



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31日 星期四 收盤日報

● 法人動態：

台股現貨買賣超					台股現貨買超		台股現貨賣超					
單位：億	買進	賣出	合計	累計本月至今	台股現貨買超		台股現貨賣超					
外資及陸資	1057.86	1087.41	-29.55	-281.34	台積電	29.69	鴻海	-11.24				
投信	10.29	16.50	-6.21	-36.73	台塑化	12.72	國巨	-11.24				
自營商	85.09	85.01	0.08	-109.31	南亞科	3.55	大立光	-5.12				
合計	1150.31	1185.18	-34.87	-428.36	富邦金	3.52	南亞	-4.24				
5/30融資	77.67	68.54	9.13	今日 1831.00	國泰金	3.36	台化	-3.36				
5/30融券	27153	29384	2231	餘額 368195	統一	2.60	台塑	-2.43				
單位：口	多		空		中鋼	2.40	和碩	-1.70				
5/30摩台07月多空比	2,078		209		永豐金	1.69	禾伸堂	-1.08				
台指期前十大佔市場	59.0%		44.0%		元大金	1.58	台達電	-0.99				
電子期前十大佔市場	67.9%		71.9%		中華電	1.48	第一金	-0.93				
金融期前十大佔市場	64.2%		70.5%		前十名合計	62.59	後十名合計	-42.32				
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	39572	4165	-45	-53	-894	46	35417	34182	1235	24116	19953	4163
投信	-24261	317	8	0	50	0	-573	-573	0	1602	1602	0
自營商	-2322	408	44	107	-59	14	-29073	-28334	-739	-35248	-33364	-1884

● 觀盤重點提示

國際金融：由於義大利脫歐出現轉機的大利多消息，使得美股盤後DJIA指數漲 1.26%、S&P 500漲 1.27%、Nasdaq漲 0.89%、費半指數漲 0.65%。

選擇權籌碼：今日未平倉p/c ratio為 1.46，較前日增加 0.02，成交量p/c ratio為 1.23，較前日減少 0.05；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賣超 34.87 億元，其中外資賣超 29.55 億元。[2]期貨外資今日淨部位多單留倉 39572 口，較前日增加 4165 口淨多單，投信淨空單留倉 24261 口，自營商淨空單留倉 2322 口。

台灣市場：終場加權指數上漲 0.5%，收在 10874.96 點，成交值 2369.78 億元。櫃買指數終場上漲 0.45%，收在 155.98 點，成交值 687.83 億元。

技術面：由於歐洲政治動盪出現轉機，盤後美股走高，使得台股、台指期的盤後結果皆站上月線、季線，並形成支撐區。觀察今日外資在現貨市場賣超金額顯著縮小，預期若總體風險降低，下週新台幣(NTD)有機會進一步止跌。雖然今日盤後指數走高，然在日線MACD卻形成負差離，且在週線附近形成高檔壓力區。由於6/1中國A股納入MSCI可能進一步排擠台股資金，以及須留意近期美、中貿易關稅的動向，在國際情勢未明朗化下，預期短線將維持中性的區間盤整看法。

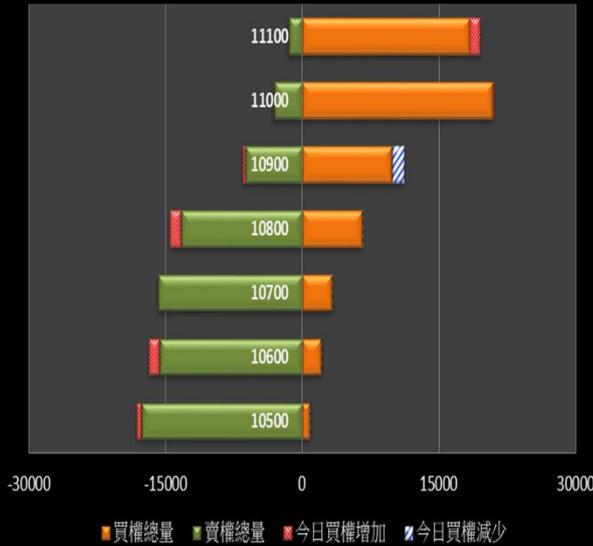
● 台指期貨收盤行情

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	10874.96	10909.61	10853.65	53.79		2369億	3.01	2.25	6.23	
06月台指期	10865	10870	10821	91.00	-0.09	124620	2.33	2.26	2.96	87385
07月台指期	10609	10614	10568	84.00	-2.51	1690	1.38	1.58	1.54	4095
06月小台指	10865	10870	10821	89.00	-0.09	90479	1.76	1.68	2.00	34537
07月小台指	10609	10614	10568	85.00	-2.51	2674	1.34	1.33	1.39	2950
電子指數	445.59	448.49	443.76	1.34		1644億				
06月電子期	445.40	446.80	443.25	2.35	-0.04	3565	1.37	1.34	1.38	3482
07月電子期	435.00	436.20	433.10	2.20	-2.43	67	1.15	1.11	1.06	92
金融指數	1254.35	1257.82	1251.20	7.11		166億				
06月金融期	1252.80	1254.20	1248.60	9.20	-0.12	1665	1.29	1.29	1.33	2723
07月金融期	1233.00	1233.00	1228.40	10.20	-1.73	34	1.09	1.11	1.13	302
摩台指	398.88	400.33	397.79	1.54						
06月摩台指	394.90	395.20	392.60	3.20	-1.01	51387	-	-	2.13	180152
07月摩台指	387.40	387.70	387.70	1.30	-2.96	4	-	-	4.00	-

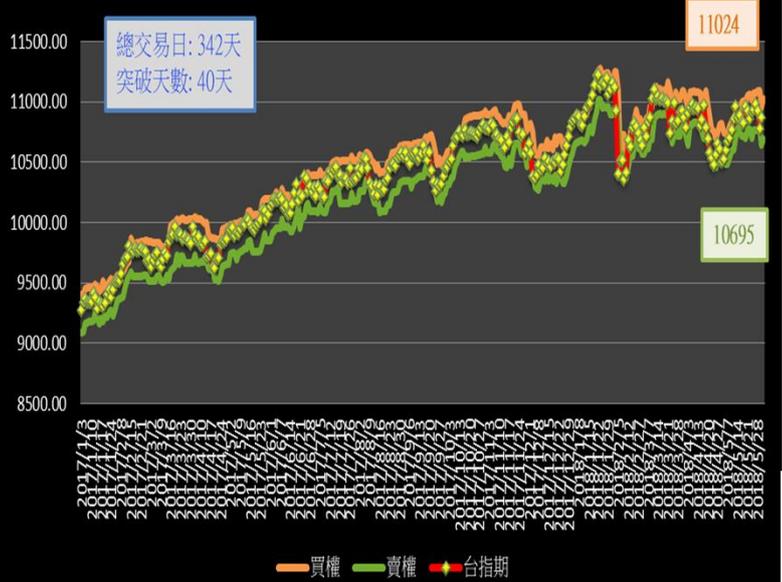


### 台指選擇權未平倉解析

近月選擇權未平倉分佈圖

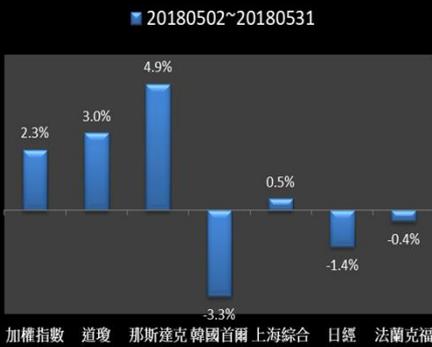


近月選擇權未平倉(加權平均法)一壓力支撐圖

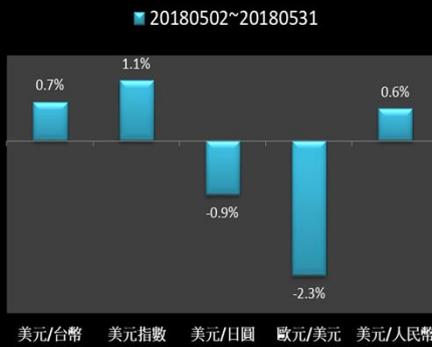


### 國際指數/商品期貨/外匯行情

國際股市月績效表現



國際外匯月績效表現



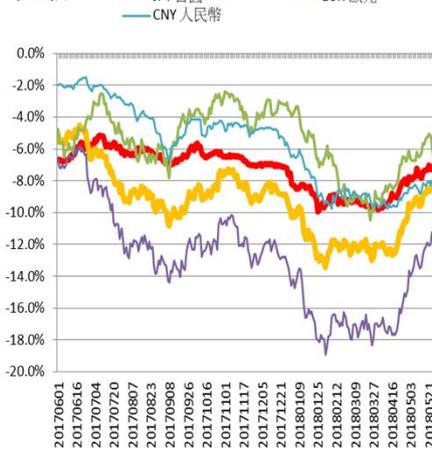
國際商品期貨月績效表現



年漲幅



年漲幅



年漲幅

