



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (107)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09月03日 星期一 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					台股現貨買超		台股現貨賣超					
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今	台股現貨買超		台股現貨賣超					
外資及陸資	221.22	242.06	-20.84	307.06	台積電	9.38	國巨	-10.59				
投信	9.33	13.98	-4.64	87.59	儒鴻	0.69	台化	-6.36				
自營商	38.28	60.75	-22.47	-257.64	台灣大	0.62	華新科	-5.45				
合計	267.96	315.92	-47.96	135.41	台肥	0.58	台塑化	-5.17				
8/31融資	44.26	42.11	2.15	今日 1729.69	彰銀	0.34	台塑	-3.45				
8/31融券	24230	29169	4939	餘額 410252	微星	0.31	南亞科	-3.32				
單位：口	多		空		百和	0.23	統一	-2.88				
8/31摩台09月多空比	100		1,475		臺企銀	0.22	統一超	-2.82				
台指期前十大佔市場	60.2%		45.4%		基泰	0.19	國泰金	-2.73				
電子期前十大佔市場	67.5%		54.4%		日勝生	0.16	鴻海	-2.51				
金融期前十大佔市場	64.7%		69.4%		前十名合計	12.73	後十名合計	-45.27				
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	46922	439	504	-144	-881	-41	17539	16020	1519	35383	26439	8944
投信	-24970	-519	43	0	30	0	-479	-479	0	-273	-273	0
自營商	-3142	-1251	-106	-13	23	3	-26246	-15748	-10498	-11712	-10649	-1063

● 觀盤重點提示

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.45，較前日減少 0.05，成交量p/c ratio為 1.01，較前日減少 0.06；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 47.96 億元，其中外資賣超 20.84 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 46922 口，較前日增加 439 口淨多單，投信淨空單留倉 24970 口，自營商淨空單留倉 3142 口。

盤勢分析：美、中貿易戰將於09/06(北美時間)結束公聽會，屆時美國總統Trump方才定調對中國USD\$2,000億商品加徵25%關稅與否？使得國內期、現貨市場之大盤指數開盤走低；盤中則受到滬、深2大股市指數開低後再繼續下探、跌破2700點，拖累臺灣加權指數、近月台指期收盤皆走跌。觀察國內期交所發佈之vix波動率升至14.09，使得今日台指期(近月)收盤呈黑色K柱線，且指數跌破5日SMA均線；然而今日收盤成交量仍然較前一日增加，且短天期SMA均線維持多頭排列。研發部預期短線指數可能略微偏空，然而推估高檔拉回僅為短暫現象；投資人可考慮指數回檔之際逢低佈局期貨多單部位，抑或考慮採用買權的多頭價差以利規避市場的波動風險。

● 台指期貨收盤行情

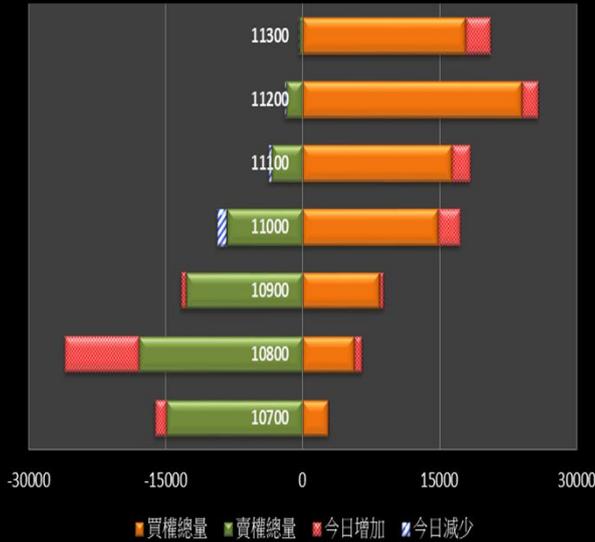
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10964.22	11097.11	10952.85	-99.72		1102億	2.28	1.35	4.85	
09月台指期	10934	11045	10919	-87.00	-0.28	141932	2.22	2.33	2.93	94731
10月台指期	10920	11030	10906	-86.00	-0.40	2364	1.58	1.50	1.55	7336
09月小台指	10934	11045	10920	-88.00	-0.28	107334	1.69	1.77	1.93	35589
10月小台指	10920	11029	10908	-85.00	-0.40	4731	1.33	1.28	1.38	7761
電子指數	450.37	457.13	449.81	-3.73		787億				
09月電子期	449.65	454.85	448.55	-3.00	-0.16	3028	1.38	1.46	1.49	2480
10月電子期	449.10	454.00	448.00	-3.05	-0.28	102	1.32	1.30	1.31	105
金融指數	1273.22	1280.34	1270.05	-8.01		45億				
09月金融期	1269.00	1276.00	1265.40	-3.80	-0.33	1143	1.36	1.29	1.45	2185
10月金融期	1268.00	1273.00	1264.80	-4.00	-0.41	31	1.25	1.04	1.35	79
摩台指	410.94	415.85	410.45	-3.06						
09月摩台指	409.90	414.30	409.80	-2.60	-0.25	31901	-	-	2.08	204928
10月摩台指	410.80	409.90	409.80	-2.90	-0.03	906	-	-	69.69	218

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

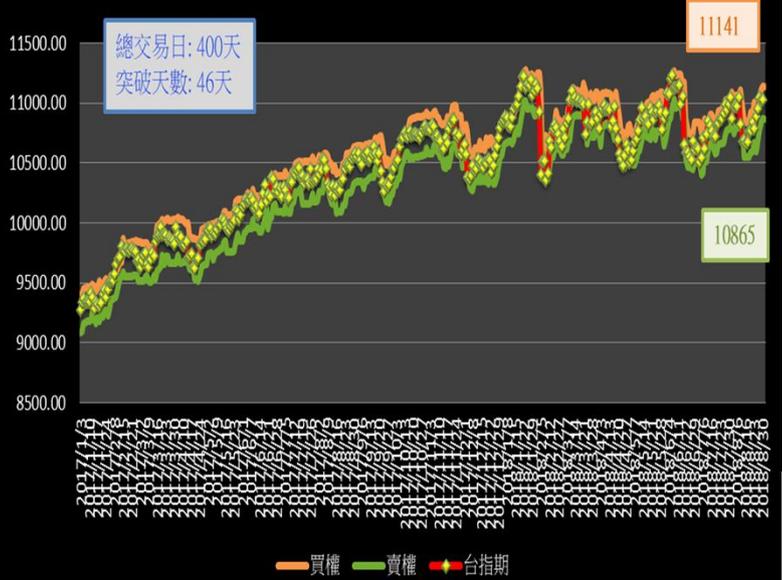


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

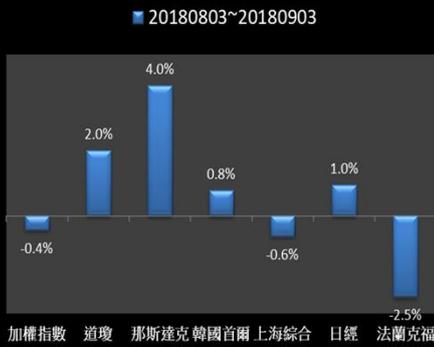


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

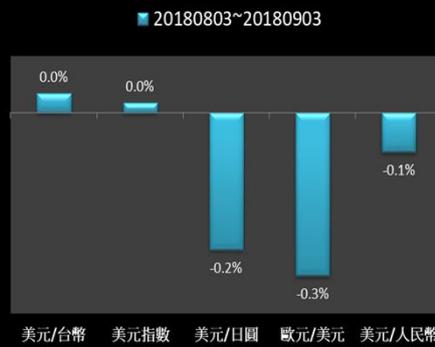


國際指數/商品期貨/外匯行情

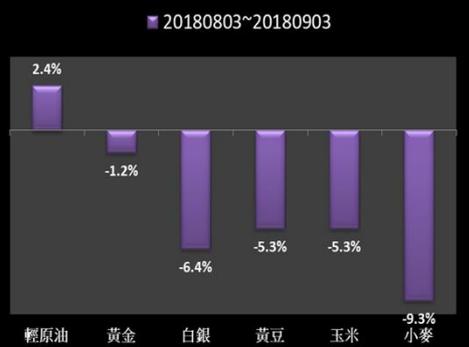
國際股市月績效表現



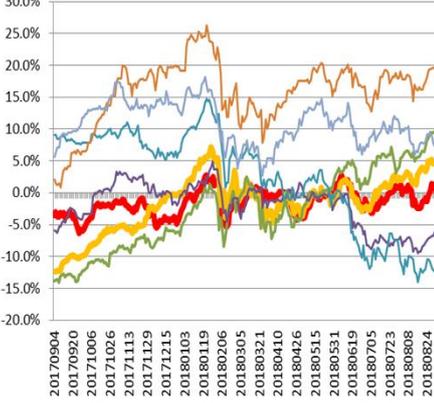
國際外匯月績效表現



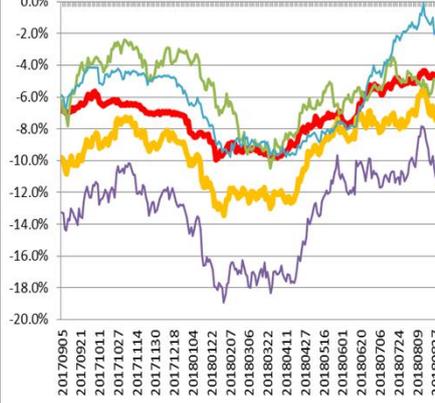
國際商品期貨月績效表現



年漲幅



年漲幅



年漲幅

