



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22日 星期五 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	244.76	323.21	-78.45	-434.90	1659.50	527648	83586	77931	5655	197938	177976	19962
投信	11.58	16.43	-4.85	-60.06			-643	-643	0	-673	0	-673
自營商	53.10	85.71	-32.60	-89.52			20303	39123	-18820	-36446	-64459	28013
合計	309.44	425.35	-115.91	-584.48								
9/21融資	70.31	58.68	11.64									
9/21融券	35855	34870	-985									
單位：口	多		空									
9/21摩台09月多空比	1,725		529									
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	50665	-7477	46	-524	-1307	83	83586	77931	5655	197938	177976	19962
投信	-41017	-631	-240	0	-47	0	-643	-643	0	-673	0	-673
自營商	-7901	-1565	133	38	21	-317	20303	39123	-18820	-36446	-64459	28013

● 觀盤重點提示

- 國際金融：昨(21)日因美國聯準會公布縮表時程以及暗示今年仍有機會再次加息的鷹派言論，使得美元轉強，而美股主要指數開低，科技股連遇賣壓，如輝達、超微、特斯拉、凌雲等股價平均跌幅逾2%；此外，市場對於iPhone8反應不佳且新款Apple Watch又發生技術性故障等問題，衝擊蘋果股價下跌1.72%，拖累道瓊指數走低；終場道瓊指數跌0.24%、S&P500跌0.30%、Nasdaq跌0.52%、費半指數跌0.41%。
- 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，但仍以買權未平倉量的增幅較賣權為大，且買權未平倉均價下移，顯示上檔壓力漸強，推測股市不易攻高，且賣權於10500和10600序列減少逾一千口，估計選擇權賣方減碼賣出之賣權部位執行停損。今日未平倉p/c ratio為1.69，較前日減少0.09，成交量p/c ratio為1.21，較前日減少0.04；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：今日因川普與北韓緊張局勢升高，使得亞股普遍走跌，台股亦以低盤開出，權值股中台積電和鴻海開低震盪走低，而股王大立光更跌至季線之下跌幅逾5%，拖累其他光學鏡頭股如亞光、玉晶光、佳凌、今國光等平均跌幅逾5%；金融股的國泰金、新光金、開發金亦跌逾1%；此外，宏達電今恢復交易，受惠於Google買下手機ODM部門，股價開盤即鎖漲停，連帶相關企業威盛亦漲停開出，成為今日抗跌的個股；但因大盤九成類股均收黑，其中光電類股更跌4.22%表現最差，使指數收在相對低點；終場加權指數下跌1.22%，收在10449.68點，成交值1196.41億元。櫃買指數開平高走低，終場指數下跌1.12%，收在142.14點，成交值406.22億元。(2)資金面：川普19日在聯合國發表對北韓經濟制裁的言論，使北韓今日放話將考慮太平洋氫彈試爆，消息一出，市場避險情緒升溫，日圓走強，其他亞洲貨幣亦走貶，受韓元貶值影響，台幣早盤以30.215元，貶值0.7分開出，雖台股大跌，但逢月底出口商有拋匯需求，台幣貶幅受限，台幣兌美元由貶轉升，呈現股匯市脫鈎的現象；終場新台幣兌美元升值1.7分，收在30.191元，台北外匯經紀公司成交量為5.49億美元。(3)技術面：今台股賣壓沉重，加權指數收在相對低點，且跌至季線之下，短均線均下跌；以日線型態觀察，日KD開口向下擴大，MACD下跌柱狀負值增加，技術面仍偏弱，而量能方面呈現價跌量縮，若後市未放大量上漲突破，則大盤整理時間恐拉長。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超115.91億元，其中外資賣超78.45億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉50665口，較前日減少7477口淨多單，投信淨空單留倉41017口，自營商淨空單留倉7901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	10449.68	10579.02	10446.45	-128.76	-0.17	1201億	2.79	1.92	5.54	
10月台指期	10432	10568	10427	-140.00	-0.17	168104	2.27	2.47	2.84	99875
11月台指期	10415	10543	10412	-142.00	-0.33	2387	1.38	1.42	1.49	1412
10月小台指	10432	10558	10427	-141.00	-0.17	111716	1.67	1.93	2.00	29293
11月小台指	10415	10541	10412	-142.00	-0.33	3547	1.30	1.41	1.47	1540
電子指數	443.63	450.95	443.60	-7.25	-0.13	876億				
10月電子期	443.05	449.95	442.95	-7.55	-0.13	4298	1.27	1.34	1.32	3560
11月電子期	442.50	449.65	442.50	-7.10	-0.26	49	1.08	1.10	1.04	53
金融指數	1124.37	1131.54	1122.47	-7.35	-0.33	44億				
10月金融期	1124.00	1130.60	1119.60	-8.20	-0.03	2890	1.46	1.51	1.57	4123
11月金融期	1123.00	1128.00	1120.00	-7.40	-0.12	27	1.00	1.00	1.08	22
摩台指	389.86	395.09	389.84	-5.33						
09月摩台指	388.90	394.80	388.90	-6.50	-0.25	55534	-	-	2.86	218541
10月摩台指	388.70	394.50	388.70	-6.40	-0.30	11731	-	-	8.27	41355

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

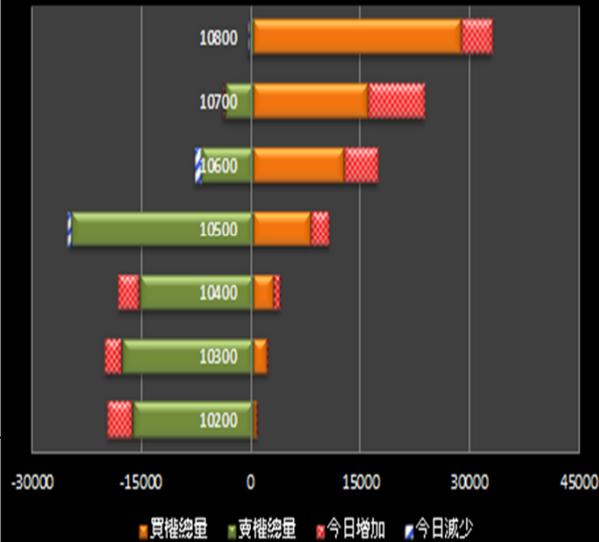
華南期貨股份有限公司

(104)金管期總字第002號

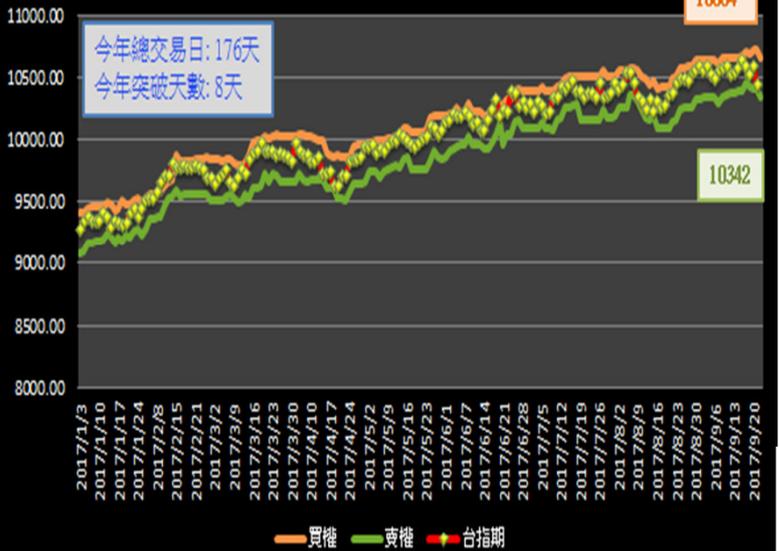
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖



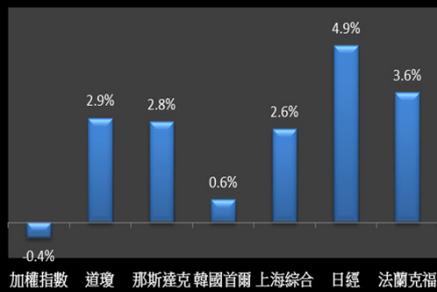
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

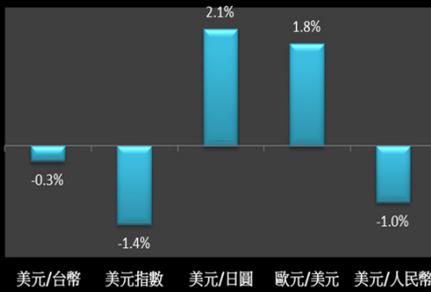
國際股市月績效表現

20170824~20170922



國際外匯月績效表現

20170824~20170922

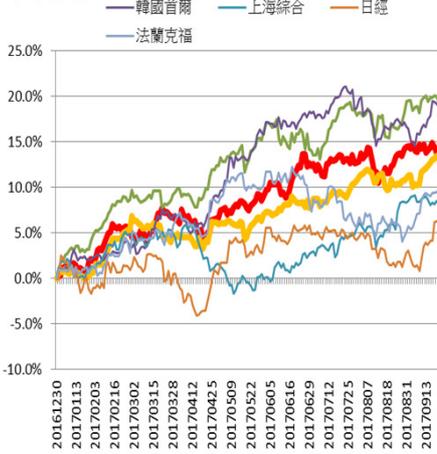


國際商品期貨月績效表現

20170824~20170922



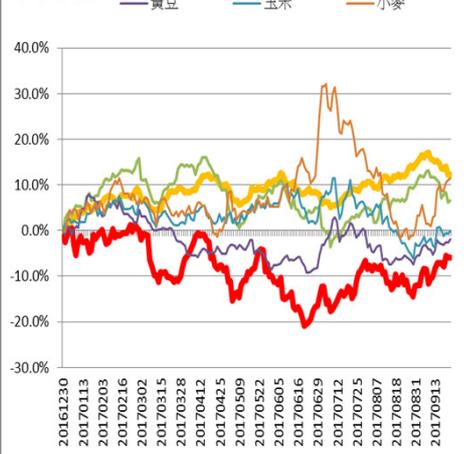
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>