투자주체별 동향

KOSDAQ	04월 16일		순매수 추이 (억원)		
	매수	매도	전거래일	5일 누적	3개월 누적
외국인	33,359	35,821	**-2,463**	-1,828	24,430
기관계	7,966	8,606	**-640**	-153	115,641
금융투자	2,647	3,694	**-1,047**	-4,052	126,550
은행	7	5	**2**	-6	-199
투신	1,899	1,887	**12**	1,950	3,196
사모펀드	1,761	1,254	**507**	2,167	-6,894
보험	224	170	**54**	237	-717
연기금	1,420	1,479	**-59**	16	947
기타법인	1,246	1,748	**-502**	-2,020	-33,516
개인	125,899	122,294	**3,605**	4,000	-106,555

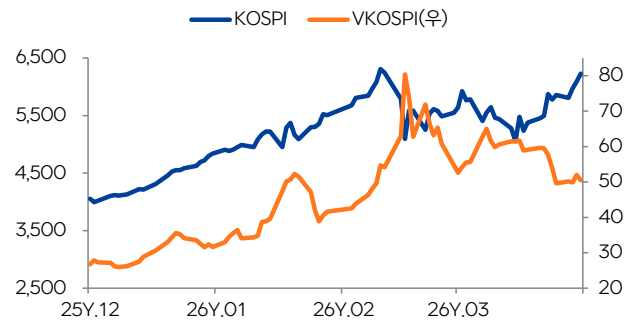
출처 : Infomax, 삼성선물

S&P 500, VIX 지수 추이



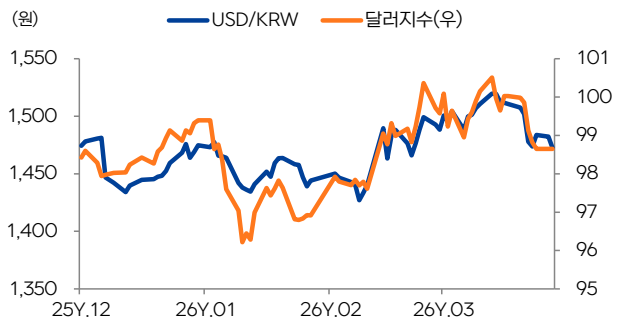
출처 : Bloomberg, 삼성선물

KOSPI, VKOSPI 지수 추이



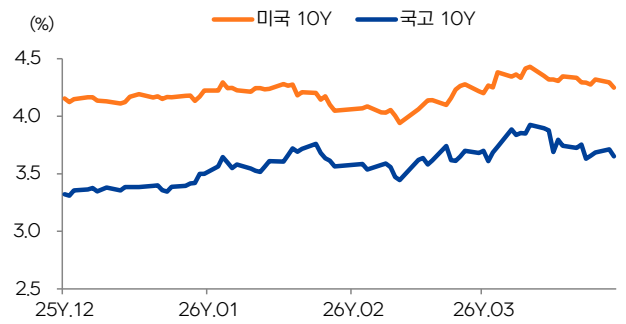
출처 : Bloomberg, 삼성선물

달러/원 환율 및 달러지수 추이



출처 : Bloomberg, 삼성선물

한국, 미국 채권 10년물 금리 추이



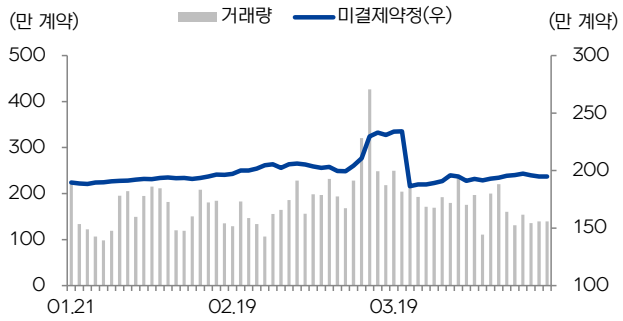
출처 : Bloomberg, 삼성선물

미국 지수선물 시세

	월물	시가	고가	저가	정산가	등락폭	등락률	거래량	미결제약정	미결제약정 증감	베이시스	잔존만기
E-mini S&P 500	JUN	7,057.25	7,089.00	7,046.50	7,077.00	+16.50	+0.2%	1,291,956	1,927,501	-11,727	35.72	62
	SEP	7,114.50	7,142.75	7,101.50	7,131.75	+16.50	+0.2%	1,434	19,051	+331	90.47	154
E-mini NASDAQ 100	JUN	26,350.00	26,564.00	26,275.50	26,487.25	+121.75	+0.5%	577,694	263,285	+3,943	154.25	62
	SEP	26,585.50	26,803.25	26,539.00	26,728.75	+122.00	+0.5%	631	921	+77	395.75	154

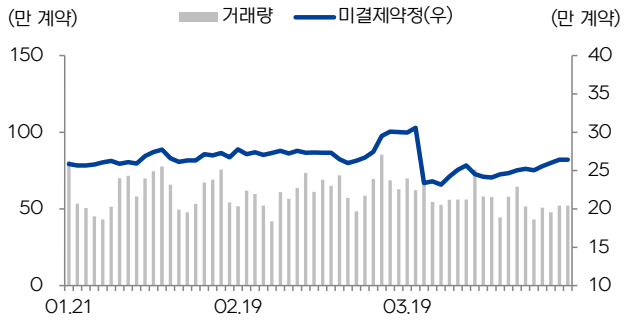
* 미결제약정은 2거래일 전 수치

E-mini S&P 500 선물 거래량과 미결제약정 추이



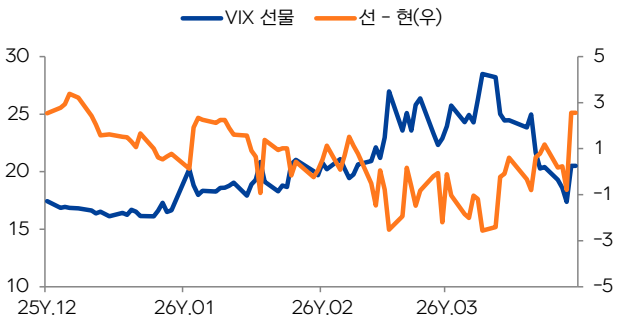
출처 : Bloomberg, 삼성선물

E-mini NASDAQ 100 선물 거래량과 미결제약정 추이



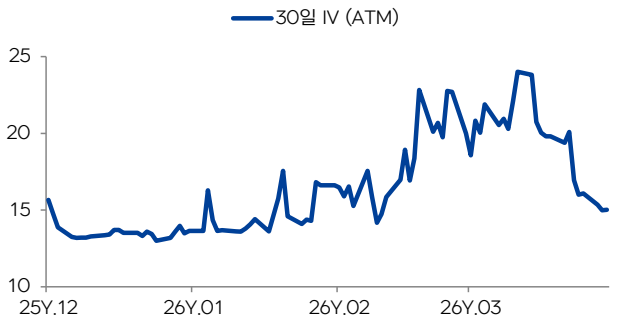
출처 : Bloomberg, 삼성선물

VIX 선물



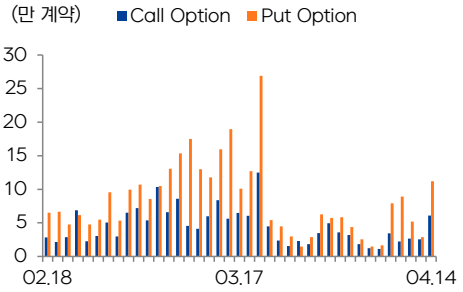
출처 : Bloomberg, 삼성선물

E-mini S&P 500 선물옵션 내재변동성 추이



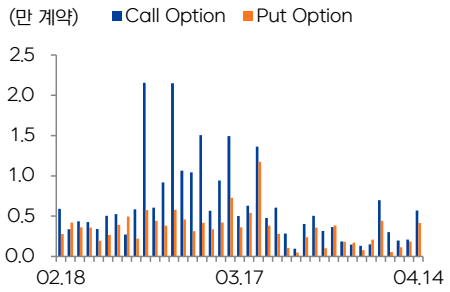
출처 : Bloomberg, 삼성선물

S&P 500 선물 콜, 풋 옵션 거래량



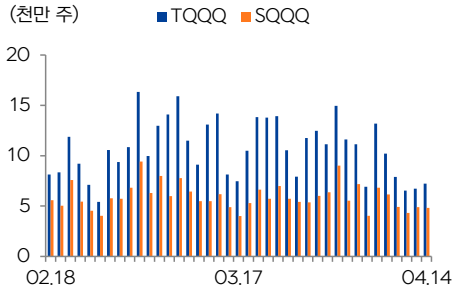
출처 : Bloomberg, 삼성선물

NASDAQ 100 선물 콜, 풋 옵션 거래량



출처 : Bloomberg, 삼성선물

주요 파생상품 ETF 거래량



출처 : Bloomberg, 삼성선물

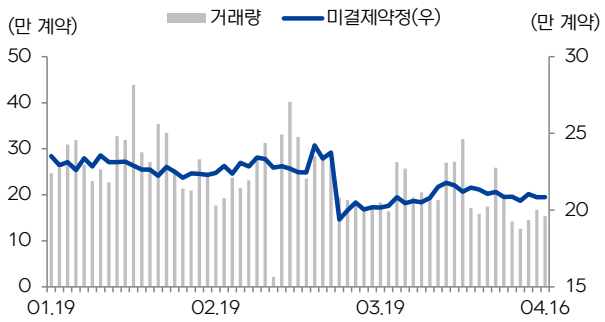
Technical Analysis

			PIVOT POINT					DEMARK		Moving Average			
현물	종가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
S&P 500	7,041.28	+18.33	6,990.97	7,016.12	7,033.68	7,058.83	7,076.39	7,067.61	7,024.90	6,946.95	6,815.36	6,664.47	6,793.80
NASDAQ	24,102.70	+86.68	23,789.99	23,946.35	24,051.26	24,207.62	24,312.53	24,260.08	23,998.81	23,568.89	22,919.52	22,257.73	22,690.79
선물 (E-mini)	정산가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
S&P 500	7,077.00	+16.50	7,028.33	7,052.67	7,070.83	7,095.17	7,113.33	7,104.25	7,061.75	6,984.05	6,853.73	6,707.48	6,813.61
NASDAQ 100	26,487.25	+121.75	26,153.75	26,320.50	26,442.25	26,609.00	26,730.75	26,669.88	26,381.38	25,934.85	25,294.75	24,640.96	24,953.83

국내 지수선물 시세 (주간 거래)

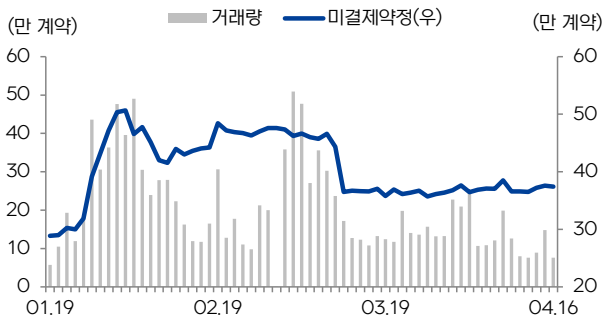
	월물	시가	고가	저가	정산가	등락폭	등락률	거래량	미결제약정	미결제약정	베이시스	잔존만기
KOSPI 200	JUN	925.95	943.80	925.15	943.80	+19.05	+2.1%	133,274	200,929	-331	5.93	55
	SEP	931.55	947.05	931.00	945.85	+20.80	+2.2%	125	1,817	-3	7.98	146
KOSPI 200 Spread		4.25	4.40	4.20	4.40	+0.15		179				
MINI KOSPI 200	MAY	923.90	941.70	923.34	941.70	+18.84	+2.0%	136,104	36,153	-31	3.83	27
	JUN	925.50	943.42	925.50	943.80	+19.05	+2.1%	1,215	2,504	+21	5.93	55
KOSDAQ 150	JUN	1,973.50	1,986.10	1,961.70	1,976.00	+17.90	+0.9%	74,259	373,891	-73	9.18	55

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 16일		순매수 추이 (계약)		
	매수	매도	전거래일	5일 누적	만기일 후 누적
외국인	107,777	104,656	**3,121**	13,442	24,704
기관계	18,599	21,433	**-2,834**	-13,940	-25,117
금융투자	11,686	14,801	**-3,115**	-13,374	-29,713
은행	233	225	**8**	-20	-18
투신	3,705	3,490	**215**	-916	3,463
보험	104	38	**66**	519	1,152
연기금	2,871	2,879	**-8**	-154	0
기타법인	1,065	1,127	**-62**	-122	134
개인	26,489	26,714	**-225**	620	279

출처 : Infomax, 삼성선물

전거래일 거래량 상위 개별주식선물

	선물가	등락률	거래량	미결제약정	기초자산
삼성전자	218,500	+3.1%	1,586,061	4,225,646	217,500
대우건설	28,550	+0.4%	914,728	363,228	28,600
대한전선	42,400	+2.3%	439,205	89,419	42,100
두산에너빌리티	111,200	+6.3%	432,226	206,489	110,800
SK하이닉스	1,159,000	+1.7%	278,729	984,299	1,155,000
GS건설	39,500	-4.0%	227,206	136,570	39,550
삼성중공업	28,800	+1.8%	165,340	374,006	28,700
한화솔루션	44,250	+4.0%	148,706	160,722	44,300
한국전력	46,050	+3.4%	144,376	168,469	45,800
한화오션	132,300	+5.1%	117,374	99,226	131,900

출처 : Infomax, 삼성선물

전거래일 지수옵션 투자자 동향

콜옵션		구분	풋옵션	
거래수량	거래대금		거래수량	거래대금
순매수 (계약)	순매수 (백만원)		순매수 (계약)	순매수 (백만원)
-195	277	외국인	-1,207	144
27	-995	기관계	630	756
44	-945	금융투자	539	214
152	287	개인	481	-725

출처 : Infomax, 삼성선물

KOSPI 프로그램 매매 동향

	전거래일 (백만원)			누적 5일 (백만원)	
	차익	비차익	총합	차익	비차익
외국인	-	127,082	127,082	-	1,611,378
금융투자	134,308	28,429	162,737	349,823	179,707
투신	28,429	-	28,429	179,707	43,246
연기금	27,094	-76,464	-49,370	57,070	-222,378
총합	161,427	135,956	297,383	450,289	1,012,446

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	6,226.05	+134.66	6,089.41	6,157.73	6,194.38	6,262.70	6,299.35	6,281.03	6,176.06	5,990.54	5,792.54	5,612.52	5,495.39
KOSDAQ	1,162.97	+10.54	1,150.22	1,156.60	1,162.68	1,169.06	1,175.14	1,165.87	1,153.41	1,126.15	1,094.45	1,104.70	1,109.10
선물	정산가	전일비	2차지지	1차지지	PIVOT	1차저항	2차저항	High	Low	5MA	10MA	20MA	60MA
KOSPI 200	943.80	+19.05	918.93	931.37	937.58	950.02	956.23	953.13	934.48	917.68	885.98	843.93	819.34
KOSDAQ 150	1,976.00	+17.90	1,950.20	1,963.10	1,974.60	1,987.50	1,999.00	1,993.25	1,968.85	1,936.08	1,887.60	1,906.14	1,933.31