



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11日 星期四 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	527.08	829.05	-301.97	-763.54	致茂	2.17	台積電	-195.11				
投信	24.84	18.82	6.02	-36.83	智邦	0.30	鴻海	-41.09				
自營商	126.78	132.34	-5.57	-30.38	大同	0.16	台塑化	-36.92				
合計	678.34	979.96	-301.61	-830.82	新興	0.10	台塑	-30.48				
10/9融資	37.88	53.69	-15.81	今日 1509.59	中和	0.07	台化	-26.73				
10/9融券	46700	57348	10648	餘額 445258	華經	0.03	大立光	-21.71				
單位：口	多		空		中電	0.01	南亞	-20.25				
台指期前十大市場佔比	-36.6%		-39.9%		台榮	0.01	中信金	-14.23				
電子期前十大市場佔比	-54.1%		-20.2%		銘旺科	0.00	日月光投控	-13.39				
金融期前十大市場佔比	-18.6%		-71.2%		五鼎	0.00	統一	-13.21				
非金電期前十大市場佔	-33.7%		-3.1%		前十名合計	2.87	後十名合計	-413.13				
期貨未平倉	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)	
多空淨額	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	16702	10454	608	644	-1155	-135	35	-1	-31861	-34820	-3117	-26196
投信	-26827	-3457	281	-451	17	0	3	0	-180	260	1499	-137
自營商	7581	4312	-212	446	209	72	-73	-64	-103209	-812	11614	-5978

觀盤重點提示

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 0.62，較前日減少 0.09，成交量p/c ratio為 1，較前日增加 0.23；近月買權最大未平倉量集中在 10900 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超 301.61 億元，其中外資賣超 301.97 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 16702 口，較前日增加 10454 口淨多單，投信淨空單留倉 26827 口，自營商淨多單留倉 7581 口。

盤勢分析：今日晨間美股四大指數出現大幅跌勢，美道瓊指數下跌逾830點(跌幅為-3.15%)、Nasdaq指數下跌近316點(跌幅為-4.08%)；此利空現象擴及全球股市皆重跌，亞洲股市以台股、臺指期之跌幅最顯著，跌幅分別為-6.31%及-7.83%；次為中國的深證指數、上證指數，跌幅分跌落在-6.07%及-5.22%。國內期交所發佈之VIX波動率25.87達近兩年來的次高水位，顯示短期間市場不穩定性大幅提高。

受到美股衝擊，台股、臺指期近月於晨間開盤即大跌逾400點，由日線K線圖觀察可得知盤面上形成顯見的跳空缺口，並出現長柱型態之黑色K柱線，收盤跌破10,000點關卡，創下今年2018全年指數最低點。由於開盤立即出現賣壓行情，盤中多次釋出停損賣單，期貨近月合約出現鉅額成交量34.7萬口，期、現貨逆價差達164點。今日集中市場跌停家數不斷增加，達近3年來首次跌停逾200間上市、櫃公司。財政部指出，一旦有必要條件，適時將會透過國安基金進場。

由籌碼面觀察，(1)未平倉P/C ratio降至0.72、成交量P/C ratio增至0.91；(2)臺指選之買權OI減持口數大於賣權OI減持口數，以上均顯示短線籌碼面趨向空方。後續大盤指數能否有效止跌？需視外資對於期、權、現貨市場之增、減情形而定，研發部推估短線指數將有機會出現跌深反彈，持續關注後續期市表現。

台指期貨收盤行情

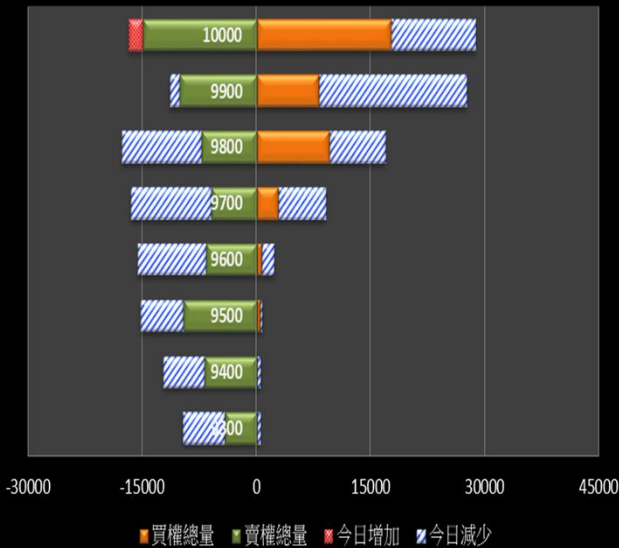
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	9806.11	10272.04	9797.93	-660.72		2058億	2.02	1.51	4.59	
10月台指期	9654	10080	9630	-819.00	-1.58	347807	2.13	2.14	2.61	95760
11月台指期	9638	10074	9616	-835.00	-1.74	17123	1.67	1.97	1.95	12526
10月小台指	9654	10080	9630	-820.00	-1.58	243268	1.74	1.79	2.00	32259
11月小台指	9638	10077	9617	-827.00	-1.74	24079	1.41	1.59	1.68	10366
電子指數	383.42	398.12	383.02	-27.26		1101億				
10月電子期	377.20	391.35	376.00	-34.55	-1.65	8849	1.61	1.68	1.67	3139
11月電子期	376.60	390.55	376.00	-34.90	-1.81	594	1.45	1.52	1.37	523
金融指數	1231.38	1281.97	1230.28	-59.42		201億				
10月金融期	1223.00	1263.40	1219.20	-70.80	-0.69	6747	1.41	1.43	1.53	2345
11月金融期	1220.00	1262.00	1220.00	-69.60	-0.93	420	1.44	1.59	1.28	272
摩台指	365.58	377.88	365.26	-25.48						
10月摩台指	360.50	375.90	360.50	-28.30	-1.41	144706	-	-	2.18	185458
11月摩台指	360.00	375.90	360.00	-29.60	-1.55	3715	-	-	11.12	3923

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

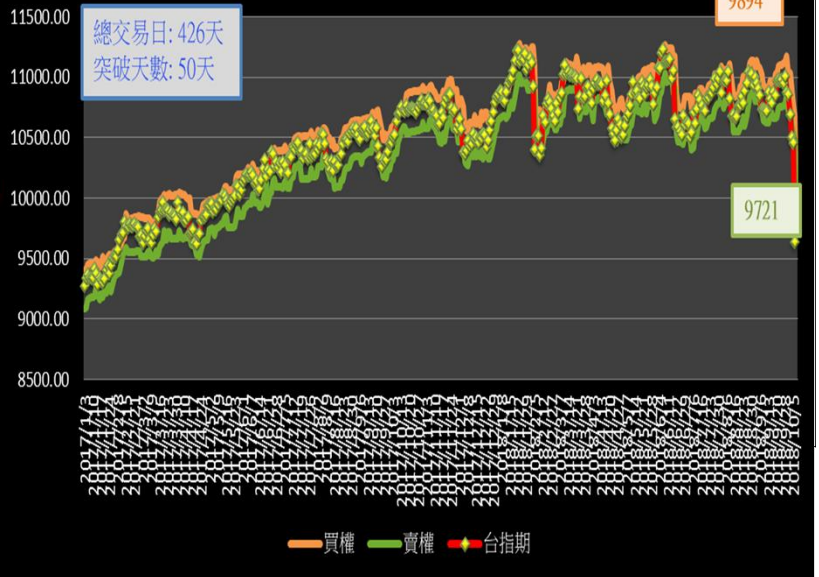


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

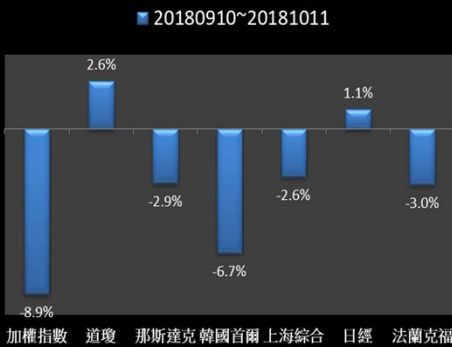


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

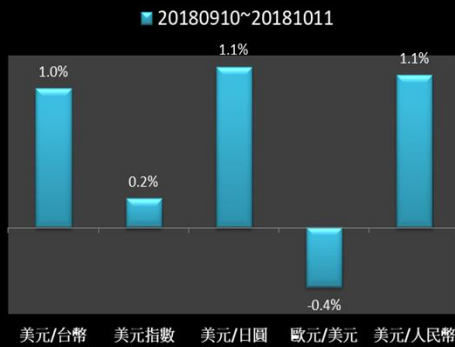


國際指數/商品期貨/外匯行情

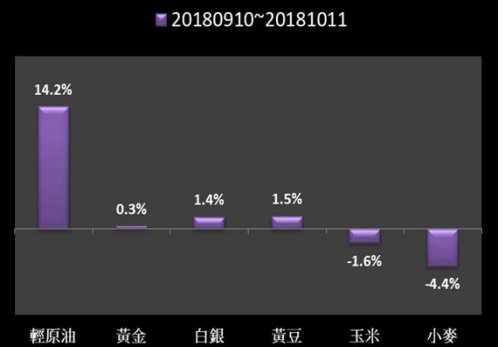
國際股市月績效表現



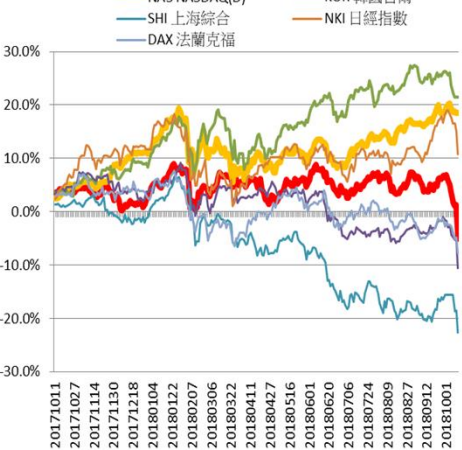
國際外匯月績效表現



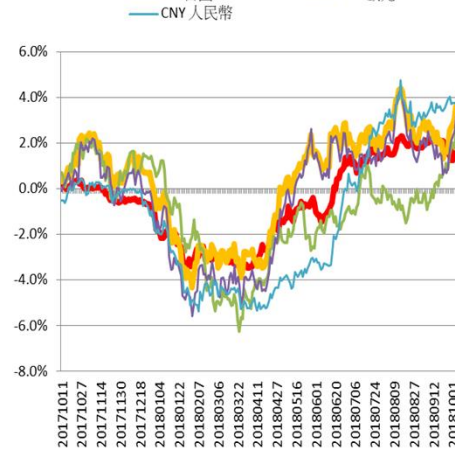
國際商品期貨月績效表現



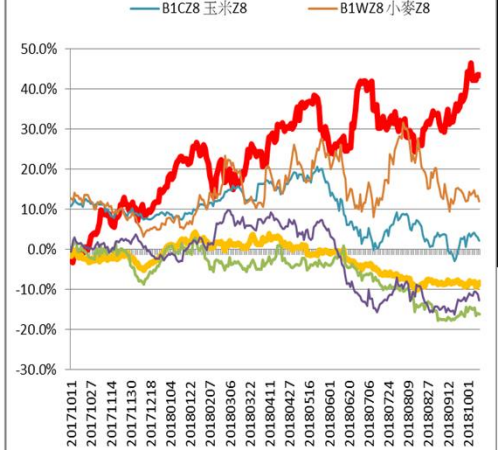
年漲幅



年漲幅



年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>