



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16日 星期五 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					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	744.76	729.12	15.64	-172.57	台化	6.33	大立光	-4.58				
投信	30.56	30.47	0.09	-10.03	南亞	4.00	鴻海	-3.74				
自營商	63.63	75.88	-12.25	-32.94	南亞科	3.41	台塑化	-3.43				
合計	838.95	835.47	3.48	-215.53	統一超	3.18	中信金	-2.10				
3/15融資	68.00	52.82	15.18	今日 1703.10	中華電	2.79	和泰車	-1.67				
3/15融券	33090	23894	-9196	餘額 476753	統一	2.25	研華	-1.38				
單位：口	多		空		兆豐金	1.96	日月光	-1.10				
3/15摩台03月多空比	67		2,119		遠東新	1.93	東元	-0.90				
台指期前十大佔市場	57.5%		47.7%		富邦金	1.84	緯創	-0.89				
電子期前十大佔市場	69.2%		59.8%		寶成	1.64	晶電	-0.67				
金融期前十大佔市場	55.6%		76.9%		前十名合計	29.33	後十名合計	-20.47				
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	41721	-6739	151	-4	-1599	-57	35096	39640	-4544	107074	98949	8125
投信	-29964	-219	8	0	52	0	-808	-808	0	1382	1451	-69
自營商	-570	2788	288	-50	-192	78	-42202	-24417	-17785	-99093	-111414	12321

● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數漲 0.47%、S&P500跌 0.08%、Nasdaq跌 0.2%、費半指數跌 0.1%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.69，與前日持平，成交量p/c ratio為 1，較前日減少 0.2；近月買權最大未平倉量集中在 11000 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買超 3.48 億元，其中外資買超 15.64 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 41721 口，較前日增加 0 口淨多單，投信淨空單留倉 29964 口，自營商淨空單留倉 570 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.08%，收在 11027.7 點，成交值 1663.85 億元。櫃買指數終場上漲 0.01%，收在 154.29 點，成交值 409.75 億元。

技術面：雖然美股Dow Jones Index盤後收高，然受到中美貿易戰、通俄門的影響，美國科技股亦出現走跌，台股電子族群亦出現疲弱。由於台股收盤受到富時指數(FTSE)即將調節台灣50、中型100成份股將於下週一3/19生效，使得台指期、電子期皆未跌深、金融期卻出現小漲。觀察近月台指期的9日KD未呈現走升、日MACD多方量縮，短線將逢高減碼。觀察選擇權全月未平倉量 put/call ratio降至1.55；買權平均隱含波動率降至13.21%，賣權平均隱含波動率降至16.28%。現階段延續中性預期，選擇權可採價差策略。

● 台指期貨收盤行情

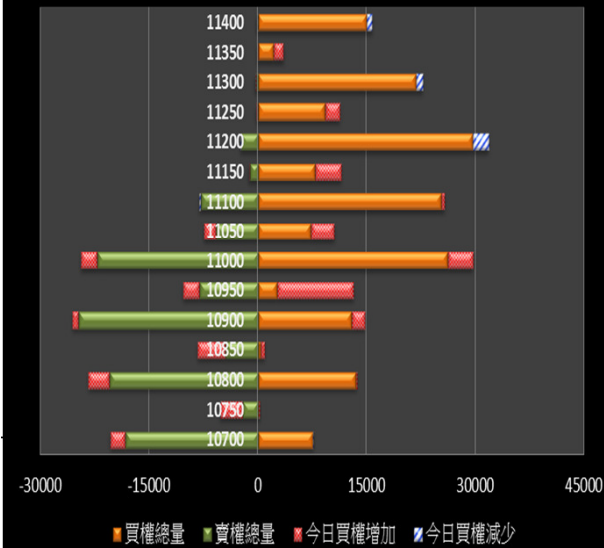
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	11027.70	11054.86	10933.46	9.25		1663億	2.89	2.01	6.03	
03月台指期	11016	11043	10923	-23.00	-0.11	182422	2.33	2.38	2.85	79278
04月台指期	10997	11025	10907	-25.00	-0.28	12259	2.08	2.10	1.92	21080
03月小台指	11016	11043	10922	-24.00	-0.11	127197	1.67	1.74	1.90	33016
04月小台指	10997	11027	10907	-27.00	-0.28	14075	1.49	1.57	1.74	10361
電子指數	464.23	466.02	459.87	-0.67		1092億				
03月電子期	463.60	465.65	459.10	-1.85	-0.14	4518	1.42	1.41	1.38	2327
04月電子期	463.05	465.10	458.70	-1.95	-0.25	603	1.38	1.28	1.24	474
金融指數	1231.82	1233.52	1220.54	6.75		124億				
03月金融期	1231.40	1232.40	1221.80	3.40	-0.03	2322	1.34	1.32	1.42	2769
04月金融期	1230.80	1231.00	1221.80	3.20	-0.08	304	1.21	1.31	1.22	534
摩台指	413.85	415.29	408.97	0.64						
03月摩台指	412.90	414.10	408.50	-0.90	-0.23	70274	-	-	2.27	190953
04月摩台指	413.50	412.80	408.50	-2.00	-0.08	322	-	-	3.46	528

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

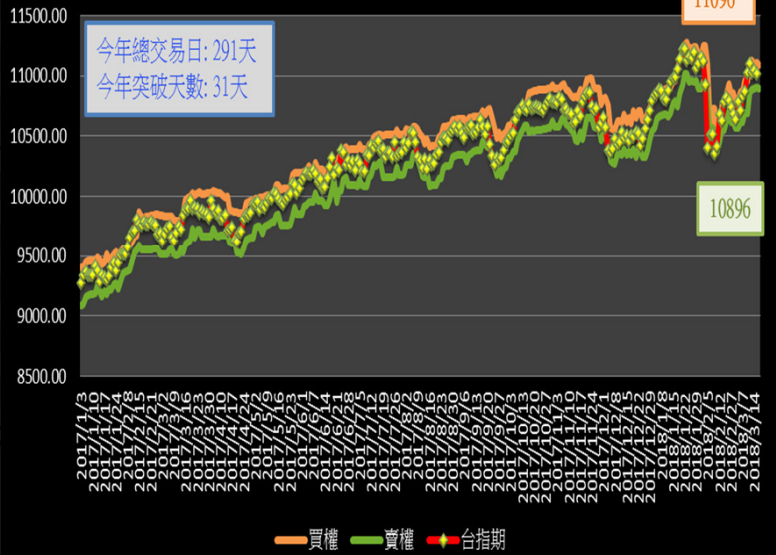


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

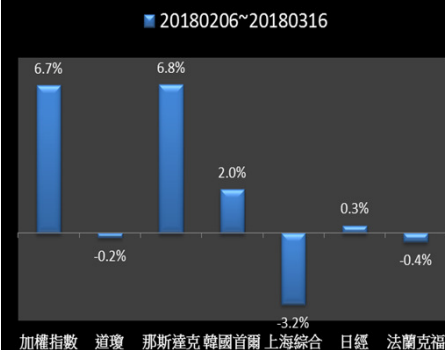


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

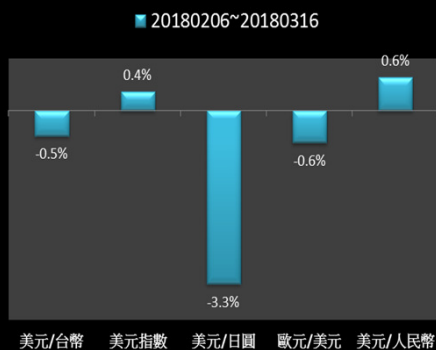


國際指數/商品期貨/外匯行情

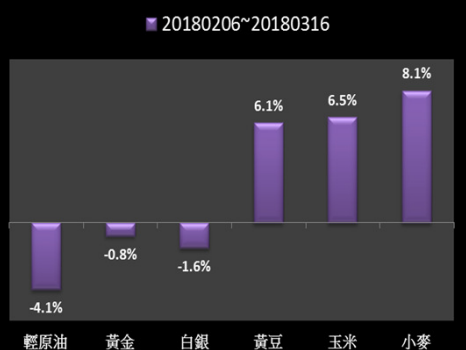
國際股市月績表現



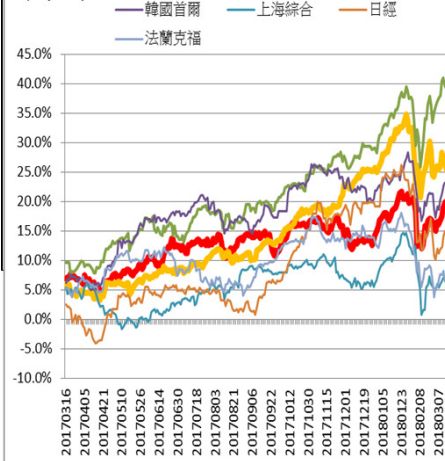
國際外匯月績表現



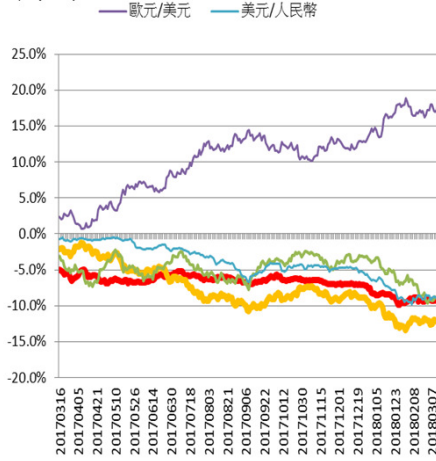
國際商品期貨月績表現



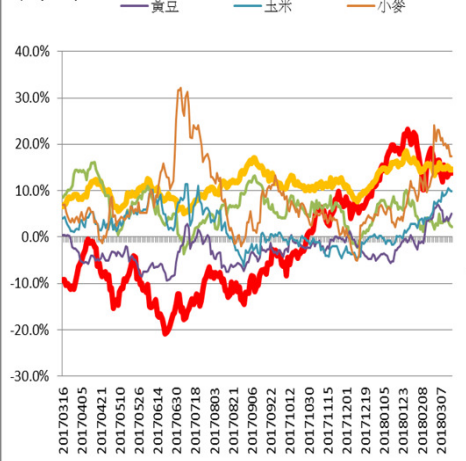
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>