



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15日 星期五 收盤日報

● 法人動態：

		台股現貨買賣起				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	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	554.07	562.81	-8.73	-234.88	113665	112751	914	292409	285497	6912		
投信	16.36	11.57	4.79	-49.51	-40371	31	-138	0	-448	-448		
自營商	74.67	73.07	1.59	-27.69	-3750	-507	-43	35	197	-23		
合計	645.10	647.45	-2.35	-312.09	-1916	10781	-12697	-98901	-104358	5457		
9/14融資	73.90	63.53	10.37	前日 1633.44								
9/14融券	20775	40448	19673	餘額 530902								
單位：口	多		空									
9/14摩台09月多空比	1,861		884									
台指期前十大佔市場	53.5%		46.3%									
電子期前十大佔市場	53.1%		77.4%									
金融期前十大佔市場	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	62577	3438	1551	-44	-1384	173	113665	112751	914	292409	285497	6912
投信	-40371	31	-138	0	-42	0	-427	-427	0	-448	0	-448
自營商	-3750	-507	-43	35	197	-23	-1916	10781	-12697	-98901	-104358	5457

● 觀盤重點提示

- 國際金融：昨(14)英國央行公布利率決策會議，表示利率將維持不變，但央行行長Mark Carney表示，未來幾個月可能升息，激勵英鎊大漲至一年新高，使得英國股市受到壓力收跌1.14%。美股方面，美國波音提高787每月產量，推升股價上漲1.36%；而原油價格持續上揚，帶動能源類股走高，令道瓊指數收盤再創新高；終場道瓊指數長0.20%、S&P500跌0.11%、Nasdaq跌0.48%、費半指數漲0.48%。數據面，美國公布8月初領失業救濟金人數為28.4萬人低於市場預期，此外，8月消費者物價指數月增0.4%，扣除食物和能源等價格後的核心CPI亦月增0.2%，符合市場預期，雖低於聯準會設定2%的目標，但顯示通膨壓力開始回升，增加年底升息機率從41%上升至46.2%，令美元指數盤中再攀高，市場將聚焦在下週四(21)美國聯準會公布的利率決策。
- 台指選擇權：近月選擇權買賣權於10600序列上下五檔均顯著增幅未平倉量，但仍以買權部位增加較多，顯示買權未平倉量持續在上檔作增量壓力。今日未平倉p/c ratio為1.63，較前日減少0.05，成交量p/c ratio為1.06，較前日減少0.25；近月買權最大未平倉量集中在10800序列，賣權最大未平倉量由10000上升至10400序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：今早盤電子股表現疲弱，大立光跌幅一度逾2%，台積電和鴻海則在平盤附近狹幅震盪整理，金融股亦走跌，使指數早盤開平高後走低震盪，但因富時羅素調整台灣50成分股將於下周一(18)生效，故多檔電子股和金融股都出現爆量拉尾盤的情況，使指數由黑翻紅；終場加權指數上漲0.25%，收在10580.41點，成交值1555.10億元，為2015年4月24日以來單日最大量。櫃買指數開高震盪走低，終場指數下跌0.06%，收在142.67點，成交值409.76億元。(2)資金面：今早雖北韓再次試射飛彈，但國際匯市並未有顯著影響，顯示市場對訊息面消化快速，而台幣早盤因大盤下跌走貶，但隨後因承接美元買盤進場下，使台幣由貶轉升；終場新台幣兌美元升值3.1分，收在30.075元，台北外匯經紀公司成交量為7.71億美元。(3)技術面：今加權指數尾盤爆量拉了30幾點，令指數收盤收在今日最高點，並站上五日均線；以日線型態來看，收紅K下影線，在月線附近有所支撐，預計近期仍不脫狹幅盤整走勢，且前述支撐不宜再次失守，否則指數防守區域恐有下修至季線位置之虞。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超2.35億元，其中外資賣超8.73億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉62577口，較前日增加3438口淨多單，投信淨空單留倉40371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	10580.41	10580.78	10520.15	26.84		1555億	2.91	2.12	5.74	
09月台指期	10566	10570	10491	37.00	-0.14	133194	2.48	2.42	2.99	84574
10月台指期	10542	10545	10467	39.00	-0.36	10731	2.39	2.34	2.02	28040
09月小台指	10566	10570	10491	39.00	-0.14	79802	1.78	1.73	2.03	37818
10月小台指	10542	10545	10467	40.00	-0.36	9606	1.65	1.43	1.86	8452
電子指數	449.92	449.92	446.55	1.51		1088億				
09月電子期	449.10	449.30	445.40	2.20	-0.18	2966	1.37	1.33	1.35	4545
10月電子期	448.00	448.15	444.40	2.00	-0.43	350	1.17	1.40	1.27	535
金融指數	1134.02	1134.02	1128.22	2.34		91億				
09月金融期	1132.20	1132.80	1124.60	4.40	-0.16	1841	1.34	1.37	1.48	3632
10月金融期	1131.00	1131.60	1123.60	4.40	-0.27	158	1.08	1.06	1.10	665
摩台指	395.36	395.42	392.83	0.78						
09月摩台指	394.70	394.80	391.60	0.90	-0.17	42072	-	-	2.36	237038
10月摩台指	394.40	394.40	391.40	0.70	-0.24	543	-	-	5.78	8319

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

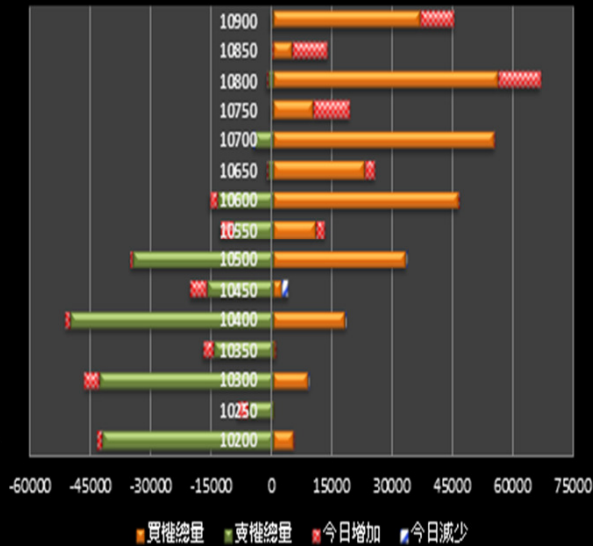
華南期貨股份有限公司

(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



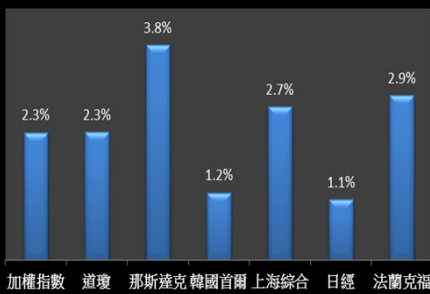
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

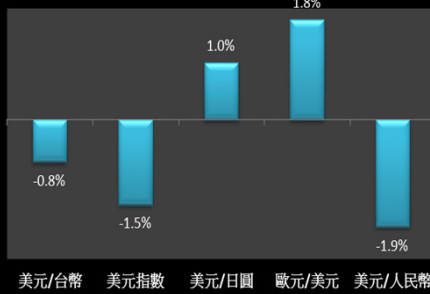
國際股市月績效表現

20170817~20170915



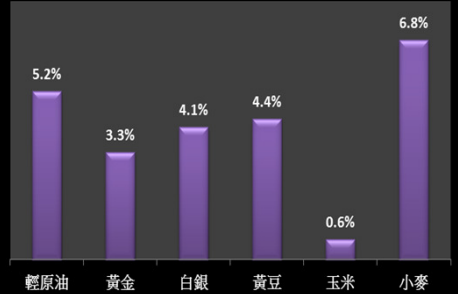
國際外匯月績效表現

20170817~20170915



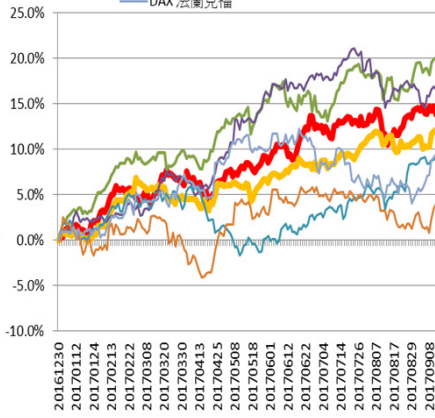
國際商品期貨月績效表現

20170817~20170915



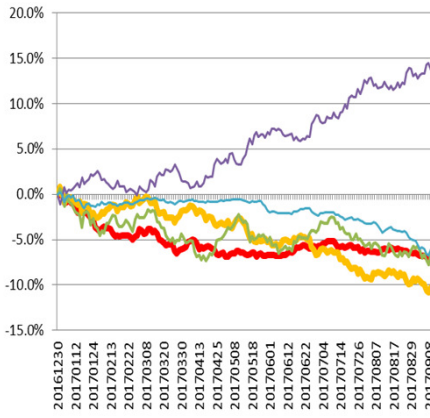
今年漲幅

■ #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



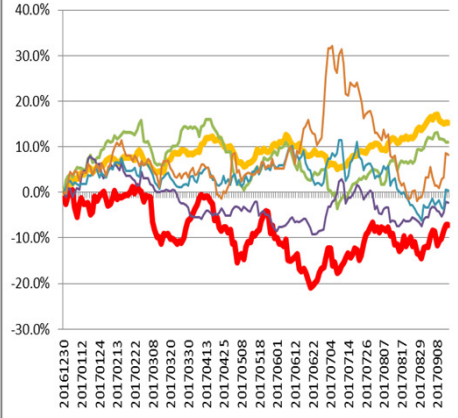
今年漲幅

■ 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&
■ O1S1& 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。>