



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23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	331.44	391.76	-60.32	-183.12	台塑化	3.43	台積電	-60.67				
投信	7.42	14.35	-6.93	-24.09	大同	1.68	鴻海	-14.97				
自營商	80.14	118.83	-38.69	-119.29	台塑	1.15	大立光	-9.41				
合計	419.00	524.94	-105.94	-326.50	群聯	0.50	富邦金	-5.53				
3/22融資	81.60	84.02	-2.42	今日 1715.30	潤泰全	0.47	國泰金	-5.43				
3/22融券	37556	56647	19091	餘額 427954	奇力新	0.29	聯發科	-4.55				
單位：口	多		空		華擎	0.24	中信金	-4.21				
3/22摩台03月多空比	114		807		裕日車	0.22	中華電	-4.19				
台指期前十大佔市場	58.0%		50.0%		上銀	0.20	國巨	-2.90				
電子期前十大佔市場	70.2%		55.3%		全新	0.20	南亞	-2.57				
金融期前十大佔市場	52.0%		84.2%		前十名合計	8.37	後十名合計	-114.43				
期貨未平倉	台指期		電子期		金融期		台指選擇權(買權)			台指選擇權(賣權)		
多空淨額	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	45385	-152	-22	20	-1873	-160	38265	28497	9768	57199	50808	6391
投信	-32506	-1419	1	-7	52	0	-682	-682	0	1175	1623	-448
自營商	-6437	-561	302	-1	61	130	-23458	-6688	-16770	-72075	-67229	-4846

● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 2.93%、S&P500跌 2.52%、Nasdaq跌 2.43%、費半指數跌 2.77%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.61，較前日減少 0.13，成交量p/c ratio為 1.48，較前日增加 0.12；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 10200 履約價序列。

期現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣超 105.94 億元，其中外資賣超 60.32 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 45385 口，較前日減少 152 口淨多單，投信淨空單留倉 32506 口，自營商淨空單留倉 6437 口。

台灣市場：終場加權指數下跌 1.66%，收在 10823.33 點，成交值 1460.1 億元。櫃買指數終場下跌 1.87%，收在 150.62 點，成交值 378.54 億元。

技術面：受到美國於今日3/23正式對中國實施301條款的貿易關稅-美總統祭出500億美元的高額課徵，此利空消息使得美股 Dow Jones Index重跌逾-700點、該近月期貨亦重跌逾-990點，關股四大指數均翻黑，進而拖累台股大盤指數大跌逾-180點、台股近月期貨亦大跌逾-250點，並跌破月線，短線MA呈空頭狀態、9日KD值呈向下交叉並擴大。三大近月類股期貨均呈現跌勢，其中近月電子期貨跌幅-2.81%為最大。觀察選擇權全月未平倉量(OI)put/call ratio值降至1.21、VIX指數亦增至20.98高於歷史均值17.99，顯示市場避險現象升高。短線台指期可能呈大區間整理，可考慮持有賣權策略，並須視後續情形調整。

● 台指期貨收盤行情

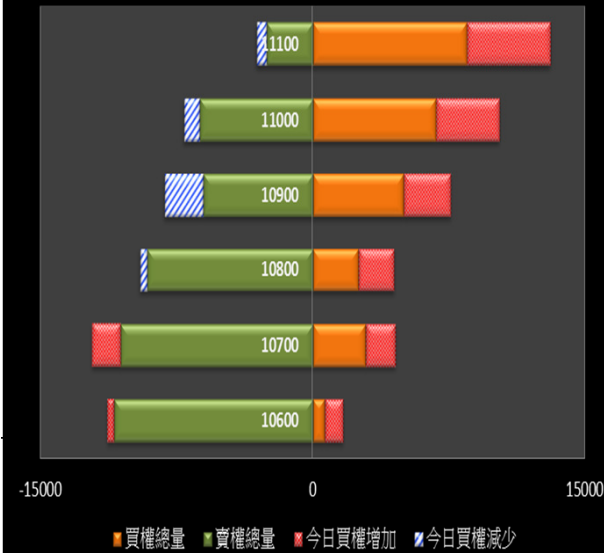
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10823.33	10863.67	10758.06	-182.51		1460億	2.48	1.70	5.57	
04月台指期	10733	10816	10718	-256.00	-0.84	178541	2.20	2.27	2.71	89891
05月台指期	10708	10790	10695	-258.00	-1.08	1698	1.47	1.57	1.62	1223
04月小台指	10733	10817	10715	-257.00	-0.84	134534	1.71	1.74	1.92	26055
05月小台指	10708	10791	10694	-258.00	-1.08	3373	1.28	1.33	1.35	1868
電子指數	452.88	456.12	451.07	-10.29		902億				
04月電子期	448.95	453.60	448.35	-13.00	-0.88	5087	1.41	1.40	1.41	2426
05月電子期	448.00	452.75	448.00	-13.20	-1.09	103	2.03	1.52	1.32	59
金融指數	1209.46	1217.08	1206.35	-19.55		92億				
04月金融期	1202.20	1211.40	1195.00	-24.80	-0.60	2825	1.33	1.32	1.40	2930
05月金融期	1202.00	1210.00	1201.80	-21.00	-0.62	28	1.25	1.25	1.27	51
摩台指	404.51	406.63	402.94	-8.21						
03月摩台指	401.90	405.40	401.20	-10.00	-0.65	65986	-	-	2.04	188281
04月摩台指	401.20	404.80	400.90	-10.10	-0.83	8933	-	-	4.14	9973

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

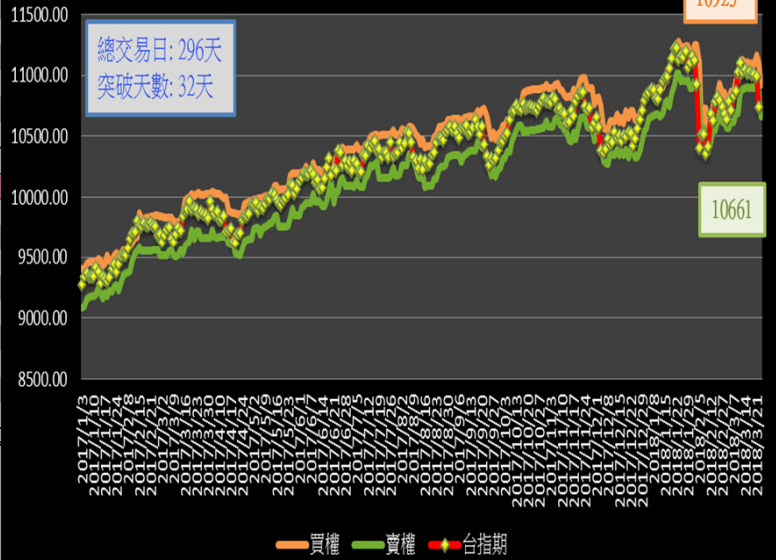


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

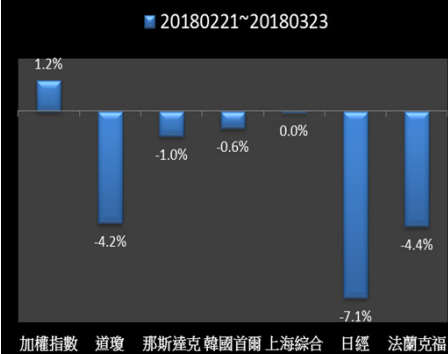


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

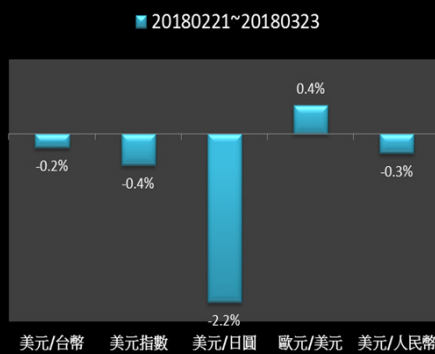


國際指數/商品期貨/外匯行情

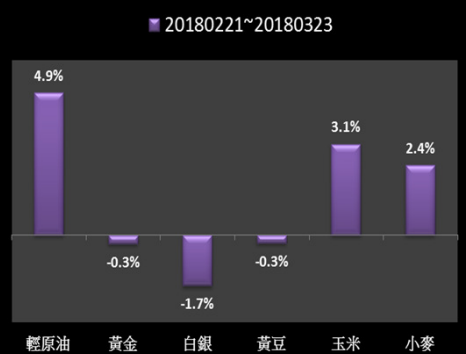
國際股市月績表現



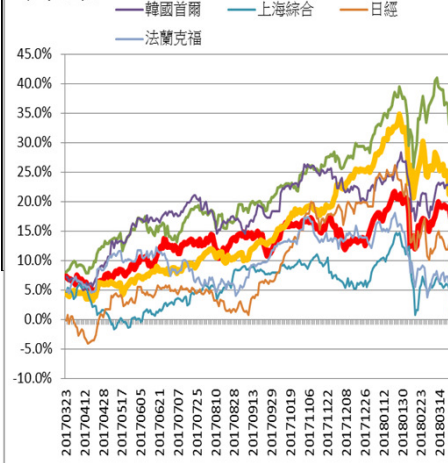
國際外匯月績表現



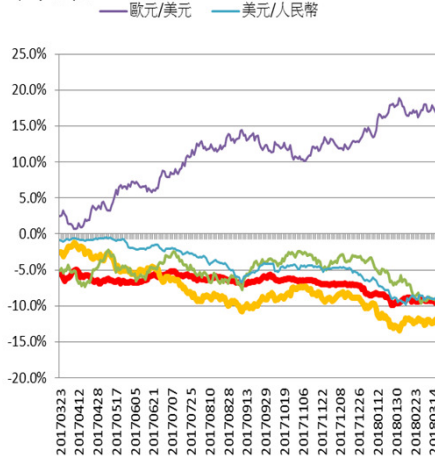
國際商品期貨月績表現



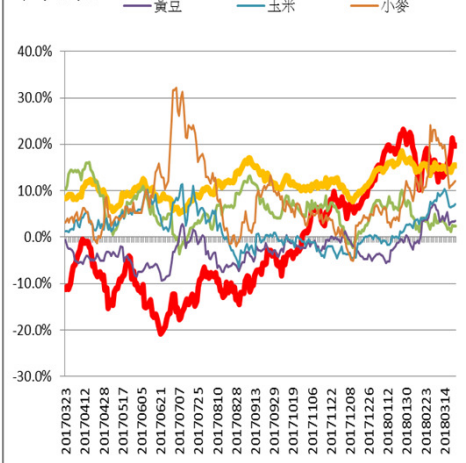
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>