



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27日 星期五 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					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	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	
外資及陸資	342.56	272.83	69.73	74.81	52586	5691	1319	254	-1599	85	4118	229	3889
投信	13.91	9.83	4.07	67.60	-23481	355	156	0	58	0	-559	-559	0
自營商	70.78	66.03	4.74	13.51	-6665	-1740	-336	96	-196	-7	22517	12445	10072
合計	425.43	346.58	78.85	154.55									
7/26融資	60.84	60.86	-0.02	今日 1836.62									
7/26融券	26024	34896	8872	餘額 350881									
單位：口	多			空									
7/26摩台08月多空比	493			1,203									
台指期前十大佔市場	61.9%			42.7%									
電子期前十大佔市場	76.6%			52.7%									
金融期前十大佔市場	63.1%			82.8%									
期貨未平倉					台指選擇權(買權)				台指選擇權(賣權)				
多空淨額													
外資及陸資													
投信													
自營商													

● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數漲 0.44%、S&P500跌 0.3%、Nasdaq跌 1.01%、費半指數漲 1.87%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.39，較前日增加 0.13，成交量p/c ratio為 1.31，較前日增加 0.21；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 78.85 億元，其中外資買超 69.73 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 52586 口，較前日增加 5691 口淨多單，投信淨空單留倉 23481 口，自營商淨空單留倉 6665 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.59%，收在 11075.78 點，成交值 1246.87 億元。櫃買指數終場上漲 0.44%，收在 152.12 點，成交值 312.89 億元。

技術面：近日美、歐為強化雙邊經貿合作關係進而釋出大利多，並有意針對非汽車工業產品零關稅、零補貼。且迄今公告之美國財報週優於市場預期，以及美、中兩國的關稅清單有多項為未交易商品，使今日vix指數降至12.9顯著下滑。觀察台指期技術面，週線以上形成顯著支撐，MACD的快速線在慢速線之上；雖然大盤成交量仍在量縮，但不至於影響過大。研發部重新修正對短線台指期的預估持盤整偏多，至於短~中線指數能否再創下自6月以來的高點？需留意美股財報週、Nasdaq、S&P 500、中國人銀(PBoC)政策影響陸股走勢，以上皆會攸關國內期市的後市情形。

● 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	11075.78	11075.78	11009.16	65.17		1246億	2.81	1.81	5.70	
08月台指期	10991	10995	10918	78.00	-0.77	111648	2.41	2.27	3.00	103521
09月台指期	10949	10952	10877	81.00	-1.16	1667	1.51	1.34	1.38	7650
08月小台指	10991	10995	10918	77.00	-0.77	82115	1.79	1.62	2.02	45015
09月小台指	10949	10951	10876	80.00	-1.16	2739	1.30	1.20	1.31	9504
電子指數	459.40	459.40	454.98	4.76		888億				
08月電子期	457.15	457.40	452.00	5.25	-0.49	2507	1.42	1.39	1.48	3068
09月電子期	455.90	455.90	450.80	5.15	-0.77	70	1.17	1.23	1.15	170
金融指數	1252.92	1253.34	1248.96	0.65		52億				
08月金融期	1238.20	1238.60	1233.40	5.40	-1.19	1123	1.39	1.46	1.37	2644
09月金融期	1232.40	1232.40	1230.80	3.60	-1.67	8	1.07	1.07	1.14	76
摩台指	410.69	410.69	407.50	2.83						
07月摩台指	410.40	410.90	407.80	2.60	-0.07	66805	-	-	4.37	82098
08月摩台指	408.00	408.30	405.10	2.90	-0.66	61418	-	-	4.58	147316

<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>



華南金融集團

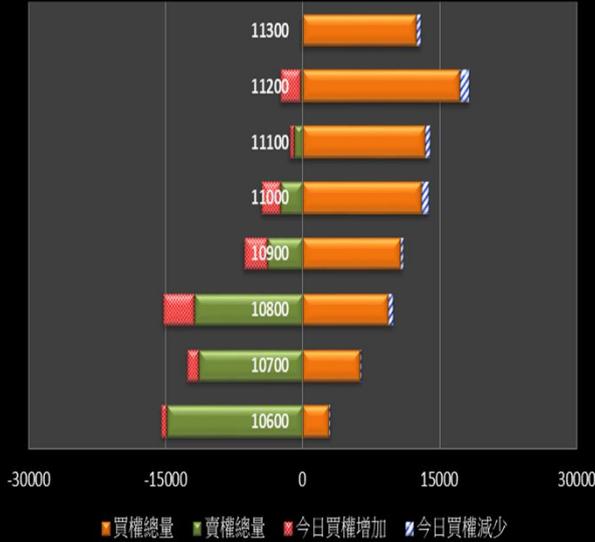
華南期貨股份有限公司

(104)金管期總字第002號

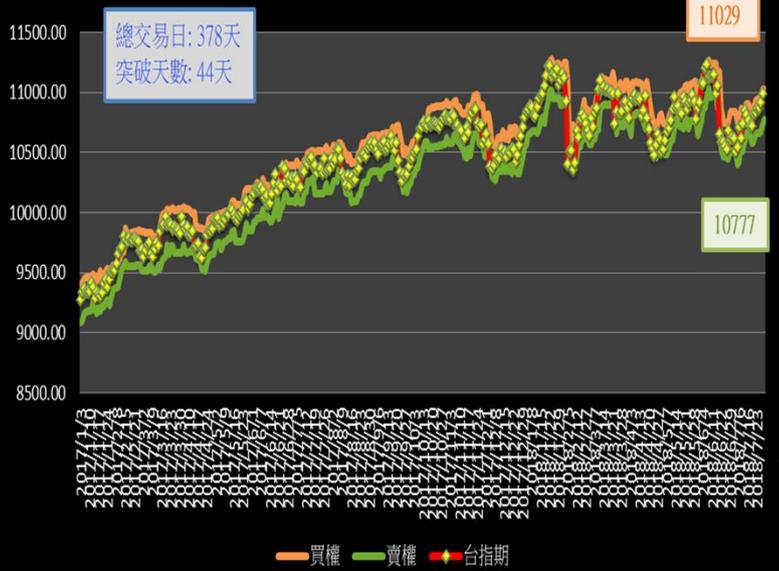
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL:(02)2718-0000 FAX:(02)2546-3708
3F, No. 54 Ming Sheng East Road Sec. 4 Taipei, TAIWAN.

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

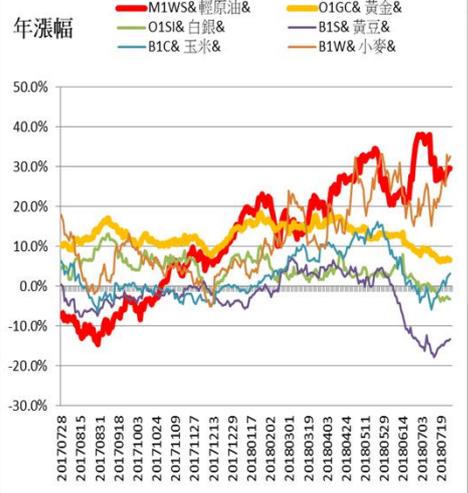
國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



<本文僅供參考，並不做任何獲利保證。>