



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 2018年07月24日 星期二 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								
外資及陸資	351.83	349.66	2.18	-10.26	國巨	7.77	聯發科	-9.54				
投信	15.86	11.44	4.42	60.84	台泥	4.43	中華電	-2.84				
自營商	99.73	58.82	40.92	12.96	台化	4.29	富邦金	-2.62				
合計	465.60	417.47	48.12	62.67	華新科	3.82	鴻海	-1.90				
7/23融資	61.65	67.53	-5.88	今日 1829.37	可成	3.39	台塑化	-1.74				
7/23融券	30283	44153	13870	餘額 337538	中鋼	2.88	統一超	-1.71				
單位：口	多		空		台塑	2.33	新光金	-0.97				
7/23摩台08月多空比	486		1,873		微星	2.17	國泰金	-0.92				
台指期前十大佔市場	61.9%		46.6%		亞泥	2.09	和大	-0.84				
電子期前十大佔市場	75.0%		58.8%		南亞	2.03	亞德客-KY	-0.42				
金融期前十大佔市場	60.3%		82.0%		前十名合計	35.20	後十名合計	-23.52				
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	42056	-2544	1037	50	-1517	-49	-833	-1237	404	8498	4577	3921
投信	-23843	37	155	0	58	0	-578	-578	0	2068	2044	24
自營商	-4252	1702	-580	7	-222	54	11435	20336	-8901	-13916	-17140	3224

● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數跌 0.06%、S&P500漲 0.18%、Nasdaq漲 0.28%、費半指數漲 0.16%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.15，較前日減少 0.01，成交量p/c ratio為 1.02，較前日增加 0.07；近月買權最大未平倉量集中在 11200 履約價序列，賣權最大未平倉量集中在 10500 履約價序列。

期、現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計買超 48.12 億元，其中外資買超 2.18 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 42056 口，較前日減少 2544 口淨多單，投信淨空單留倉 23843 口，自營商淨空單留倉 4252 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.44%，收在 10995.39 點，成交值 1442.89 億元。櫃買指數終場上漲 1.31%，收在 149.96 點，成交值 311.14 億元。

技術面：由於美、中貿易關稅議題已延續逾3個月，市場對於反覆利空逐漸感到鈍化，觀察VIX波動率大多落在13.8~14.1反覆震盪。以期、權籌碼面分析，外資買超現貨金額已由近70億元大幅降至逾2億元、台指期淨多單明顯由增加轉為減、台指選的賣權OI增額明顯大於買權OI增額，顯示籌碼面逐漸轉為中性略偏空(Short)；至於台指選p/c ratio籌碼面，可得知全月份Vol. p/c ratio增至1.3、OI p/c ratio增至1.34，亦逐漸由略微偏多轉為中性。

由於大盤成交量逐漸呈現量縮格局，預期短線台指期(近月)維持盤整的格局；對於中線的指數預期將逐漸趨近週線~季線，持偏空看法。本週7/25除鴻海、鴻準除權、息外，尚有聯電(2303 TT)法說會，持續關注盤面的後續情形。

● 台指期貨收盤行情

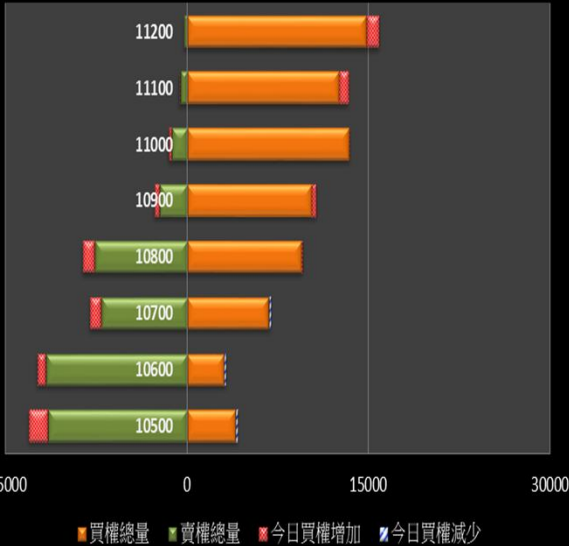
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10995.39	10995.39	10917.61	48.50		1442億	2.72	1.87	5.82	
08月台指期	10871	10880	10802	42.00	-1.14	115303	2.31	2.24	2.99	96202
09月台指期	10831	10838	10763	43.00	-1.52	1295	1.50	1.45	1.45	6753
08月小台指	10871	10879	10802	44.00	-1.14	88516	1.71	1.68	2.03	33407
09月小台指	10831	10838	10763	42.00	-1.52	2334	1.30	1.24	1.35	8421
電子指數	454.22	454.22	450.41	1.74		1008億				
08月電子期	449.85	450.00	447.15	1.35	-0.97	2335	1.41	1.41	1.52	3240
09月電子期	448.70	448.70	446.20	1.05	-1.23	27	1.39	1.17	1.35	124
金融指數	1247.13	1247.13	1242.69	0.42		59億				
08月金融期	1229.80	1230.80	1224.80	1.60	-1.41	1210	1.46	1.54	1.56	2677
09月金融期	1226.40	1226.40	1221.60	2.40	-1.69	8	1.20	1.11	1.14	64
摩台指	407.83	407.83	404.82	1.32						
07月摩台指	406.00	406.60	403.20	1.00	-0.45	36032	-	-	2.34	191285
08月摩台指	403.30	403.70	400.60	1.50	-1.12	6196	-	-	4.69	7560

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>

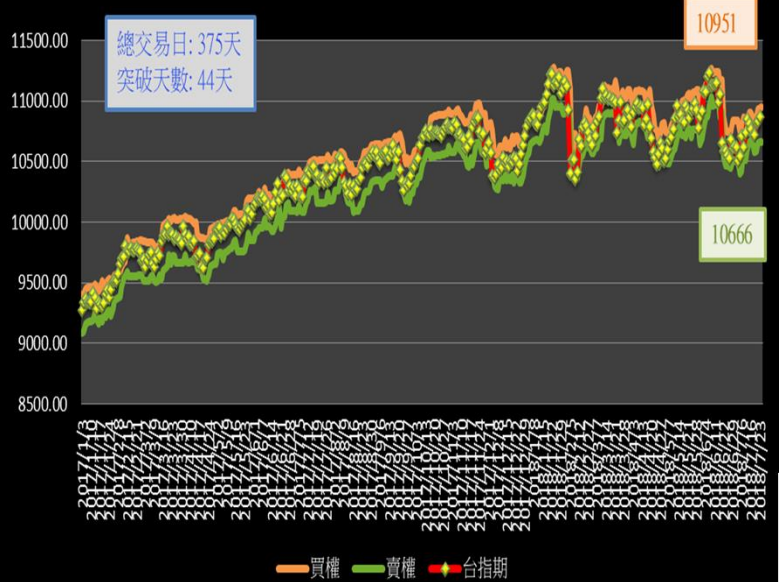


台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖



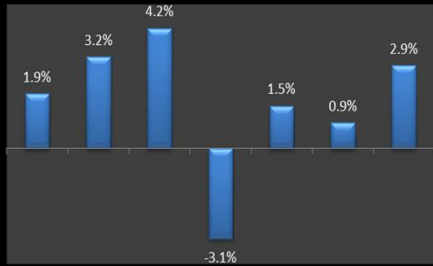
近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖



國際指數/商品期貨/外匯行情

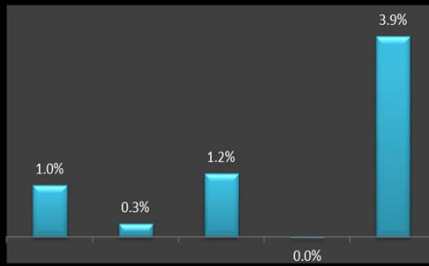
國際股市月績效表現

20180625~20180724



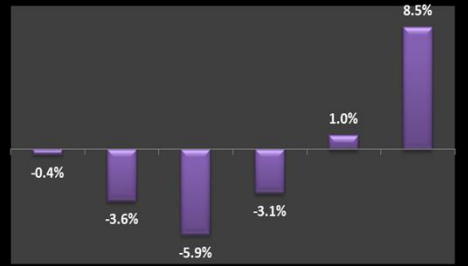
國際外匯月績效表現

20180625~20180724



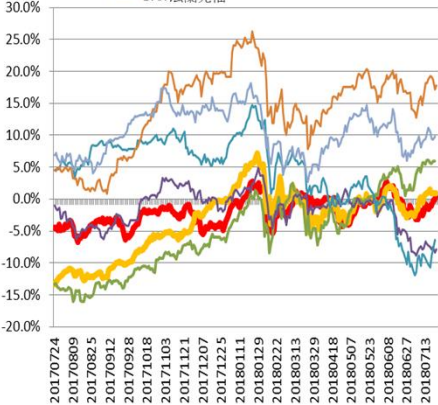
國際商品期貨月績效表現

20180625~20180724



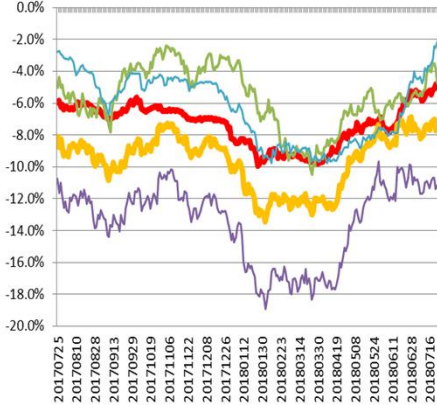
年漲幅

■ TWI 加權指數
■ NAS NASDAQ(D)
■ SHI 上海綜合
■ DAX 法蘭克福
■ DJI 道瓊指數
■ KOR 韓國首爾
■ NKI 日經指數



年漲幅

■ TWD 台幣
■ JPY 日圓
■ CNY 人民幣
■ YDX 美元指數
■ EUR 歐元



年漲幅

■ M1WS&輕原油&
■ O1SI&白銀&
■ B1C&玉米&
■ O1GC&黃金&
■ B1S&黃豆&
■ B1W&小麥&

