



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08月09日

星期三

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	218.46	287.98	-69.51	-67.37	健鼎	1.83	台積電	-28.14				
投信	10.02	13.51	-3.49	-10.90	玉山金	0.86	鴻海	-18.81				
自營商	58.67	84.40	-25.74	-16.49	儒鴻	0.74	大立光	-5.34				
合計	287.15	385.89	-98.74	-94.76	華碩	0.67	國泰金	-2.73				
8/8融資	91.32	90.37	0.95	前日 1507.03	華新	0.61	兆豐金	-1.72				
8/8融券	30789	25081	-5708	餘額 388834	遠傳	0.47	聯發科	-1.72				
單位：口	多		空		緯創	0.45	群聯	-1.64				
8/8摩台7月多空比	67		2,823		亞光	0.36	群創	-1.44				
台指期前十大佔市場比	53.5%		46.3%		TPK-KY	0.31	中華電	-1.40				
電子期前十大佔市場比	53.1%		77.4%		光寶科	0.26	中信金	-1.06				
金融期前十大佔市場比	63.9%		68.9%		前十名合計	6.55	後十名合計	-63.99				
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	37671	-1137	1376	-190	-1862	46	75510	77352	-1842	219455	214719	4736
投信	-30615	-344	7	1	-47	0	0	0	0	0	0	0
自營商	5694	-1714	86	-133	106	2	-24169	-12929	-11240	-22240	-19898	-2342

觀盤重點提示

- 國際金融：週二美國公布六月JOLTs工作職缺數為616.3萬個，遠高於市場預期570萬個，帶動美元指數走升，也激勵道瓊連續十個交易日創歷史新猷，連帶S&P500亦創新高。但受美國川普總統警告北韓言論的影響，地緣政治風險增加，使得美股自高檔回落收黑，其中道瓊更結束連十天的漲勢。終場道瓊跌 0.15%、S&P500跌 0.24%、Nasdaq跌 0.21%、費半指數跌 0.41%。
- 台指選擇權：今日台股重挫，近月份買權10500序列上下一檔未平倉量顯著增加，賣權10300和10200序列未平倉量則增加較多，使買賣權未平倉均價皆下移。以未平倉量而言，買權最大量集中在10600序列，賣權最大量集中在10300序列，未平倉p/c ratio為1.36，較前一日下降0.08，成交量p/c ratio為1.14，較前一日上升0.24，顯示今日整體籌碼為空方勢力較強。
- 台北股市：(1)基本面及策略：週二美國川普總統對北韓提出警告的言論，造成國際局勢緊張，韓國今早開盤跌破季線，連帶加權指數亦開低，大立光、台積電、鴻海、聯發科、國泰金等大型權值股賣壓湧現，跌幅皆達1%以上，今日以其他電子類股表現最差，跌幅達2.08%。終場指數下跌 0.93%，收在 10470.38 點，成交量 1117.28 億元。櫃買指數受到半導體類股如環球晶、中美晶和旺矽重挫影響，拖累指數收長黑棒。終場下跌 1.45%，收在 137.73 點，成交量 388.55 億元。(2)資金面：週二美國公布六月職位空缺數突破四月高點，且大幅優於市場預期，使美元指數走升，加上東北亞地緣政治因素升溫，使新台幣今日走勢趨貶。終場台幣兌美元收在 30.218 元，貶值 1.7 分，台北外匯經紀公司成交量為 6.15 億美元。(3)技術面：今日加權指數收長黑棒，五日均線出現下彎，且KD指標轉為死亡交叉，台股已連續兩天量增價跌，短線上大盤恐進入修正，宜中性偏空看待。(4)籌碼面：[1]現貨三大法人今日合計賣超 98.74 億元，其中外資賣超 69.51 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 37671 口，較前日減少 1137 口淨多單，投信淨空單留倉 30615 口，自營商淨多單留倉 5694 口。外資今日籌碼顯著偏空布局，籌碼面宜中性偏空看待。

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	10470.38	10536.19	10457.52	-98.59		1117億	2.68	2.07	5.68	
08月台指期	10455	10497	10436	-72.00	-0.15	139245	2.35	2.44	3.01	79580
09月台指期	10416	10457	10399	-70.00	-0.52	6132	1.72	1.69	1.81	16227
08月小台指	10455	10497	10437	-72.00	-0.15	86025	1.66	1.81	2.03	24305
09月小台指	10416	10456	10400	-71.00	-0.52	6975	1.44	1.62	1.71	9086
電子指數	444.51	448.33	443.86	-5.52		754億				
08月電子期	443.70	446.90	443.15	-4.50	-0.18	3430	1.32	1.31	1.32	3899
09月電子期	442.15	445.00	441.70	-4.35	-0.53	141	1.12	1.37	1.10	287
金融指數	1143.20	1148.79	1141.45	-9.88		83億				
08月金融期	1135.80	1138.20	1129.20	-4.60	-0.65	1890	1.30	1.34	1.40	4158
09月金融期	1132.00	1134.20	1127.00	-4.80	-0.99	78	1.27	1.29	1.15	298
摩台指	394.91	397.52	394.11	-4.68						
08月摩台指	393.60	395.80	393.00	-3.90	-0.33	31350	-	-	2.03	219389
09月摩台指	393.80	395.00	393.00	-4.20	-0.28	142	-	-	4.58	23539

<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

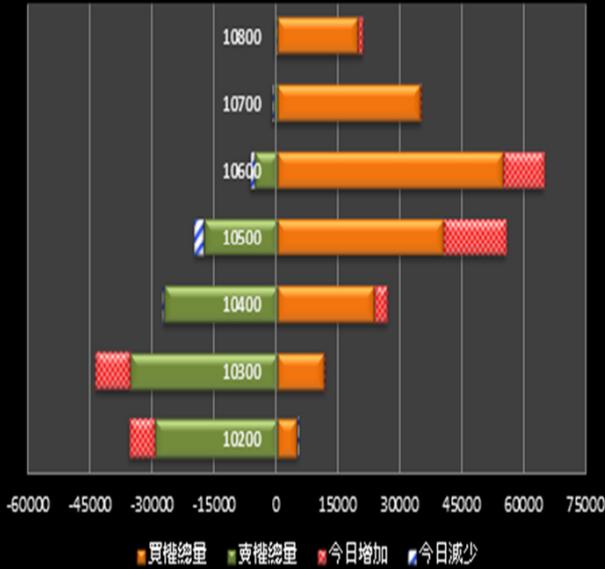
(98)金管期總字第019號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708

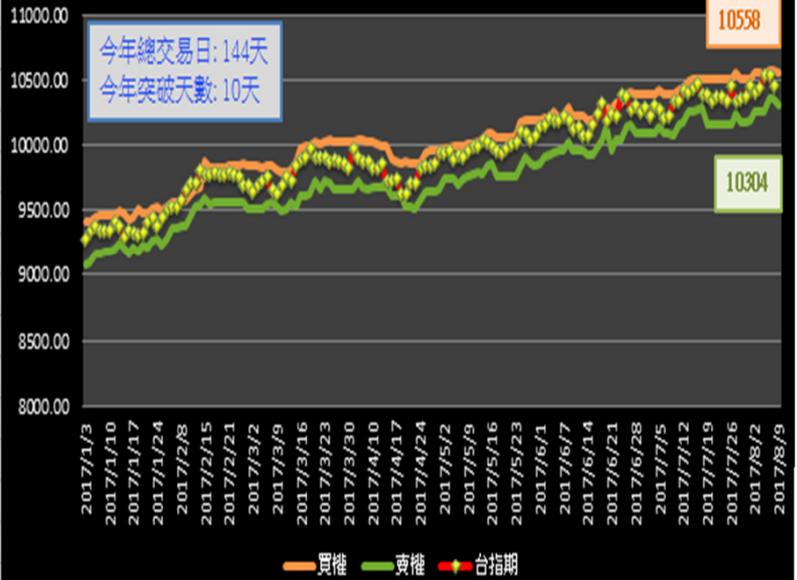
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

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

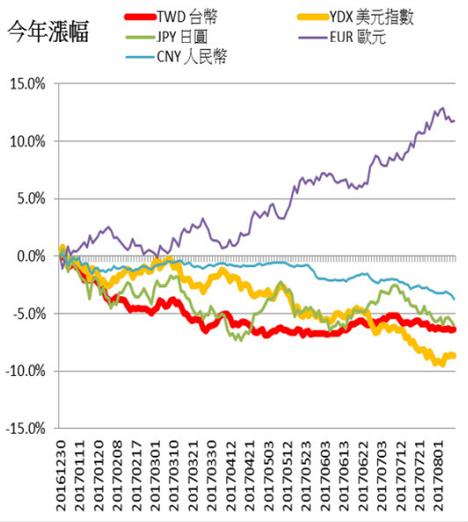
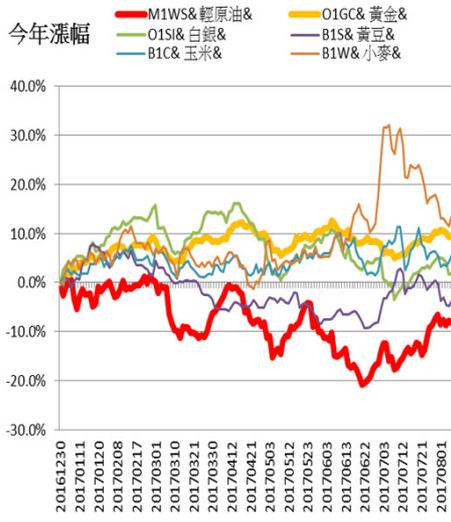
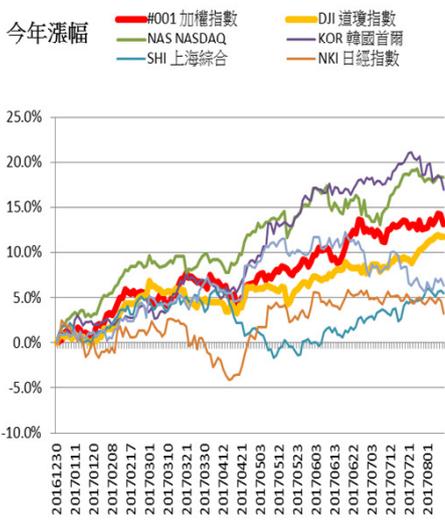
國際股市月績效表現



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。>