



華南金融集團

華南期貨股份有限公司 (104)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

2017年09月11日

星期一

收盤日報

法人動態:

| | | 台股現貨買賣超 | | | | 台股選擇權(買權) | | 台股選擇權(賣權) | | | | |
|------------|--------|---------|--------|------------|--------|-----------|-----------|-----------|--------|-----------|---------|-------|
| 單位: 億 | 買進 | 賣出 | 合計 | 累計本月至今日 | 未平倉 | 增減 | 未平倉 | 前日未平倉 | 增減 | 未平倉 | 前日未平倉 | 增減 |
| 外資及陸資 | 232.88 | 270.07 | -37.19 | -78.72 | 105603 | 56 | 105603 | 114731 | -9128 | 264280 | 256937 | 7343 |
| 投信 | 8.15 | 10.97 | -2.82 | -46.94 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 自營商 | 56.62 | 74.39 | -17.77 | -30.05 | 22573 | -78 | 22573 | 40627 | -18054 | -84632 | -109731 | 25099 |
| 合計 | 297.65 | 355.43 | -57.78 | -155.72 | | | | | | | | |
| 9/8融資 | 82.08 | 65.44 | 16.64 | 前日 1598.71 | | | | | | | | |
| 9/8融券 | 21887 | 39391 | 17504 | 餘額 496844 | | | | | | | | |
| 單位: 口 | 多 | | 空 | | | | | | | | | |
| 9/8摩台9月多空比 | 611 | | 858 | | | | | | | | | |
| 台指期前十大佔市場比 | 53.5% | | 46.3% | | | | | | | | | |
| 電子期前十大佔市場比 | 53.1% | | 77.4% | | | | | | | | | |
| 金融期前十大佔市場比 | 63.9% | | 68.9% | | | | | | | | | |
| 期貨未平倉 | 台指期 | | 電子期 | | 金融期 | | 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 | 前日未平倉 | 增減 | 未平倉 | 前日未平倉 | 增減 |
| 外資及陸資 | 59721 | -5990 | 1365 | -542 | -1266 | 56 | 105603 | 114731 | -9128 | 264280 | 256937 | 7343 |
| 投信 | -38884 | -375 | 12 | 0 | -42 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 自營商 | -3831 | 2456 | -52 | -19 | 220 | -78 | 22573 | 40627 | -18054 | -84632 | -109731 | 25099 |

觀盤重點提示

- 國際金融：繼颶風哈維重創德州後，市場擔憂美國周末超強颶風艾瑪所帶來的衝擊，以及上週六適逢北韓國慶日，投資人憂慮北韓再次試射核武，市場觀望氣氛濃，故上週五(8)美股三大指數收黑，僅道瓊指數因保險股反彈而小幅收紅；終場道瓊指數上漲0.06%、S&P500跌0.15%，而大型科技股如蘋果和臉書下跌，拖累Nasdaq指數跌0.59%、費半指數跌1.25%。
- 台指選擇權：近月選擇權買賣權於10600序列上下四檔同步增加未平倉量，其中賣權10600序列顯著增加逾兩千口，推測後續行情仍有震盪走揚的機會。今日未平倉p/c ratio為1.65，較前日減少0.03，成交量p/c ratio為1.1，較前日減少0.29；近月買權最大未平倉量集中在10700序列，賣權最大未平倉量集中在10000序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：因北韓未於國慶日試射飛彈，市場緊張情緒降溫，使今日亞股普遍走高，台股開高不久即衝上27年來的新高，適逢蘋果新機發表前，蘋概股出現獲利了結賣壓，大型權值股台積電、鴻海、大立光均由紅翻黑，股王大立光更跌至逾2%，連帶光電族群成為類股中跌幅最大者，其中玉晶光更是攔壓至跌停；終場加權指數下跌0.36%，收在10572.16點，成交值1312.48億元。櫃買指數開高走低，終場指數下跌0.31%，收在141.46點，成交值479.55億元。(2)資金面：今亞洲貨幣兌美元普遍走弱，台幣亦由近日走升態勢轉貶開出，加上台股高檔出現獲利了結的賣壓，外資轉賣超，推測部分資金匯出，但因美元仍偏弱勢，台幣貶幅受限，今以區間盤整為主；終場新台幣兌美元貶值2分，收在30.026元，台北外匯經紀公司成交量為6.23億美元。(3)技術面：今加權指數開高，但盤中創新高後遇賣壓走低，收盤未守住五日均線，且日KD值呈死亡交叉開口擴大，加上量增價跌，推測短線台股有高檔修正的壓力，需嚴設停損。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超57.78億元，其中外資賣超37.19億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉59721口，較前日減少5990口淨多單，投信淨空單留倉38884口，自營商淨空單留倉3831口。

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 | 10572.16 | 10656.25 | 10565.78 | -37.79 | | 1312億 | 2.86 | 2.03 | 5.07 | |
| 09月台指期 | 10563 | 10635 | 10535 | 14.00 | -0.09 | 148759 | 2.33 | 2.44 | 2.95 | 101142 |
| 10月台指期 | 10541 | 10612 | 10518 | 12.00 | -0.30 | 6163 | 1.69 | 1.72 | 1.79 | 8988 |
| 09月小台指 | 10563 | 10635 | 10535 | 13.00 | -0.09 | 91759 | 1.73 | 1.85 | 1.97 | 38259 |
| 10月小台指 | 10541 | 10611 | 10517 | 13.00 | -0.30 | 6787 | 1.51 | 1.55 | 1.70 | 6166 |
| 電子指數 | 449.04 | 454.07 | 448.72 | -2.03 | | 893億 | | | | |
| 09月電子期 | 448.55 | 453.20 | 447.75 | -0.35 | -0.11 | 3772 | 1.33 | 1.31 | 1.37 | 4432 |
| 10月電子期 | 447.80 | 452.25 | 447.00 | -0.40 | -0.28 | 185 | 1.26 | 1.32 | 1.23 | 196 |
| 金融指數 | 1133.74 | 1139.54 | 1132.72 | -3.99 | | 58億 | | | | |
| 09月金融期 | 1132.80 | 1139.60 | 1129.00 | 2.60 | -0.08 | 1607 | 1.27 | 1.34 | 1.39 | 4192 |
| 10月金融期 | 1131.40 | 1138.40 | 1129.20 | 1.60 | -0.21 | 63 | 1.07 | 1.14 | 1.13 | 157 |
| 摩台指 | 395.62 | 399.29 | 395.39 | -1.88 | | | | | | |
| 09月摩台指 | 395.00 | 398.90 | 394.10 | -0.30 | -0.16 | 38390 | - | - | 2.27 | 237802 |
| 10月摩台指 | 395.20 | 398.40 | 394.10 | -1.00 | -0.11 | 318 | - | - | 4.97 | 6935 |

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

華南期貨股份有限公司

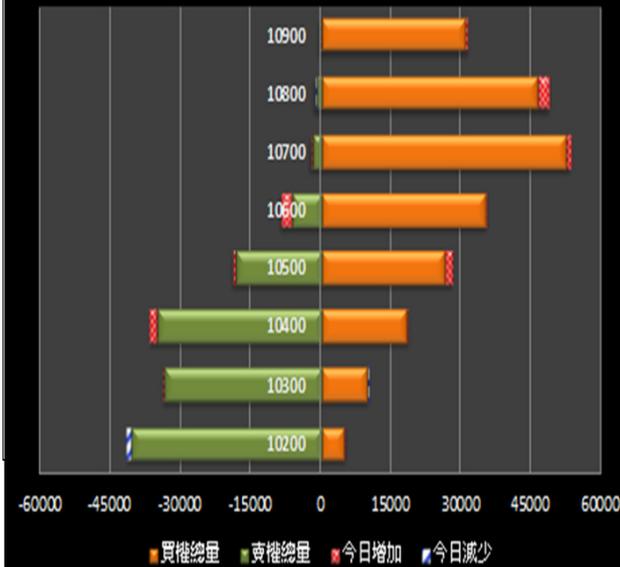
(98)金管期總字第019號

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

近月選擇權未平倉分佈圖



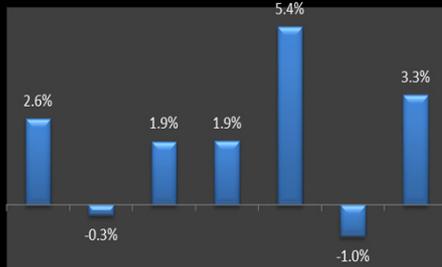
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

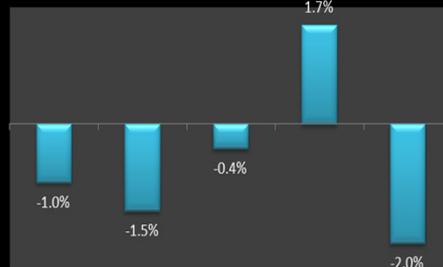
國際股市月績效表現

20170811~20170911



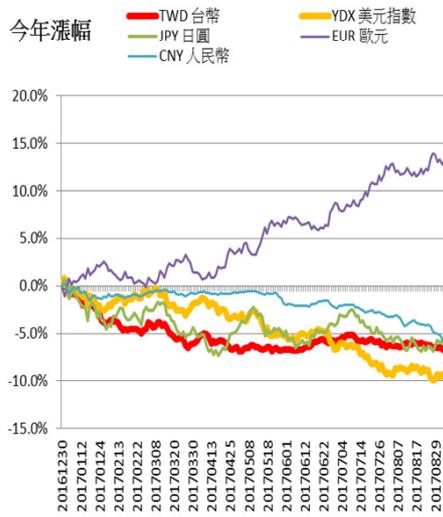
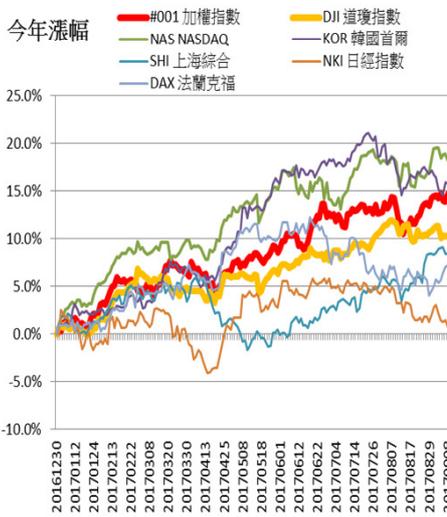
國際外匯月績效表現

20170811~20170911



國際商品期貨月績效表現

20170811~20170911



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>