



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12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	396.07	334.79	61.28	196.98	台積電	42.13	台達電	-3.75				
投信	13.51	11.49	2.03	7.14	大立光	10.41	台塑化	-1.72				
自營商	72.60	61.63	10.97	30.71	鴻海	6.26	研華	-1.51				
合計	482.19	407.91	74.27	234.83	鴻準	2.20	聯發科	-1.43				
10/11融資	82.04	78.52	3.52	今日 1653.38	美食-KY	1.74	兆豐金	-0.98				
10/11融券	33948	28547	-5401	餘額 509173	統一	1.44	國泰金	-0.91				
單位：口	多		空		中鋼	1.42	遠傳	-0.71				
10/11摩台10月多空比	3		3,483		晶電	1.42	裕日車	-0.70				
台指期前十大佔市場	57.4%		38.9%		日月光	1.21	台灣大	-0.62				
電子期前十大佔市場	76.1%		54.1%		華碩	0.94	正新	-0.59				
金融期前十大佔市場	62.3%		84.4%		前十名合計	69.15	後十名合計	-12.91				
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	59370	803	991	359	-1830	-336	135932	128792	7140	263081	251633	11448
投信	-32153	479	-232	0	-59	0	-606	-417	-189	-635	-635	0
自營商	-2582	1446	469	71	588	167	23124	25235	-2111	-77792	-68036	-9756

## ● 觀盤重點提示

- 國際金融：歐洲股市，因加泰隆尼亞暫緩宣布獨立，並於西班牙政府進行協商，政治風暴危機緩解，使得昨(11)日西班牙指數上漲1.34%。因西班牙局勢舒緩，加上美國財長推薦白宮任命鮑威爾(Jerome Powell)為下一任聯準會主席，市場認為人選在金融和政策面都是安全牌，以及聯準會9月會議記錄顯示，維持今年度再升息的預期，使得美股收紅再創歷史新高；終場道瓊指數漲0.18%、S&P500漲0.18%、Nasdaq漲0.25%、費半指數漲0.66%。
- 台指選擇權：近月選擇權買賣權於10600履約價序列上下四檔顯著增加未平倉量，其中以賣權10500~10700履約價序列合計增加逾五萬口較為積極，表示下檔支撐較強，且支撐位置上移，而買權10500~10600履約價序列合計減少14,232口，推測選擇權賣方隨著指數大漲停損賣出買權部位。今日未平倉p/c ratio為1.7，較前日增加0.17，成交量p/c ratio為1.03，較前日減少0.09；近月買權最大未平倉量集中在10700履約價序列，賣權最大未平倉量由10000上移至10500履約價序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：受美股續創新高，今天台股延續昨日漲勢開高，盤中台積電續強上漲約2%股價再創新高，鴻海9月營收月增達42.38%，股價上漲0.93%，連帶子公司鴻準亦大漲逾4%，而股王大立光盤後將召開法說會，投資人看好法說會釋出利多，激勵股價大漲約4%，帶動二線光學股如亞光止跌走揚4.31%；今日電子股表現強勁，電子指數上漲1.13%，推升指數收在最高點；終場加權指數上漲0.66%，收在10711.44點，成交值1246.75億元。櫃買指數開高走高，終場指數上漲1.06%，收在144.09點，成交值419.77億元。(2)資金面：因美元持續走弱，亞洲貨幣均走強，加上台股走強，外資於現貨市場買起，推估外資熱錢回籠，使得台幣短線呈現揚升走勢，短線上待觀察十月中旬美國公布匯率操縱國名單和持續關注外資動向；終場新台幣兌美元升值1.9分，收在30.213元，台北外匯經紀公司成交量為6.58億美元。(3)技術面：以日線型態觀察，指數收紅K並收在27年來最高點，且所有均線皆呈現上揚，KD指標持續向上攀升，但K值已經落入超買區，指數處在萬點高檔需留意修正風險，下檔支撐可觀察月線位置。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計買起74.27億元，其中外資買起61.28億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉59370口，較前日增加803口淨多單，投信淨空單留倉32153口，自營商淨空單留倉2582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	10711.44	10711.44	10668.39	70.25		1246億	2.89	1.97	5.30	
10月台指期	10697	10705	10640	65.00	-0.13	99010	2.41	2.34	2.87	89931
11月台指期	10682	10688	10625	67.00	-0.28	6409	1.88	1.78	1.80	15893
10月小台指	10697	10705	10640	67.00	-0.13	59879	1.77	1.66	1.91	30251
11月小台指	10682	10688	10624	68.00	-0.28	6716	1.67	1.39	1.64	9543
電子指數	460.77	461.06	457.85	5.13		904億				
10月電子期	460.70	460.75	456.00	5.35	-0.02	3522	1.35	1.34	1.32	4229
11月電子期	459.80	459.85	455.65	5.45	-0.21	288	1.32	1.16	1.20	692
金融指數	1138.35	1139.90	1135.85	-0.14		51億				
10月金融期	1137.40	1139.20	1134.80	-0.20	-0.08	1674	1.48	1.65	1.59	4990
11月金融期	1136.80	1138.60	1134.60	-0.20	-0.14	103	1.34	1.26	1.14	227
摩台指	403.00	403.01	401.07	3.55						
10月摩台指	402.80	403.10	399.50	3.70	-0.05	37989	-	-	2.21	228582
11月摩台指	402.70	402.80	399.60	3.50	-0.07	672	-	-	12.44	819

&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

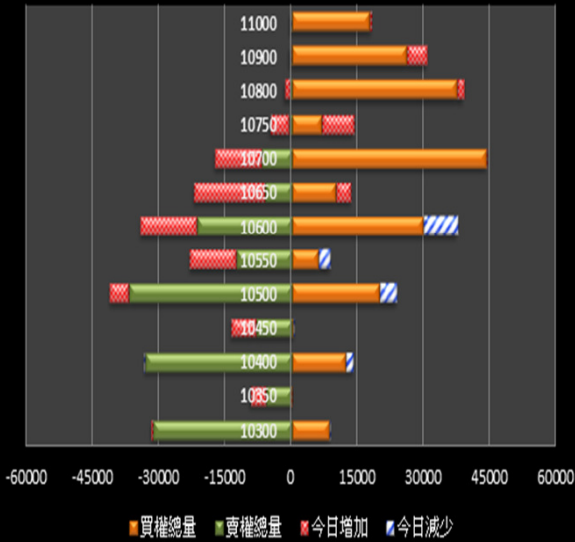
(104)金管期總字第002號

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

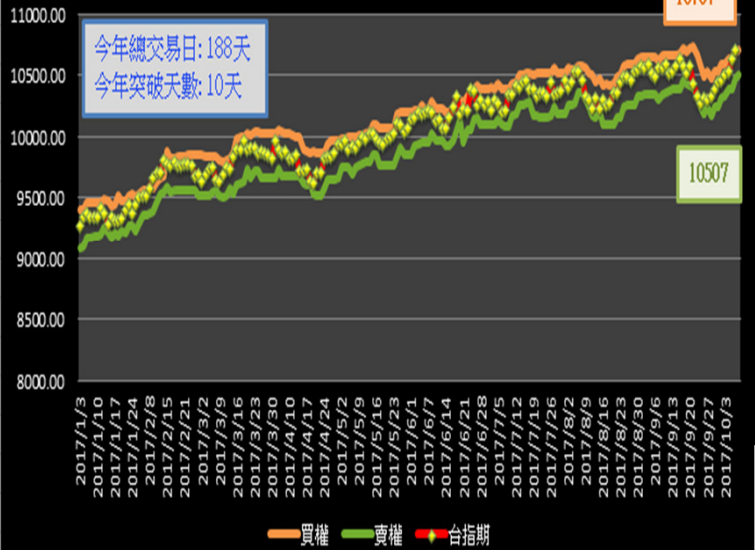
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

### 台指選擇權未平倉解析

#### 近月選擇權未平倉分佈圖



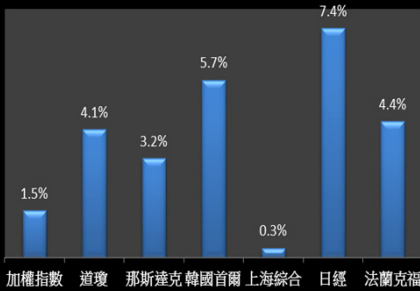
#### 近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



### 國際指數/商品期貨/外匯行情

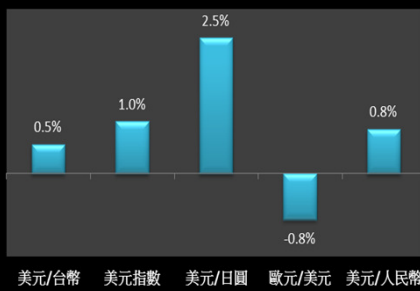
#### 國際股市月績效表現

20170911~20171012



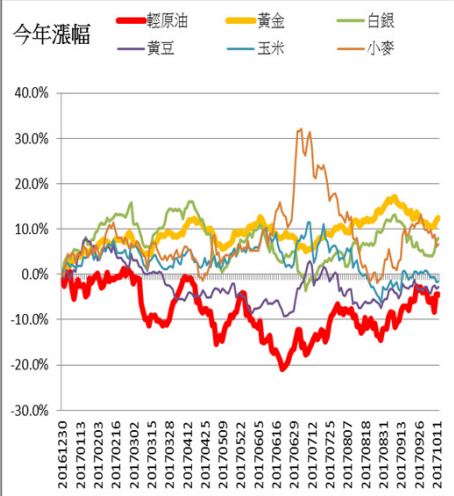
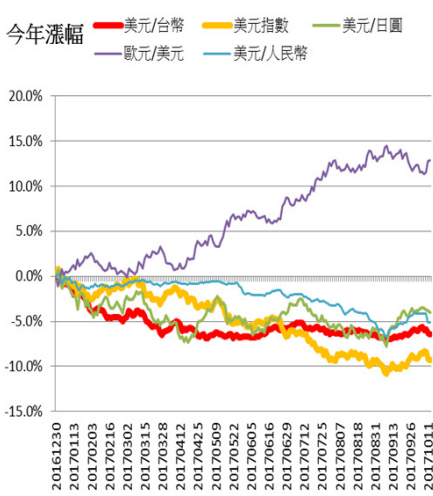
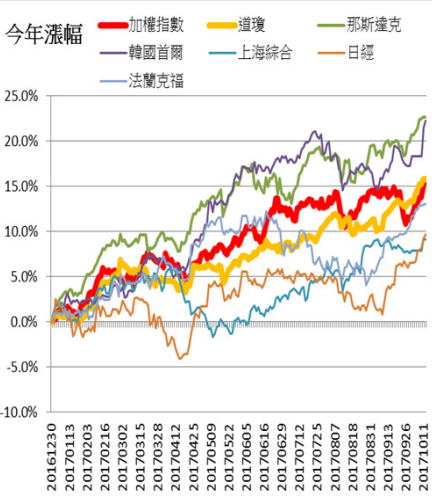
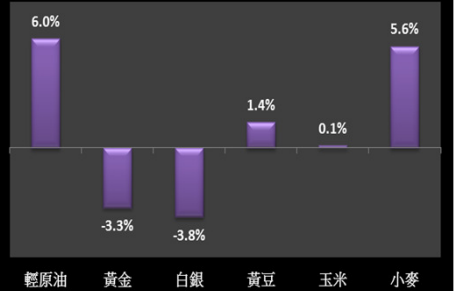
#### 國際外匯月績效表現

20170911~20171012



#### 國際商品期貨月績效表現

20170911~20171012



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>