

華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (1

(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

3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4, Taipei, TAIWAN 台指期貨 2018年10月12日

2018年10月12日 星期五 收盤日報

● 法人動態:

14/53/16											
台股現貨買賣超											
買進	賣出	合計	累計本月至今		個股貢獻點數前十		前十名	名 個股貢獻黑		占數後十名	
426.95	468.15	-41.20	-804.73		台積電		90.68	中華電		-1.43	
13.51	18.86	-5.36	-42.57		大立光		15.80	奇力新		-1.39	
85.46	66.62	18.84	-11	-11.63		鴻海		致茂		-0.92	
525.69	553.11	-27.42	-858.72		台化		9.71	裕日車		-0.66	
61.31	157.28	-95.97	今日	1390.81	1	台塑	7.03	福懋油		-0.56	
88008	85770	-2238	餘額	438565	台	達電	6.69	聯電		-0.46	
/11融券 88008 85770 -223 單位:口 多			空		統一		5.65	智邦		-0.33	
·指期前十大市場佔比 -40.		1%	√₀ -39.5%		聯發科		5.52	大聯大		-0.31	
期前十大市場佔比 -57.3		-18.		.5% 南		0亞科 5.48		華新		-0.31	
期前十大市場佔比 -23.99		9%	-60.1%		南亞		5.26	華映		-0.21	
大市場佔	-27.8	3%	-2	.2%	前十	名合計	163.30	後十名合計		-6.57	
台指	期	電子	期	金屬	k期 非金電期		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
26347	9645	800	192	-887	268	41	6	-15234	16627	4111	7228
-23919	2908	31	-250	18	1	3	0	-180	0	1082	-417
6712	-869	61	273	73	-136	-70	3	-109996	-6787	14130	2516
	買進 426.95 13.51 85.46 525.69 61.31 88008 口市場佔比市場佔比 市場佔比 大市場佔 大市場佔 大市場佔 26347 -23919	世 (日本)	世界	台股現貨買賣超 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日	台股現貨買賣超 買進 賣出 合計 累計本月至今 426.95 468.15 -41.20 -804.73 13.51 18.86 -5.36 -42.57 85.46 66.62 18.84 -11.63 525.69 553.11 -27.42 -858.72 61.31 157.28 -95.97 今日 1390.81 88008 85770 -2238 餘額 438565 口	一日 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本	台股現貨買賣超 買進 賣出 合計 累計本月至今 個股貢獻點數頁 426.95 468.15 -41.20 -804.73 台積電 13.51 18.86 -5.36 -42.57 大立光 85.46 66.62 18.84 -11.63 鴻海 525.69 553.11 -27.42 -858.72 台化 61.31 157.28 -95.97 今日 1390.81 台塑 88008 85770 -2238 餘額 438565 台達電 口 多 空 統一 市場佔比 -40.4% -39.5% 聯發科 市場佔比 -57.3% -18.5% 南亞科 市場佔比 -23.9% -60.1% 南亞 大市場佔 -27.8% -2.2% 前十名合計 全報期 非金 未平倉 增減 未平倉 增減 未平倉 26347 9645 800 192 -887 268 41 -23919 2908 31 -250 18 1 3	当日 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本	台股現貨買賣超 買進 賣出 合計 累計本月至今 個股貢獻點數前十名 個 426.95 468.15 -41.20 -804.73 台積電 90.68 中華 13.51 18.86 -5.36 -42.57 大立光 15.80 奇力 85.46 66.62 18.84 -11.63 鴻海 11.48 致力 525.69 553.11 -27.42 -858.72 台化 9.71 谷日 61.31 157.28 -95.97 今日 1390.81 台塑 7.03 福懋 88008 85770 -2238 餘額 438565 台達電 6.69 聯行 0 室 統一 5.65 智慧 市場佔比 -40.4% -39.5% 南亞科 5.48 華男 市場佔比 -57.3% -18.5% 南亞科 5.48 華男 市場佔比 -23.9% -60.1% 南亞 5.26 華麗 大市場佔比 -27.8% -2.2% 前十名合計 163.30 後十名 大市場佔比 -27.8% -2.2% 前十名合計 4 4 4 4	台股現貨買賣超 買進 賣出 合計 累計本月至今 個股貢獻點數前十名 個股貢獻點 426.95 468.15 -41.20 -804.73 台積電 90.68 中華電 13.51 18.86 -5.36 -42.57 大立光 15.80 奇力新 85.46 66.62 18.84 -11.63 鴻海 11.48 致茂 525.69 553.11 -27.42 -858.72 台化 9.71 裕日車 61.31 157.28 -95.97 今日 1390.81 台塑 7.03 福懋油 88008 85770 -2238 餘額 438565 台達電 6.69 聯電 口 多 空 統一 5.65 智邦 市場佔比 -40.4% -39.5% 聯發科 5.52 大聯大 市場佔比 -57.3% -18.5% 南亞科 5.48 華新 市場佔比 -23.9% -60.1% 南亞 5.26 華映 大市場佔比 -27.8% -2.2% 前十名合計 台指選擇權(買權) 未平倉 增減 未平倉 增減 未平倉 增減 未平倉 <	一日 日本 日本 日本 日本 日本 日本 日本

● 觀盤重點提示

選擇權籌碼:今日未平倉p/c ratio為 0.68,較前日增加 0.06,成交量p/c ratio為 0.95,較前日減少 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 10600 履約價序列。

期、現貨籌碼:[1]現貨三大法人今日合計賣超 27.42 億元,其中外資賣超 41.2 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 26347 口,較前日增加 9645 口淨多單,投信淨空單留倉 23919 口,自營商淨多單留倉 6712 口。

盤勢分析: 美股四大指數維持前一交易日之跌勢,其中美股道瓊指數下跌逾545點;今日亞洲股市、新興市場則出現跌深反彈,未受美股之下跌衝擊。臺灣市場加權指數今日收盤反彈至10,000點關卡以上;臺指期近月則受惠夜間台指期進而出現上漲走勢,今日收盤明顯反彈至9,900點關卡之上。期、現貨市場仍維持逆價差未變,推估後續指數將有補跌的可能性。

觀察國內期交所發佈之VIX波動率已降至22.06,相對前一交易日下滑,推估後續之跌幅將逐漸收斂。籌碼面觀察,今日外資持有買權 oi增加口數大於賣權oi增加口數,且未平倉P/C ratio增至0.78、成交量P/C ratio降至0.87,顯示今日籌碼面相對良好。至於後續表 現需視外資的增、減持情形而定。

由於美國的升息步調,可能使得全球資金收縮。以技術面評估,台指期近月的短期日均線仍維持空方排列,今日收盤指數尚未站上週均線。在國際金融市場尚未穩定的情況下,短線波動的可能性大增,預估短期間指數將於週均線以下區間震盪徘迴;待未來指數重新站回週均線之上,方才有望重啟多方的機會。

台指期貨收盤行情

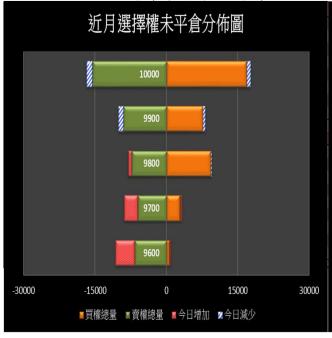
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10045.81	10046.01	9740.76	239.70		1438億	1.98	1.25	4.69	
10月台指期	9958	10021	9683	294.00	-0.88	241580	2.24	2.19	2.83	85868
11月台指期	9942	9994	9664	288.00	-1.04	15940	1.82	1.83	1.93	19679
10月小台指	9958	10021	9683	296.00	-0.88	167744	1.78	1.70	2.01	27122
11月小台指	9942	9995	9664	291.00	-1.04	18378	1.41	1.33	1.51	9580
電子指數	395.81	395.98	382.97	12.39		871億				
10月電子期	391.85	395.00	379.75	13.70	-1.01	5926	1.48	1.43	1.49	2597
11月電子期	391.45	394.25	379.75	14.45	-1.11	702	1.31	1.40	1.31	702
金融指數	1246.34	1247.93	1215.27	14.96		110億				
10月金融期	1238.60	1242.80	1212.60	14.20	-0.62	3664	1.33	1.31	1.38	2161
11月金融期	1238.40	1241.80	1213.00	18.00	-0.64	345	1.43	1.26	1.20	364
摩台指	376.86	376.86	364.91	11.28						
10月摩台指	372.80	376.50	363.70	12.30	-1.09	101632	-	-	2.09	179972
11月摩台指	373.00	376.20	363.90	13.10	-1.03	1263	_	_	6.10	7004

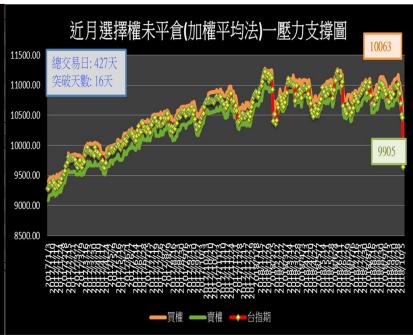


華南金融集團

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.

台指選擇權未平倉解析





國際指數/商品期貨/外匯行情

