



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07月27日 星期四 收盤日報

## 法人動態：

|             |        | 台股現貨買賣起 |       |            |       | 個股貢獻點數前十名 |           | 個股貢獻點數後十名 |       |           |        |        |
|-------------|--------|---------|-------|------------|-------|-----------|-----------|-----------|-------|-----------|--------|--------|
| 單位：億        | 買進     | 賣出      | 合計    | 累計本月至今日    |       |           |           |           |       |           |        |        |
| 外資及陸資       | 289.79 | 240.35  | 49.44 | 22.84      | 台積電   | 23.93     | 聯電        | -5.36     |       |           |        |        |
| 投信          | 6.83   | 13.58   | -6.75 | -73.80     | 鴻海    | 12.79     | 聯詠        | -0.90     |       |           |        |        |
| 自營商         | 72.05  | 65.30   | 6.75  | 42.05      | 台塑化   | 8.79      | 旺宏        | -0.34     |       |           |        |        |
| 合計          | 368.67 | 319.23  | 49.44 | -8.91      | 台化    | 3.89      | 群聯        | -0.25     |       |           |        |        |
| 7/26融資      | 70.65  | 66.88   | 3.77  | 前日 1463.50 | 台塑    | 3.52      | 中鼎        | -0.23     |       |           |        |        |
| 7/26融券      | 22988  | 46260   | 23272 | 餘額 395051  | 國泰金   | 3.48      | 東陽        | -0.22     |       |           |        |        |
| 單位：口        | 多      |         | 空     |            | 南亞    | 2.93      | 巨大        | -0.21     |       |           |        |        |
| 7/26摩台7月多空比 | 89     |         | 631   |            | 日月光   | 2.75      | 瑞昱        | -0.19     |       |           |        |        |
| 台指期前十大佔市場比  | 53.5%  |         | 46.3% |            | 聯發科   | 2.34      | 碩禾        | -0.15     |       |           |        |        |
| 電子期前十大佔市場比  | 53.1%  |         | 77.4% |            | 研華    | 1.54      | 義隆        | -0.14     |       |           |        |        |
| 金融期前十大佔市場比  | 63.9%  |         | 68.9% |            | 前十名合計 | 65.97     | 後十名合計     | -7.97     |       |           |        |        |
| 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       | 45441  | 7589    | 1362  | 210        | -1894 | 78        | 69265     | 64008     | 5257  | 123982    | 117885 | 6097   |
| 投信          | -29943 | 564     | 2     | 0          | -50   | 1         | 0         | 0         | 0     | 0         | 0      | 0      |
| 自營商         | -1304  | -1710   | 352   | 52         | 36    | 182       | 29494     | 2874      | 26620 | -15318    | -3223  | -12095 |

## 觀盤重點提示

- 國際金融：美國時間週三(26)公布企業財報中波音、可口可樂和福特汽車等公司Q2財報優，波音漲9.88%、可口可樂漲1.69%，加上Fed利率決策會議上，如市場預期不升息，但表示將於9月進行縮表計畫，推升道瓊、S&P500和Nasdaq指數紛紛創歷史高點。終場道瓊指數漲 0.45%、S&P500漲 0.03%、Nasdaq漲 0.16%、費半指數漲 1.16%。經濟數據面：美國6月新屋銷售較前月上揚0.8%，略低於預期。
- 台指選擇權：今日8月份賣權選擇權10400點附近增加部位幅度大，今天台股強勁走揚下，買權10400、10500點大幅縮減部位，使得買賣權未平倉均價皆上移。以未平倉量而言，買權集中在10600點，賣權集中在10200，未平倉p/c ratio為1.26，較前日上升0.08，顯示整體籌碼短線有偏多的現象。
- 台北股市：(1)基本面及策略：美國股市收漲，連帶今日加權指數開高，盤中電子權值股回溫，鴻海宣布到美國投資設立面板廠，推升股價開高走高上漲1.73%，台積電和大立光也收紅。今天類股漲多於跌，漲幅最高為油電燃氣2.24%，最低為建材營造跌0.68%。終場加權指數上漲 0.86%，收在 10508.37 點，成交值 1093.15億元。櫃買指數今日開高震盪，主要領漲族群為半導體和網通類股，終場上漲 0.20%，收在 140.23 點，成交值 360.89 億元。(2)資金面：美國昨晚宣布維持利率不變，美元持續走弱。今天亞洲主要貨幣兌美元普遍走強，加上台股強勢上漲，新台幣盤中一度大升2角多，因午後買匯湧現使台幣升幅收斂，終場收 30.252元，升1.5角，台北外匯經紀公司成交量為9.41億美元。(3)技術面：今日加權指數收長紅，短線上均線皆走揚，且指數價量齊揚站穩月線之上，若大型股持續走穩，則台股有望突破震盪整理的格局，短線上中性看待。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計買起 49.44 億元，其中外資買起 49.44 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 45441 口，較前日增加 7589 口淨多單，投信淨空單留倉 29943 口，自營商淨空單留倉 1304 口。其中外資今天大幅加碼多單部位，須留意後續部位變化，短線上籌碼面宜中性看待。

## 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   | 10508.37 | 10516.23 | 10427.83 | 89.26  |       | 1093億  | 3.04 | 2.17 | 6.06 |        |
| 08月台指期 | 10447    | 10462    | 10362    | 118.00 | -0.59 | 131031 | 2.60 | 2.34 | 3.05 | 79805  |
| 09月台指期 | 10415    | 10425    | 10332    | 116.00 | -0.90 | 3327   | 1.59 | 1.62 | 1.68 | 13388  |
| 08月台指期 | 10447    | 10462    | 10360    | 119.00 | -0.59 | 82908  | 1.86 | 1.66 | 2.02 | 25737  |
| 09月台指期 | 10415    | 10426    | 10331    | 115.00 | -0.90 | 3851   | 1.50 | 1.31 | 1.50 | 7750   |
| 電子指數   | 446.08   | 447.11   | 442.98   | 4.01   |       | 781億   |      |      |      |        |
| 08月電子期 | 444.20   | 444.45   | 440.10   | 5.55   | -0.42 | 3759   | 1.40 | 1.33 | 1.43 | 3797   |
| 09月電子期 | 442.90   | 443.00   | 439.50   | 5.75   | -0.72 | 52     | 1.18 | 1.11 | 1.08 | 107    |
| 金融指數   | 1144.86  | 1145.76  | 1137.04  | 7.76   |       | 51億    |      |      |      |        |
| 08月金融期 | 1126.80  | 1129.20  | 1119.60  | 8.40   | -1.60 | 2489   | 1.48 | 1.40 | 1.61 | 3937   |
| 09月金融期 | 1124.80  | 1126.00  | 1118.60  | 9.00   | -1.78 | 42     | 1.05 | 1.24 | 1.24 | 148    |
| 摩台指    | 397.03   | 397.66   | 393.87   | 3.69   |       |        |      |      |      |        |
| 07月摩台指 | 397.30   | 398.00   | 394.40   | 4.10   | 0.07  | 49384  | -    | -    | 4.72 | 74818  |
| 08月摩台指 | 394.70   | 395.20   | 391.50   | 4.50   | -0.59 | 54665  | -    | -    | 4.44 | 170778 |

&lt;本文僅供參考，並不做任何獲利保證。&gt;



華南金融集團

華南期貨股份有限公司

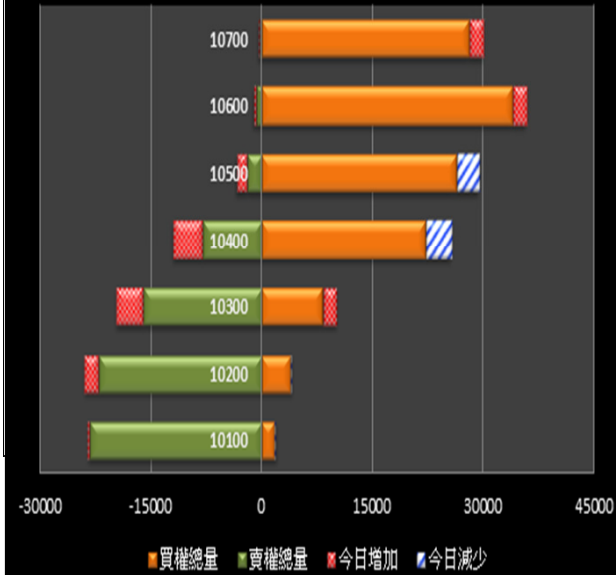
(98)金管期總字第019號

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

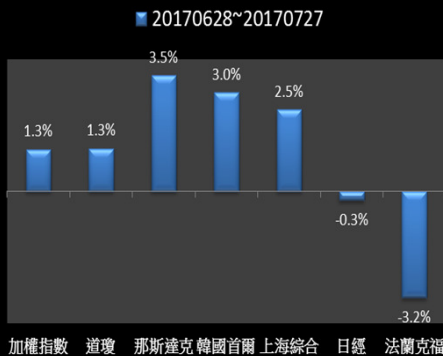


#### 近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

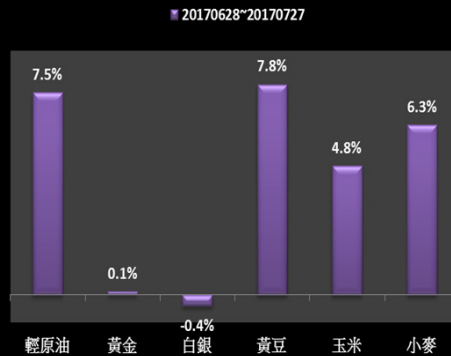


### 國際指數/商品期貨/外匯行情

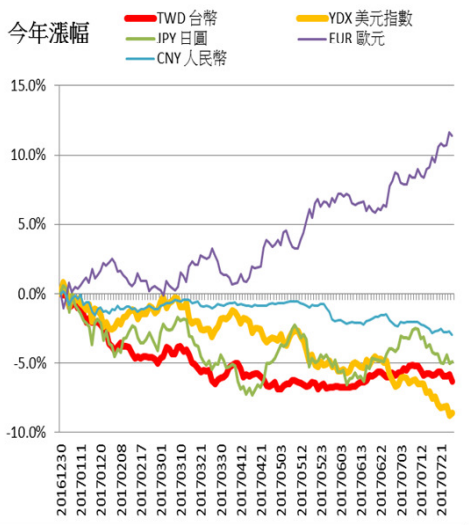
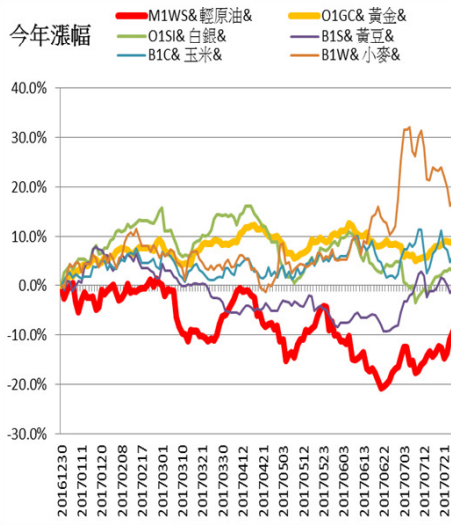
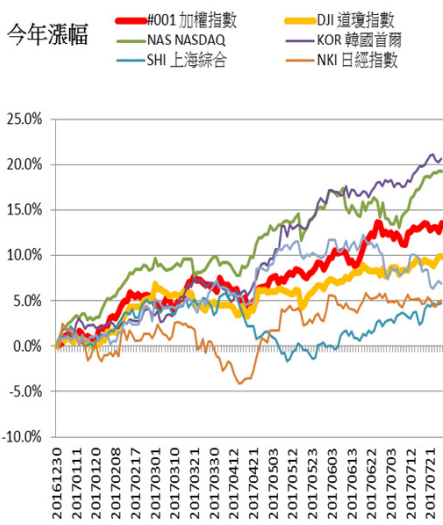
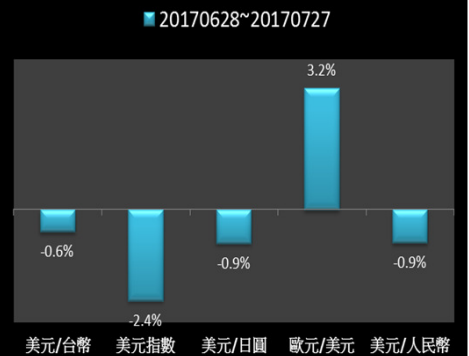
#### 國際股市月績效表現



#### 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。>