



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (104)金管期總字第002號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: (02)2718-0000 FAX: (02)2546-3708

3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4, Taipei, TAIWAN

台指期貨 2018年03月05日 星期一 收盤日報

● 法人動態：

		台股現貨買賣起				個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名				
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今								
外資及陸資	236.80	338.93	-102.13	-286.69	台積電	13.97	大立光	-8.19				
投信	10.19	12.57	-2.38	-3.95	國巨	1.45	鴻海	-4.98				
自營商	59.00	80.05	-21.05	-36.20	台塑	1.14	聯發科	-4.26				
合計	305.99	431.56	-125.56	-326.85	南電	0.64	台塑化	-3.42				
3/2融資(億)	50.04	44.23	5.81	今日 1661.32	智原	0.61	國泰金	-3.16				
3/2融券(張)	33968	28856	-5112	餘額 544929	創意	0.48	富邦金	-2.57				
單位：口	多		空		華新科	0.47	中鋼	-1.98				
3/2摩台03月多空比	2,166		2,123		台達電	0.47	統一	-1.84				
台指期前十大佔市場	56.4%		51.2%		技嘉	0.41	新光金	-1.47				
電子期前十大佔市場	71.4%		65.7%		遠傳	0.35	智邦	-1.19				
金融期前十大佔市場	60.8%		78.8%		前十名合計	19.98	後十名合計	-33.05				
期貨未平倉 多空淨額	台指期		電子期		金融期		台指選擇權(買權)			台指選擇權(賣權)		
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	前日未平倉	增減	未平倉	前日未平倉	增減
外資及陸資	45149	-599	30	-397	-1909	174	41596	40343	1253	77179	74797	2382
投信	-34328	-355	-190	0	49	0	-728	-728	0	-680	-680	0
自營商	-4622	189	394	138	81	-193	-38433	-30853	-7580	-80493	-78590	-1903

● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 0.29%、S&P500漲 0.51%、Nasdaq 漲 1.08%、費半指數漲 1.76%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.35，與前日持平，成交量p/c ratio為 1.17，與前日持平；近月買權最大未平倉量集中在 11200 履約價序列，賣權最大未平倉量集中在 10500 履約價序列。

期現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣超 125.56 億元，其中外資賣超 102.13 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 45149 口，較前日增加 0 口淨多單，投信淨空單留倉 34328 口，自營商淨空單留倉 4622 口。

台灣市場：終場加權指數下跌 0.52%，收在 10642.9 點，成交值 1122.94 億元。櫃買指數終場下跌 0.74%，收在 146.69 點，成交值 307.66 億元。

技術面：受到近期美股電子盤勢拖累、亞洲股市低迷，台股3/5收盤持續走跌，收在10,642.9點。觀察技術面，MACD出現轉弱跡象、RSI、KD亦轉弱呈死亡交叉。觀察選擇權部位，賣權的隱含波動率升至23.19%、買權的隱含波動率升至17.2%，顯示買權、賣權的避險部位皆提高，目前持中性看法。須留意近日義大利的選舉結果，可能將加劇歐洲政治動盪之風險。

● 台指期貨收盤行情

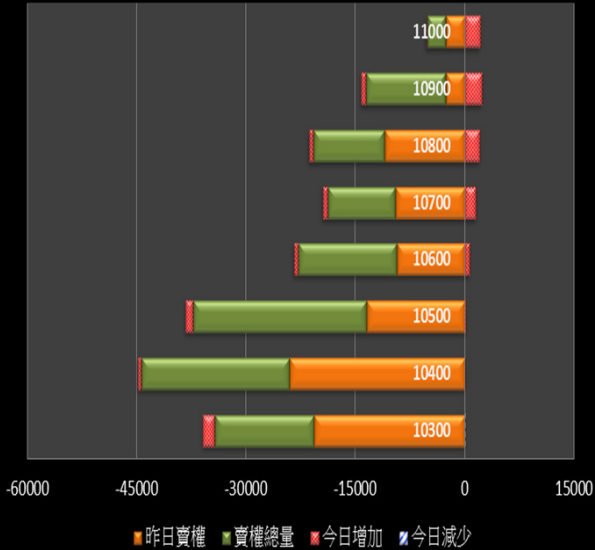
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10642.90	10756.37	10642.90	-55.27		1122億	2.32	1.63	5.28	
03月台指期	10632	10741	10598	-43.00	-0.10	172783	2.26	2.32	3.01	90715
04月台指期	10612	10720	10580	-44.00	-0.29	2605	1.43	1.49	1.50	3436
03月小台指	10632	10741	10598	-44.00	-0.10	124058	1.66	1.70	1.86	28014
04月小台指	10612	10722	10581	-46.00	-0.29	4808	1.35	1.42	1.48	2931
電子指數	444.27	448.65	444.16	-1.34		713億				
03月電子期	443.90	448.25	442.50	-1.30	-0.08	4125	1.31	1.32	1.31	3118
04月電子期	443.20	447.45	442.30	-1.30	-0.24	64	1.23	1.71	1.25	132
金融指數	1199.96	1214.82	1199.96	-11.56		69億				
03月金融期	1198.80	1212.20	1198.00	-9.60	-0.10	2407	1.34	1.37	1.40	3464
04月金融期	1198.00	1210.80	1198.00	-9.60	-0.16	39	1.21	1.31	1.15	71
摩台指	396.18	399.79	395.96	-1.34						
03月摩台指	396.20	399.40	394.60	-0.40	0.01	42211	-	-	1.77	187128
04月摩台指	396.60	398.50	395.10	-1.50	0.11	20	-	-	1.82	62

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

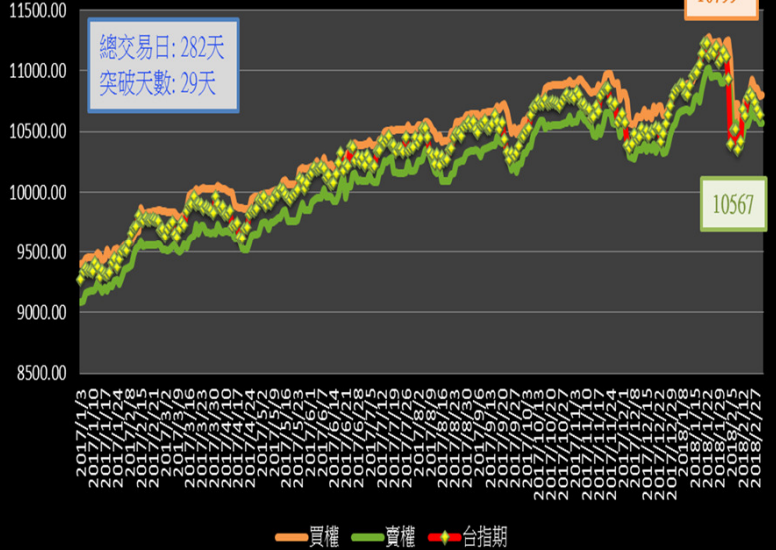


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

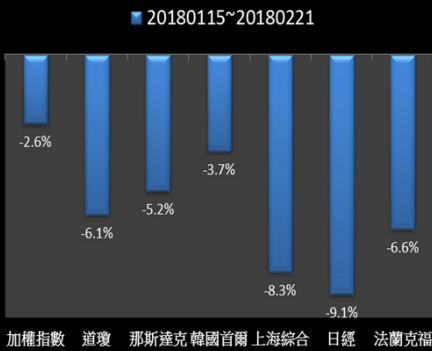


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

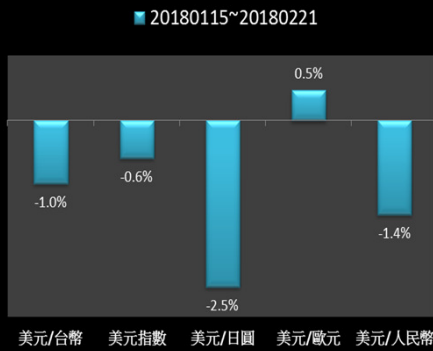


國際指數/商品期貨/外匯行情

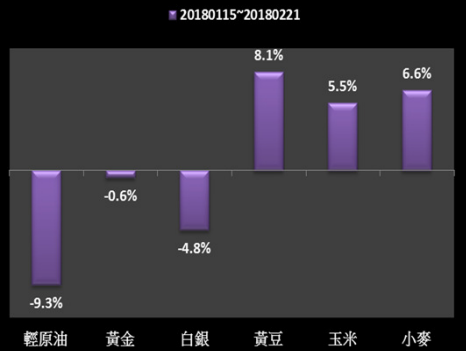
國際股市月績效表現



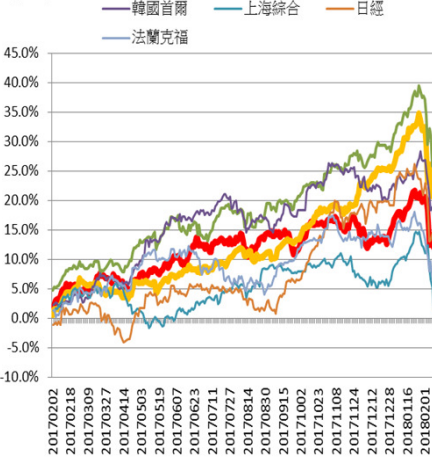
國際外匯月績效表現



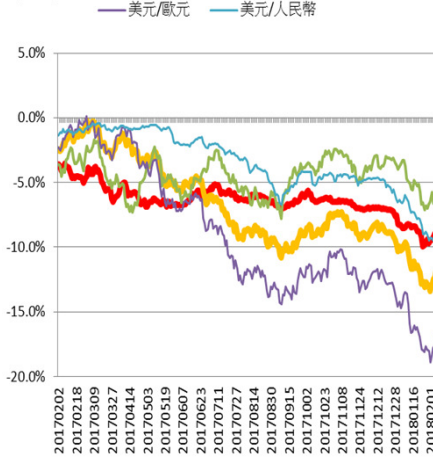
國際商品期貨月績效表現



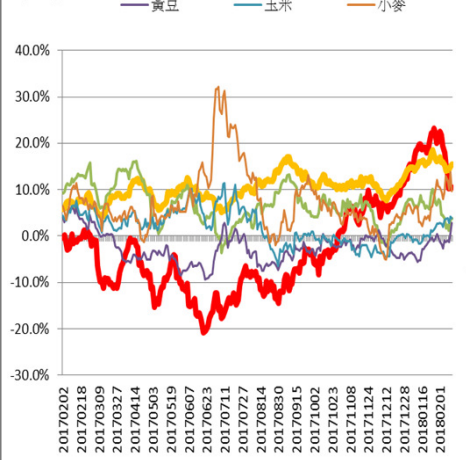
年漲幅



年漲幅



年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>