



兆豐期貨
Mega Futures

國際指數期貨 期貨交易員的一天

兆豐期貨 顧問事業部



一天的開始 太陽升起

6:00 AM 起床 第一件事情做什麼呢?

>>打開非凡電視台 *看美股收多少??

****美股指數期貨電子盤開盤 6:00 AM**



亞洲主要指數 開盤

- 7:45 AM：日經225開盤
- 8:45 AM：台指期、新加坡摩台指開盤
- 9:00 AM：台股現貨開盤
- 9:00 AM：中國A50指數期貨(SGX)
- 9:15 AM：恆生指數期貨、H股指數期貨

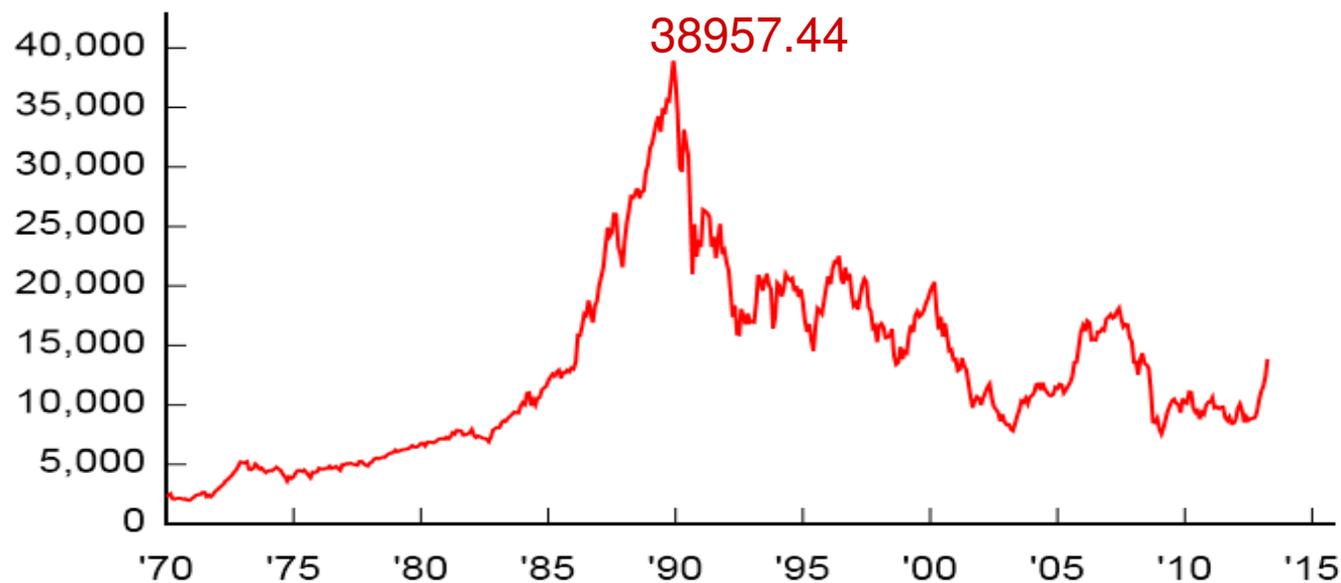


日經225

交易時間：07:45-14:30

原始保證金：JPY ¥418,000(約台幣\$130,000)

最小跳動點：5點（每跳5點JPY ¥2500）



委託(剛)	市場(買)	價格	市場(賣)	委託(剛)
		13990		
		13985		
		13980		
		13975		
		13970		
		13965		
		13960	64	
		13955	33	
		13950	23	
		13945	22	
		13940	2	
	19	13935		
	20	13930		
	50	13925		
	34	13920		
	61	13915		
		13910		
		13905		
		13900		
		13895		
--(--)	184		144	--(--)

買單全部取消 ↑ ↻ ↓ 賣單全部取消

部位: 平倉



中國A50指數期貨 (SCN)

交易時間：09:00-16:00

原始保證金：USD \$550 (約台幣\$16,500)

最小跳動點：5點 (每跳5點 USD \$5)

印SP08 新華50&08 小恆指0813 1/2

MTL買進 自動 ROD 當日有效 MTL賣出

委託(刪)	市場(買)	價格	市場(賣)	委託(刪)
		7275.0		
		7270.0		
		7265.0		
		7260.0		
		7255.0	260	
		7250.0	189	
		7245.0	197	
		7240.0	219	
		7235.0	83	
	215	7230.0		
	212	7225.0		
	252	7220.0		
	237	7215.0		
	147	7210.0		
		7205.0		
		7200.0		
		7195.0		
		7190.0		
		7185.0		
--(--)	1,063		948	--(--)

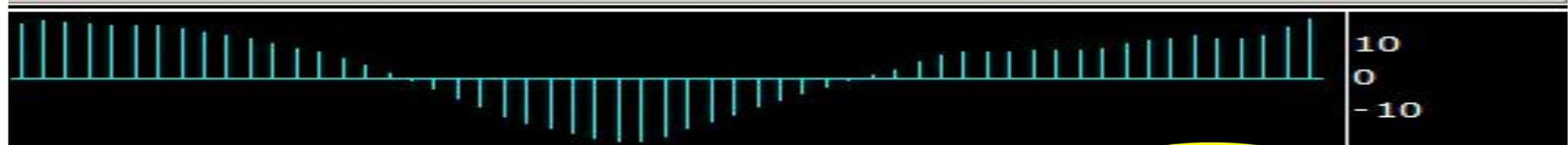
買單全部取消 賣單全部取消



中國A50指數期貨 特性

S2SFC& A50指數1308(5分) 7025.00 +85.00 +1.22% 開 694
高 7055.00 低 6935.00 量 19338 OI 161116 09:56:18

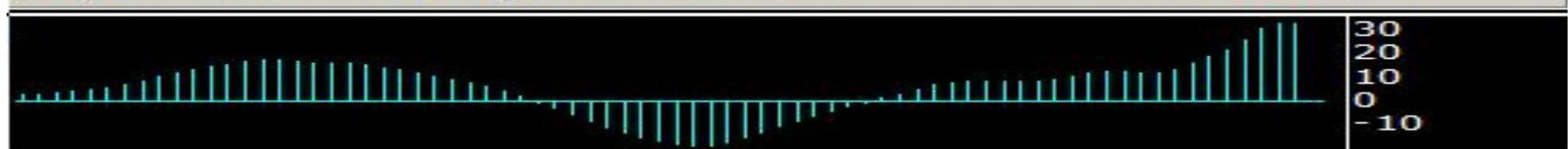
日週月分 5 進階 57



中國A50指數期貨 特性

S2SFC& A50指數1308(5分) 7035.00 +95.00 +1.37% 開 6940
高 7075.00 低 6935.00 量 31191 OI 161116 10:20:25

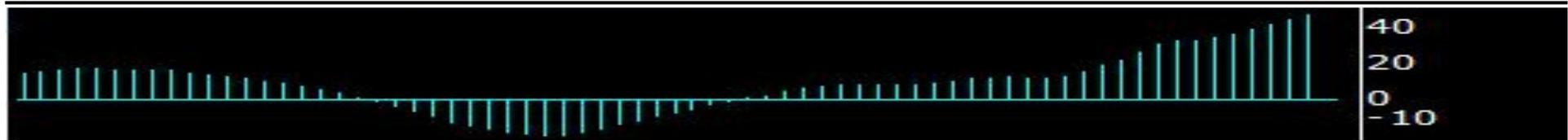
日週月分 5 進階 76



中國A50指數期貨 特性

S2SFC& A50指數1308(5分) ↑ 7090.00 +150.00 +2.16% 開 69
高 7095.00 低 6935.00 量 41465 OI 161116 10:54:32

日週月分 5 進階 71

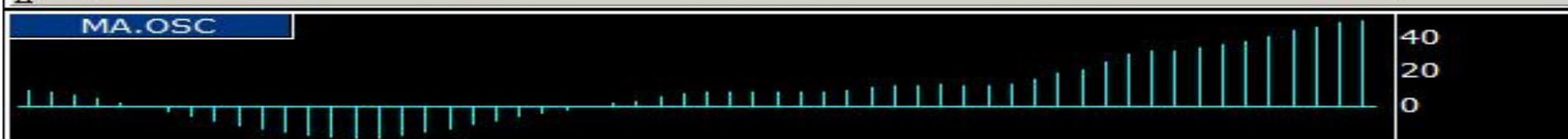


中國A50指數期貨 特性

技術分析

S2SFC& A50指數1308(5分) ↑ 7110.00 -170.00 -2.45% 開 6940.00
高 7130.00 低 6935.00 量 44935 OI 161116 11:01:07

日週月分 5 進階 58



中國A50指數期貨 特性



恆生指數期貨 (HSI)

交易時間：09:15-12:00；13:30-16:15

大恆生：

原始保證金：HKD \$82,150 (約台幣\$32萬)

最小跳動點：1點 (每跳點 HKD \$50)

小恆生：

原始保證金：HKD \$16,430 (約台幣\$64,000)

最小跳動點：1點 (每跳點 HKD \$10)

小恆指0813 日225&09 恆生指數081 1/2

自動 ROD 當日有效

委託(刪)	市場(買)	價格	市場(賣)	委託(刪)
		22568	1	
		22567	2	
		22566		
		22565		
		22564		
		22563	1	
		22562	2	
		3 22561		
		5 22560		
		1 22559		
		22558		
		22557		
		2 22556		
		1 22555		
		22554		
		22553		
		22552		
		22551		
		22550		
	12		10	--(--)

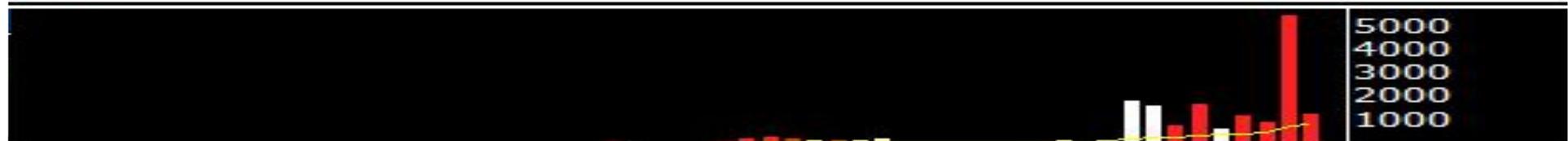
取消 買 賣 賣單全部取消



恆生指數期貨 特性

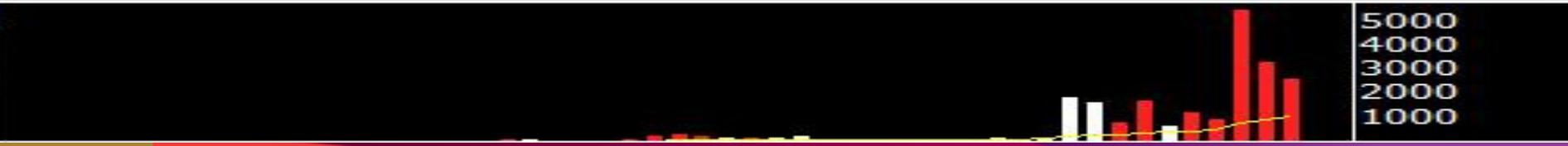
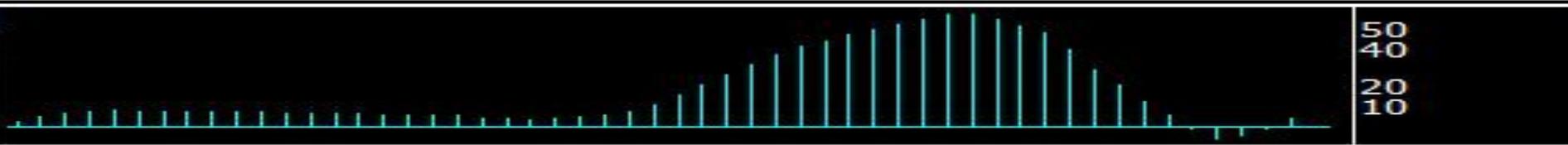
HSI& 恆生指1308(5分) 21967 +264 +1.22% 開 21715 高 21996
量 18025 OI 96842 09:55:41

日週月 公 進階 55



恆生指數期貨 特性

HSI& 恆生指1308(5分) ↓ 22027 +324 +1.49% 開 21715 高 22039
量 22630 OI 96842 10:03:56



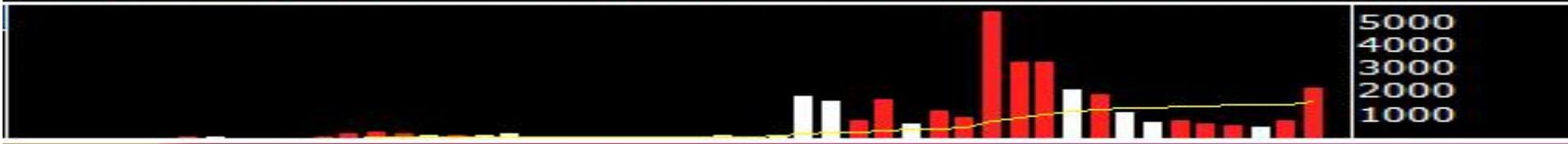
恆生指數期貨 特性

HSI& 恆生指1308(5分) ↓ 22036 +333 +1.53% 開 21715 高 22095
量 28537 OI 96842 10:20:43



恆生指數期貨 特性

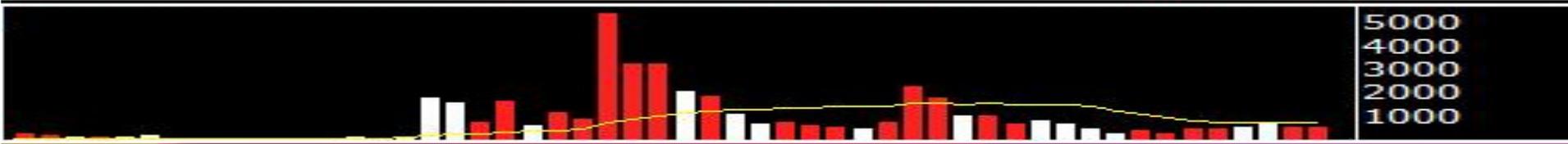
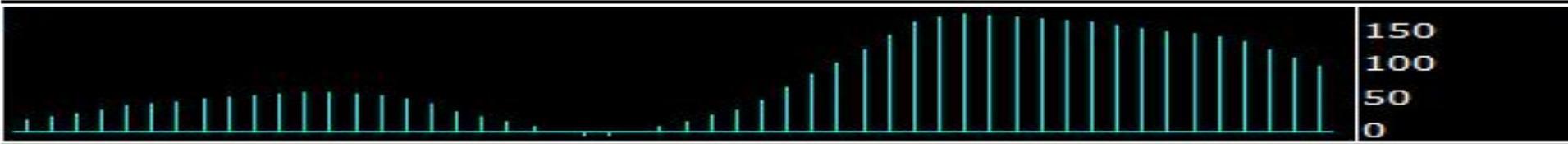
HSI& 恆生指1308(5分) 22134 +431 +1.99% 開 21715 高 22144
量 34419 OI 96842 10:53:48



恆生指數期貨 特性

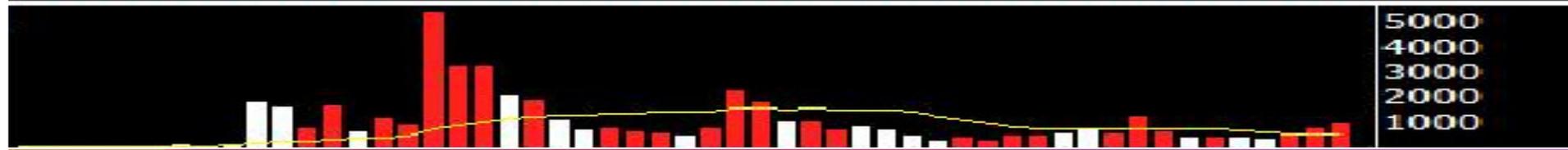
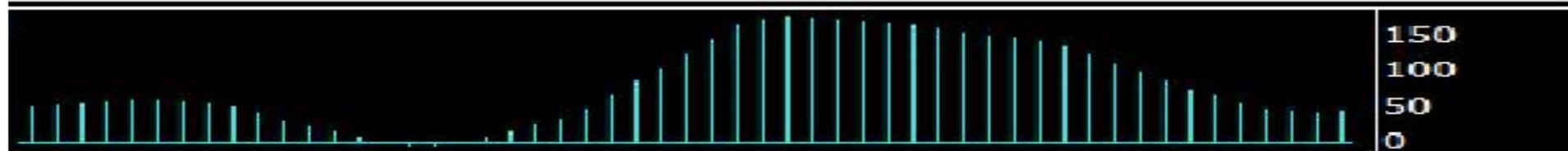
HSI& 恆生指1308(5分) 22191 +488 +2.25% 開 21715 高 22194
量 45658 OI 96842 13:11:46

日週月合 5 進階 5



恆生指數期貨 特性

HSI& 恆生指1308(5分) ↑ 22226 +523 +2.41% 開 21715 高 22234 低 21662
量 50653 OI 96842 13:54:44



日經225 技術分析應用

技術分析
S2NI& 日經2251309(5分) 13605.00 - - 開 13635.00 高 13670.00
低 13410.00 量 45266 OI 241772 10:21:09



主要指數期貨 合約規格

商品名稱	代號	交易月份	合約規約	最小跳動點 (Tick)	最小跳動點 (金額)	台北交易時間(夏令)	交易所
日經225指數	SSI	3.6.9.12月	500日圓*指數	5點	JPY 2500	07:45-14:30	SGX
摩台指數期貨	STW	最近2個月份+	100美元*指數	0.1點	USD 10	08:45-13:50	SGX
中國A50指數	SCN	最近2個月份+	1美元*指數	5點	USD \$5	09:00-16:00	SGX
印度指數	SIN	最近2個月份+	2美元*指數	0.5點	USD \$1	09:00-18:15	SGX
恆生指數期貨	HIS	最近2個月份+	50港幣*指數	1點	HKD 50	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
小恆生指數期貨	MHI	最近2個月份+	10港幣*指數	1點	HKD 10	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
H股指數期貨	HHI	最近2個月份+	50港幣*指數	1點	HKD 50	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
小H股指數期貨	MCH	最近2個月份+	10港幣*指數	1點	HKD 10	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
FT-SE 100	FFI	3.6.9.12月	10英鎊*指數	0.5點	GBP 5	電子盤08:00-14:50	LIFFE倫敦金融
德國法蘭克福指數	DAX	3.6.9.12月	25歐元*指數	0.5點	EUR 12.5	電子盤 13:50-04:00	EURO歐洲期貨交易所
歐洲藍籌50指數	ESX	3.6.9.12月	10歐元*指數	1點	EUR 10	電子盤 13:50-04:00	EURO歐洲期貨交易所
CAC40	FCE	3個近月+	10歐元*指數	0.5點	EUR 5	電子盤14:00-04:00	法國期貨交易所
迷你道瓊指數	YM	3.6.9.12月	5美元*指數	1點	USD \$5	電子盤06:00-05:15 (次日4:15-4:30暫停)	CBOT
E-MINI NASDAQ 100	NQ	3.6.9.12月	20美元*指數	0.25點	USD \$5	電子盤06:00-05:15 (次日4:15-4:30暫停)	CME
E-MINI S&P INDEX	ES	3.6.9.12月	50美元*指數	0.25點	USD \$12.5	電子盤06:00-05:15 (次日4:15-4:30暫停)	CME
10年美國中期債券	TY	3.6.9.12月	100,000美元	0.5/32點	USD \$15.625	電子06:00-05:00	CBOT
美國長期債券	US	3.6.9.12月	100,000美元	1/32點	USD \$31.25	電子06:00-05:00	CBOT



印度指數期貨(SIN)

交易時間：09:00-18:15 (中午11:30起熱絡)

原始保證金：USD \$528 (約台幣\$16,000)

最小跳動點：0.5 點 (每跳 0.5點 USD \$1)

委託(刪)	市場(買)	價格	市場(賣)	委託(刪)
		5746.5		
		5746.0		
		5745.5		
		5745.0		
		5744.5		
		5744.0		
		5743.5	1	
		5743.0	1	
		5742.5	2	
		5742.0	1	
		5741.5	1	
	9	5741.0		
		5740.5		
	1	5740.0		
	3	5739.5		
	3	5739.0		
	3	5738.5		
		5738.0		
		5737.5		
--(--)	19		6	--(--)



印度指數期貨 特性

技術分析

S2SIN& 印度指數1308(60分) ↓ 5739.00 -13.00 -0.23% 開 5755.50 高 5755.50 低 5729.50 量 1005 OI 289787 00:17:11

日週月分 60 進階 259



印度國定假日

Market Timings & Holidays

Select Product:

Equity Derivatives

Period:

From 01-01-2013

To 31-12-2013

Get Data

Trading Holidays

Clearing Holidays

Market Segment	Date	Day	Description
F&O	27-Mar-2013	Wednesday	Holi
F&O	29-Mar-2013	Friday	Good Friday
F&O	19-Apr-2013	Friday	Ram Navmi
F&O	24-Apr-2013	Wednesday	Mahavir Jayanti
F&O	01-May-2013	Wednesday	May Day
F&O	09-Aug-2013	Friday	Ramzan ID
F&O	15-Aug-2013	Thursday	Independence Day
F&O	09-Sep-2013	Monday	Ganesh Chaturthi
F&O	02-Oct-2013	Wednesday	Gandhi Jayanti
F&O	16-Oct-2013	Wednesday	Bakri ID
F&O	04-Nov-2013	Monday	Diwali-Balipratipada
F&O	14-Nov-2013	Thursday	Moharram
F&O	25-Dec-2013	Wednesday	Christmas

Market Timings

Trading on the derivatives segment takes place on all days of the week (except Saturdays and Sundays and holidays declared by the Exchange in advance). The market timings of the derivatives segment are:

Normal market / Exercise market open time : 09:15 hrs

Normal market close time : 15:30 hrs

Setup cutoff time for Position limit/Collateral value : 16:15hrs

Trade modification / Exercise market end time : 16:15hrs



迷你道瓊指數期貨 (YM, 小道)

交易時間：06:00-05:15 (21:30美股開盤)

原始保證金：USD \$2,750 (約台幣\$83,000)

最小跳動點：1點 (每跳點 USD \$5)

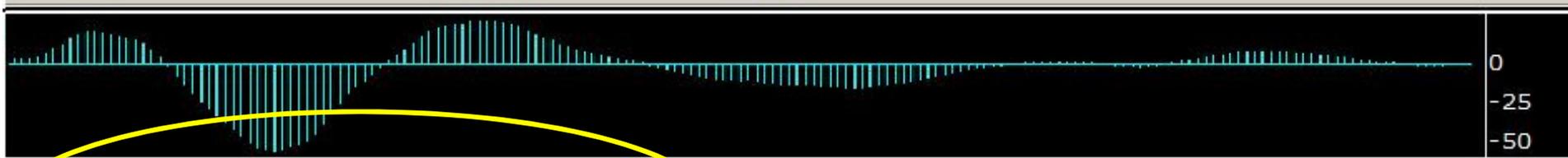
委託(刪)	市場(買)	價格	市場(賣)	委託(刪)
		15347		
		15346		
		15345		
		15344		
		15343		
		15342	70	
		15341	76	
		15340	65	
		15339	56	
		15338	4	
	12	15337		
	38	15336		
	50	15335		
	63	15334		
	66	15333		
		15332		
		15331		
		15330		
		15329		
		15328		
--(--)	229		271	--(--)



迷你道瓊指數期貨 特性

B1YM& M道瓊1309(5分) ↓ 15374 -1 -0.01% 開 15373 高 15383 低 15348 量 6125 OI 123896 01:33:01

日週月 5 進階 179



合約規格

商品資訊

+ 合約規格

+ 商品保證金

+ 期貨交易稅率

+ 例假日一覽表

+ 商品最後交易日

+ 臺灣期交所資訊

+ 期貨契約調整

+ 交易公告

+ 相關網站

美國交易所期貨合約

國家/區域：美國交易所

交易所：芝加哥CME交易所

芝加哥CME交易所

商品名稱	代號	交易月份	合約規約	最小跳動點 =每合約跳動值	台北交易時間 (夏令)
歐元	EC	3.6.9.12月	125,000歐元	0.01美分/歐元 = USD 12.50	人工盤20:20-03:00 電子盤06:00-05:00
小歐元	E7	3.6.9.12月	62,500歐元	0.01美分/歐元 = USD 6.25	06:00-05:00(電子盤)
微型歐元	ECM	3.6.9.12月	12,500歐元	0.01美分/歐元 = USD 1.25	06:00-05:00(電子盤)
日圓	JY	3.6.9.12月	12,500,000 日圓	0.000001美分/日圓 = USD 12.50	人工盤20:20-03:00 電子盤06:00-05:00
瑞士法郎	SF	3.6.9.12月	125,000 瑞士法郎	0.01美分/瑞郎 = USD 12.50	人工盤20:20-03:00 電子盤06:00-05:00
加幣	CD	3.6.9.12月	100,000加幣	0.01美分/加幣 = USD 10	人工盤20:20-03:00 電子盤06:00-05:00
澳幣	AD	3.6.9.12月	100,000澳幣	0.01美分/澳幣 = USD 10	人工盤20:20-03:00 電子盤06:00-05:00
英鎊	BP	3.6.9.12月	62,500英鎊	0.01美分/英鎊 = USD 6.25	人工盤20:20-03:00 電子盤06:00-05:00



商品保證金

新加坡、香港交易所

交易所	契約	代碼	幣別	原始保證金	維持保證金
SGX	摩根台股指數	STW	美金	1,210	1,100
	NIKKEI 225指數	SSI	日幣	418,000	380,000
	印度指數	SIN	美金	528	480
	富時中國A50指數	SCN	美金	550	500
HKFE	恆生指數期貨	HSI	港幣	82,150	65,700
	小恆生指數期貨	MHI	港幣	16,430	13,140
HKFE	H股指數指數期貨	HHI	港幣	36,600	29,300
	小型H股指數指數期貨	MCH	港幣	7,320	5,860

美國期貨交易所

交易所	契約	代碼	幣別	原始保證金	維持保證金
CBOT	美國長期債券	US	美金	2,750	2,500
	10年美國中期債券	TY	美金	1,623	1,475
	5年美國中期債券	FV	美金	990	900
	2年美國中期債券	TU	美金	248	225
	道瓊工業股價指數	DJ	美金	5,500	5,000
	迷你道瓊指數	YM	美金	2,750	2,500
	小麥	W	美金	3,240	2,400
	燕麥	O	美金	1,350	1,000
	黃豆	S	美金	4,590	3,400
	小黃豆	YK	美金	918	680
	黃豆油	BO	美金	1,688	1,250
	黃豆粉	SM	美金	2,160	1,600
	粗米	RR	美金	1,350	1,000
	玉米	C	美金	2,700	2,000
	小玉米	YC	美金	540	400



主要指數期貨 合約規格

商品名稱	代號	交易月份	合約規約	最小跳動點 (Tick)	最小跳動點 (金額)	台北交易時間(夏令)	交易所
日經225指數	SSI	3.6.9.12月	500日圓*指數	5點	JPY 2500	07:45-14:30	SGX
摩台指數期貨	STW	最近2個月份+	100美元*指數	0.1點	USD 10	08:45-13:50	SGX
中國A50指數	SCN	最近2個月份+	1美元*指數	5點	USD \$5	09:00-16:00	SGX
印度指數	SIN	最近2個月份+	2美元*指數	0.5點	USD \$1	09:00-18:15	SGX
恆生指數期貨	HIS	最近2個月份+	50港幣*指數	1點	HKD 50	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
小恆生指數期貨	MHI	最近2個月份+	10港幣*指數	1點	HKD 10	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
H股指數期貨	HHI	最近2個月份+	50港幣*指數	1點	HKD 50	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
小H股指數期貨	MCH	最近2個月份+	10港幣*指數	1點	HKD 10	09:15-12:00 ; 13:30-16:15	HKF
FT-SE 100	FFI	3.6.9.12月	10英鎊*指數	0.5點	GBP 5	電子盤08:00-14:50	LIFFE倫敦金融
德國法蘭克福指數	DAX	3.6.9.12月	25歐元*指數	0.5點	EUR 12.5	電子盤 13:50-04:00	EURO歐洲期貨交易所
歐洲藍籌50指數	ESX	3.6.9.12月	10歐元*指數	1點	EUR 10	電子盤 13:50-04:00	EURO歐洲期貨交易所
CAC40	FCE	3個近月+	10歐元*指數	0.5點	EUR 5	電子盤14:00-04:00	法國期貨交易所
迷你道瓊指數	YM	3.6.9.12月	5美元*指數	1點	USD \$5	電子盤06:00-05:15 (次日4:15-4:30暫停)	CBOT
E-MINI NASDAQ 100	NQ	3.6.9.12月	20美元*指數	0.25點	USD \$5	電子盤06:00-05:15 (次日4:15-4:30暫停)	CME
E-MINI S&P INDEX	ES	3.6.9.12月	50美元*指數	0.25點	USD \$12.5	電子盤06:00-05:15 (次日4:15-4:30暫停)	CME
10年美國中期債券	TY	3.6.9.12月	100,000美元	0.5/32點	USD \$15.625	電子06:00-05:00	CBOT
美國長期債券	US	3.6.9.12月	100,000美元	1/32點	USD \$31.25	電子06:00-05:00	CBOT



謝謝指教 Q&A 時間



責任聲明：本報告純屬研究性質，僅供兆豐集團內部同仁及客戶參考，不保證其完整性及精確性，且不提供或嘗試遊說客戶做為交易期權之依據。報告中所有的意見與預估，係取自本公司相信為可靠之資料來源，且為特定日期所為之判斷，有其時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。投資人於決策時應審慎衡量本身風險，並就投資結果自行負責。以上報告內容之著作權屬兆豐期貨所有，禁止任何形式之抄襲、引用或轉載。

兆豐期貨(股) 102年金管期總字第008號 地址：北市忠孝東路二段95號2樓 電話：(02)2327-8895