



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					台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
外資及陸資	351.83	349.66	2.18	-10.26	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
投信	15.86	11.44	4.42	60.84	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
自營商	99.73	58.82	40.92	12.96	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
合計	465.60	417.47	48.12	62.67	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
7/23融資	61.65	67.53	-5.88	今日 1829.37	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
7/23融券	30283	44153	13870	餘額 337538	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
單位：口	多			空	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
7/23摩台08月多空比	486			1,873	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
台指期前十大佔市場	61.9%			46.6%	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
電子期前十大佔市場	75.0%			58.8%	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
金融期前十大佔市場	60.3%			82.0%	台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超		台股現貨買賣超	
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)		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

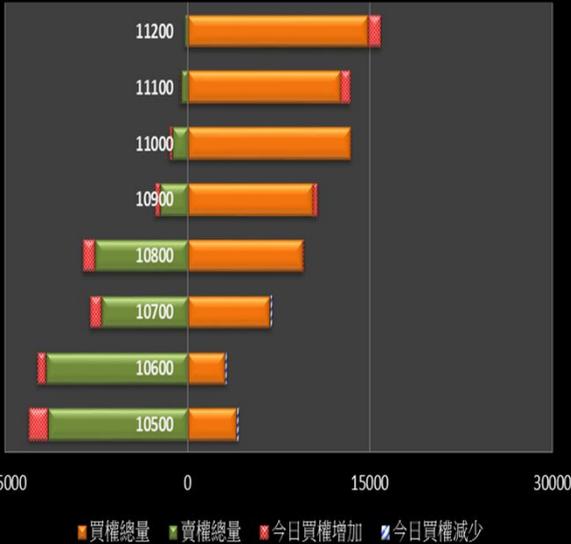
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10995.39	10995.39	10917.61	48.50		1442億	2.72	1.87	5.82	
08月台指期	10871	10880	10802	42.00	-1.14	115303	2.31	2.24	2.99	96202
09月台指期	10831	10838	10763	43.00	-1.52	1295	1.50	1.45	1.45	6753
08月小台指	10871	10879	10802	44.00	-1.14	88516	1.71	1.68	2.03	33407
09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

&lt;本文僅供參考，並不做任何獲利保證。&gt;

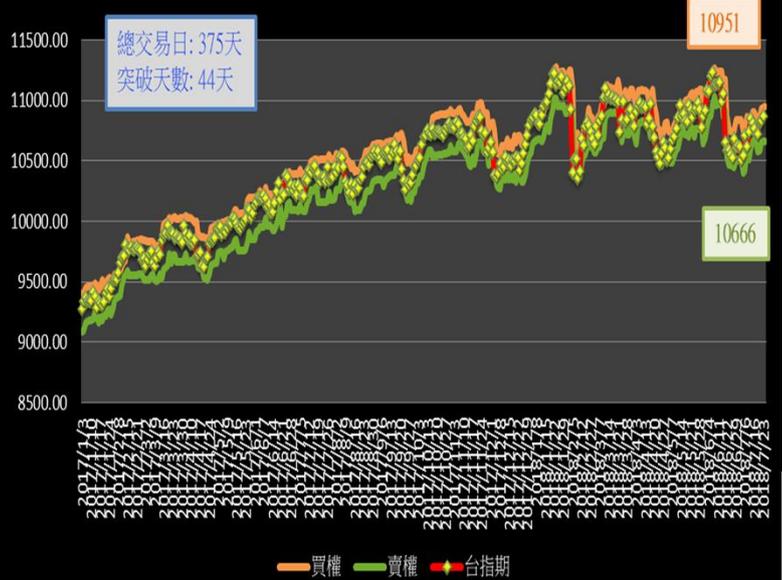


### 台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

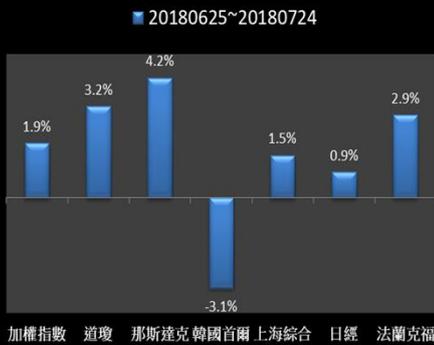


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

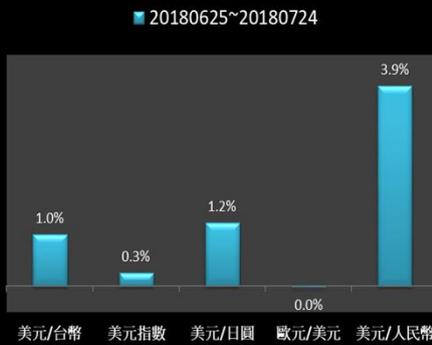


### 國際指數/商品期貨/外匯行情

國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現

