



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16日 星期一 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 | 351.34 | 301.94 | 49.40 | 274.39 | 大立光 | 10.91 | 台達電 | -2.82 | | | | |
| 投信 | 13.25 | 8.79 | 4.46 | 15.86 | 鴻海 | 9.39 | 中華電 | -1.40 | | | | |
| 自營商 | 75.64 | 65.87 | 9.77 | 48.79 | 廣達 | 6.84 | 台灣大 | -1.24 | | | | |
| 合計 | 440.23 | 376.60 | 63.63 | 339.04 | 台積電 | 4.69 | 統一 | -0.82 | | | | |
| 10/13融資 | 71.88 | 67.04 | 4.84 | 今日 1660.64 | 南亞 | 3.15 | 旺宏 | -0.72 | | | | |
| 10/13融券 | 17263 | 31610 | 14347 | 餘額 523435 | 聯發科 | 2.29 | 台塑 | -0.69 | | | | |
| 單位：口 | 多 | | 空 | | 台化 | 1.91 | 第一金 | -0.66 | | | | |
| 10/13摩台10月多空比 | 40 | | 3,514 | | 南亞科 | 1.79 | 美律 | -0.61 | | | | |
| 台指期前十大佔市場 | 60.2% | | 45.5% | | 儒鴻 | 1.54 | 豐泰 | -0.60 | | | | |
| 電子期前十大佔市場 | 74.4% | | 55.3% | | 微星 | 1.44 | 長榮海 | -0.44 | | | | |
| 金融期前十大佔市場 | 64.1% | | 82.8% | | 前十名合計 | 43.94 | 後十名合計 | -10.00 | | | | |
| 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 | 55780 | -2056 | 752 | -105 | -1841 | -37 | 135111 | 136125 | -1014 | 273012 | 271921 | 1091 |
| 投信 | -31956 | 252 | -232 | 0 | -59 | 0 | -608 | -608 | 0 | -630 | -635 | 5 |
| 自營商 | -992 | -155 | 529 | 23 | 640 | 101 | 8067 | 9363 | -1296 | -81122 | -71863 | -9259 |

● 觀盤重點提示

- 國際金融：美國第三季財報已公布的公司中有逾85%獲利優於預期，加上10月美國密西根大學消費者信心指數年增15.9%、月增6.3%，為2004年1月以來新高，並遠高於市場預期，且CBOE VIX指數收在9.61，為歷史相對低點，季報和數據帶來的利多推升美股上週五(13)續創新高，道瓊更連續第五周收高；終場道瓊指數漲0.13%、S&P500漲0.09%、Nasdaq漲0.22%、費半指數漲0.67%。
- 台指選擇權：近月選擇權買權與賣權於10750履約價序列上下三檔顯著增加未平倉量，其中以賣權10650~10800履約價序列合計增加逾四萬口較為積極，表示下檔支撐強勁且持續上移，而買權10500~10750履約價序列合計減少16,642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1.94，較前日增加0.09，成交量p/c ratio為0.97，較前日減少0.25；近月買權最大未平倉量集中在10800履約價序列，賣權最大未平倉量集中在10600履約價序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：隨著美股持續創高，帶動台股今日開高，因上周末首批iPhone X傳出從鄭州海關開始出貨，激勵組裝廠鴻海開高上漲1.39%，並站回月線之上，而鴻海集團旗下觸控板GIS-KY(業成)獲三星手機指紋辨識大單，股價大漲5.38%，加上股王大立光開高走高漲逾4%，推升指數收在27年來新高，今日類股以光電最強漲2.49%；終場加權指數上漲0.47%，收在10774.21點，成交值1259.6億元。櫃買指數開高震盪，今新日光、昱晶及昇陽科暫停交易，市場認為將組成大聯盟提升國際競爭力，激勵太陽能股，如茂迪、益通、碩禾漲幅均逾8%；終場指數上漲0.26%，收在144.61點，成交值384.48億元。(2)資金面：上週五(13)美國公布通膨數據不如預期，壓抑美元走勢，使台幣今日以30.14元，升值4.5分開出，加上台股續創新高，推估短線熱錢持續湧入台灣股市和匯市，此現象反映在台股收紅與外資持續買超，但受進口商買匯力道，令台幣升幅收斂，今日呈現區間盤整；終場新台幣兌美元升值2.7分，收在30.158元，台北外匯經紀公司成交量為5.81億美元。(3)技術面：指數已連四紅，並沿著五日均線走升，所有均線呈現多頭格局，量能亦維持於千億元之上，顯示多方氣勢續旺，但KD值均落入超買區，且5日乖離率持續擴大，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，短線強弱則觀察是否跌破五日線。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計買超63.63億元，其中外資買超49.4億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉55780口，較前日減少2056口淨多單，投信淨空單留倉31956口，自營商淨空單留倉992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 | 10774.21 | 10774.21 | 10723.37 | 50.12 | | 1259億 | 2.64 | 1.86 | 5.42 | |
| 10月台指期 | 10756 | 10763 | 10710 | 47.00 | -0.17 | 98363 | 2.50 | 2.50 | 3.00 | 65770 |
| 11月台指期 | 10743 | 10748 | 10698 | 47.00 | -0.29 | 11219 | 2.23 | 2.31 | 2.01 | 54532 |
| 10月小台指 | 10756 | 10762 | 10710 | 46.00 | -0.17 | 56441 | 1.81 | 1.83 | 2.02 | 28299 |
| 11月小台指 | 10743 | 10747 | 10699 | 46.00 | -0.29 | 12022 | 1.64 | 1.51 | 1.72 | 13528 |
| 電子指數 | 464.97 | 465.24 | 462.39 | 2.90 | | 920億 | | | | |
| 10月電子期 | 464.40 | 464.60 | 462.20 | 2.55 | -0.12 | 2206 | 1.46 | 1.42 | 1.41 | 3343 |
| 11月電子期 | 463.50 | 463.65 | 461.50 | 2.65 | -0.32 | 423 | 1.43 | 1.33 | 1.28 | 1446 |
| 金融指數 | 1143.09 | 1143.09 | 1136.87 | 1.66 | | 46億 | | | | |
| 10月金融期 | 1141.40 | 1142.20 | 1137.60 | 2.40 | -0.15 | 1211 | 1.47 | 1.39 | 1.59 | 4769 |
| 11月金融期 | 1143.20 | 1143.40 | 1137.80 | 4.60 | 0.01 | 389 | 1.41 | 1.36 | 1.47 | 935 |
| 摩台指 | 405.44 | 405.44 | 403.01 | 2.18 | | | | | | |
| 10月摩台指 | 404.30 | 404.60 | 402.60 | 1.80 | -0.28 | 31706 | - | - | 2.17 | 226802 |
| 11月摩台指 | 404.10 | 404.20 | 402.70 | 1.30 | -0.33 | 107 | - | - | 3.34 | 1552 |

<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

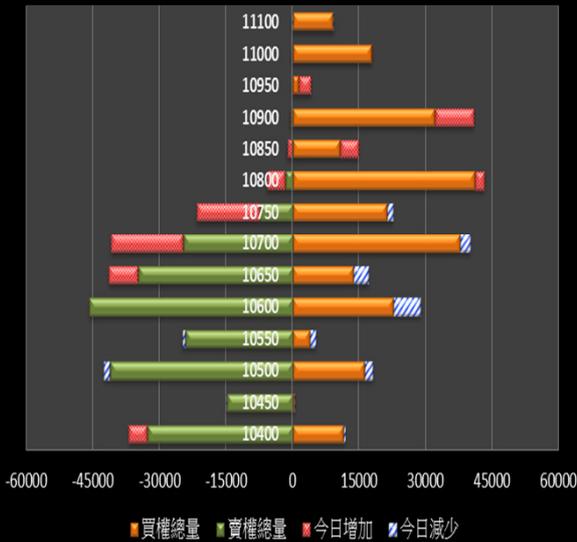
(104)金管期總字第002號

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

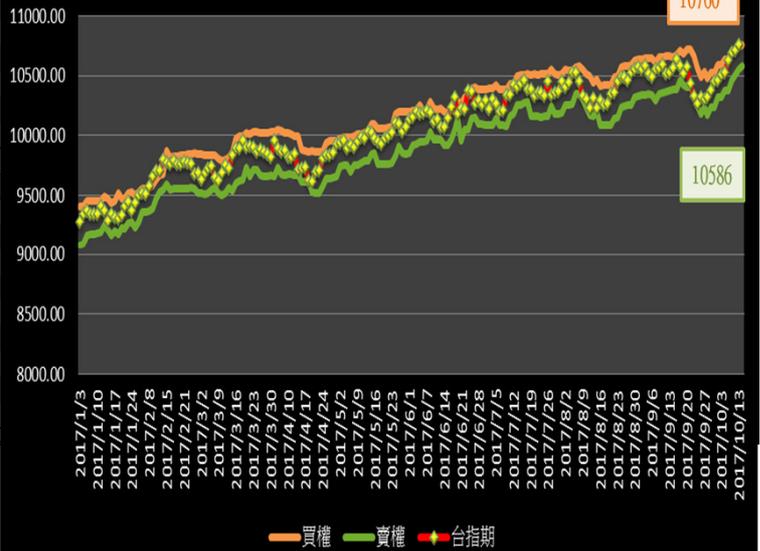
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

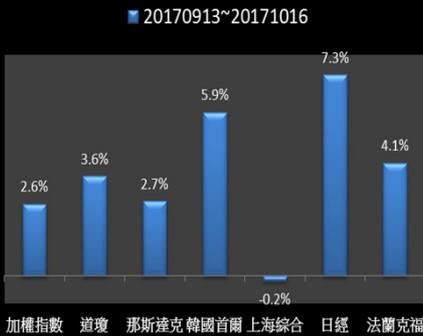


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

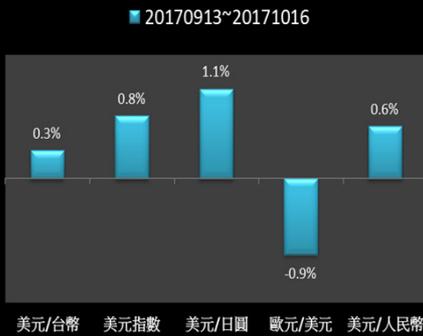


國際指數/商品期貨/外匯行情

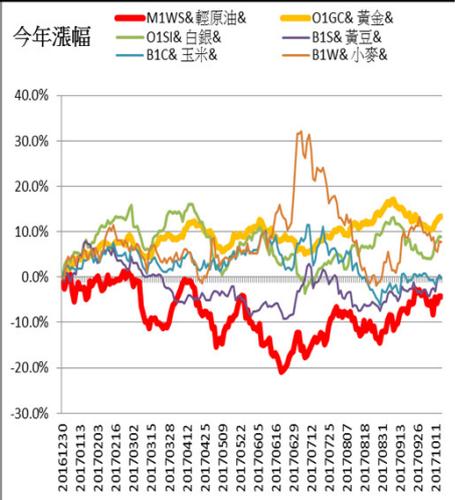
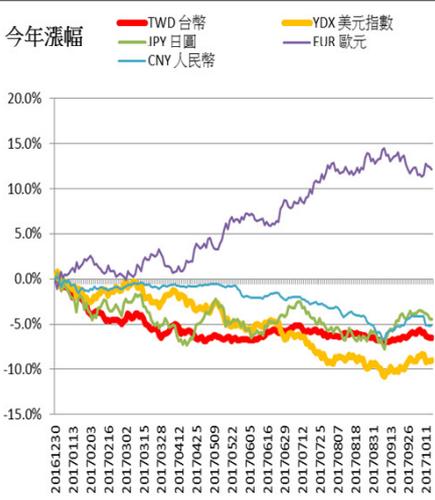
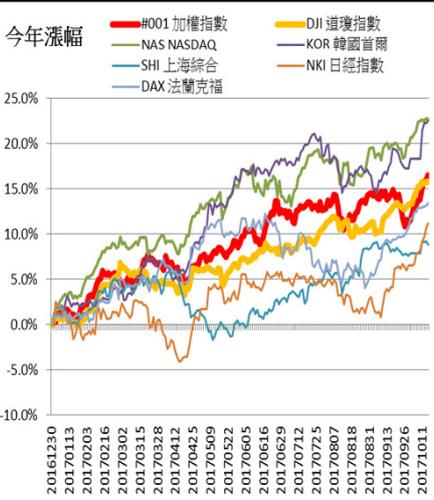
國際股市月績效表現



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。>