



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21日 星期四 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	台股選擇權(買權)		台股選擇權(賣權)					
外資及陸資	267.66	319.72	-52.06	-355.99	鴻海	28.20	台積電	-4.69				
投信	7.65	12.33	-4.68	-54.31	南亞科	5.07	台塑化	-1.72				
自營商	79.20	58.99	20.21	-56.92	國泰金	4.32	中華電	-1.40				
合計	354.50	391.04	-36.54	-467.22	聯發科	2.00	台化	-1.06				
9/20融資	73.25	69.25	4.00	前日 1649.34	廣達	1.96	統一	-1.03				
9/20融券	32506	29083	-3423	餘額 536966	儒鴻	1.84	台塑	-0.69				
單位：口	多		空		華邦電	1.75	群聯	-0.68				
9/20摩台09月多空比	2,109		426		玉晶光	1.41	台灣大	-0.62				
台指期前十大佔市場	53.5%		46.3%		華通	1.34	緯創	-0.60				
電子期前十大佔市場	53.1%		77.4%		國巨	1.26	美律	-0.54				
金融期前十大佔市場	63.9%		68.9%		前十名合計	49.13	後十名合計	-13.02				
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	58142	3857	570	642	-1390	-183	77931	70383	7548	177976	163948	14028
投信	-40386	678	-240	0	-47	0	-643	-643	0	-673	0	-673
自營商	-6336	972	95	-220	338	301	39123	11691	27432	-64459	-61245	-3214

● 觀盤重點提示

- 國際金融：聯準會(FOMC)公布利率決策會議前，主要指數漲跌互見，隨後葉倫聲明利率維持不變，但暗示今年度可能再升息一次，並於10月開始進行縮表，市場認為談話比預期更為鷹派，激勵金融股上漲，使道瓊指數和S&P500由黑翻紅，終場各漲0.19%和0.06%，而Nasdaq和費半指數則因科技股走跌，拖累指數表現，分別下跌0.08%和1.41%。
- 台指選擇權：近月選擇權買賣權於10600序列上下四檔均有顯著增加未平倉量，但買權未平倉量的增幅較賣權為大，顯示上檔有壓，推測將不利台股攻高，今日未平倉p/c ratio為1.78，較前日減少0.1，成交量p/c ratio為1.25，較前日增加0.15；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10000序列。
- 台北股市：(1)基本面及策略：台股開低走高，因東芝收購案出局的鴻海，在跌深多日後出現強勢反彈漲幅逾4%；而股王大立光開低後翻紅，帶動光學鏡頭股齊漲，其中玉晶光更收漲停價，其他如新鉅科、聯一光、亞光、先進光等熱門股人氣回籠，平均漲幅逾4%；DRAM廠南亞科、華邦電續強漲逾5%，推升指數走高，但在台積電尾盤由紅翻黑下，令指數漲幅收斂；終場加權指數上漲0.56%，收在10578.44點，成交值1197.8億元。櫃買指數開高走高，終場指數上漲1.18%，收在143.75點，成交值378.39億元。(2)資金面：Fed公布貨幣政策聲明中，釋放出鷹派訊息，令美元指數走強，使得今日台幣開低走低，來到一個月的新低點，終場新台幣兌美元貶值7.6分，收在30.208元，台北外匯經紀公司成交量為11.7億美元。(3)技術面：今加權指數開低，但盤中在買盤出籠下，指數由黑翻紅並收復月線，終場更收在五日线之上；以日線型態觀察，指數若能持續帶量收紅站穩月線，有機會突破整理格局，否則指數進一步下探季線尋求支撐時，大盤整理時間將拉長。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超36.54億元，其中外資賣超52.06億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉58142口，較前日增加3857口淨多單，投信淨空單留倉40386口，自營商淨空單留倉6336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	10578.44	10603.08	10493.95	59.27		1197億	2.98	2.07	5.73	
10月台指期	10573	10583	10473	63.00	-0.05	133103	2.44	2.35	2.92	98124
11月台指期	10557	10565	10457	61.00	-0.20	1918	1.53	1.55	1.58	634
10月小台指	10573	10583	10472	61.00	-0.05	87577	1.79	1.65	1.98	24618
11月小台指	10557	10565	10458	61.00	-0.20	2130	1.29	1.28	1.37	697
電子指數	450.88	452.59	445.54	3.63		873億				
10月電子期	450.65	451.10	444.20	4.55	-0.05	4830	1.32	1.35	1.35	3955
11月電子期	449.60	449.90	443.60	3.95	-0.28	42	1.03	1.05	1.02	25
金融指數	1131.72	1134.69	1126.32	4.36		49億				
10月金融期	1132.60	1134.40	1125.20	5.20	0.08	3339	1.53	1.45	1.63	4143
11月金融期	1130.40	1132.60	1125.60	3.80	-0.12	10	1.06	1.00	1.11	5
摩台指	395.19	396.76	391.49	1.95						
09月摩台指	395.40	396.20	390.70	2.30	0.05	44499	-	-	2.38	224833
10月摩台指	395.10	395.90	390.40	2.50	-0.02	4754	-	-	8.17	22370

<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

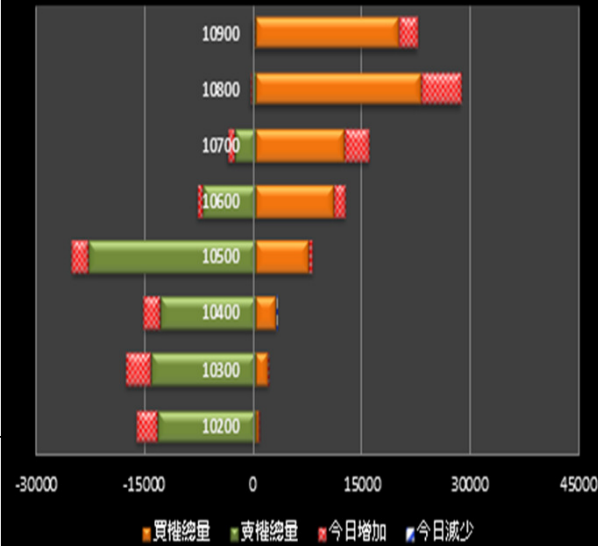
(98)金管期總字第019號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708

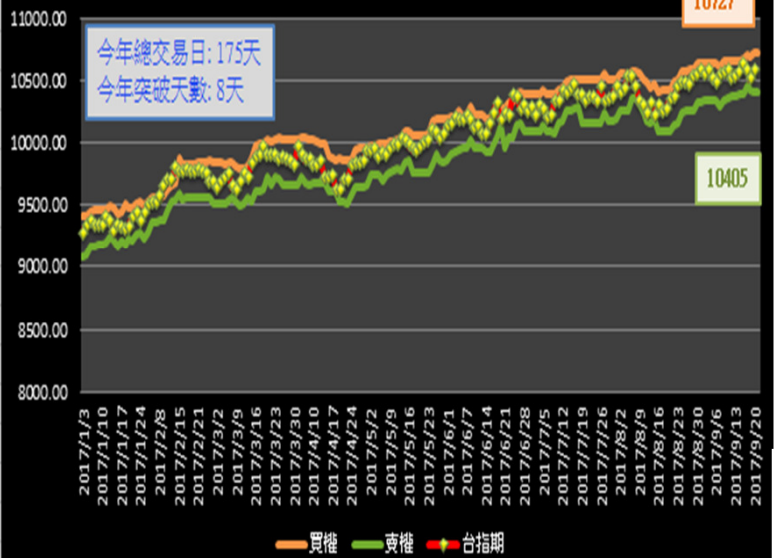
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖



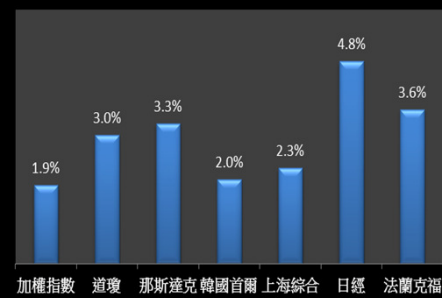
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

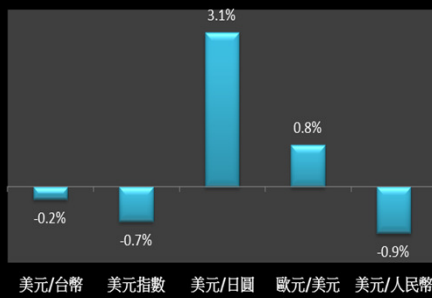
國際股市月績效表現

20170823~20170921



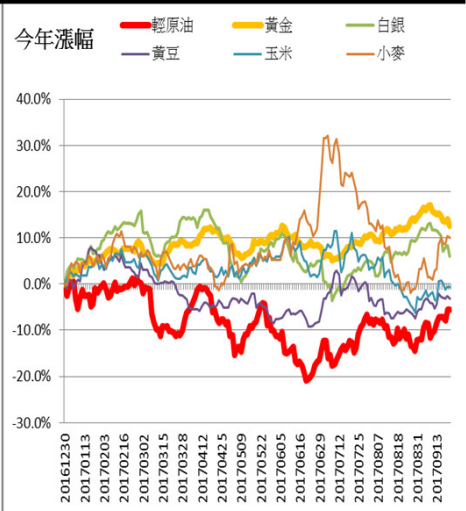
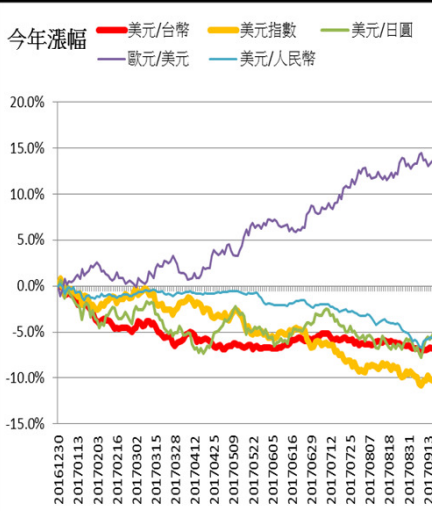
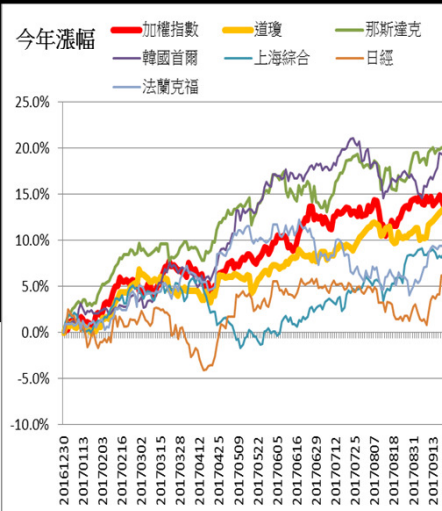
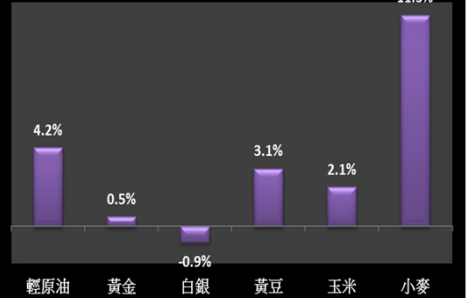
國際外匯月績效表現

20170823~20170921



國際商品期貨月績效表現

20170823~20170921



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>