



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31日 星期一 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	累計本月至今日	未平倉	增減	未平倉	增減	
外資及陸資	289.01	301.13	-12.12	-52.34	75096	72429	2667	160168	
投信	6.52	10.34	-3.81	-84.74	0	0	0	0	
自營商	53.88	50.59	3.28	29.72	5625	2058	3567	-5688	
合計	349.41	362.06	-12.66	-107.35	81946	74487	6234	165580	
7/28融資	59.42	59.19	0.23	前日 1467.79	72096	72429	2667	160168	
7/28融券	26579	22180	-4399	餘額 393571	0	0	0	0	
單位：口	多		空		未平倉	增減	未平倉	增減	
7/28摩台7月多空比	90		1,826		37372	1205	1207	69	
台指期前十大佔市場比	53.5%		46.3%		-31500	-340	3	1	
電子期前十大佔市場比	53.1%		77.4%		1510	-827	242	-7	
金融期前十大佔市場比	63.9%		68.9%		37372	1205	1207	69	
前日	1467.79		393571		1207	69	-1774	-53	
餘額	393571		393571		3	1	-50	0	
台股現貨買賣起	多		空		0	0	0	0	
台股選擇權(買權)	90		1,826		5625	2058	3567	-5688	
台股選擇權(賣權)	53.5%		46.3%		2058	3567	-5688	11833	
台股現貨買賣起	53.1%		77.4%		3567	-5688	11833	-17521	
台股選擇權(買權)	63.9%		68.9%		11833	-17521	11833	-17521	
台股選擇權(賣權)	1467.79		393571		11833	-17521	11833	-17521	
台股現貨買賣起	393571		393571		11833	-17521	11833	-17521	
台股選擇權(買權)	多		空		11833	-17521	11833	-17521	
台股選擇權(賣權)	90		1,826		11833	-17521	11833	-17521	
台股現貨買賣起	53.5%		46.3%		11833	-17521	11833	-17521	
台股選擇權(買權)	53.1%		77.4%		11833	-17521	11833	-17521	
台股選擇權(賣權)	63.9%		68.9%		11833	-17521	11833	-17521	

● 觀盤重點提示

- 國際金融：上週五(28)美股指數漲跌互見，英特爾第二季營收和淨利的成長優於市場預期，收漲0.97%，推升道瓊指數連續第三日再創新高。盤中部分個股出現獲利了結的賣壓，使S&P500、Nasdaq都相繼走低震盪。終場道瓊上漲0.15%、S&P500跌0.13%、Nasdaq跌0.12%、費半指數跌0.39%。數據面：美國商務部上週五(28)公布第二季經濟成長率為2.6%，優於市場預期。
- 台指選擇權：今日台股開低終場拉尾盘收紅，近月份買權10500附近序列未平倉量明顯增加，今買權未平倉均價微幅下移。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1.22，較前日增加0.02。
- 台北股市：(1)基本面及策略：美國股市出現個股高檔調節的壓力，拖累今早加權指數開盤走低，盤中電子股和金融股都在平盤上下震盪，使指數於平盤下震盪整理，尾盘在台積電、大立光和台塑化等大型權值股買盤急拉下，指數由黑翻紅。終場指數小漲0.04%，收在10427.33點，成交值957.88億元。櫃買指數今日開高震盪整理，終場上漲0.19%，收在139.17點，成交值322.03億元。(2)資金面：因美元走弱，今日亞洲貨幣相對強勢，加上出口商月底有拋匯的需求，使新台幣兌美元走揚，午盤後升幅擴大，終場升值7.5分，收在30.227元，台北外匯經紀公司成交量為5.54億美元。(3)技術面：今日加權指數由黑翻紅，短均線持續走跌，盤中指數跌破月線，但尾盘在買盤進場下，指數拉回於月線之上。短線上中性看待，觀察月線是否有支撐。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超12.66億元，其中外資賣超12.12億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉37372口，較前日增加1205口淨多單，投信淨空單留倉31500口，自營商淨多單留倉1510口。籌碼面中性看待。

● 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	10427.33	10427.33	10366.17	4.28		957億	2.98	2.12	5.76	
08月台指期	10355	10363	10289	16.00	-0.70	108337	2.37	2.35	2.87	77036
09月台指期	10324	10331	10260	15.00	-1.00	2534	1.52	1.64	1.61	13392
08月台指期	10355	10363	10289	17.00	-0.70	71824	1.74	1.71	1.99	22639
09月台指期	10324	10331	10260	14.00	-1.00	3066	1.41	1.37	1.51	7798
電子指數	442.79	442.79	439.19	0.34		633億				
08月電子期	439.85	440.30	436.50	1.55	-0.67	2946	1.33	1.29	1.35	3715
09月電子期	438.60	438.70	435.30	1.55	-0.96	72	1.28	1.03	1.09	99
金融指數	1138.44	1139.25	1135.12	-0.72		54億				
08月金融期	1120.40	1124.40	1118.40	-0.80	-1.61	1286	1.30	1.35	1.37	3969
09月金融期	1117.00	1120.80	1116.80	-1.20	-1.92	21	1.09	1.13	1.05	159
摩台指	393.63	393.63	390.88	0.13						
08月摩台指	390.00	390.50	387.90	0.50	-0.93	26776	-	-	1.97	220599
09月摩台指	389.90	389.50	388.90	-1.20	-0.96	3	-	-	1.50	22688

<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

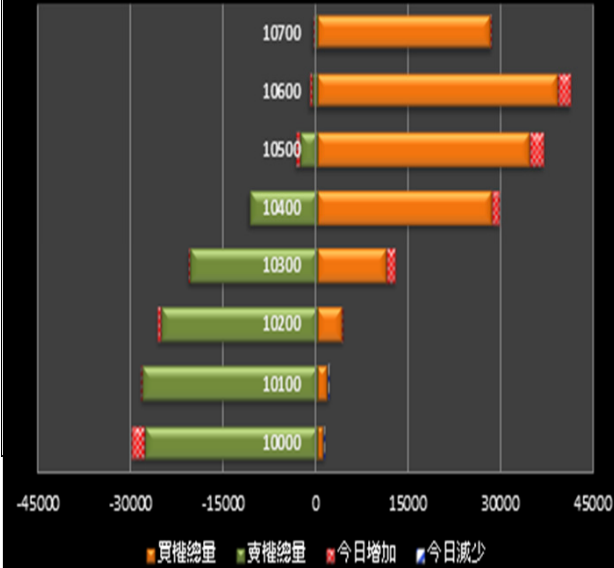
(98)金管期總字第019號

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

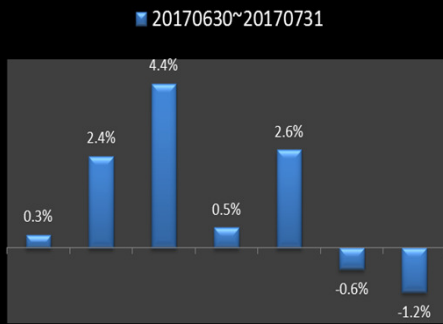


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

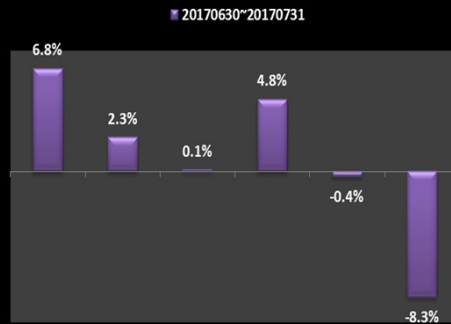


國際指數/商品期貨/外匯行情

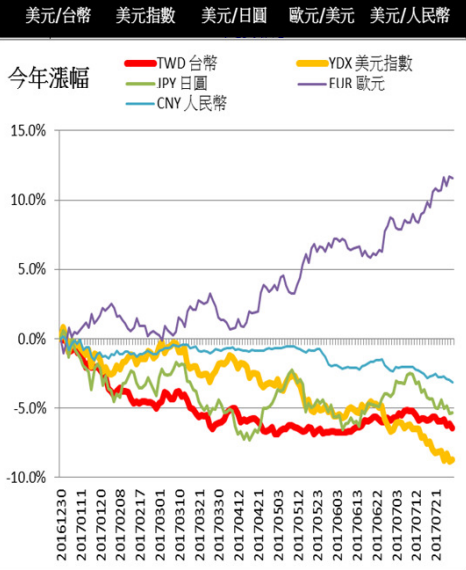
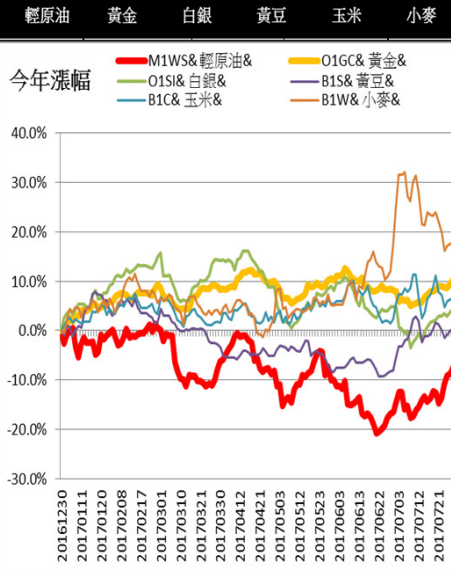
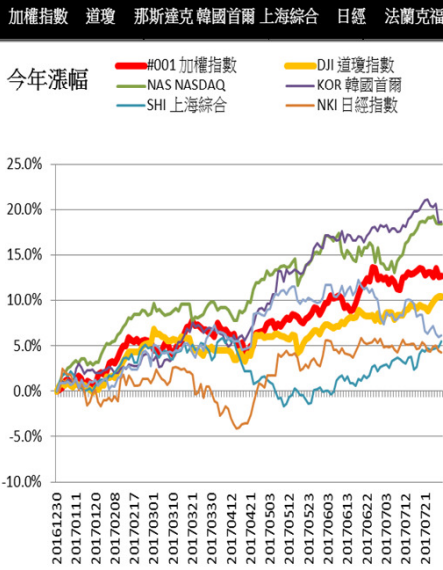
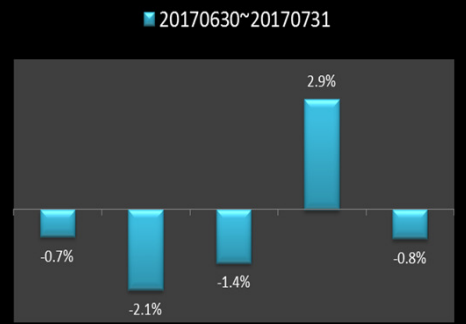
國際股市月績效表現



國際商品期貨月績效表現



國際外匯月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>