



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26日 星期二 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)	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	296.31	372.00	-75.69	-558.69	第一金	1.32	89039	82653	6386	210253	205225	5028
投信	22.87	8.79	14.08	-59.14	富邦金	1.29	-216	-216	0	-637	0	-637
自營商	69.56	73.64	-4.08	-104.57	兆豐金	1.23	-18343	-7952	-10391	-34655	-38765	4110
合計	388.75	454.43	-65.68	-722.39	台塑	1.15						
9/25融資	67.53	76.27	-8.74	前日 1638.37	統一超	0.94						
9/25融券	45782	34085	-11697	餘額 501902	健鼎	0.85						
單位：口	多		空		廣達	0.84						
9/25摩台09月多空比	2,469		260		華映	0.70						
台指期前十大佔市場	53.5%		46.3%		聯強	0.60						
電子期前十大佔市場	53.1%		77.4%		台郡	0.46						
金融期前十大佔市場	63.9%		68.9%		前十名合計	9.39						
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)			
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	48571	-3	-280	117	-1062	333	89039	82653	6386	210253	205225	5028
投信	-42675	-481	10	0	-47	0	-216	-216	0	-637	0	-637
自營商	-9107	-811	396	39	-249	-187	-18343	-7952	-10391	-34655	-38765	4110

● 觀盤重點提示

- 國際金融：伊拉克庫德族獨立公投事件，恐遭土耳其阻斷其石油往外運輸的管道，使得連日油價上漲，激勵美國能源股走揚，但能源股的漲勢仍不敵科技股下跌的幅度；市場傳出蘋果要求供應鏈備料縮減，導致其股價持續走弱跌0.88%，而臉書取消調整股價結構，令股價重挫逾4%，加上美國與朝鮮緊張關係再度升溫，市場不確定性增加，使主要指數週一均收低；終場道瓊指數跌0.24%、S&P500跌0.22%、Nasdaq跌0.88%、費半指數跌1.97%。
- 台指選擇權：近月選擇權買權10300序列以上四檔均有顯著增加未平倉量，而價平履約價持續往下位移，顯示上檔壓力續強；賣權於10400~10500序列合計減少逾兩千口，相較昨日減少幅度明顯縮小，並同時賣權於10100~10300序列有小幅度的加碼，顯示下檔在此區間有支撐。今日未平倉p/c ratio為1.36，較前日減少0.13，成交量p/c ratio為0.93，較前日減少0.11；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：今日三大權值股台積電、鴻海、大立光早盤一度收紅，使得指數小幅走揚，但午後三巨頭紛紛走低，台積電和鴻海跌逾1%，而大立光賣壓較強跌4%，拖累其他光學鏡頭股如亞光、佳凌、今國光、玉晶光等重挫，此外，記憶體大廠股價創高後亦出現修正，華邦電和南亞科均跌至五日均線之下；今日電子指數重挫逾1%，而金融指數小漲0.34%，第一金、兆豐金和富邦金平均漲幅約1%，成為今日大盤較抗跌的族群；終場加權指數下跌0.76%，收在10257.02點，成交值1215.45億元。櫃買指數開平盤走低，終場指數下跌1.85%，收在137.37點，成交值373.48億元。(2)資金面：美國和北韓之間的對峙和緊張進一步惡化，市場資金轉移至避險資產，日圓兌美元走升，而韓元則趨貶，連帶台幣貶值5.8分，以30.23元開出，但因台股大跌，和出口商月底的拋匯需求，台幣呈現趨貶震盪整理；終場新台幣兌美元貶值4.4分，收在30.216元，台北及元太外匯經紀公司總成交量為8.28億美元。(3)技術面：今日台股早盤一度小漲，但上檔壓力仍大，指數午後由紅翻黑，終場收在最低點，所有短均線持續下彎；以日線型態觀察，日K下彎開口擴大，MACD亦持續顯示指標走空，短線走勢維持弱勢格局，下檔支撐已經來到半年線，近期宜觀望靜待指數回穩。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣起65.68億元，其中外資賣起75.69億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉48571口，較前日減少3口淨多單，投信淨空單留倉42675口，自營商淨空單留倉9107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	10257.02	10374.54	10257.02	-78.87		1215億	2.46	1.72	5.55	
10月台指期	10263	10369	10261	-68.00	0.06	164595	2.32	2.32	2.76	101264
11月台指期	10245	10350	10242	-71.00	-0.12	3394	1.55	1.55	1.56	2143
10月小台指	10263	10369	10261	-70.00	0.06	103190	1.72	1.75	1.91	31443
11月小台指	10245	10350	10242	-70.00	-0.12	4142	1.39	1.40	1.44	2770
電子指數	431.82	438.96	431.82	-5.53		883億				
10月電子期	432.35	438.50	432.20	-4.65	0.12	3809	1.32	1.27	1.28	3795
11月電子期	431.25	437.05	431.25	-4.60	-0.13	24	1.28	1.00	1.04	73
金融指數	1121.49	1124.13	1116.91	3.79		43億				
10月金融期	1119.60	1123.00	1113.20	2.60	-0.17	2159	1.42	1.36	1.45	4211
11月金融期	1118.80	1121.60	1116.80	2.40	-0.24	25	1.10	1.00	1.09	39
摩台指	382.60	386.86	382.60	-3.04						
09月摩台指	383.10	386.60	383.00	-2.40	0.13	93530	-	-	5.86	160166
10月摩台指	382.70	386.20	382.60	-2.40	0.03	79315	-	-	7.98	106400

<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

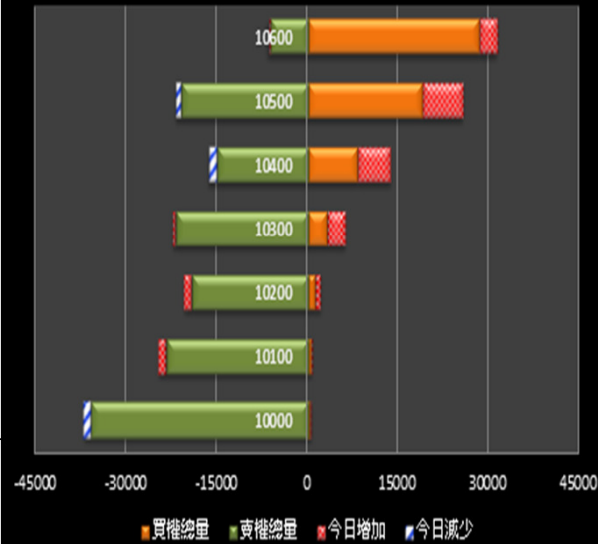
(104)金管期總字第002號

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

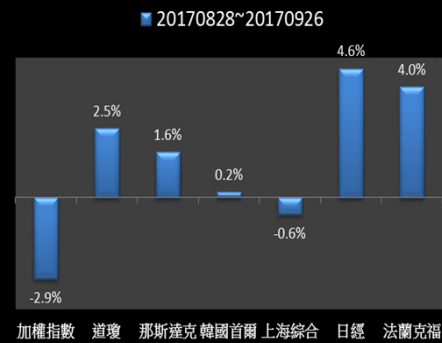


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

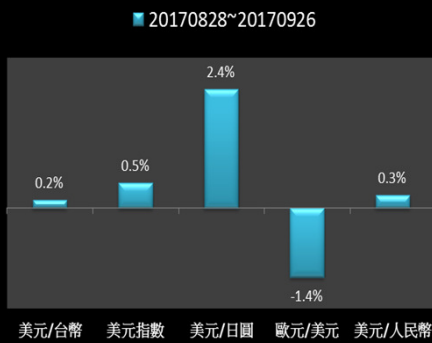


國際指數/商品期貨/外匯行情

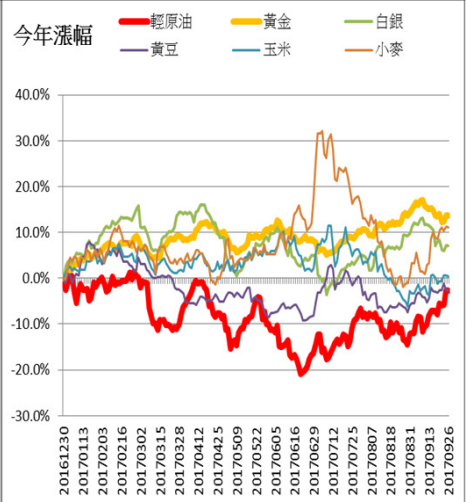
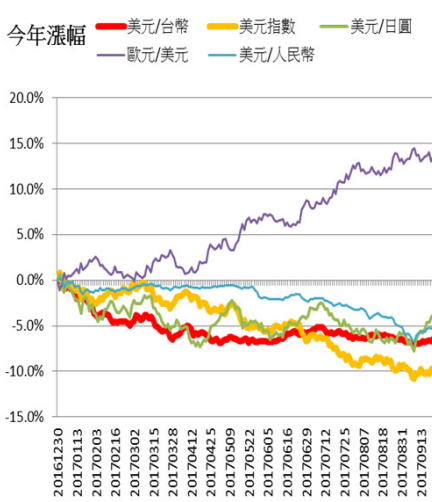
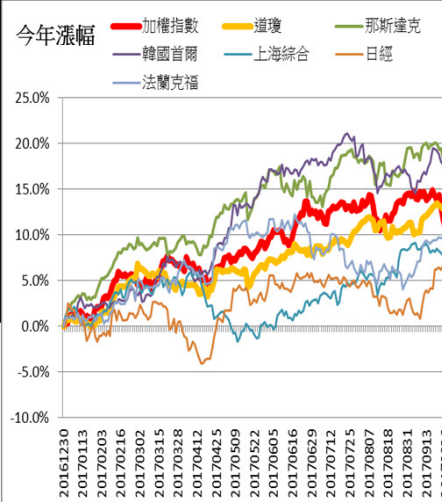
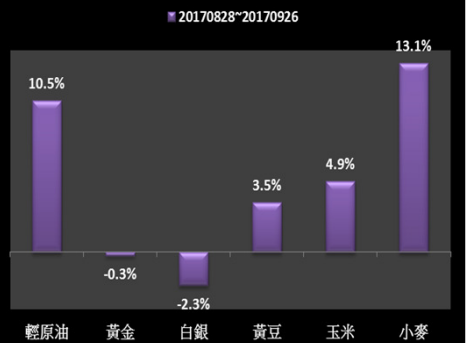
國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>