



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06月27日

星期二

收盤日報

● 法人動態：

單位：億	台股現貨買賣超				個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名					
	買進	賣出	合計	累計本月至今								
外資及陸資	273.76	272.04	1.72	155.69	台塑化	14.79	台積電	-40.26				
投信	5.04	8.48	-3.44	-50.10	鴻海	11.53	台達電	-2.30				
自營商	90.54	62.47	28.08	158.03	台化	3.38	大立光	-1.78				
合計	369.35	342.99	26.35	263.62	鴻準	1.82	統一超	-1.61				
6/26融資	64.41	63.96	0.45	前日 1444.40	南亞科	1.34	廣達	-1.03				
6/26融券	22390	38295	15905	餘額 348760	宏達電	1.17	遠傳	-1.01				
單位：口	多		空		友達	1.07	聯電	-0.84				
6/26摩台6月多空比	1,121		985		第一金	1.06	華碩	-0.82				
台指期前十大佔市場	53.5%		46.3%		亞德客-KY	0.95	南亞	-0.70				
電子期前十大佔市場	53.1%		77.4%		華邦電	0.95	和泰車	-0.61				
金融期前十大佔市場	63.9%		68.9%		前十名合計	38.06	後十名合計	-50.98				
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	48698	-4929	1173	-79	-2326	-306	92726	94460	-1734	80553	80933	-380
投信	-30644	114	15	0	-88	0	0	0	0	0	0	0
自營商	-20	823	469	-95	358	-79	-14788	-15265	477	32948	15159	17789

● 觀盤重點提示

- 國際金融：週一美股開盤走高，主要受到銀行股和科技股激勵，但隨後受到科技股轉弱影響，美股指數盤中轉跌，加上週一公布的五月耐久財訂單月減1.1%，低於市場預期，為六個月以來的最大跌幅。道瓊終場上漲0.07%、S&P500上漲0.03%、Nasdaq下跌0.29%、費半下跌0.97%。
- 台指選擇權：雖台股走勢今日較疲弱，但盤中一度來到高點10545.70，買賣權在10400點上下四檔的未平倉部位皆微幅增加，提高買賣權未平倉均價，以未平倉量來看，目前買權集中在10400點，賣權集中在10000點，7月未平倉p/c ratio為1.24，較昨日減少0.03，顯示籌碼偏多的格局有稍緩的跡象。
- 台北股市：(1)基本面及策略：今日台股開小高，不如前一天台積電填息行情的漲勢，今日台積電開盤即走低震盪，盤中在鴻海和塑化類股撐盤下，大盤今日走勢都在平盤附近震盪，終場小跌0.02%，收在10512.06點，量能仍放大至1127.86億。櫃買指數方面，今日開小高震盪，受遊戲股表現不佳影響，尾盤翻黑，終場下跌0.07%，收在137.01點。(2)資金面：台股今日表現平淡，加上韓元貶值拖累影響，台幣開盤後呈現貶值，新台幣兌美元以30.341元作收。因今日台股漲勢稍歇，外資沒有大舉匯入資金到股市，觀察日後台股走勢，短線上建議中性看待新台幣。(3)技術面：目前均線上5日和10日均線都來到萬點，但今日K棒收黑十字，顯示目前漲勢受阻的跡象，留意台股近日的走勢，建議台股轉中性看待。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計買超26.35億元，其中外資買超1.72億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉48698口，較前日減少4929口淨多單，外資已連續兩天減少8218口多單，投信淨空單留倉30644口，自營商淨空單留倉20口，籌碼面中性偏多看待。

● 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	10512.06	10545.70	10489.10	-1.90		1146.8億	3.37	2.42	5.95	
7月台指期	10368	10412	10353	-13.00	-1.37	113890	2.31	2.36	1.99	91255
8月台指期	10268	10316	10258	-16.00	-2.32	2579	1.51	1.48	1.38	4768
7月小台指	10369	10412	10353	-13.00	-1.36	70471	1.69	1.78	1.51	28838
8月小台指	10268	10316	10258	-16.00	-2.32	2488	1.44	1.61	1.48	1874
電子指數	442.67	444.80	441.90	-1.46		782.28億				
7月電子期	438.05	440.10	438.00	-1.60	-1.04	2662	1.29	1.34	1.22	3284
8月電子期	434.70	436.35	434.60	-1.60	-1.80	28	1.81	1.88	1.02	95
金融指數	1139.58	1141.87	1134.08	3.13		76.33億				
7月金融期	1126.40	1129.60	1122.20	4.20	-1.16	4428	1.47	1.53	1.35	3894
8月金融期	1110.20	1114.00	1106.60	4.20	-2.58	73	1.47	1.56	1.07	141
摩台指	395.97	397.11	394.82	-1.13						
6月摩台指	396.10	398.80	395.30	-0.90	0.03	91903				171495
7月摩台指	390.00	392.70	389.30	-0.80	-1.51	75582				136525

<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

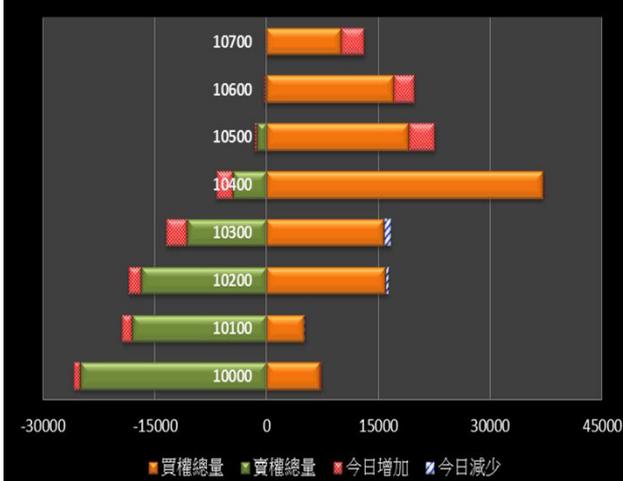
(98)金管期總字第019號

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



國際股市/外匯/大宗物資行情

國際股市月績效表現



國際商品期貨月績效表現



國際外匯月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>