



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15日 星期五 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
外資及陸資	575.16	664.21	-89.06	-15.58	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
投信	48.31	47.56	0.75	0.94	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
自營商	83.69	76.21	7.48	60.02	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
合計	704.70	785.13	-80.43	43.72	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
6/14融資	90.89	79.00	11.89	今日 1913.65	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
6/14融券	27941	23448	-4493	餘額 390303	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
單位：口	多			空	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
6/14摩台07月多空比	1,374			525	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
台指期前十大佔市場	58.5%			46.6%	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
電子期前十大佔市場	74.9%			67.5%	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
金融期前十大佔市場	60.4%			68.8%	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
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)		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	44957	1346	691	465	-956	50	5261	2883	2378	50619	41709	8910
投信	-25647	40	23	0	50	0	-523	-523	0	-188	-188	0
自營商	-5614	-354	-271	-176	-264	-126	-33305	-38250	4945	-57006	-44727	-12279

● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 0.1%、S&P500漲 0.25%、Nasdaq漲 0.85%、費半指數漲 0.61%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.53，較前日增加 0.05，成交量p/c ratio為 1.13，較前日增加 0.18；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 80.43 億元，其中外資賣超 89.06 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 44957 口，較前日增加 1346 口淨多單，投信淨空單留倉 25647 口，自營商淨空單留倉 5614 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.67%，收在 11087.47 點，成交值 1903.85 億元。櫃買指數終場下跌 0.02%，收在 157.55 點，成交值 433.9 億元。

技術面：今日盤後大盤指數皆走升，預期可能受惠(1)美方對華實施關稅清單將由1,300項商品降為800項商品、(2)台積電(TSMC)將開發2nm，且在昨日6/14指數跌深後出現反彈。由技術層面觀察大盤指數的MACD於今日出現微幅的負差離、KD值皆向下滑落。雖然各期間SMA均線維持多頭排列，然近日盤後指數均在週線之下，預期短線近月台指期將持續盤整。

有選擇權籌碼面觀察近月台指選，買賣權的未平倉量p/c ratio升至127.88%、買賣權的成交量p/c ratio升至101.42，顯示近月台選(TXO)的籌碼面趨向中性。

在vix波動率指數降至14.13，顯示現階段的國際事件風險略為降低，短線維持台指期的中性預期。

● 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	11087.47	11087.47	10981.61	73.49		1903億	2.75	2.00	5.90	
06月台指期	11054	11075	10961	70.00	-0.30	129640	2.43	2.33	2.91	69673
07月台指期	10806	10827	10726	67.00	-2.60	8798	2.71	2.43	1.83	32857
06月小台指	11054	11075	10960	70.00	-0.30	91671	1.73	1.66	1.91	38911
07月小台指	10806	10827	10727	66.00	-2.60	8692	1.50	1.39	1.63	8731
電子指數	458.72	458.72	452.55	4.02		1378億				
06月電子期	457.80	458.80	452.25	4.75	-0.20	4768	1.42	1.47	1.47	3130
07月電子期	447.30	448.50	442.05	4.70	-2.55	470	1.28	1.28	1.22	611
金融指數	1277.84	1277.84	1266.17	9.76		107億				
06月金融期	1272.20	1273.80	1265.20	2.20	-0.44	1873	1.22	1.27	1.30	2426
07月金融期	1248.00	1249.80	1243.00	1.20	-2.39	147	1.31	1.06	1.13	529
摩台指	406.46	406.46	401.21	3.53						
06月摩台指	399.70	400.90	395.50	3.20	-1.69	38944	-	-	2.13	190535
07月摩台指	393.30	393.90	390.00	3.30	-3.35	191	-	-	11.94	894

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

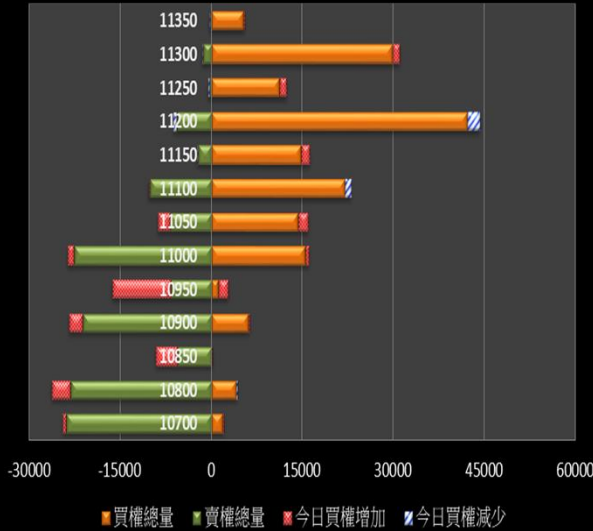
華南期貨股份有限公司

(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

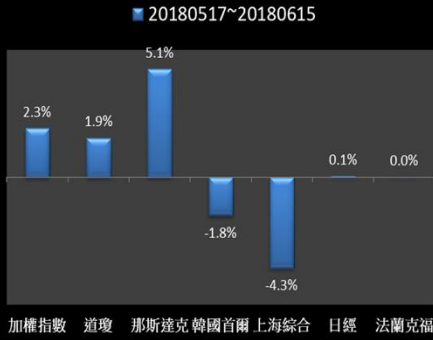


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

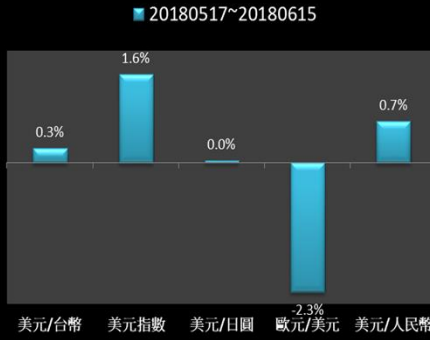


國際指數/商品期貨/外匯行情

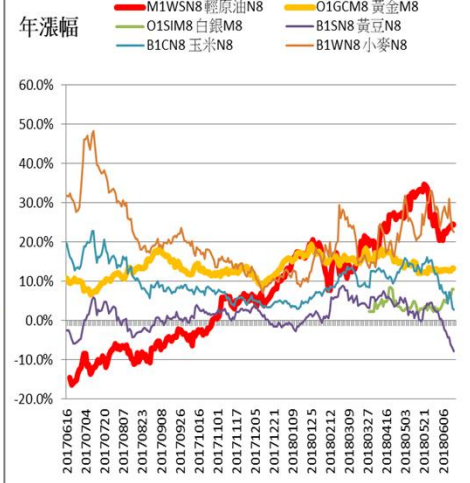
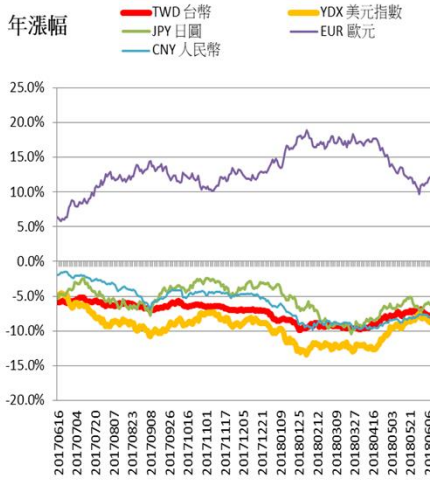
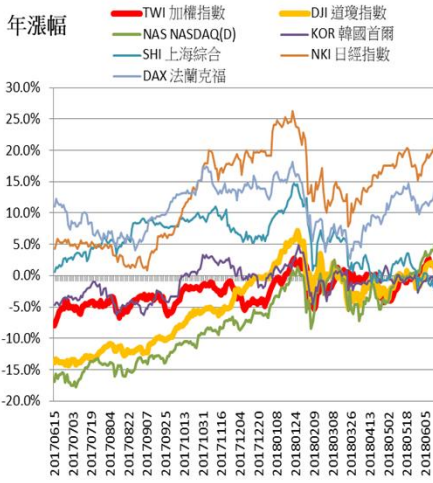
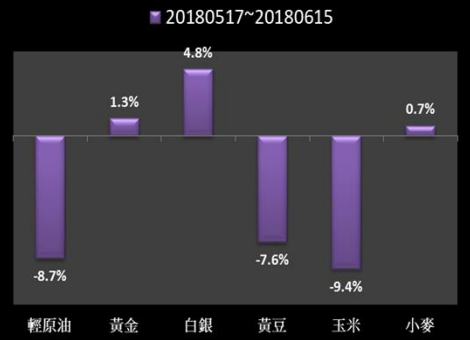
國際股市月績效表現



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。>