



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11日 星期二 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
外資及陸資	363.39	352.79	10.60	43.92	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
投信	17.39	19.30	-1.91	-41.57	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
自營商	55.90	55.84	0.07	-86.80	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
合計	436.23	427.03	9.20	-84.36	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
9/10融資	53.61	91.74	-38.13	今日 1644.91	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
9/10融券	73238	57938	-15300	餘額 413901	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
單位：口	多		空		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
9/10摩台09月多空比	21		1,022		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
台指期前十大佔市場	55.4%		47.8%		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
電子期前十大佔市場	57.4%		57.4%		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
金融期前十大佔市場	56.6%		71.3%		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
期貨未平倉	台股期		電子期		金融期		台指選擇權(買權)		台指選擇權(賣權)		台股現貨買賣超	
多空淨額	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	28729	-5105	647	-82	-1151	-23	15646	16462	-816	52046	46327	5719
投信	-25179	462	-146	0	22	-8	-479	-479	0	-303	-283	-20
自營商	-3959	1354	-218	-83	28	17	-45022	-35991	-9031	-10561	-21375	10814

● 觀盤重點提示

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.15，與前日持平，成交量p/c ratio為 1.1，較前日增加 0.05；近月買權最大未平倉量集中在 11000 履約價序列，賣權最大未平倉量集中在 10500 履約價序列。

期、現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計買超 9.2 億元，其中外資買超 10.6 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 28729 口，較前日減少 5105 口淨多單，投信淨空單留倉 25179 口，自營商淨空單留倉 3959 口。

盤勢分析：台指期(近月份)晨間開盤受到美股三大指數止跌反彈而走高，盤中則受到陸、港股影響一度跌破10,700關卡，收盤則再度走高。今日外資持續買超現貨市場，然而金額已較前一日縮減。觀察資金流入非金電族群、金融族群，電子期指、現貨指數受到美、中關稅議題之衝擊再度補跌，其中昨日強勢的電子龍頭股台積電(2330 TT)卻在今日收盤下跌、鴻海(2317 TT)卻在連續數個交易日走跌後出現反彈。加權指數亦於連續4個交易日下跌後出現反彈，成交量卻較前一日下滑，形成價量背離。由期、權籌碼面可得知，台指期淨多單減少逾-5,100口、台指選的賣權部位卻增加逾5,700口、台指選的成交量P/C ratio由1.03增至1.07，顯示現階段的籌碼面仍有偏向空方的疑慮。以技術面檢驗，近月份台指期的短天期SMA均線出現死亡交叉，在指數尚未站回年線之前，不排除指數可能將在探底。短線指數將隨國際關稅議題使得波動加劇，可能形成範圍較大的區間盤整格局，因此期貨避險方面可考慮當日沖銷；選擇權則可考慮賣出價外之買權、賣權，且應設定停損、停利點。

● 台指期貨收盤行情

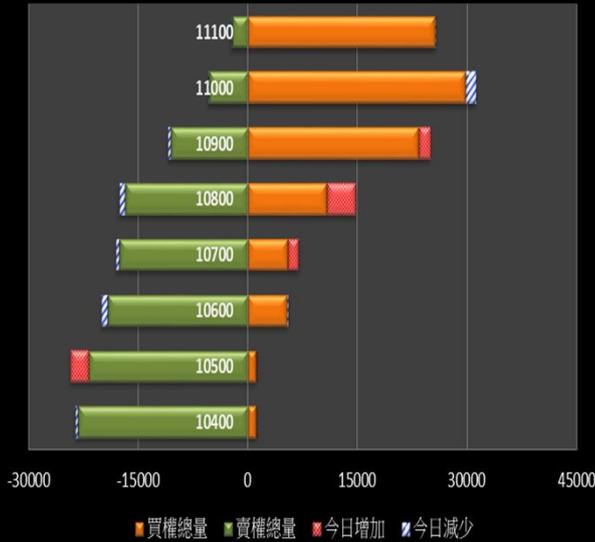
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10752.30	10765.42	10669.59	26.50		1245億	2.29	1.19	4.76	
09月台指期	10741	10767	10682	6.00	-0.11	169832	2.33	2.34	2.93	87472
10月台指期	10735	10756	10676	10.00	-0.16	4450	2.52	2.80	1.66	11524
09月小台指	10741	10767	10682	7.00	-0.11	116040	1.71	1.73	1.91	35922
10月小台指	10735	10757	10676	8.00	-0.16	7366	1.31	1.37	1.41	8535
電子指數	439.96	442.02	436.74	0.22		861億				
09月電子期	439.65	442.05	437.00	-0.80	-0.07	3626	1.37	1.41	1.41	2424
10月電子期	439.60	441.50	437.00	-0.15	-0.08	198	1.15	1.13	1.11	256
金融指數	1258.17	1258.17	1252.04	3.37		63億				
09月金融期	1256.20	1258.80	1253.40	1.00	-0.16	1117	1.26	1.25	1.29	2190
10月金融期	1256.00	1258.40	1253.80	0.80	-0.17	30	1.11	1.19	1.07	148
摩台指	405.15	406.41	402.53	-0.07						
09月摩台指	404.10	406.30	402.00	-1.30	-0.26	43090	-	-	1.98	204052
10月摩台指	404.00	405.30	402.00	-1.50	-0.28	286	-	-	8.41	2752

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

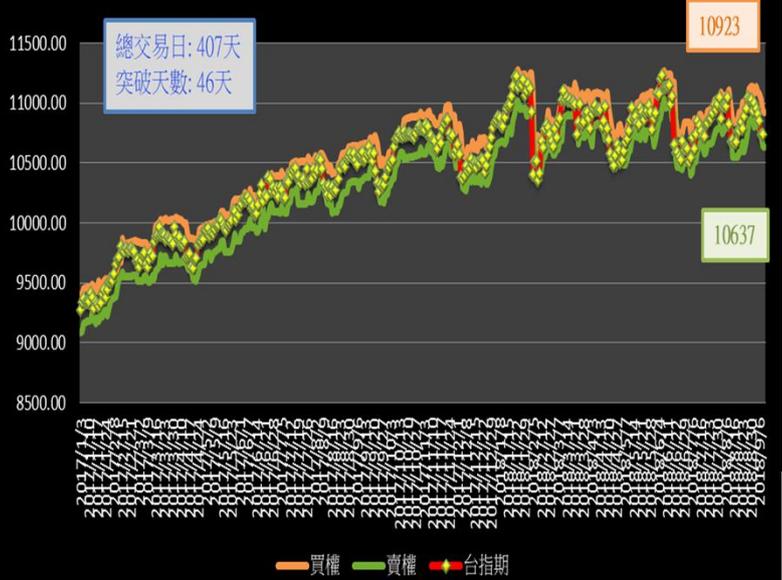


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

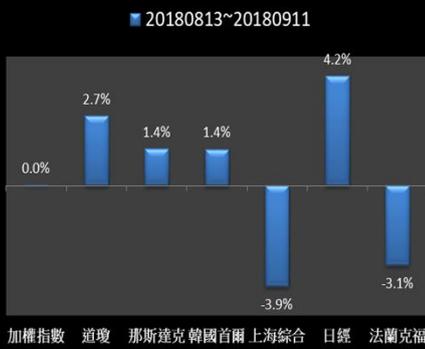


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

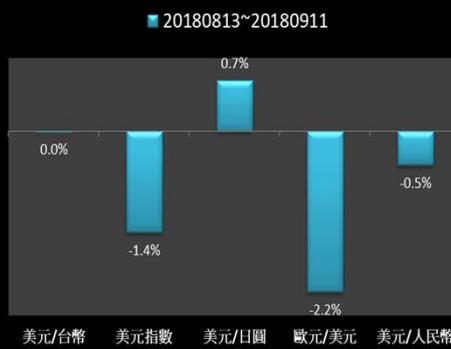


國際指數/商品期貨/外匯行情

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

