



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12日 星期五 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	426.95	468.15	-41.20	-804.73	台積電	90.68	中華電	-1.43				
投信	13.51	18.86	-5.36	-42.57	大立光	15.80	奇力新	-1.39				
自營商	85.46	66.62	18.84	-11.63	鴻海	11.48	致茂	-0.92				
合計	525.69	553.11	-27.42	-858.72	台化	9.71	裕日車	-0.66				
10/11融資	61.31	157.28	-95.97	今日 1390.81	台塑	7.03	福懋油	-0.56				
10/11融券	88008	85770	-2238	餘額 438565	台達電	6.69	聯電	-0.46				
單位：口	多		空		統一	5.65	智邦	-0.33				
台指期前十大市場佔比	-40.4%		-39.5%		聯發科	5.52	大聯大	-0.31				
電子期前十大市場佔比	-57.3%		-18.5%		南亞科	5.48	華新	-0.31				
金融期前十大市場佔比	-23.9%		-60.1%		南亞	5.26	華映	-0.21				
非金電期前十大市場佔	-27.8%		-2.2%		前十名合計	163.30	後十名合計	-6.57				
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	26347	9645	800	192	-887	268	41	6	-15234	16627	4111	7228
投信	-23919	2908	31	-250	18	1	3	0	-180	0	1082	-417
自營商	6712	-869	61	273	73	-136	-70	3	-109996	-6787	14130	2516

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徊；待未來指數重新站上週均線之上，方才有望重啟多方的機會。

台指期貨收盤行情

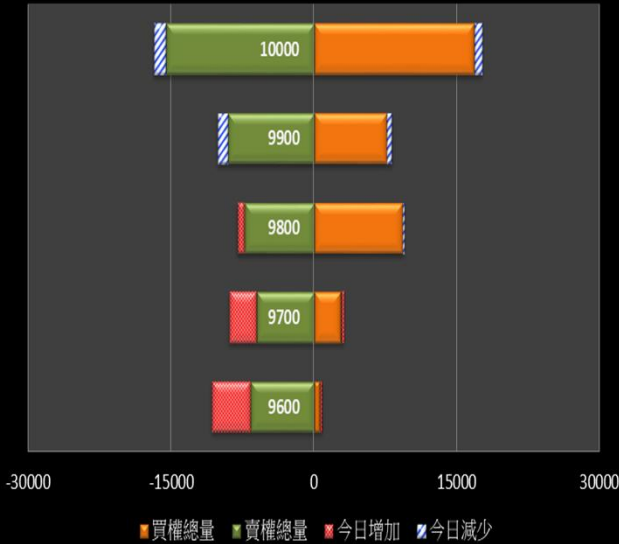
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10045.81	10046.01	9740.76	239.70		1438億	1.98	1.25	4.69	
10月台指期	9958	10021	9683	294.00	-0.88	241580	2.24	2.19	2.83	85868
11月台指期	9942	9994	9664	288.00	-1.04	15940	1.82	1.83	1.93	19679
10月小台指	9958	10021	9683	296.00	-0.88	167744	1.78	1.70	2.01	27122
11月小台指	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

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

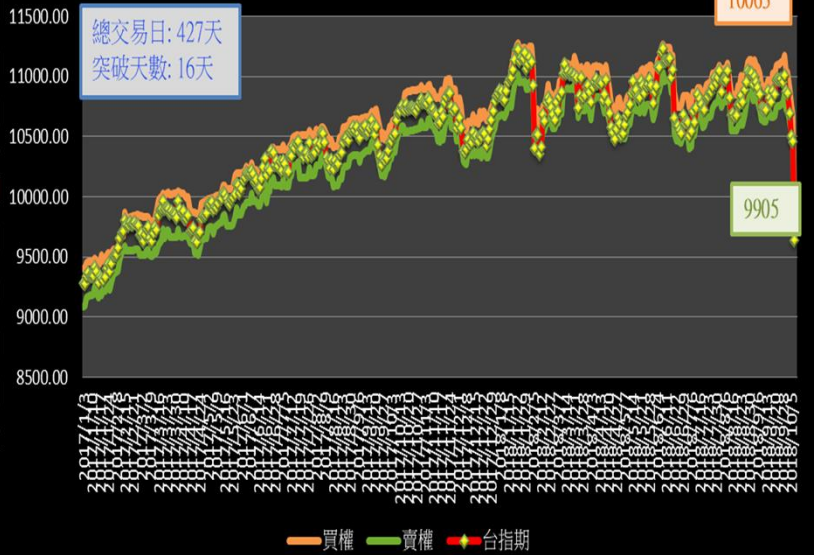


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

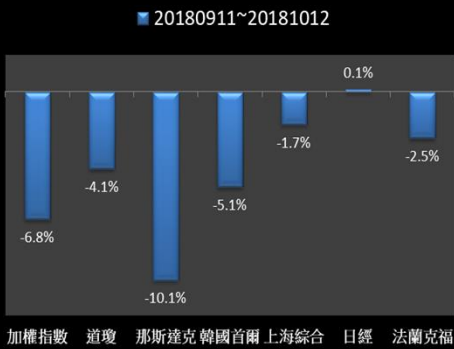


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

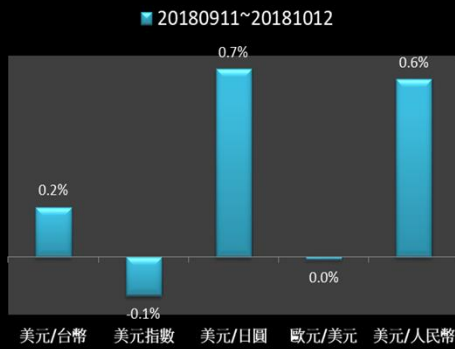


國際指數/商品期貨/外匯行情

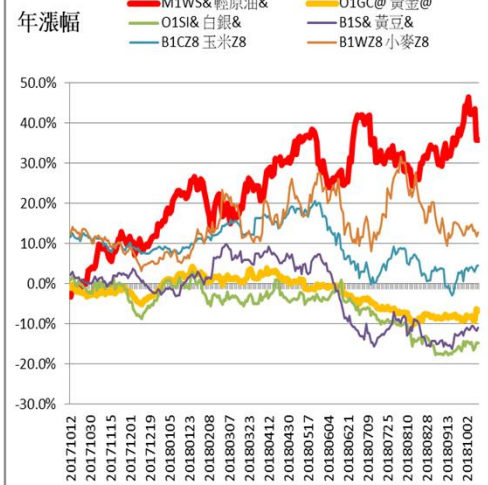
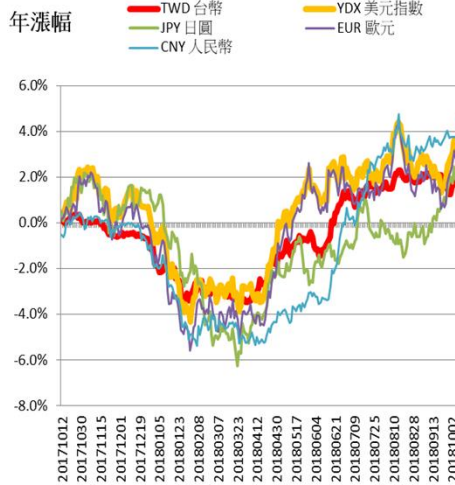
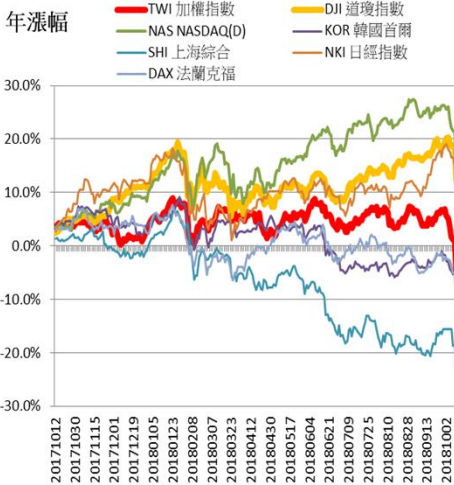
國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>