



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24日 星期三 收盤日報

法人動態：

台股現貨買賣超					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	290.19	354.15	-63.96	-1414.90	統一超	4.27	台積電	-6.27				
投信	16.78	24.65	-7.86	-64.80	台達電	3.77	中信金	-5.19				
自營商	67.11	74.70	-7.59	-75.17	大立光	3.24	台泥	-4.57				
合計	373.85	452.91	-79.06	-1554.87	國泰金	2.73	國巨	-3.49				
10/23融資	39.48	34.03	5.45	今日 1310.31	中華電	1.88	中鋼	-3.42				
10/23融券	48880	61476	12596	餘額 488725	友達	1.86	台化	-2.83				
單位：口	多		空		台灣大	1.65	大成鋼	-2.36				
台指期前十大市場佔比	52.8%		57.0%		聚陽	1.27	富邦金	-1.98				
電子期前十大市場佔比	67.3%		67.2%		英業達	1.21	南亞科	-1.80				
金融期前十大市場佔比	68.0%		72.0%		大同	1.13	美利達	-1.74				
非金電期前十大市場佔	94.1%		94.1%		前十名合計	23.02	後十名合計	-33.64				
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	31053	2498	751	130	-819	14	10	6	-9309	-4212	1425	-10752
投信	-26757	-420	44	0	18	0	3	0	-440	-4	-280	-1810
自營商	1602	-1333	-103	-184	-272	25	19	-14	-19430	20767	5348	3610

觀盤重點提示

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 0.84，較前日減少 0.04，成交量p/c ratio為 0.76，較前日增加 0.07；近月買權最大未平倉量集中在 10300 履約價序列，賣權最大未平倉量集中在 8300 履約價序列。

期、現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計賣超 79.06 億元，其中外資賣超 63.96 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 31053 口，較前日增加 2498 口淨多單，投信淨空單留倉 26757 口，自營商淨多單留倉 1602 口。

盤勢分析：由於部份公告之美股企業財報不如預期、歐盟駁回義大利之預算草案，導致美股10/23開盤大跌逾400點，所幸收盤跌幅收斂至-0.5%，使得台指期今日開盤走高，收盤則未如預期疲弱，呈現小幅下跌。除美股財報陸續公告外，美國期中選舉將於11/06召開，使得近期美股波動較大，國內期交所發佈之vix波動率維持於22以上，所幸未再創新高。昨日10/23夜間台指期雖然維持日盤跌幅，然而成交口數大增逾97,800口，顯示台指期之夜間交易量能佔比日盤比例有創高的趨勢。以籌碼面觀察，未平倉P/C ratio增至 0.94，成交量P/C ratio增至0.93，且外資持有期貨淨多單，卻賣超台股現貨，顯示今日籌碼面趨於中性。現階段國安基金仍尚未進場，今日優先撥發140億新台幣予7大投信公司進場護盤，因此可顯見11月台指期成交口數大增逾22萬口。若後續政府資金持續挹注股市、期市，則台指期支撐點有機會上移至10日均線，持續關注後市情形。

台指期貨收盤行情

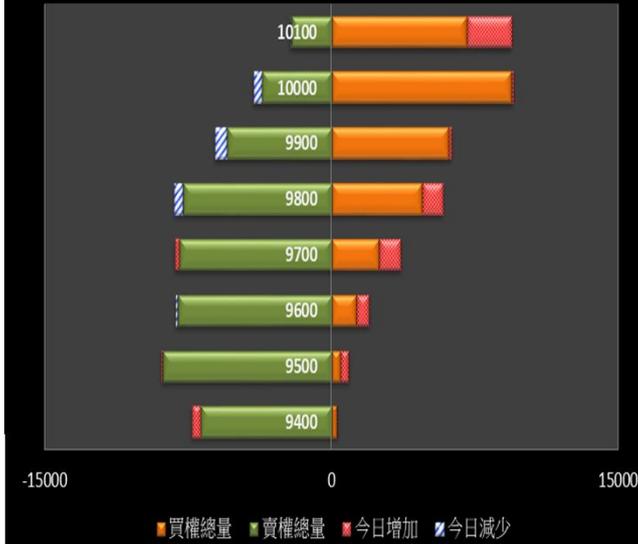
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	9759.40	9809.19	9667.85	-15.80		1234億	1.94	1.10	4.84	
11月台指期	9715	9791	9623	-14.00	-0.46	221427	2.09	2.09	3.16	86603
12月台指期	9702	9777	9612	-14.00	-0.59	2356	1.42	1.44	1.95	4737
11月小台指	9715	9791	9623	-15.00	-0.46	183403	1.75	1.73	2.34	25434
12月小台指	9702	9777	9611	-14.00	-0.59	5307	1.29	1.30	1.79	8762
電子指數	386.45	389.10	382.08	0.50		748億				
11月電子期	385.05	388.15	380.20	0.70	-0.36	5189	1.50	1.48	1.84	2327
12月電子期	384.40	387.50	383.15	0.70	-0.53	56	1.19	1.21	1.37	109
金融指數	1207.11	1212.45	1197.73	-7.11		86億				
11月金融期	1201.20	1211.60	1192.20	-6.40	-0.49	3195	1.38	1.33	1.74	2314
12月金融期	1201.20	1210.60	1193.40	0.00	-0.49	20	1.07	1.10	1.18	49
摩台指	365.31	367.19	361.82	-0.64						
10月摩台指	363.50	366.60	360.50	-1.00	-0.50	58576	-	-	2.46	155751
11月摩台指	363.40	366.40	360.70	-1.20	-0.53	5031	-	-	3.71	12986

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

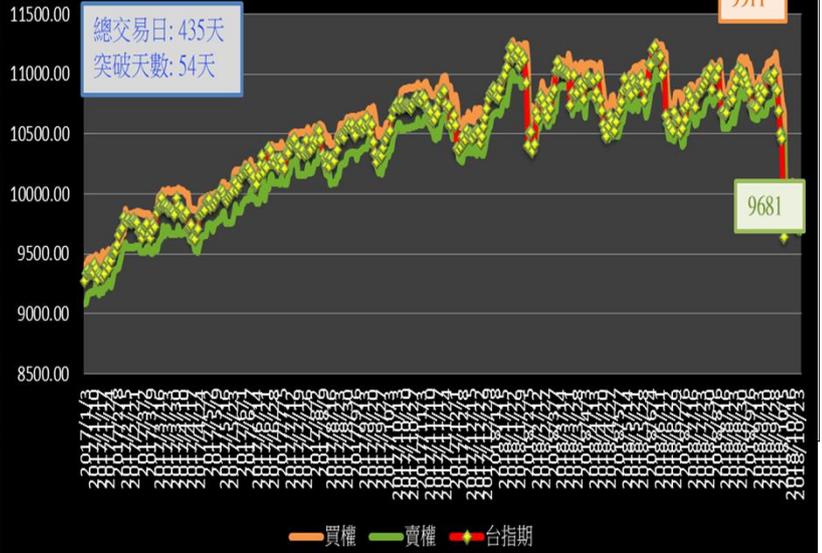


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

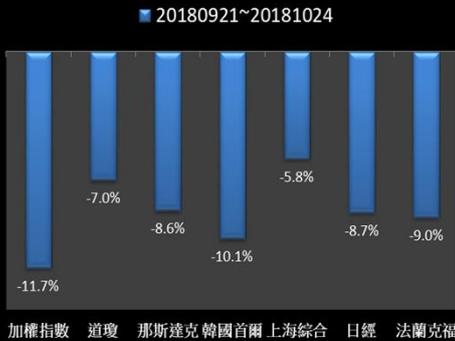


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

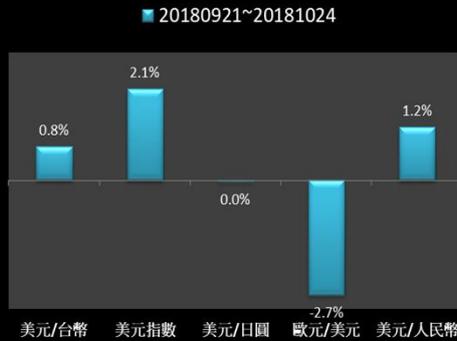


國際指數/商品期貨/外匯行情

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

