



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13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	323.09	296.64	26.45	224.99	聯發科	10.57	大立光	-4.12				
投信	12.74	8.42	4.32	11.53	旺宏	2.41	台塑化	-3.44				
自營商	69.81	61.52	8.30	39.01	台灣大	1.85	台塑	-2.53				
合計	405.64	366.57	39.07	275.54	中華電	1.40	台達電	-2.35				
10/12融資	69.83	64.26	5.57	今日 1657.34	南亞科	1.19	南亞	-2.29				
10/12融券	20390	29202	8812	餘額 510908	創意	0.97	可成	-2.23				
單位：口	多		空		群聯	0.93	和泰車	-0.89				
10/12摩台10月多空比	0		4,061		華邦電	0.91	台化	-0.85				
台指期前十大佔市場	58.8%		41.4%		華新	0.85	廣達	-0.70				
電子期前十大佔市場	77.0%		55.3%		研華	0.75	百和	-0.65				
金融期前十大佔市場	61.1%		84.7%		前十名合計	21.84	後十名合計	-20.03				
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	57836	-1534	857	-134	-1804	26	136125	135932	193	271921	263081	8840
投信	-32208	-55	-232	0	-59	0	-608	-606	-2	-635	-635	0
自營商	-837	1745	506	37	539	-49	9363	23124	-13761	-71863	-77792	5929

● 觀盤重點提示

- 國際金融：昨(12)日花旗集團和摩根大通公布第三季財報雖優於預期，但摩根大通交易收入不及分析師預估，而花旗第三季債券收入則大幅減少令股價大跌3.4%，使得美股盤中創高後，受銀行股走跌拖累指數高檔拉回整理；終場道瓊指數跌 0.14%、S&P500跌 0.17%、Nasdaq跌 0.18%、費半指數跌 0.34%。
- 台指選擇權：近月選擇權買權與賣權於10700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三萬口較為積極，表示下檔支撐強勁且持續上移，而買權10400~10700履約價序列合計減少8777口，推測選擇權賣方隨著指數上漲而停損賣出買權部位。今日未平倉p/c ratio為 1.85，較前日增加 0.15，成交量p/c ratio為 1.22，較前日增加 0.19；近月買權最大未平倉量從10700上移至10800履約價序列，賣權最大未平倉量從10500上移至10600履約價序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：受到美股創高後拉回影響，今日台股開低，早盤電子權值股台股積電、鴻海和大立光均拉回整理，其中大立光法說會後股價回檔修正1.51%，拖累光電族群跌幅均逾1%，使指數在平盤下震盪，但受惠於聯發科年底推出新品和對手高通重罰股價大漲逾6%，以及午後在台積電和鴻海奮力拉尾盤下，令指數由黑翻紅，並收在27年來新高；終場加權指數上漲 0.12%，收在 10724.09 點，成交值 1214.06 億元。櫃買指數開高震盪，終場指數上漲 0.1%，收在 144.24 點，成交值 420.03 億元。(2)資金面：國際美元持續走弱，早盤亞洲貨幣普遍走升，加上台股收紅、外資買超，推估資金持續湧入台股股市和匯市，使得台幣今日呈現走升格局，並來到9月26日以來收盤新高價；終場新台幣兌美元升值 2.8分，收在 30.185 元，台北外匯經紀公司成交量為 6.97 億美元。(3)技術面：以日線型態觀察，指數收紅K留下影線，顯示下檔有撐，且所有均線皆呈現上揚，KD指標持續向上攀升，惟K值落入超買區，需持續留意與D值之相對變化，加上5日乖離率過大，指數處於相對高檔需留意追價風險，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超 39.07 億元，其中外資買超 26.45 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 57836 口，較前日減少 1534 口淨多單，投信淨空單留倉 32208 口，自營商淨空單留倉 837 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	10724.09	10724.09	10675.83	12.65		1214億	2.82	1.89	5.33	
10月台指期	10710	10713	10670	14.00	-0.13	73052	2.50	2.45	3.03	84135
11月台指期	10697	10700	10657	16.00	-0.25	4891	2.25	2.32	1.85	23748
10月小台指	10710	10713	10670	13.00	-0.13	43307	1.74	1.74	1.99	29012
11月小台指	10697	10699	10656	16.00	-0.25	5522	1.51	1.51	1.63	10675
電子指數	462.07	462.07	458.74	1.30		919億				
10月電子期	461.85	461.95	459.00	1.15	-0.05	1985	1.40	1.42	1.39	3924
11月電子期	460.85	461.00	458.10	1.05	-0.26	284	1.53	1.27	1.27	937
金融指數	1141.43	1141.43	1138.02	3.08		34億				
10月金融期	1139.00	1141.00	1135.00	2.00	-0.21	1266	1.44	1.38	1.52	4921
11月金融期	1138.80	1140.40	1134.60	1.80	-0.23	155	1.67	1.10	1.31	330
摩台指	403.26	403.26	400.75	0.26						
10月摩台指	402.50	402.70	400.90	-0.30	-0.19	24907	-	-	2.23	228233
11月摩台指	402.50	402.20	400.90	-0.50	-0.19	120	-	-	6.67	1432

<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

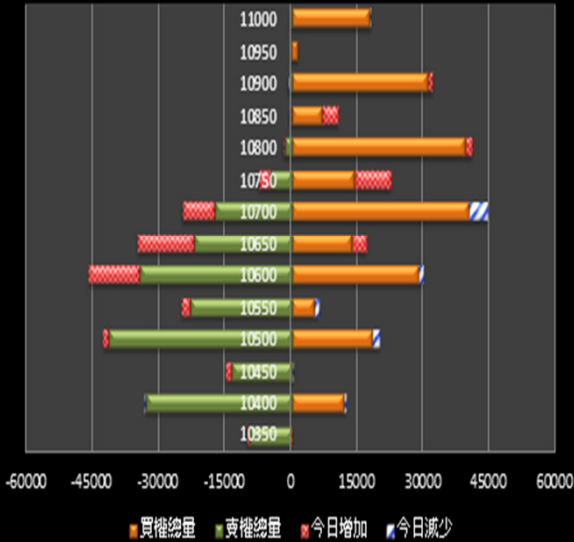
(104)金管期總字第002號

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

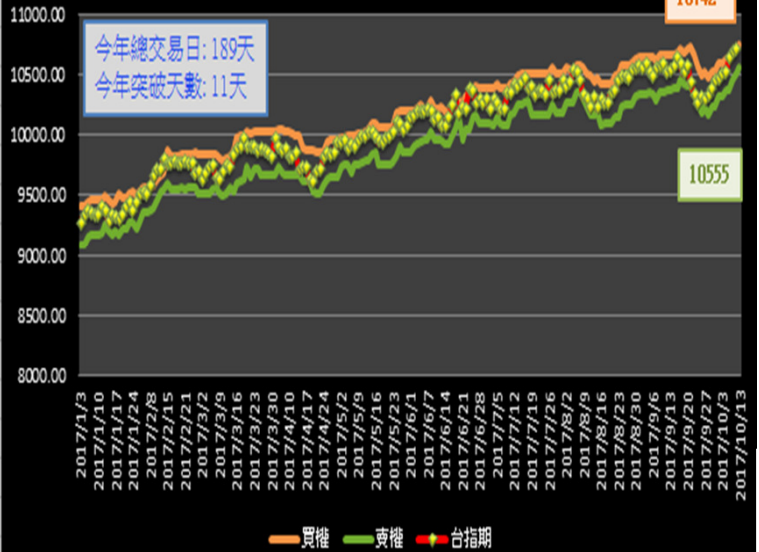
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖



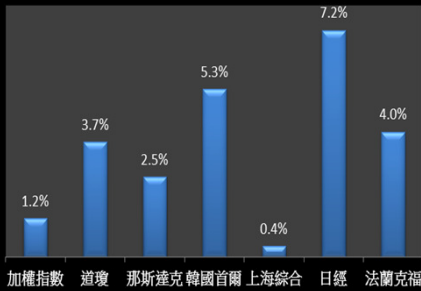
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

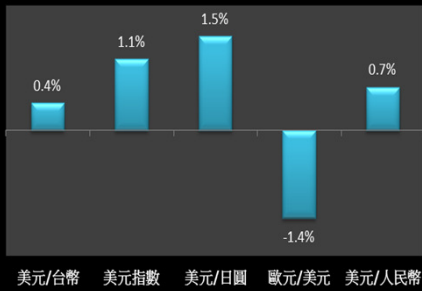
國際股市月績效表現

20170912~20171013



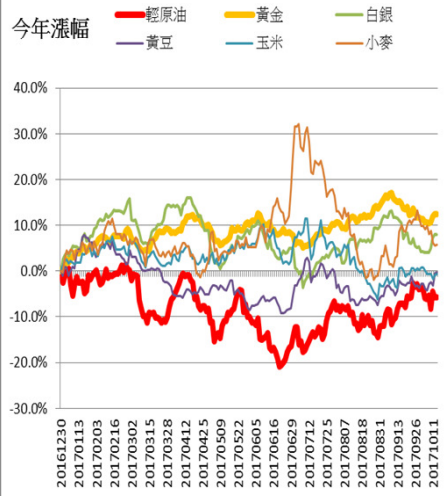
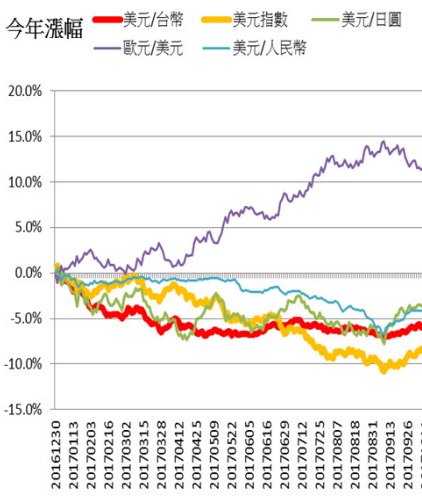
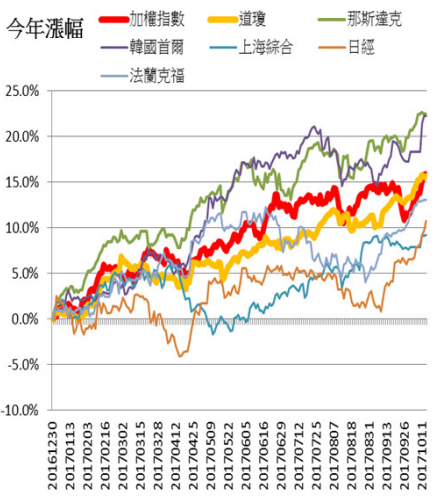
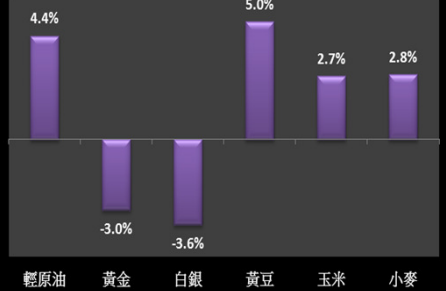
國際外匯月績效表現

20170912~20171013



國際商品期貨月績效表現

20170912~20171013



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>