



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14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	286.09	429.75	-143.66	73.37	華通	1.87	台積電	-64.07				
投信	12.49	20.45	-7.96	0.96	達方	0.74	鴻海	-17.90				
自營商	76.93	90.88	-13.95	52.54	銖德	0.63	國巨	-7.88				
合計	372.40	538.66	-166.27	124.81	華新	0.60	大立光	-6.63				
6/13融資	106.05	100.07	5.98	今日 1902.87	順德	0.47	台塑化	-6.42				
6/13融券	28655	33631	4976	餘額 401982	欣興	0.38	南亞	-6.06				
單位：口	多		空		華晶科	0.34	國泰金	-5.64				
6/13摩台07月多空比	1,318		866		光罩	0.33	台化	-5.27				
台指期前十大佔市場	57.7%		45.4%		大毅	0.30	富邦金	-5.06				
電子期前十大佔市場	67.2%		65.1%		美食-KY	0.26	中信金	-3.94				
金融期前十大佔市場	59.9%		70.1%		前十名合計	5.93	後十名合計	-128.86				
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	43611	-6601	226	-96	-1006	-171	2883	13799	-10916	41709	41336	373
投信	-25687	-556	23	0	50	0	-523	-523	0	-188	-50	-138
自營商	-5260	1102	-95	-38	-138	-64	-38250	-49486	11236	-44727	-42363	-2364

## ● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 0.47%、S&P500跌 0.4%、Nasdaq跌 0.11%、費半指數跌 0.13%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.48，較前日減少 0.02，成交量p/c ratio為 0.95，較前日增加 0.02；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 10700 履約價序列。

期現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣超 166.27 億元，其中外資賣超 143.66 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 43611 口，較前日減少 6601 口淨多單，投信淨空單留倉 25687 口，自營商淨空單留倉 5260 口。

台灣市場：終場加權指數下跌 1.43%，收在 11013.98 點，成交值 1645.64 億元。櫃買指數終場下跌 0.18%，收在 157.58 點，成交值 420.7 億元。

技術面：今日美FOMC會議正式升息一碼，符合市場預期；並暗示今年2018年底前將升息4次，進一步衝擊美股、台股的盤後情形。市場預期近期美元指數可能持續升值，使得新台幣可能受到壓抑。觀察今日外資在現貨市場賣超逾143億元，因此不論在台股指數、近月台指期(TX)皆呈現走跌，MACD正差離明顯縮小，且收盤後的指數皆低於週線。

觀察賣權(Put)在履約價11,000點的未平倉量呈現增加、買權(Call)在履約價10,950點的未平倉亦增加，預期可能分別為壓力區、支撐區。研發部維持先前的中性預期rating，待國際事件釐清後，方有較明確的後市發展。

## ● 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	11013.98	11143.04	11013.98	-159.23		1645億	2.67	1.97	5.33	
06月台指期	10985	11106	10984	-161.00	-0.26	137380	2.32	2.49	2.92	81479
07月台指期	10741	10858	10740	-151.00	-2.54	5625	2.51	2.98	1.79	15351
06月小台指	10985	11106	10984	-162.00	-0.26	96968	1.63	1.77	1.92	40169
07月小台指	10741	10858	10741	-152.00	-2.54	7201	1.29	1.55	1.61	7390
電子指數	454.70	460.33	454.70	-7.54		1182億				
06月電子期	453.05	459.25	453.00	-7.70	-0.36	3717	1.43	1.47	1.50	3340
07月電子期	442.60	448.00	442.50	-7.20	-2.73	261	1.23	1.19	1.23	320
金融指數	1268.08	1284.82	1268.08	-18.48		76億				
06月金融期	1270.00	1280.80	1268.20	-12.00	0.15	1644	1.28	1.31	1.37	2551
07月金融期	1246.80	1256.00	1245.00	-12.20	-1.71	121	1.10	1.24	1.19	410
摩台指	402.93	408.06	402.93	-7.59						
06月摩台指	396.50	403.00	396.50	-8.40	-1.62	44928	-	-	2.13	187042
07月摩台指	390.60	396.20	392.00	-6.60	-3.16	17	-	-	1.13	863

&lt;本文僅供參考，並不做任何獲利保證。&gt;



### 台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

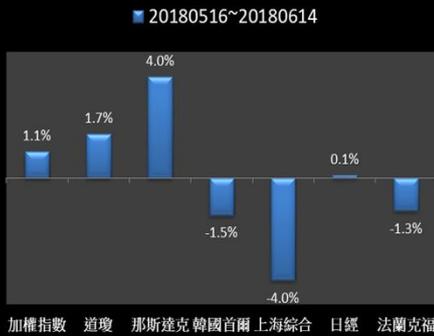


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

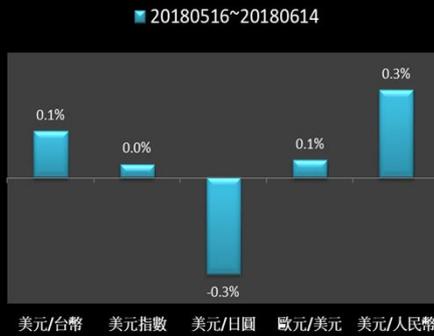


### 國際指數/商品期貨/外匯行情

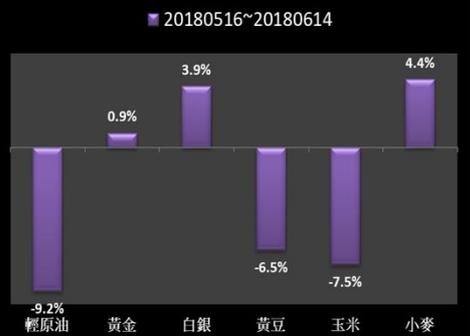
國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>