



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16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	264.58	360.70	-96.12	-1096.19	台積電	61.22	大立光	-7.31				
投信	12.33	16.48	-4.15	-47.27	台塑化	8.65	南亞科	-3.49				
自營商	47.42	57.39	-9.97	-28.67	可成	5.32	遠東新	-2.04				
合計	324.03	434.16	-110.13	-1172.01	和碩	2.66	玉山金	-0.98				
10/15融資	35.87	35.52	0.35	今日 1362.41	中鋼	2.29	豐泰	-0.97				
10/15融券	31791	53693	21902	餘額 432428	台達電	1.89	富邦金	-0.93				
單位：口	多		空		國泰金	1.83	聯電	-0.68				
台指期前十大市場佔比	-45.7%		-41.6%		南亞	1.44	鴻海	-0.63				
電子期前十大市場佔比	-61.0%		-19.8%		中華電	1.41	和泰車	-0.60				
金融期前十大市場佔比	-20.7%		-64.6%		國巨	1.39	台泥	-0.56				
非金電期前十大市場佔	-26.2%		-3.0%		前十名合計	88.08	後十名合計	-18.18				
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	27361	855	603	-368	-1000	80	31	8	-2201	9895	29469	14416
投信	-23964	111	31	0	18	0	3	0	-194	-14	1096	5
自營商	5799	284	-29	-38	55	-118	-58	-30	-123371	-6946	8372	-5645

● 觀盤重點提示

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 0.76，較前日增加 0.07，成交量p/c ratio為 1.14，較前日增加 0.1；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超 110.13 億元，其中外資賣超 96.12 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 27361 口，較前日增加 855 口淨多單，投信淨空單留倉 23964 口，自營商淨多單留倉 5799 口。

盤勢分析：美股四大指數雖然呈現下跌，亞洲市場則以台股、日股出現跌深反彈，國內期交所發佈之vix波動率略降至22.31，大型權值股上漲帶動電子期指、非金電期指出現反彈。觀察昨夜盤10月台指期合約成交口數、小型台指期成交口數皆出現下滑，且10月台指期合約將於隔日10/17進行結算並更換至下一月份契約合約，期、現貨逆價差相對前一交易日收斂及夜盤相對活絡，皆有望支撐台指期的後市走勢。

本週10/18台積電(2330 TT)即將舉行法說，預期將有機會帶動大盤指數站回10,000點以上。觀察期、權、現貨籌碼面，今日外資賣超台股行情略微縮減、期貨淨多單增加、且買權oi口數亦相對前一交易日增加，顯示外資於籌碼面有出現相對回補的現象。在國際金融市場持續波動下，預期本週臺指期近月將有機會止跌並向上突破10,000點關卡。此外，研發部推估短線指數將順沿週均線徘徊震盪。展望中短線，美國10年債券殖利率尚處在3%相對高檔、美Fed官員大多偏持鷹派言論，需留意資金外移的可能性。

● 台指期貨收盤行情

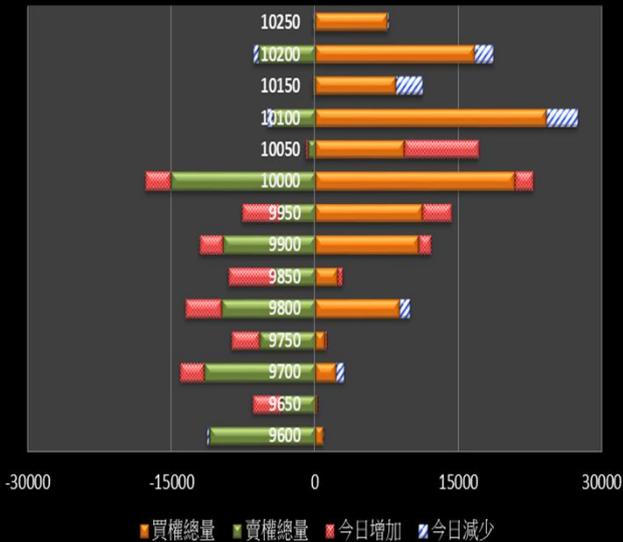
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	9981.10	10011.19	9888.73	79.98		1074億	2.21	1.21	4.63	
10月台指期	9951	9992	9868	89.00	-0.30	170490	2.19	2.20	2.71	47540
11月台指期	9909	9962	9851	64.00	-0.73	37854	1.87	1.84	2.03	71859
10月小台指	9950	9992	9869	88.00	-0.31	121062	1.77	1.73	1.93	20752
11月小台指	9910	9961	9851	65.00	-0.72	30868	1.45	1.45	1.72	12619
電子指數	395.18	396.44	389.16	5.12		688億				
10月電子期	393.60	395.55	388.50	4.60	-0.40	4509	1.40	1.49	1.43	1592
11月電子期	392.20	394.30	388.40	3.95	-0.76	946	1.32	1.32	1.26	1141
金融指數	1230.86	1235.52	1224.50	1.57		61億				
10月金融期	1225.40	1234.40	1224.00	-2.00	-0.45	1861	1.25	1.23	1.26	1064
11月金融期	1226.20	1234.00	1223.40	-0.80	-0.38	499	1.31	1.14	1.13	1423
摩台指	373.91	374.75	369.22	3.90						
10月摩台指	371.30	372.90	368.10	3.00	-0.70	63906	-	-	2.02	166884
11月摩台指	372.10	372.20	368.70	3.00	-0.49	525	-	-	13.46	7094

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

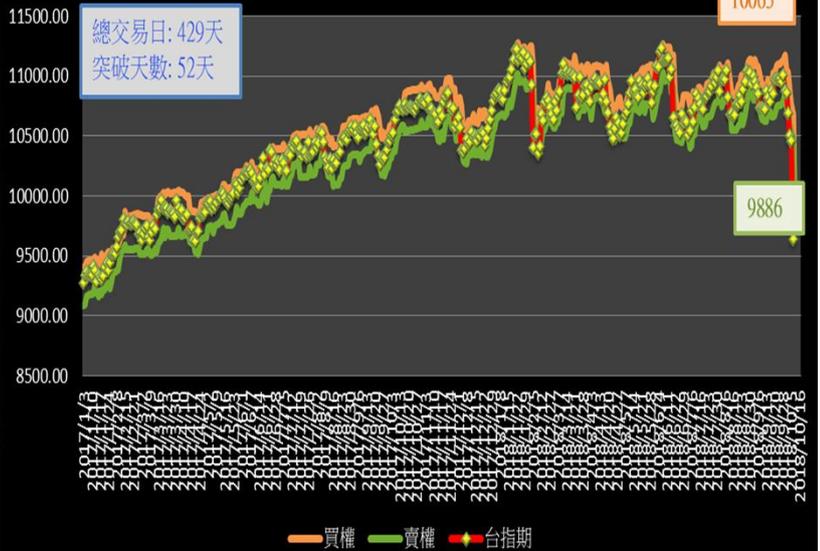


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

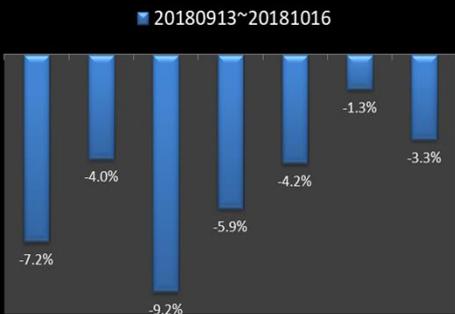


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

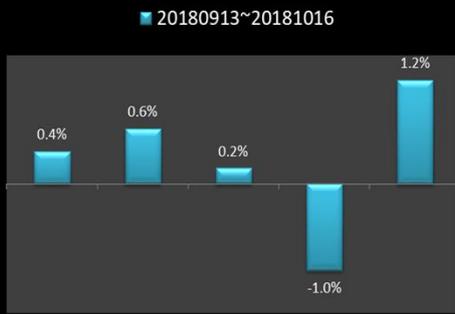


國際指數/商品期貨/外匯行情

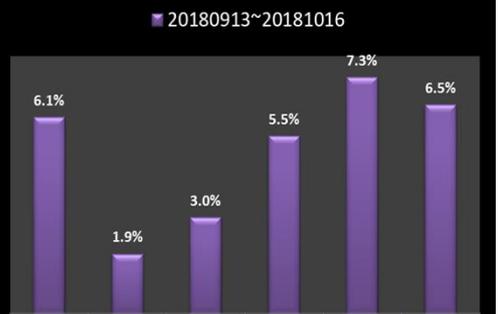
國際股市月績效表現



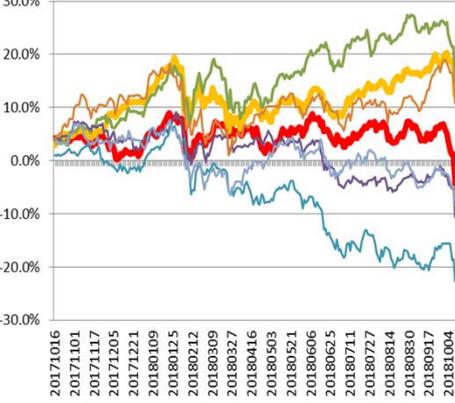
國際外匯月績效表現



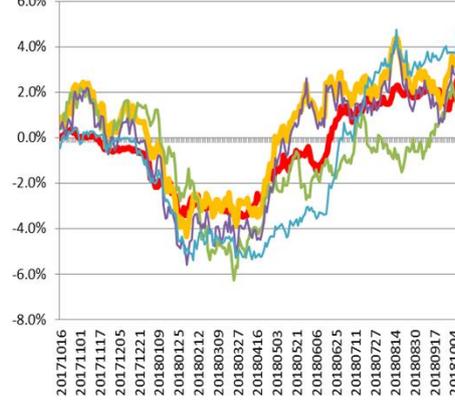
國際商品期貨月績效表現



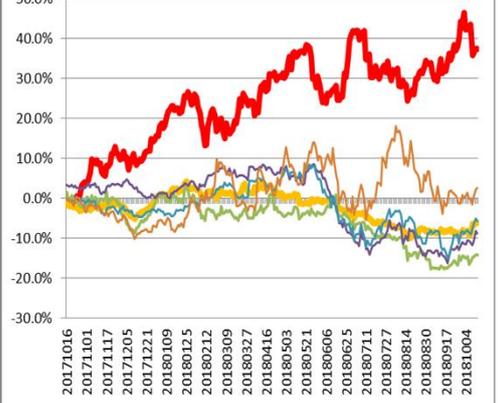
年漲幅



年漲幅



年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>