



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28日

星期五

收盤日報

● 法人動態：

| | | 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 | | | | |
|-------------|--------|---------|--------|------------|-------|-----------|-----------|-----------|--------|-----------|--------|-------|
| 單位：億 | 買進 | 賣出 | 合計 | 累計本月至今日 | | | | | | | | |
| 外資及陸資 | 183.84 | 255.58 | -71.74 | -48.57 | 聯發科 | 2.00 | 台積電 | -23.40 | | | | |
| 投信 | 8.62 | 13.20 | -4.58 | -79.40 | 欣興 | 0.41 | 統一超 | -8.44 | | | | |
| 自營商 | 54.40 | 70.32 | -15.92 | 26.44 | 台光電 | 0.40 | 統一 | -4.31 | | | | |
| 合計 | 246.86 | 339.10 | -92.24 | -101.53 | 美律 | 0.28 | 大立光 | -3.63 | | | | |
| 7/27融資 | 70.12 | 63.68 | 6.44 | 前日 1468.83 | 華邦電 | 0.26 | 可成 | -2.50 | | | | |
| 7/27融券 | 19662 | 32202 | 12540 | 餘額 406111 | 東聯 | 0.21 | 研華 | -2.14 | | | | |
| 單位：口 | 多 | | 空 | | 瑞儀 | 0.20 | 國泰金 | -2.04 | | | | |
| 7/27摩台7月多空比 | 7 | | 142 | | 旺宏 | 0.20 | 台塑化 | -1.72 | | | | |
| 台指期前十大佔市場比 | 53.5% | | 46.3% | | 亞光 | 0.17 | 台化 | -1.69 | | | | |
| 電子期前十大佔市場比 | 53.1% | | 77.4% | | 健鼎 | 0.17 | 富邦金 | -1.66 | | | | |
| 金融期前十大佔市場比 | 63.9% | | 68.9% | | 前十名合計 | 4.30 | 後十名合計 | -51.54 | | | | |
| 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 | 36167 | -9274 | 1138 | -224 | -1721 | 173 | 72429 | 69265 | 3164 | 151220 | 123982 | 27238 |
| 投信 | -31160 | -1217 | 2 | 0 | -50 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 自營商 | 2337 | 3641 | 249 | -103 | -87 | -123 | 2058 | 29494 | -27436 | 11833 | -15318 | 27151 |

● 觀盤重點提示

- 國際金融：美國時間週四指數開高，臉書公布上季財報淨利、營收皆優於市場預期，帶動臉書盤中股價大漲5.96%，激勵道瓊、Nasdaq、S&P500創新猷，隨後盤中科技股出現壓力，部分個股出現漲多獲利了結的賣壓，使指數走跌。終場道瓊指數上漲0.39%、S&P500跌0.10%、Nasdaq跌0.63%、費半指數跌1.62%。數據方面：美國六月耐久財訂單上升6.5%優於預期。
- 台指選擇權：因今日台股大跌，使8月份買權選擇權10500點附近部位明顯增加，且微幅減少賣權10400、10500點的部位，今買賣權未平倉均價皆下移。以未平倉量而言，買權集中在10600點，賣權集中在10100，未平倉p/c ratio為1.2，較前日下降0.06，顯示整體籌碼多方力量削弱。
- 台北股市：(1)基本面及策略：美國股市受科技股賣壓走跌，連帶今日台股指數開低，盤中台積電和大立光跌幅達1%以上，鴻海則收在平盤位置，金控股表現疲弱，傳產股中的統一超和統一重挫，顯示市場投資人對昨日重大訊息偏空看待。終場加權指數下跌0.81%、收在10423.05點，成交值969.63億元。櫃買指數今日開高震盪走低，終場下跌0.95%，收在138.90點，成交值399.44億元。(2)資金面：今日美元跌深反彈，使亞洲貨幣兌美元普遍走跌，加上台股今天大跌，新台幣走勢疲弱，終場貶0.05元，收在30.302，台北外匯經紀公司成交量為7.18億美元。(3)技術面：今日加權指數收長黑，短線上均線走弱，但價跌並無伴隨著千億元之上的成交值，雖今日失守月線，若下週權值股回神，大盤仍有機會震盪往上，短線上中性看待。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超92.24億元，其中外資賣超71.74億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉36167口，較前日減少9274口淨多單，投信淨空單留倉31160口，自營商淨多單留倉2337口。其中外資大幅減碼多單部位，惟近期買賣留倉口數變化較大，需留意後續部位變化，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 | 10423.05 | 10480.67 | 10410.53 | -85.32 | | 969億 | 2.81 | 2.09 | 5.73 | |
| 08月台指期 | 10339 | 10403 | 10324 | -107.00 | -0.81 | 128645 | 2.33 | 2.58 | 2.99 | 78747 |
| 09月台指期 | 10308 | 10370 | 10295 | -107.00 | -1.12 | 3000 | 1.68 | 1.62 | 1.77 | 13152 |
| 08月台指期 | 10339 | 10404 | 10324 | -109.00 | -0.81 | 79824 | 1.59 | 1.85 | 1.96 | 22621 |
| 09月台指期 | 10308 | 10371 | 10295 | -108.00 | -1.12 | 4029 | 1.37 | 1.58 | 1.63 | 7497 |
| 電子指數 | 442.45 | 445.03 | 441.58 | -3.63 | | 675億 | | | | |
| 08月電子期 | 438.30 | 441.70 | 438.10 | -5.95 | -0.95 | 3436 | 1.29 | 1.38 | 1.37 | 3646 |
| 09月電子期 | 437.05 | 440.20 | 436.75 | -5.85 | -1.24 | 64 | 1.06 | 1.17 | 1.16 | 103 |
| 金融指數 | 1139.16 | 1144.11 | 1137.98 | -5.70 | | 36億 | | | | |
| 08月金融期 | 1122.00 | 1124.60 | 1119.00 | -5.00 | -1.53 | 2016 | 1.34 | 1.44 | 1.50 | 3912 |
| 09月金融期 | 1118.20 | 1122.40 | 1116.40 | -6.60 | -1.87 | 32 | 1.19 | 1.29 | 1.39 | 149 |
| 摩台指 | 393.50 | 395.53 | 392.92 | -3.53 | | | | | | |
| 07月摩台指 | 393.20 | 394.90 | 392.70 | -4.20 | -0.08 | 10352 | - | - | 4.34 | 22473 |
| 08月摩台指 | 389.50 | 392.20 | 389.20 | -5.20 | -1.03 | 42076 | - | - | 2.59 | 214729 |

<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

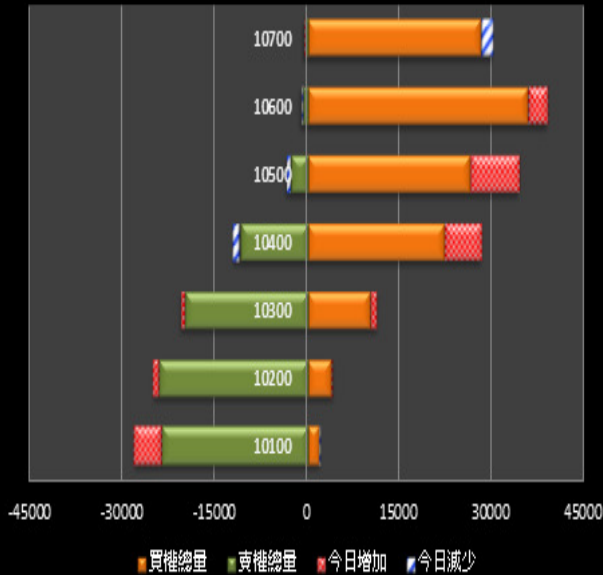
(98)金管期總字第019號

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

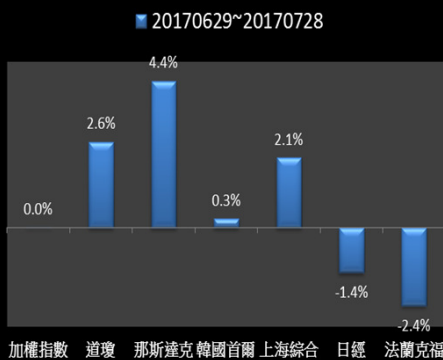


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

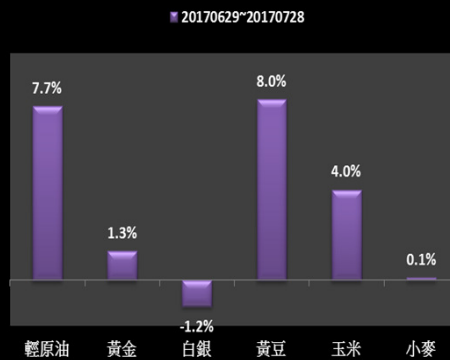


國際指數/商品期貨/外匯行情

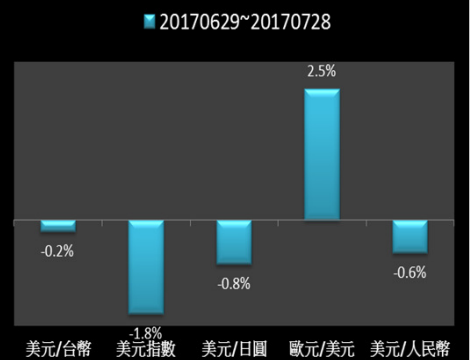
國際股市月績效表現



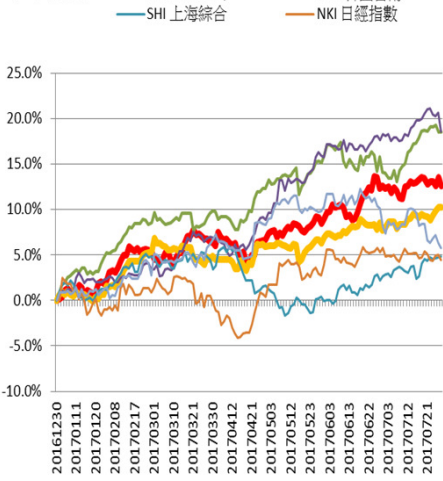
國際商品期貨月績效表現



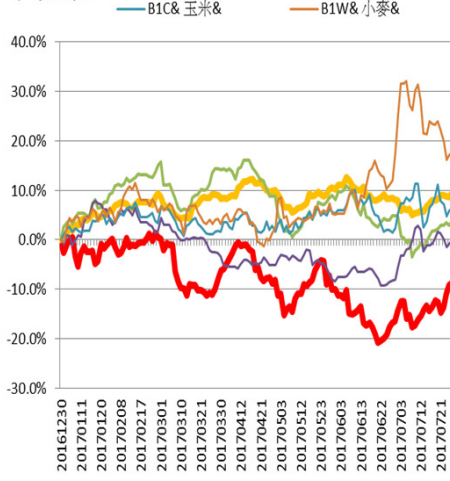
國際外匯月績效表現



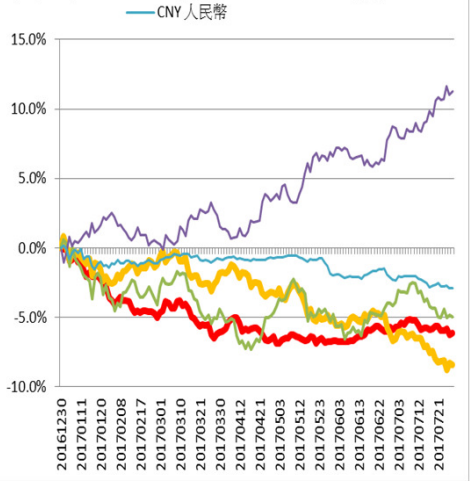
今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅



◁本文僅供參考，並不做任何獲利保證。▷