



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22日 星期四 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	348.67	316.05	32.62	-121.61	台塑化	36.00	台積電	-9.33				
投信	13.43	12.24	1.18	-17.30	中華電	2.79	台塑	-5.73				
自營商	69.80	119.73	-49.93	-80.60	鴻海	2.49	南亞科	-2.88				
合計	431.90	448.02	-16.12	-219.50	國巨	2.40	大立光	-2.65				
3/21融資	71.60	66.38	5.22	今日 1718.82	南亞	1.71	台達電	-2.34				
3/21融券	25003	21208	-3795	餘額 414417	台灣大	1.23	統一超	-1.87				
單位：口	多		空		華新科	1.22	大同	-1.43				
3/21摩台03月多空比	157		793		富邦金	1.11	日月光	-1.42				
台指期前十大佔市場	59.9%		50.4%		遠傳	0.70	可成	-1.25				
電子期前十大佔市場	65.6%		52.8%		元大金	0.64	和泰車	-1.18				
金融期前十大佔市場	51.7%		81.5%		前十名合計	50.30	後十名合計	-30.08				
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	45537	1107	-42	-112	-1713	-41	28497	31729	-3232	50808	46337	4471
投信	-31087	-821	8	0	52	0	-682	-682	0	1623	723	900
自營商	-5876	-243	303	-31	-69	-20	-6688	-13591	6903	-67229	-58317	-8912

## ● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 0.18%、S&P500跌 0.18%、Nasdaq跌 0.26%、費半指數漲 0.18%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.74，較前日增加 0.11，成交量p/c ratio為 1.36，較前日增加 0.03；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 10000 履約價序列。

期現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣超 16.12 億元，其中外資買超 32.62 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 45537 口，較前日增加 1107 口淨多單，投信淨空單留倉 31087 口，自營商淨空單留倉 5876 口。

台灣市場：終場加權指數下跌 0.05%，收在 11005.84 點，成交值 1476.71 億元。櫃買指數終場下跌 0.87%，收在 153.49 點，成交值 420.16 億元。

技術面：今3/22凌晨美國FOMC會議上如期將Fed fund rate上調一碼(約0.25個百分點)至1.50%~1.75%區間，使得美元下跌、美股大多呈現跌勢，台股、台指期亦在今3/22呈現小跌。目前台指期、金融期、電子期三大指數期貨均呈逆價差。關於技術面，台指期的日KD續弱向下交叉、日MACD柱狀收斂；週均線MA則呈多頭狀態、週KD值亦向上走升。顯示近日台指期可能面臨盤整格局，但仍持中性偏多的看法。全月選擇權未平倉量(OI)put/call ratio值降至1.38；買權平均隱含波動率降至12.49%、賣權平均隱含波動率降至17.03%。且台指VIX指數亦降至16.13，顯示市場並不悲觀。

## ● 台指期貨收盤行情

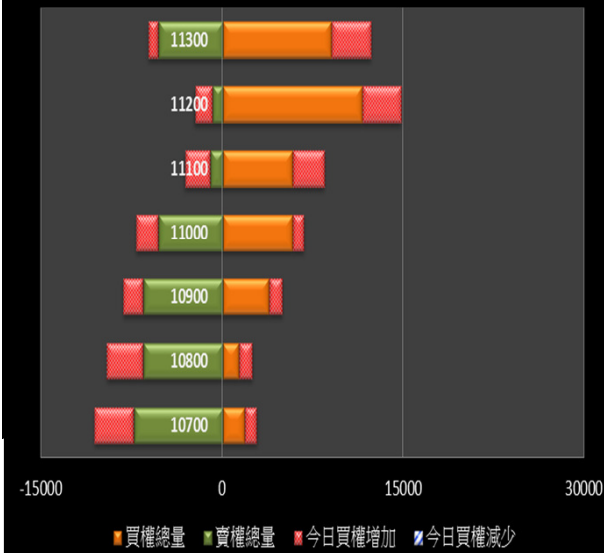
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	11005.84	11120.20	10975.33	-5.23		1476億	2.68	1.94	5.95	
04月台指期	10990	11122	10961	-14.00	-0.14	192202	2.26	2.34	2.82	85132
05月台指期	10967	11096	10940	-12.00	-0.35	1775	1.43	1.51	1.49	774
04月小台指	10990	11122	10961	-13.00	-0.14	148244	1.70	1.76	1.94	24480
05月小台指	10967	11098	10938	-14.00	-0.35	2808	1.25	1.33	1.37	1033
電子指數	463.17	468.79	461.59	-1.81		947億				
04月電子期	462.00	468.60	460.85	-2.10	-0.25	4755	1.34	1.33	1.35	2161
05月電子期	461.20	467.55	461.00	-2.65	-0.43	86	1.71	1.39	1.26	44
金融指數	1229.01	1235.58	1224.10	2.05		72億				
04月金融期	1226.60	1235.80	1222.20	3.80	-0.20	3278	1.37	1.36	1.47	2927
05月金融期	1223.00	1233.80	1223.00	0.20	-0.49	66	1.43	1.47	1.14	38
摩台指	412.72	417.01	411.16	-0.78						
03月摩台指	411.90	417.40	411.00	-1.10	-0.20	53724	-	-	2.02	190065
04月摩台指	411.30	416.40	410.50	-0.80	-0.35	5213	-	-	5.79	5837

&lt;本文僅供參考，並不作任何獲利保證。&gt;

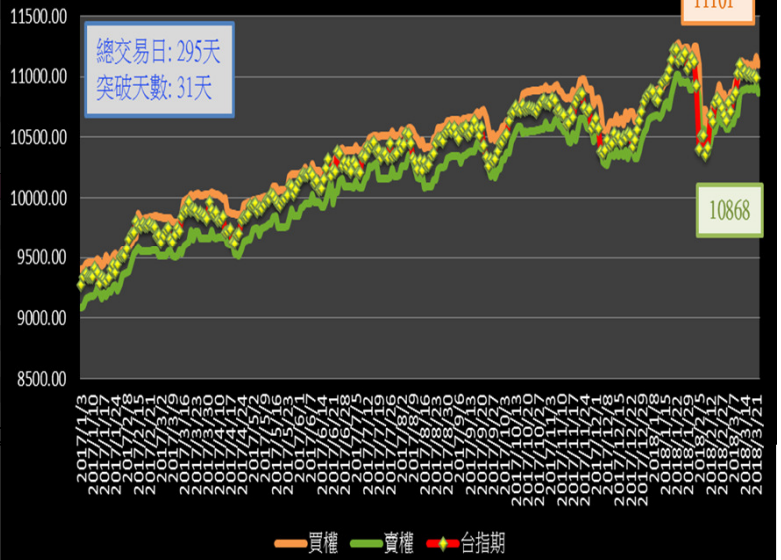


## 台指選擇權未平倉解析

### 近月選擇權未平倉分佈圖

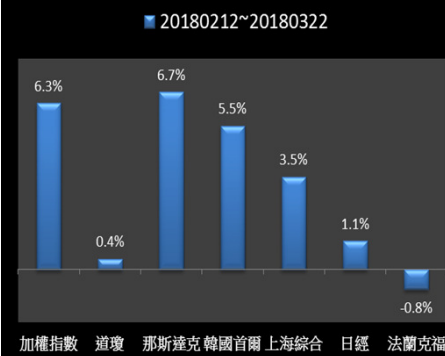


### 近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

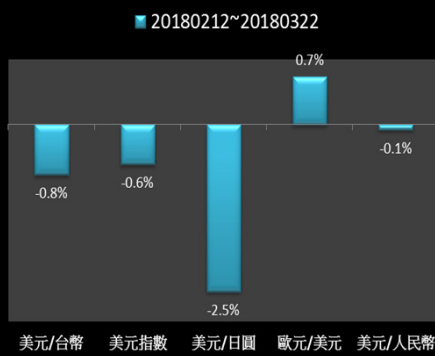


## 國際指數/商品期貨/外匯行情

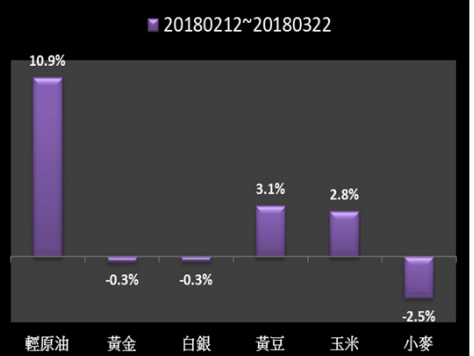
### 國際股市月績效表現



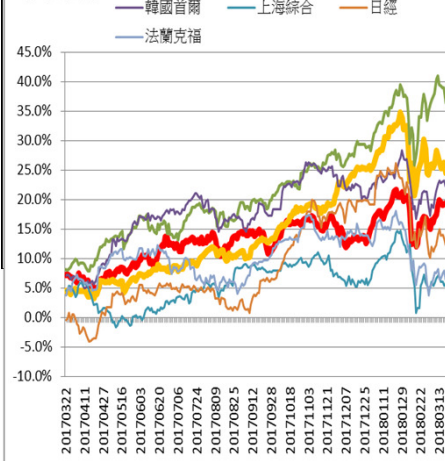
### 國際外匯月績效表現



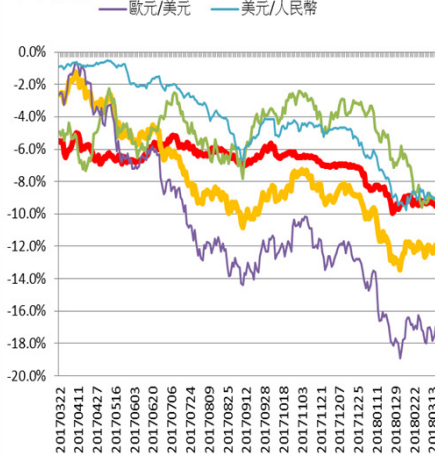
### 國際商品期貨月績效表現



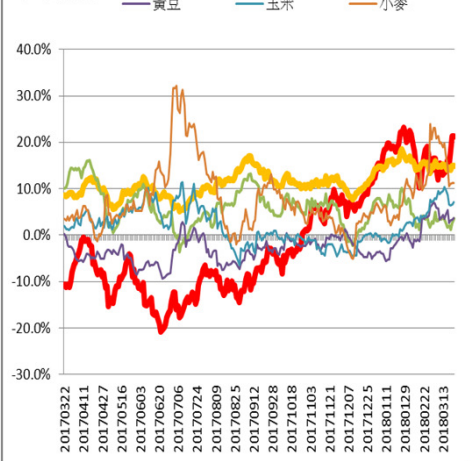
### 今年漲幅



### 今年漲幅



### 今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>