



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06月13日 星期三 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					台股貢獻點數前十名		台股貢獻點數後十名					
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今								
外資及陸資	316.08	315.14	0.94	216.92	台積電	29.26	台塑化	-7.17				
投信	16.36	28.58	-12.22	10.08	大立光	14.63	南亞科	-4.07				
自營商	87.69	81.71	5.98	66.49	聯電	7.84	聯發科	-2.08				
合計	416.40	422.31	-5.91	292.13	台達電	1.95	上銀	-2.00				
6/12融資	113.03	105.84	7.19	今日 1894.54	富邦金	1.92	統一	-1.71				
6/12融券	23301	35115	11814	餘額 409174	國泰金	1.89	奇力新	-1.66				
單位：口	多		空		中信金	1.83	亞德客-KY	-1.56				
6/12摩台07月多空比	1,920		533		南亞	1.79	鍊德	-1.13				
台指期前十大佔市場	59.0%		42.7%		玉晶光	1.58	台化	-1.10				
電子期前十大佔市場	66.5%		63.9%		台泥	1.52	微星	-0.95				
金融期前十大佔市場	60.1%		68.0%		前十名合計	64.21	後十名合計	-23.43				
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	49569	-643	284	-38	-857	-22	4082	13799	-9717	34630	41336	-6706
投信	-25118	13	23	0	50	0	-523	-523	0	-188	-50	-138
自營商	-4967	1395	-55	2	-97	-23	-34653	-49486	14833	-49401	-42363	-7038

● 觀盤重點提示

國際金融：昨日的川金會談results優於預期、市場已price on本週美聯準會(Fed)將升息一碼至1.75%-2%的目標利率區間。今日盤後美股道瓊指數跌 0.01%、S&P500漲 0.17%、Nasdaq漲 0.57%、費半指數漲 0.52%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.51，較前日增加 0.01，成交量p/c ratio為 0.92，較前日減少 0.01；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 10800 履約價序列。

期現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣超 5.91 億元，其中外資買超 0.94 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 49569 口，較前日減少 643 口淨多單，投信淨空單留倉 25118 口，自營商淨空單留倉 4967 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.26%，收在 11173.21 點，成交值 1767.41 億元。櫃買指數終場下跌 0.7%，收在 157.87 點，成交值 528.26 億元。

技術面：由於昨日川金會後results優於預期，使得芝選所(CBoE)發佈的vix波動率指數降至14.01，顯示市場風險相對淡化。台指期的MACD正差離逐漸收斂，且KD值逐漸進入起買區，顯示期貨的技術面趨向中性；台指選(TX0)成交量p/c ratio增至 0.97%、未平倉量p/c ratio增至1.38%，顯示選擇權的籌碼面亦趨向中性。

本週將有美、歐、日三大央行的利率決策會議，預期短線美元指數持續升值，國內資金可能面臨外逃的風險。此外，美國亦將於本週公佈對中國301條款的最終關稅清單。預期短線台指期維持區間震盪，待國際事件明朗化後，方有機會突破近一週交易日的新高。

● 台指期貨收盤行情

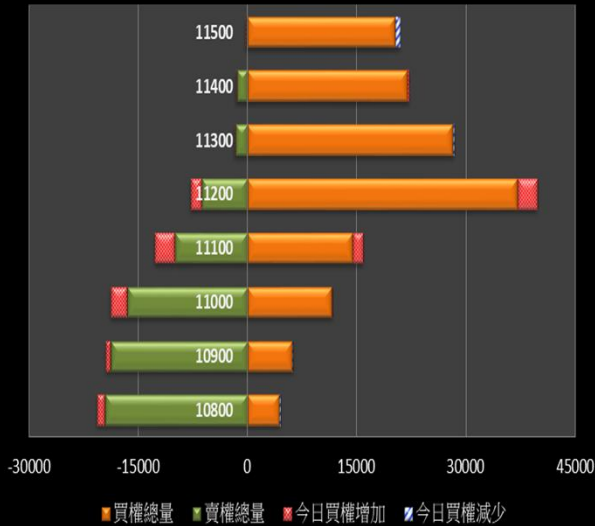
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	11173.21	11188.01	11119.24	28.42		1767億	2.61	1.98	5.54	
06月台指期	11146	11169	11095	5.00	-0.24	113977	2.34	2.36	2.98	88255
07月台指期	10893	10912	10843	6.00	-2.57	2668	1.51	1.57	1.66	10151
06月小台指	11146	11169	11096	4.00	-0.24	83781	1.75	1.75	2.00	43657
07月小台指	10893	10912	10842	7.00	-2.57	3950	1.31	1.32	1.46	5817
電子指數	462.24	462.57	458.58	2.77		1319億				
06月電子期	460.70	461.70	457.70	1.50	-0.33	3572	1.46	1.43	1.49	3617
07月電子期	449.80	450.00	447.00	1.50	-2.77	138	1.26	1.71	1.27	210
金融指數	1286.56	1289.39	1282.63	3.11		50億				
06月金融期	1282.20	1287.40	1280.40	-1.20	-0.34	1144	1.20	1.26	1.29	2672
07月金融期	1259.00	1262.60	1257.00	-1.20	-2.19	28	1.06	1.38	1.04	343
摩台指	410.52	410.53	407.52	2.39						
06月摩台指	404.90	405.20	402.00	1.70	-1.39	32476	-	-	1.94	188444
07月摩台指	398.60	398.70	396.60	2.10	-2.99	149	-	-	5.73	723

<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

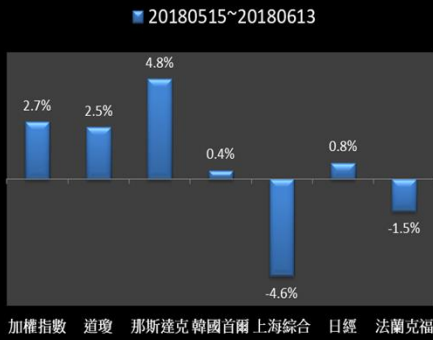


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

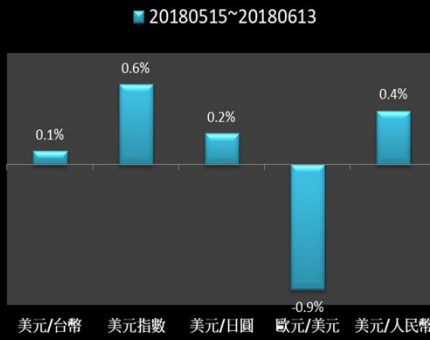


國際指數/商品期貨/外匯行情

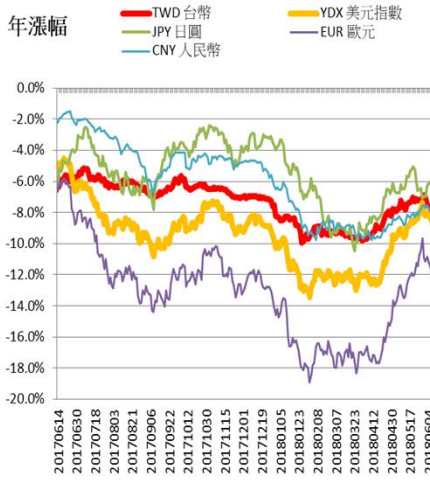
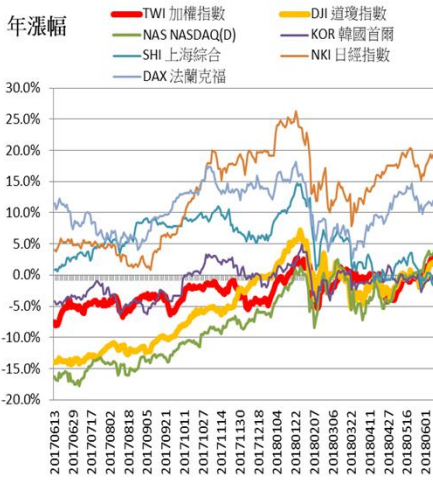
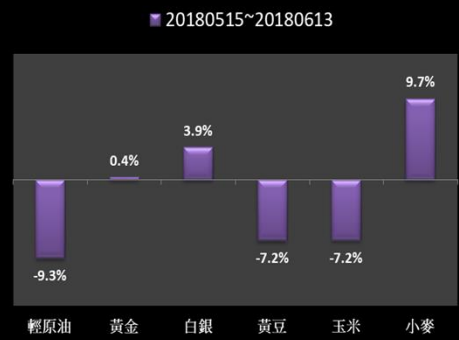
國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>