



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28日 星期三 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	211.47	296.41	-84.94	-334.02	日月光	2.05	台積電	-56.03				
投信	8.60	15.67	-7.07	-42.85	中華電	1.40	鴻海	-6.86				
自營商	55.83	100.03	-44.20	-203.66	瑞昱	0.46	聯發科	-5.41				
合計	275.90	412.11	-136.21	-580.53	佳格	0.36	南亞科	-5.02				
3/27融資	77.25	70.07	7.18	今日 1713.28	威盛	0.33	台塑	-4.59				
3/27融券	31123	34475	3352	餘額 387340	玉晶光	0.23	國泰金	-3.62				
單位：口	多		空		儒鴻	0.20	台塑化	-3.43				
3/27摩台03月多空比	6		813		玉山金	0.18	台達電	-2.81				
台指期前十大佔市場	55.8%		49.9%		兆赫	0.18	大立光	-2.66				
電子期前十大佔市場	62.6%		59.4%		彰銀	0.17	台化	-2.11				
金融期前十大佔市場	53.2%		80.3%		前十名合計	5.55	後十名合計	-92.53				
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	43066	-3854	-42	-84	-1709	-49	32207	43332	-11125	71853	80980	-9127
投信	-32665	-762	1	0	52	0	-682	-682	0	-609	1511	-2120
自營商	-6782	-1220	150	-116	-20	-108	-10344	-18628	8284	-67960	-65093	-2867

## ● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 1.43%、S&P500跌 1.73%、Nasdaq跌 2.93%、費半指數跌 3.78%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.57，較前日減少 0.03，成交量p/c ratio為 1.23，較前日減少 0.13；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 136.21 億元，其中外資賣超 84.94 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 43066 口，較前日減少 3854 口淨多單，投信淨空單留倉 32665 口，自營商淨空單留倉 6782 口。

台灣市場：終場加權指數下跌 1.1%，收在 10865.66 點，成交值 1146.46 億元。櫃買指數終場下跌 0.56%，收在 153.11 點，成交值 310.21 億元。

技術面：近期美股Dow Jones Indax因指數過高，使得波動大增。尤其受美國大型科技股重挫，導致美股四大指數全數翻黑，進一步影響台股、台指期的走勢。以技術面觀察美股Dow Jones Indax呈空頭排列，不排除近日將持續高檔震盪；近月台指期的5日MA均線低於10日MA均線、9日KD值持續交叉向下、近日K線呈三角收斂型態，短線呈現中性偏空。期、現貨市場亦出現逆價差擴大的情形。由於近期美股劇烈波動，VIX波動率指數增至22.5，且P/C ratio未平倉量增至1.48%，顯示近日的選擇權策略較偏向空方格局。

## ● 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	10865.66	10939.97	10853.48	-121.13		1146億	2.83	1.88	5.67	
04月台指期	10819	10910	10809	-169.00	-0.43	155278	2.26	2.38	2.96	91699
05月台指期	10792	10882	10783	-170.00	-0.68	2110	1.44	1.53	1.56	2133
04月小台指	10819	10910	10809	-169.00	-0.43	114963	1.66	1.79	1.94	28637
05月小台指	10792	10883	10785	-170.00	-0.68	3563	1.24	1.38	1.39	2760
電子指數	454.59	458.31	454.06	-6.98		768億				
04月電子期	451.90	457.00	451.75	-9.45	-0.60	3917	1.34	1.38	1.37	2681
05月電子期	451.10	457.55	451.10	-9.40	-0.77	76	1.20	1.25	1.04	140
金融指數	1212.73	1218.85	1209.52	-9.01		45億				
04月金融期	1206.80	1214.40	1206.20	-12.80	-0.49	1577	1.29	1.38	1.40	2785
05月金融期	1205.60	1212.20	1205.60	-14.00	-0.59	29	1.27	1.26	1.07	56
摩台指	405.82	408.59	405.17	-5.80						
03月摩台指	404.40	408.40	404.20	-7.80	-0.35	57172	-	-	3.04	75054
04月摩台指	403.40	407.60	403.30	-8.10	-0.60	50888	-	-	3.68	141368

&lt;本文僅供參考，並不做任何獲利保證。&gt;



華南金融集團

華南期貨股份有限公司

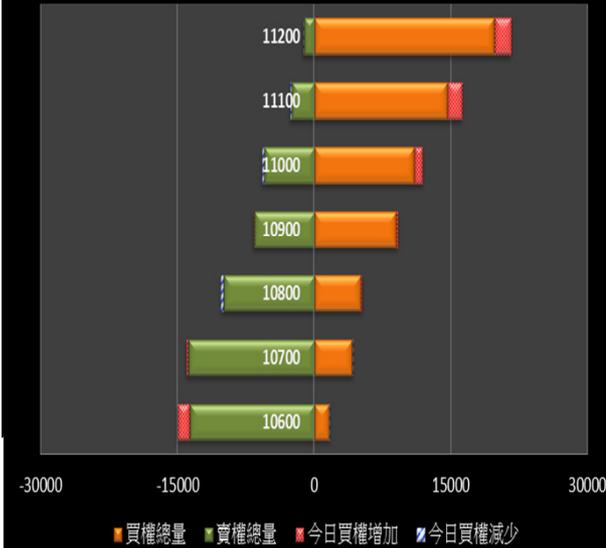
(104)金管期總字第002號

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

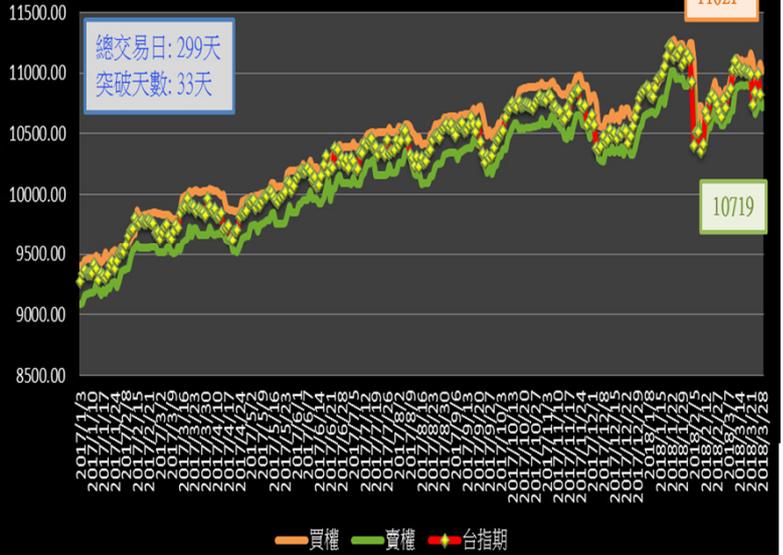
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

### 台指選擇權未平倉解析

#### 近月選擇權未平倉分佈圖



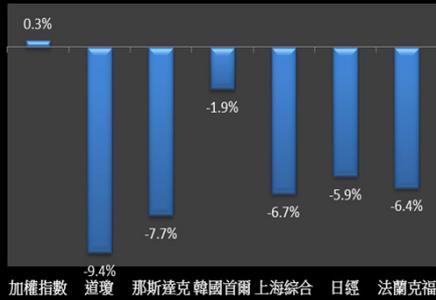
#### 近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



### 國際指數/商品期貨/外匯行情

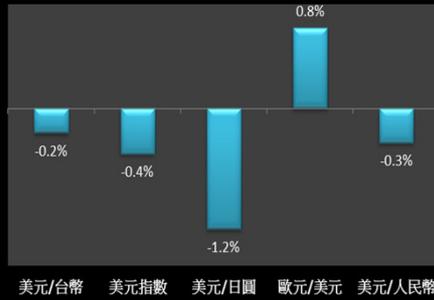
#### 國際股市月績效表現

20180226~20180328



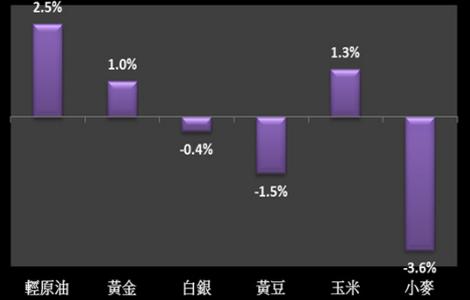
#### 國際外匯月績效表現

20180226~20180328



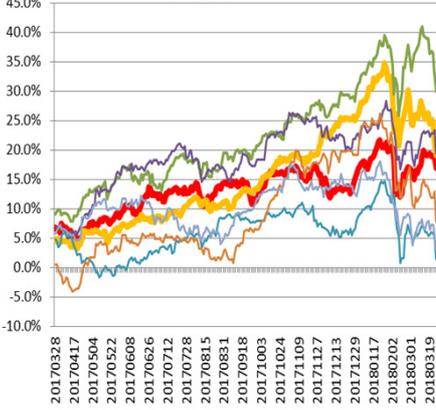
#### 國際商品期貨月績效表現

20180226~20180328



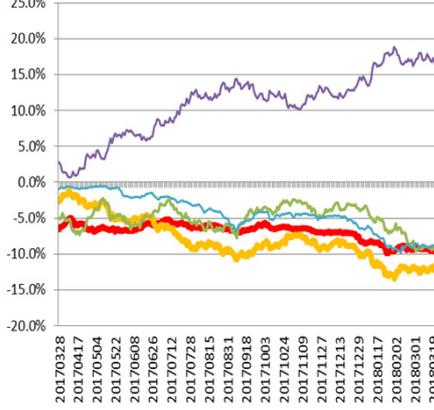
#### 今年漲幅

■ #001 加權指數  
■ NAS NASDAQ  
■ SHI 上海綜合  
■ DAX 法蘭克福  
■ DJI 道瓊指數  
■ KOR 韓國首爾  
■ NKI 日經指數



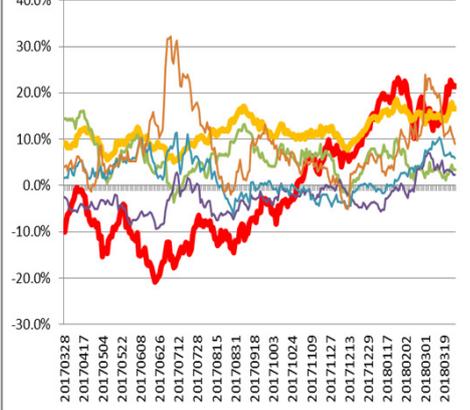
#### 今年漲幅

■ TWD 台幣  
■ JPY 日圓  
■ CNY 人民幣  
■ YDX 美元指數  
■ EUR 歐元



#### 今年漲幅

■ M1WS& 輕原油&  
■ O1SI& 白銀&  
■ B1C& 玉米&  
■ O1GC& 黃金&  
■ B1S& 黃豆&  
■ B1W& 小麥&



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>