



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13日 星期三 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	台股選擇權(買權)		台股選擇權(賣權)		台股選擇權(買權)		台股選擇權(賣權)	
外資及陸資	235.80	327.15	-91.35	-200.53	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
投信	7.97	11.63	-3.65	-51.64	111392	112465	-1073	277915	267515	10400		
自營商	61.13	71.95	-10.81	-37.49	0	0	0	0	0	0		
合計	304.91	410.73	-105.82	-289.67	4188	24251	-20063	-88866	-81207	-7659		
9/12融資	88.52	76.35	12.18	前日 1621.48	0	0	0	0	0	0		
9/12融券	26225	31769	5544	餘額 502492	0	0	0	0	0	0		
單位：口	多		空		台股選擇權(買權)		台股選擇權(賣權)		台股選擇權(買權)		台股選擇權(賣權)	
9/12摩台09月多空比	1,264		754		111392		112465		277915		267515	
台指期前十大佔市場	53.5%		46.3%		111392		112465		277915		267515	
電子期前十大佔市場	53.1%		77.4%		111392		112465		277915		267515	
金融期前十大佔市場	63.9%		68.9%		111392		112465		277915		267515	
期貨未平倉	台指期		電子期		金融期		台股選擇權(買權)		台股選擇權(賣權)		台股選擇權(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	57355	-4028	1413	-84	-1485	-92	111392	112465	-1073	277915	267515	10400
投信	-40224	-1207	-138	0	-42	0	0	0	0	0	0	0
自營商	-3750	-177	2	-6	166	-112	4188	24251	-20063	-88866	-81207	-7659

● 觀盤重點提示

- 國際金融：受到朝鮮半島風險降溫，以及美國颶風艾瑪損害不如預期的影響，激勵歐美股市上漲，而美債值利率上升帶動金融股走揚，如美銀漲2.5%、花旗漲1.6%，推升S&P500指數收盤創高；此外，台灣時間今凌晨一點蘋果新機發表會推出十周年紀念版的Iphone手機，但因出貨時間遲於預期，使蘋果股價由升轉跌0.4%；終場道瓊上漲0.28%、S&P500漲0.34%、Nasdaq漲0.34%、費半指數漲0.42%。
- 台指選擇權：近月選擇權買賣權於10500序列上下四檔均有顯著增加未平倉量，顯示市場籌碼轉中性布局。今日未平倉p/c ratio為1.66，較前日減少0.02，成交量p/c ratio為1.3，較前日減少0.26；近月買權最大未平倉量從10700上升至10800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：蘋果新機發表會後，其股價出現利多出盡，使得今相關類股受到賣壓，電子三巨頭中僅台積電相對抗跌，鴻海跌幅逾1%，而大立光則重挫約4%，拖累大盤指數收在最低點。今表現最差類股為光學族群，如GIS-KY(業成)、亞光、玉晶光均跌逾5%，二線光學股紛紛遇到高檔拉回修正；終場加權指數下跌0.73%，收在10532.88點，成交值1254.42億元。櫃買指數開高震盪走低，終場指數下跌0.39%，收在141.25點，成交值492.58億元。(2)資金面：今台股壓低週選結算，外資現貨大幅賣超，推估盤中有資金匯出，使台幣兌美元一度貶值幅度放大，但午後受其他亞幣走升和出口商拋匯等因素，令台幣貶值受限；終場新台幣兌美元貶值2.6分，收在30.056元，台北外匯經紀公司成交量為8.53億美元。(3)技術面：今加權指數開高走低以黑K帶短上影線作收，顯示上檔有壓力；以日線型態來看，收盤失守五日均線，且五日和十日均線皆下彎，日KD值持續交叉向下，若指數未站回五日均線，短線上可能呈現盤整偏弱走勢。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超105.82億元，其中外資賣超91.35億元，為三個月來單日最大賣超。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉57355口，較前日減少4028口淨多單，投信淨空單留倉40224口，自營商淨空單留倉3750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	10532.88	10620.31	10532.88	-77.47	-0.73	1254億	2.66	1.91	5.35	
09月台指期	10521	10603	10510	-68.00	-0.64	136211	2.37	2.50	3.02	100955
10月台指期	10497	10579	10489	-70.00	-0.66	4876	1.48	1.51	1.65	12523
09月小台指	10521	10602	10510	-68.00	-0.64	83875	1.73	1.89	2.05	36352
10月小台指	10497	10579	10489	-68.00	-0.64	7177	1.41	1.60	1.74	7394
電子指數	447.17	451.71	447.03	-4.02	-0.90	869億				
09月電子期	446.10	450.60	445.75	-3.90	-0.88	4031	1.38	1.46	1.41	4527
10月電子期	445.10	449.60	445.00	-4.30	-0.97	271	1.26	1.35	1.19	345
金融指數	1133.95	1139.26	1133.04	-4.21	-0.37	56億				
09月金融期	1131.00	1138.40	1128.80	-4.80	-0.42	1772	1.35	1.43	1.46	3810
10月金融期	1129.60	1137.00	1128.00	-5.40	-0.48	67	1.06	1.11	1.16	546
摩台指	394.13	397.41	394.04	-3.22	-0.82					
09月摩台指	393.30	396.50	391.90	-3.10	-0.78	43065	-	-	2.42	235507
10月摩台指	393.50	395.00	392.00	-3.60	-0.92	167	-	-	2.23	8051

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

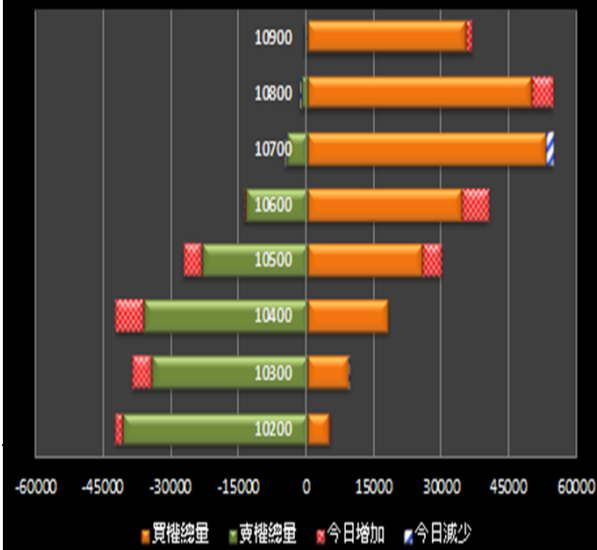
華南期貨股份有限公司

(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



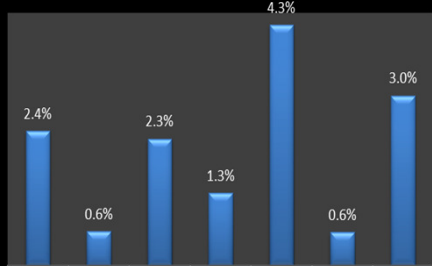
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

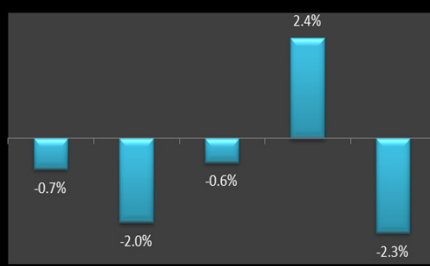
國際股市月績效表現

20170815~20170913



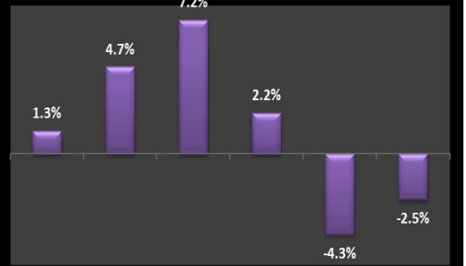
國際外匯月績效表現

20170815~20170913



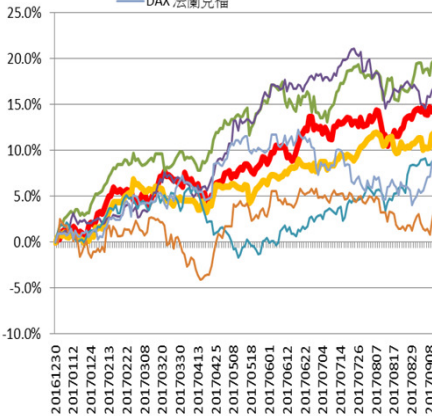
國際商品期貨月績效表現

20170815~20170913



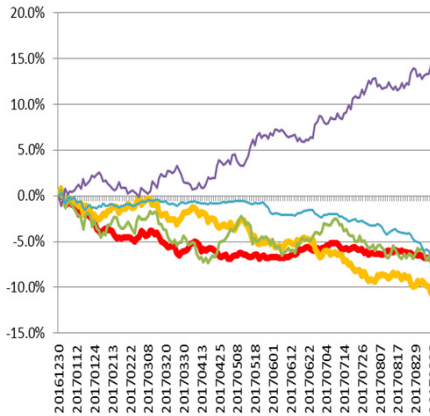
今年漲幅

■ #001 加權指數
■ NAS NASDAQ
■ SHI 上海綜合
■ DAX 法蘭克福
■ DJI 道瓊指數
■ KOR 韓國首爾
■ NKI 日經指數



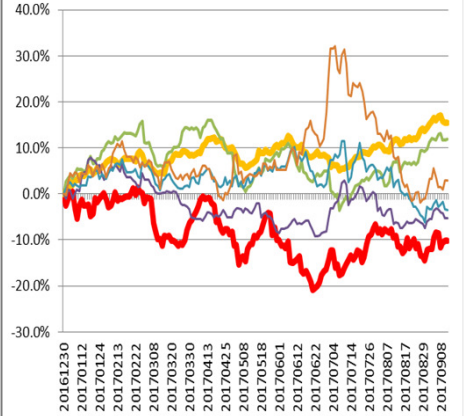
今年漲幅

■ TWD 台幣
■ JPY 日圓
■ CNY 人民幣
■ YDX 美元指數
■ EUR 歐元



今年漲幅

■ M1WS& 輕原油&
■ O1S& 白銀&
■ B1C& 玉米&
■ O1GC& 黃金&
■ B1S& 黃豆&
■ B1W& 小麥&



<本文 僅供參考，並不做任何獲利保證。>