



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10月09日 星期二 收盤日報

法人動態：

台股現貨買賣起					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	303.08	360.32	-57.24	-461.57	台塑化	6.87	可成	-3.61				
投信	18.95	16.05	2.90	-42.62	台化	5.28	聯發科	-2.85				
自營商	58.09	57.86	0.23	-24.72	台積電	4.68	致茂	-1.87				
合計	379.71	433.79	-54.08	-528.89	台塑	4.59	日月光投控	-1.71				
10/8融資	41.97	49.88	-7.91	今日 1530.14	大立光	3.87	研華	-1.51				
10/8融券	44280	56497	12217	餘額 435723	統一超	3.00	旺宏	-1.49				
單位：口	多		空		國巨	2.98	鴻海	-1.25				
台指期前十大市場佔比	45.9%		50.5%		台達電	2.81	南亞	-1.14				
電子期前十大市場佔比	51.2%		69.7%		中華電	2.80	和碩	-0.94				
金融期前十大市場佔比	59.1%		68.5%		兆豐金	2.70	亞德客-KY	-0.92				
非金電期前十大市場佔	81.4%		88.4%		前十名合計	39.57	後十名合計	-17.30				
期貨未平倉 多空淨額	台指期		電子期		金融期		非金電期		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	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資及陸資	6248	-521	-36	26	-1020	76	36	2	2959	4355	23079	5158
投信	-23370	738	732	93	17	-1	3	0	-440	-91	1636	5
自營商	3269	648	-658	-96	137	-14	-9	-11	-102397	3383	17592	3950

觀盤重點提示

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 0.71，較前日增加 0.01，成交量p/c ratio為 0.77，較前日減少 0.06；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 10000 履約價序列。

期、現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣起 54.08 億元，其中外資賣起 57.24 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 6248 口，較前日減少 521 口淨多單，投信淨空單留倉 23370 口，自營商淨多單留倉 3269 口。

盤勢分析：今日晨間美股道瓊指數盤中一度大跌，收盤則上漲近40點，帶動今日台指期收盤呈現跌幅收斂。由於美國白宮預計將於11月進行軍演，使得短期內美、中關係的衝突逐漸升高，近日國內期交所發佈之vix波動率亦攀升至18.04達近半年以來的新高，導致臺指期近月進入顯著修正的階段。此外，(1)美Fed官員談話大多持鷹派看法導致美國10年期債券殖利率逐日走高，美元升值驅使國內資金外移，外資近日賣起現貨部位；(2)單日融資出現大減，整體上市融資餘額顯著降至1530.14億元達近一年來的新低水位。以上兩大項目為近期的利空，使得電子期、現貨走跌；金融期、現貨則逐步走高。觀察台指期近月的短期日均線維持空方排列，且今日收盤指數低於週均線，顯示技術面維持疲弱；觀察台指選之賣權oi口數高於買權oi口數，以及期貨淨多單仍維持負值，顯示籌碼面仍偏弱。後市須關注蘋概股、被動元件、半導體的資金動向，倘若後續跌幅未收斂，則推估短線大盤指數可能下探至全年低點；倘若後續受惠新台幣止跌回升，則預期指數有機會站回週均線，並出現跌深反彈的行情。

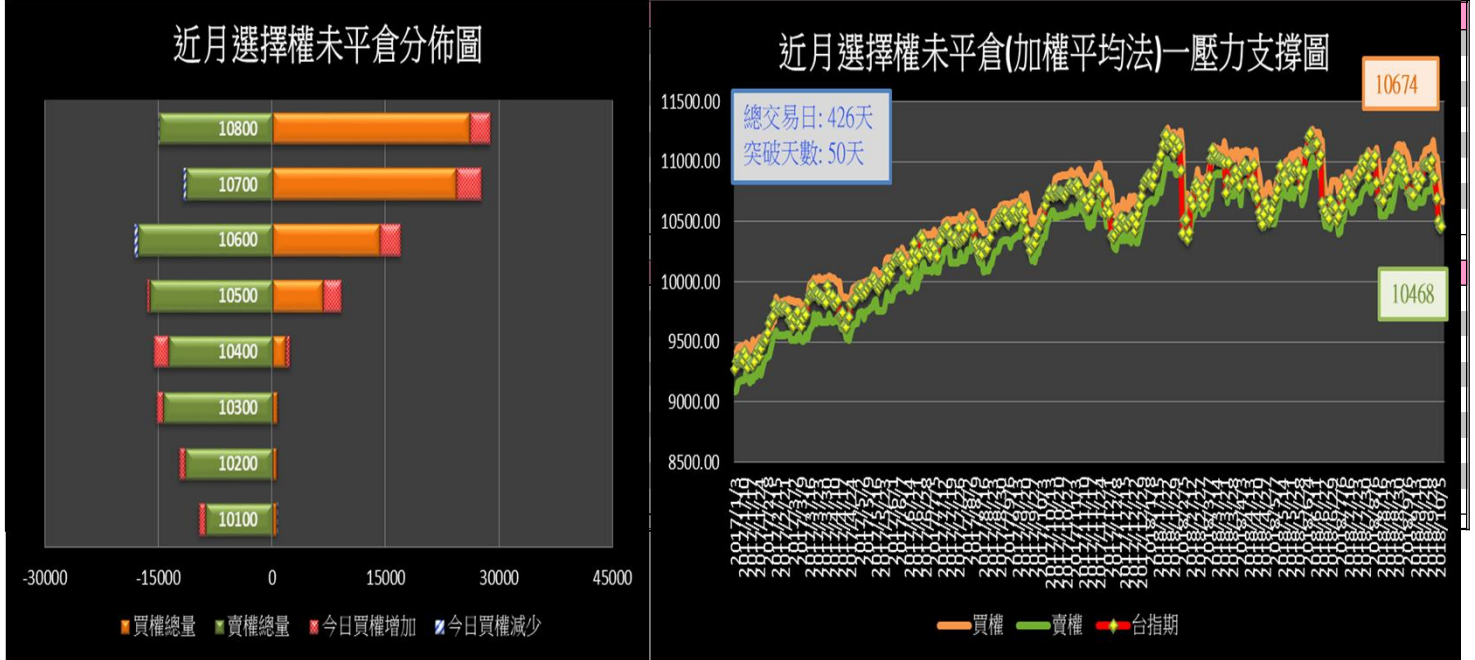
台指期貨收盤行情

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	10466.83	10503.10	10428.97	10.90		1209億	2.12	1.17	4.58	
10月台指期	10461	10508	10447	-4.00	-0.06	152939	2.35	2.31	2.90	98234
11月台指期	10458	10503	10445	0.00	-0.08	3594	1.63	1.54	1.66	10517
10月小台指	10461	10508	10447	-4.00	-0.06	105705	1.70	1.75	1.93	41439
11月小台指	10458	10503	10444	0.00	-0.08	6234	1.28	1.38	1.44	12153
電子指數	410.68	413.10	408.88	-1.25		766億				
10月電子期	410.85	414.35	409.60	-1.65	0.04	4256	1.44	1.51	1.48	3729
11月電子期	411.00	414.00	409.65	-1.45	0.08	250	1.28	1.34	1.30	491
金融指數	1290.80	1296.46	1280.59	6.59		73億				
10月金融期	1290.00	1295.20	1285.20	3.80	-0.06	1918	1.30	1.43	1.36	2544
11月金融期	1289.60	1294.40	1284.80	4.60	-0.09	89	1.46	1.19	1.07	170
摩台指	391.06	392.50	389.27	0.71						
10月摩台指	390.30	391.70	389.20	0.00	-0.19	40754	-	-	2.07	188881
11月摩台指	391.00	391.40	389.60	0.10	-0.02	624	-	-	39.00	3175

<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



國際指數/商品期貨/外匯行情

