



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05月11日 星期五 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				
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					
外資及陸資	369.88	280.06	89.83	-106.75	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
投信	17.36	20.96	-3.60	12.93	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
自營商	81.73	85.37	-3.64	-32.56	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
合計	464.31	382.95	81.36	-127.38	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
5/10融資	71.90	65.84	6.06	今日 1747.14	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
5/10融券	26468	34856	8388	餘額 363661	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					
5/10摩台05月多空比	1,553			572	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
台指期前十大佔市場	51.5%			43.9%	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
電子期前十大佔市場	68.0%			63.0%	台股現貨買賣超			台股現貨買賣超					
金融期前十大佔市場	64.2%			75.0%	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)		
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	40788	8048	333	89	-858	-83	34758	27474	7284	24846	25280	-434	
投信	-23507	265	8	0	50	0	-662	-662	0	-313	-265	-48	
自營商	-3589	-3306	-232	26	0	99	-33764	-48008	14244	-53190	-35180	-18010	

## ● 觀盤重點提示

國際金融：終場道瓊指數漲 0.8%、S&P500漲 0.94%、Nasdaq漲 0.89%、費半指數漲 1.8%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.33，較前日增加 0.2，成交量p/c ratio為 0.99，較前日減少 0.13；近月買權最大未平倉量集中在 10800 履約價序列，賣權最大未平倉量集中在 10600 履約價序列。

期、現貨籌碼：[1]現貨三大法人今日合計買超 81.36 億元，其中外資買超 89.83 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 40788 口，較前日增加 8048 口淨多單，投信淨空單留倉 23507 口，自營商淨空單留倉 3589 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.92%，收在 10858.98 點，成交值 1636.4 億元。櫃買指數終場上漲 0.11%，收在 150.9 點，成交值 505.4 億元。

技術面：在期、現貨市場呈現微幅正價差，及近日外資買超金額擴大近90億NTD、台指選擇權(TX0)的未平倉量(OI)put/call ratio增至1.4、芝加哥選擇權交易所(CBOE)發佈的VIX指數持續降低，顯示現階段市場相對佳。目前近月台指期站在週線、月線、季線、年線之上，從各天期MA均線看來，預期短線台指期的走勢呈中性偏多；然需審慎留意中線可能將受國際事件的干擾 e.g. 中、美兩國的貿易關稅長期談判下，進而影響期貨市場的波動，不排除有利多出盡的現象。整體而言，研發部對於短線的預期相對持樂觀看法；對中線的預期持中性看法。

## ● 台指期貨收盤行情

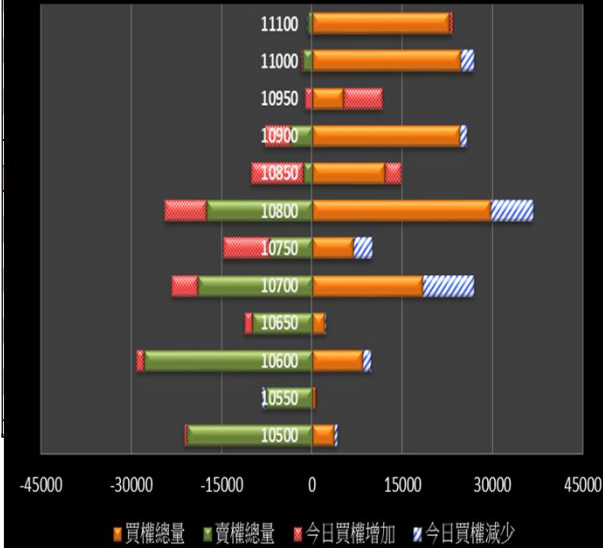
簡稱	收盤價	最高價	最低價	漲跌	價差(%)	成交量	委買均量	委賣均量	成交均量	OI
加權指數	10858.98	10874.63	10808.40	98.77		1636億	2.87	2.09	6.02	
05月台指期	10860	10865	10806	98.00	0.01	119772	2.45	2.33	3.07	75747
06月台指期	10838	10840	10788	97.00	-0.19	5053	1.87	1.82	1.75	18930
05月小台指	10860	10865	10807	97.00	0.01	79684	1.80	1.68	2.02	37936
06月小台指	10838	10840	10788	96.00	-0.19	7462	1.57	1.31	1.62	11873
電子指數	442.93	444.33	442.10	3.66		1136億				
05月電子期	443.15	443.50	441.60	4.10	0.05	2822	1.33	1.35	1.32	2735
06月電子期	442.35	442.50	441.05	3.85	-0.13	286	1.34	1.19	1.17	590
金融指數	1258.34	1258.34	1245.72	16.01		81億				
05月金融期	1259.20	1259.40	1243.00	17.80	0.07	2553	1.37	1.33	1.39	3238
06月金融期	1258.00	1258.20	1245.20	16.00	-0.03	251	1.20	1.28	1.18	395
摩台指	402.68	403.17	400.37	4.61						
05月摩台指	403.30	403.30	400.10	4.70	0.15	39945	-	-	2.10	179577
06月摩台指	398.70	398.40	395.50	3.90	-1.00	940	-	-	17.09	401

&lt;本文僅供參考，並不做任何獲利保證。&gt;

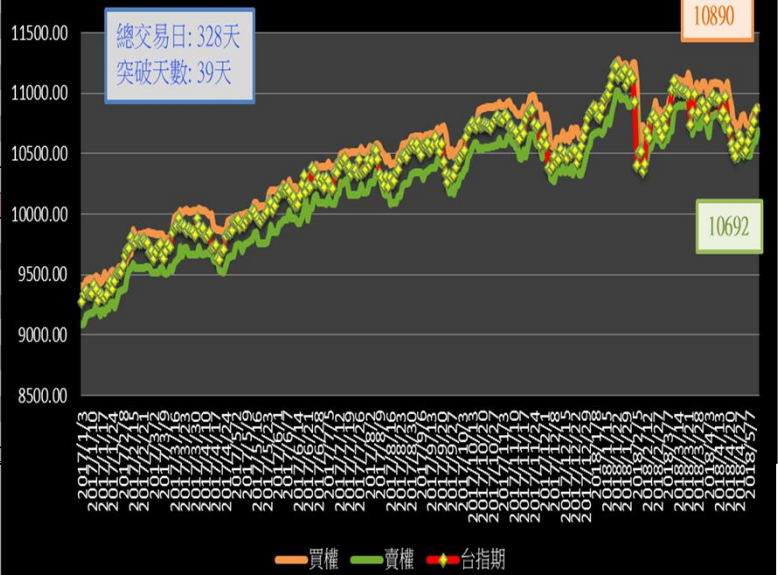


### 台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

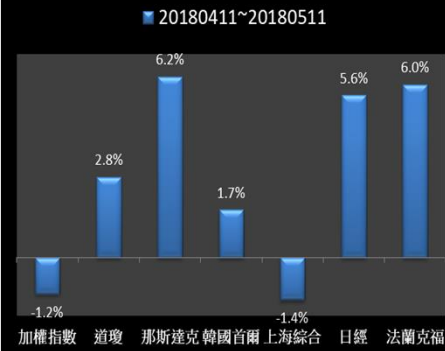


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

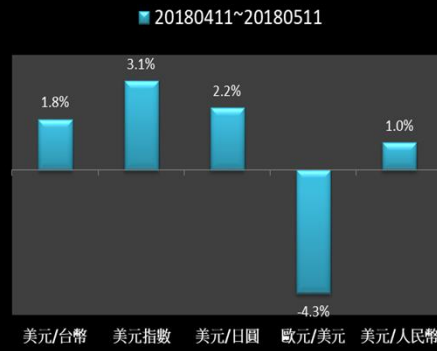


### 國際指數/商品期貨/外匯行情

國際股市月績效表現



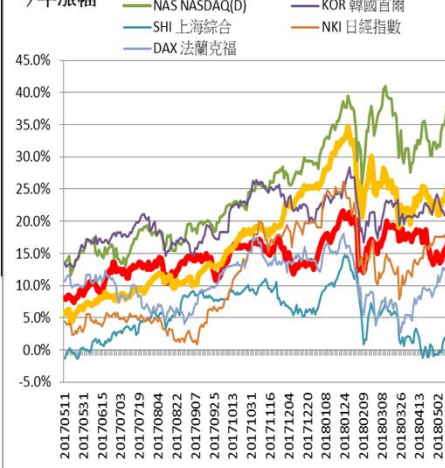
國際外匯月績效表現



國際商品期貨月績效表現



今年漲幅



今年漲幅



今年漲幅

