



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20日 星期三 收盤日報

● 法人動態：

		台股現貨買賣起				台股期貨		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	前日	餘額	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	296.93	335.07	-38.14	-303.12	1646.40	543546	70383	125507	-55124	163948	303034	-139086
投信	12.47	18.14	-5.67	-49.43			-643	-643	0	-673	0	-673
自營商	59.50	100.99	-41.49	-77.13			11691	-27232	38923	-61245	-66941	5696
合計	368.90	454.20	-85.30	-429.67								
9/19融資	83.10	81.51	1.59									
9/19融券	30890	27118	-3772									
單位：口	多		空									
9/19摩台09月多空比	2,177		589									
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	54285	852	-72	-1645	-1207	57	70383	125507	-55124	163948	303034	-139086
投信	-41064	-1100	-240	-100	-47	0	-643	-643	0	-673	0	-673
自營商	-7308	-8343	315	565	37	-82	11691	-27232	38923	-61245	-66941	5696

● 觀盤重點提示

- 國際金融：美國聯準會將於19-20日公布利率決策，投資人等待決議出爐前保持觀望，歐股震盪收紅；美股方面，銀行股持續領漲，高盛、摩根大通再次擔綱演出成為指數推升要角；而科技股部分，蘋果小漲0.04%、臉書漲1.48%、微軟漲0.37%，個股表現亮眼，持續提供大盤上漲動能，指數盤中再創新猷；終場道瓊指數漲0.18%、S&P500漲0.11%、Nasdaq漲0.1%、費半指數漲0.35%；四大指數皆以紅盤收收。
- 台指選擇權：今日月選擇權結算，以未平倉量來看，近月買權最大未平倉量集中在10800序列，賣權最大未平倉量集中在10500序列；而未平倉p/c ratio為1.88，較前日增加 0.14，成交量p/c ratio為1.1，較前日增加 0.04；但因結算過後市場會降溫，需觀察明天行情。
- 台北股市：(1)基本面及策略：東芝記憶體出售案，最終由貝恩資本買下，推測鴻海遭此衝擊造成連日來重挫，外資連續六天合計賣超9.7萬張，今其股價跌幅逾3%，已跌破季線位置；此外，其他蘋概股如鴻準、可成均逾2%，而光學股在大立光領跌下，亞光、玉晶光、先進光等平均跌幅逾4%，使得指數進一步下探低點；尾盤在資金進駐特定權值股下跌幅收斂，但仍收在相對低點；終場加權指數下跌 0.54%，收在 10519.17 點，成交值 1271.4 億元。櫃買指數開高後由紅翻黑，終場指數下跌 0.28%，收在 142.07 點，成交值 367 億元。(2)資金面：早盤在日圓和韓元兌美元轉強下，使得台幣由貶轉升，呈現股匯市脫鉤的現象；在美國公布利率決策前，台幣仍呈現區間整理格局；終場新台幣兌美元小升 0.5 分，收在 30.132 元，台北外匯經紀公司成交量為 6.79 億美元。(3)技術面：今加權指數早盤持續開低，五日均線和十日均線已連兩天下彎，且日KD開口擴大向下，加上帶量收黑，令大盤終場失守月線；以日線型態來看，月線已經跌破，若明日盤勢未守住月線，則防守區域將下修至季線位置，並推估大盤恐呈現空頭格局。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超 85.30 億元，其中外資賣超 38.14 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 54285 口，較前日增加 852 口淨多單，投信淨空單留倉 41064 口，自營商淨空單留倉 7308 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	成交量	OI
加權指數	10519.17	10589.19	10490.71	-56.97	-0.09	1271億	2.62	1.89	5.20	
09月台指期	10510	10585	10490	-69.00	-0.09	108522	2.30	2.37	2.68	30059
10月台指期	10512	10555	10485	-42.00	-0.07	82365	2.38	2.47	2.85	92066
09月小台指	10509	10585	10490	-70.00	-0.10	62513	1.86	1.97	1.97	15442
10月小台指	10512	10554	10485	-43.00	-0.07	50897	1.78	1.87	2.17	20935
電子指數	447.25	451.01	445.79	-2.84		937億				
09月電子期	447.00	450.50	446.25	-2.95	-0.06	2909	1.25	1.40	1.27	2176
10月電子期	446.20	449.00	445.15	-2.45	-0.24	2243	1.48	1.30	1.31	3008
金融指數	1127.36	1132.60	1124.73	-4.15		47億				
09月金融期	1126.40	1133.20	1126.20	-5.40	-0.09	1450	1.35	1.58	1.38	1222
10月金融期	1127.80	1131.20	1125.60	-2.80	0.04	1434	1.45	1.54	1.50	3545
摩台指	393.24	395.95	392.06	-2.45						
09月摩台指	393.10	395.00	391.90	-2.00	-0.04	42390	-	-	2.19	235504
10月摩台指	392.60	394.60	391.50	-2.20	-0.16	3743	-	-	12.60	8960

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

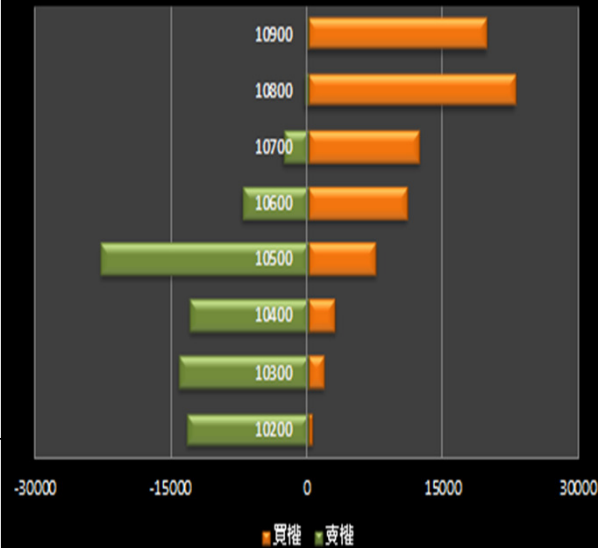
華南期貨股份有限公司

(98)金管期總字第019號

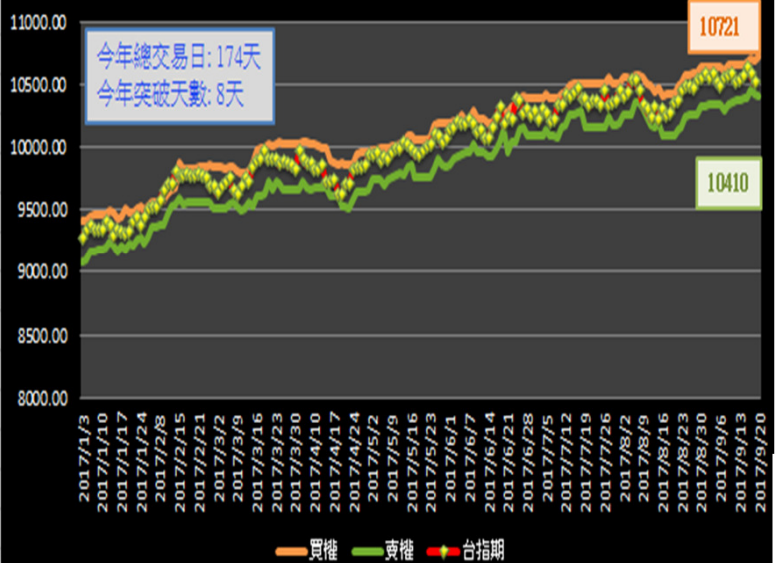
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖



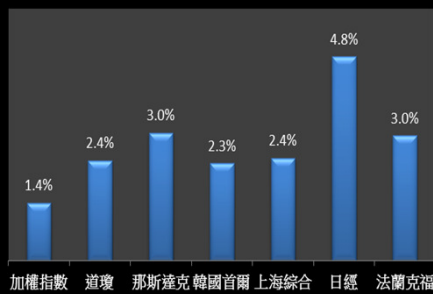
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

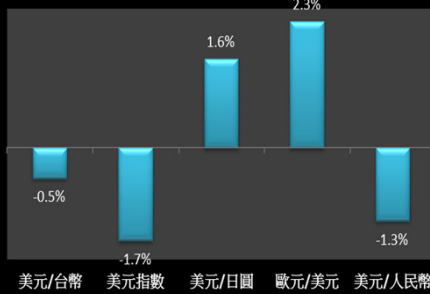
國際股市月績效表現

20170822~20170920



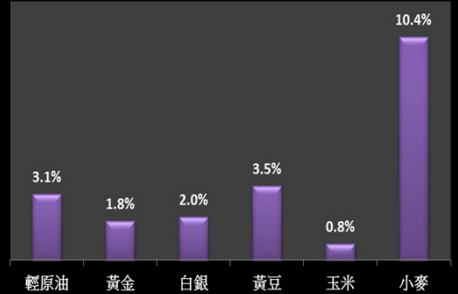
國際外匯月績效表現

20170822~20170920

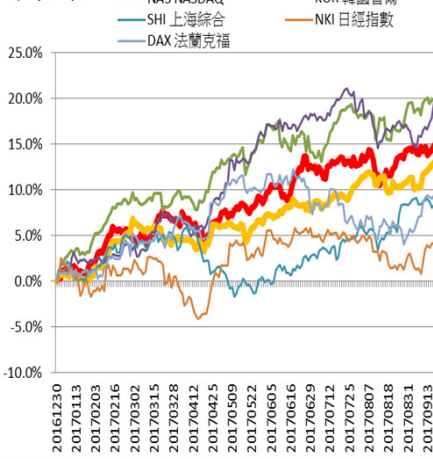


國際商品期貨月績效表現

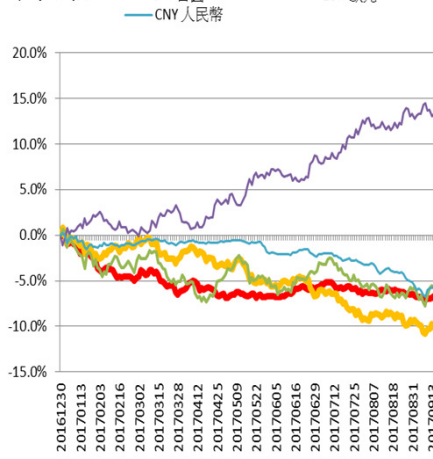
20170822~20170920



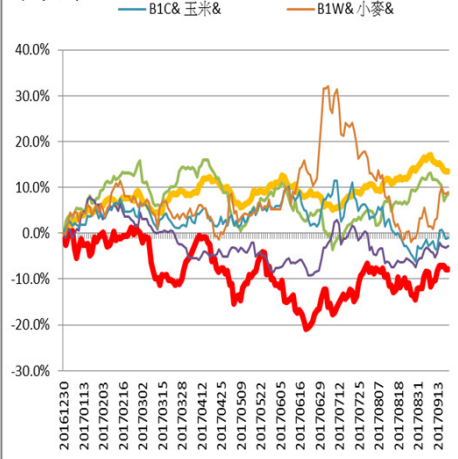
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>