



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 2017年10月06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	255.60	225.33	30.27	40.38	聯發科	3.43	南亞科	-2.48				
投信	6.82	7.06	-0.24	0.94	鴻海	3.13	大立光	-4.84				
自營商	49.21	52.22	-3.01	27.57	台塑	1.84	台達電	-0.94				
合計	311.63	284.61	27.02	68.90	可成	3.34	台光電	-0.81				
10/5融資	71.78	64.32	7.46	今日 1647.15	中信金	1.76	榮成	-0.72				
10/5融券	19766	29212	9446	餘額 531256	台化	1.06	廣達	-0.70				
單位：口	多		空		致茂	1.03	聯電	-0.68				
10/5摩台10月多空比	33		1,414		統一	1.03	研華	-0.50				
台指期前十大佔市場	58.2%		44.6%		美律	0.82	光磊	-0.49				
電子期前十大佔市場	73.6%		58.7%		旺宏	0.78	健鼎	-0.19				
金融期前十大佔市場	60.1%		83.6%		前十名合計	18.21	後十名合計	-12.35				
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	52943	-208	238	-213	-1228	197	120274	117909	2365	239609	235029	4580
投信	-33491	37	-232	0	-59	0	-420	-420	0	-636	-636	0
自營商	-4330	991	481	-82	119	-109	27403	8582	18821	-40453	-72961	32508

● 觀盤重點提示

- 國際金融：週四(5)美國公布八月工廠訂單月增1.2%、八月貿易赤字降至424億美元以及上週初領失業金降至26萬人，雖然經歷兩個超颶風侵襲，但整體數據仍優於預期，顯示美國經濟成長力道仍強勁，加上共和黨透過預算調整程序，稅改送交參院後就可以利用簡單多數通過法案，市場對稅改樂觀進行，提供股市續漲動能，道瓊、S&P500指數和Nasdaq已連續七日收紅K，並再創收盤新高，市場將聚焦今晚美國就業報告：終場道瓊指數漲0.5%、S&P500漲0.56%、Nasdaq漲0.78%、費半指數漲0.07%。
- 台指選擇權：近月選擇權賣權於10200~10500履約價序列的未平倉量顯著增加，顯示下檔支撐力道持續增強，而買權於10300~10600履約價序列合計減少逾三千口，推測選擇權賣方隨著指數連日上漲停損賣出買權部位。今日未平倉p/c ratio為1.33，較前日增加0.05，成交量p/c ratio為0.86，較前日減少0.17；近月買權最大未平倉量集中在10600履約價序列，賣權最大未平倉量集中在10000履約價序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：美股持續向上創歷史天價，帶動今天指數開高，股王大立光昨日公布9月營收月增8%創今年新高，但股價卻過賣壓收低，拖累二線光學股，如佳凌和今國光下跌逾2%，記憶體廠南亞科股價達高調節下跌2.86%，而機殼廠可成九月營收月增34.3%，連2個月創新高，激勵股價大漲3.8%，帶動相關個股鴻海、聯發科、和碩收紅，成為今日撐盤個股；終場加權指數上漲0.14%，收在10532.81點，成交值1076.56億元。櫃買指數開高走低震盪，終場指數下跌0.22%，收在142.97點，成交值370.58億元。(2)資金面：適逢雙十連假前夕，以及今晚美國將公布非農就業數據，今日匯市操作保守，交投清淡，台幣呈現狹幅盤整；終場新台幣兌美元貶值2.6分，收在30.376元，台北外匯經紀公司成交量為4.77億美元。(3)技術面：今日指數開高走低震盪，終結連五日紅K棒，但就週線角度，台股周線收紅，終結連三黑，顯示自九月中旬急挫約400點後，台股止跌回穩；以日線型態觀察，指數站穩所有均線之上，其中十日均線翻揚，MACD柱狀體轉正，且KD指標持續向上攀升，短期技術面轉趨強勢，下檔支撐移至季線位置，觀察下週指數是否能持續守穩月線。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計買超27.02億元，其中外資買超30.27億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉52943口，較前日減少208口淨多單，投信淨空單留倉33491口，自營商淨空單留倉4330口。

● 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	10532.81	10557.67	10511.50	14.54		1076億	2.96	1.97	5.20	
10月台指期	10523	10542	10496	19.00	-0.09	92112	2.35	2.33	2.80	91086
11月台指期	10506	10524	10481	18.00	-0.26	2493	1.47	1.52	1.54	6765
10月小台指	10523	10542	10495	19.00	-0.09	58700	1.72	1.71	1.95	26752
11月小台指	10506	10524	10480	16.00	-0.26	3341	1.41	1.42	1.51	5038
電子指數	449.32	451.33	448.11	0.18		785億				
10月電子期	448.85	449.95	447.65	0.80	-0.10	2742	1.24	1.31	1.27	4065
11月電子期	447.90	448.75	446.80	0.80	-0.32	58	1.18	1.25	1.07	266
金融指數	1132.89	1132.89	1127.81	5.37		29億				
10月金融期	1132.00	1132.60	1128.00	4.40	-0.08	1312	1.36	1.34	1.38	4480
11月金融期	1131.40	1131.80	1127.60	4.60	-0.13	30	1.18	1.00	1.07	117
摩台指	393.39	394.24	392.44	0.78						
10月摩台指	393.30	393.80	392.10	1.10	-0.02	24708	-	-	2.37	225750
11月摩台指	393.20	393.30	392.60	0.30	-0.05	166	-	-	23.71	286

<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

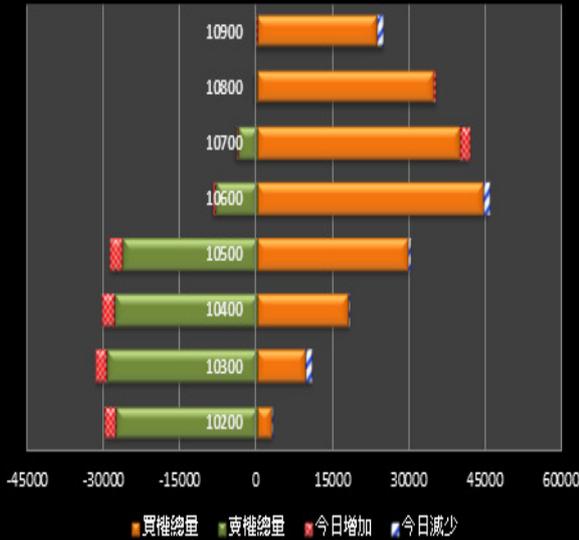
(104)金管期總字第002號

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

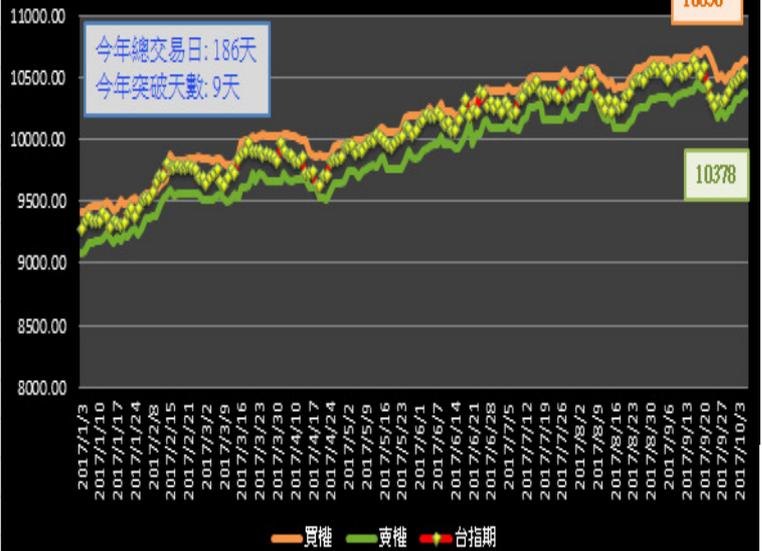
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖



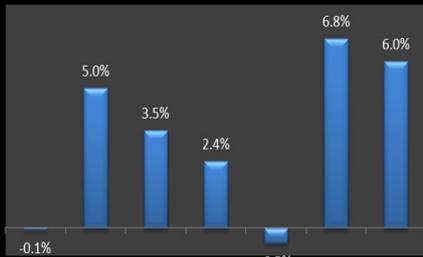
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

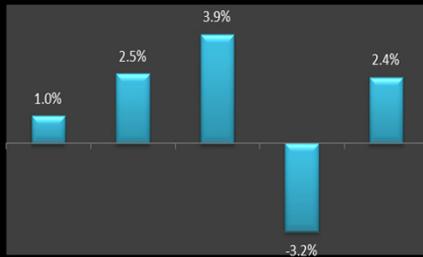
國際股市月績效表現

20170907~20171006



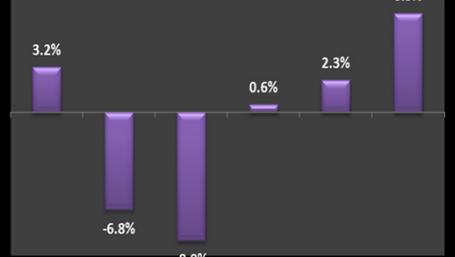
國際外匯月績效表現

20170907~20171006



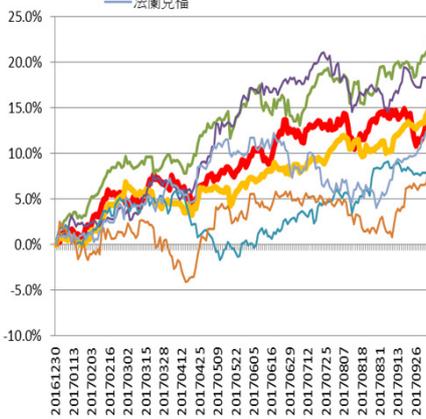
國際商品期貨月績效表現

20170907~20171006



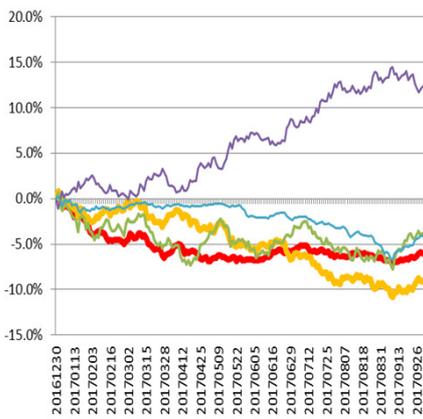
今年漲幅

加權指數 道瓊 那斯達克 韓國首爾 上海綜合 日經 法蘭克福



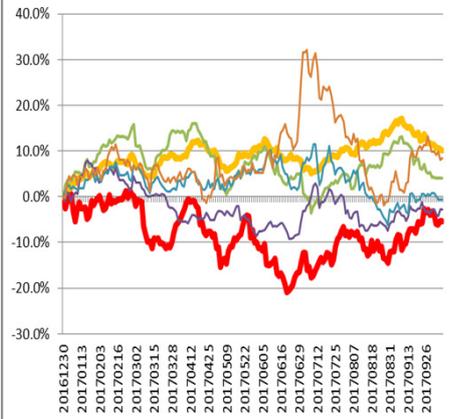
今年漲幅

美元/台幣 美元指數 美元/日圓 歐元/美元 美元/人民幣



今年漲幅

輕原油 黃金 白銀 黃豆 玉米 小麥



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>