

國內盤後日報

期貨顧問部

2024/5/22



520台股綠影重重

	前10日	前5日	當日	後5日	後10日	後20日
上漲 機率	38%	42%	33%	67%	63%	63%
平均 漲跌	-0.67%	-0.18%	-0.59%	0.78%	1.25%	1.01%
上漲機率	38%	38%	38%	81%	75%	75%
平均 漲跌	-0.67%	-0.04%	-0.42%	1.38%	2.15%	3.11%
上漲機率	38%	50%	25%	38%	38%	38%
平均漲跌	-0.67%	-0.44%	-0.91%	-0.43%	0.55%	-3.18%
	機 平漲 上機 平漲 上機 平率 均跌 漲率 均跌 漲率 均	上機率 38% -0.67% -0.67% 上機率 38% -0.67%	上漲機率 38% 42% 平均 -0.67% -0.18% 上漲 38% 38% 平均 -0.67% -0.04% 上漲 38% 50% 平均 0.67% 0.44%	上漲機率 38% 42% 33% 平均 -0.67% -0.18% -0.59% 上漲機率 38% 38% 38% 平均 -0.67% -0.04% -0.42% 上漲機率 38% 50% 25% 平均 0.67% 0.44% 0.91%	上漲機率 38% 42% 33% 67% 平均 漲跌 -0.67% -0.18% -0.59% 0.78% 上漲機率 38% 38% 81% 平均 漲跌 -0.67% -0.04% -0.42% 1.38% 平均 平均 0.67% 0.44% 0.91% 0.43%	上漲 機率 38% 42% 33% 67% 63% 平均 漲跌 -0.67% -0.18% -0.59% 0.78% 1.25% 上漲 機率 38% 38% 81% 75% 平均 漲跌 -0.67% -0.04% -0.42% 1.38% 2.15% 上漲 機率 38% 50% 25% 38% 38% 平均 0.67% 0.44% 0.01% 0.43% 0.55%





元富期貨 Masterlink



Environment

企業如何保護環境

- ✓ 廢棄物管理
- ✔ 能源使用管理
- ✔ 保護天然資源
- ✔ 保護生態系統
- ✓ 減少溫室氣體排放

Social

企業的社會責任

- ✓ 勞工權益
- ✔ 資訊安全
- ✓ 產品責任
- ✓ 公司環境
- ✔ 員工健康與安全
- ✔ 隱私權維護

Governance

企業的管理方式

- ▼ 董事會組成
- ✓ 薪酬制度
- ✔ 獎勵措施
- ✔ 企業道徳/聲譽
- ✔ 財務透明
- ✔ 股東權益



OPEN DELTA

外資期權合計:為淨空單2892口大台 淨空單較前一日減少5420口大台

		未平倉口數	成本	約當履約價	總Delta	OPTIONS DELTA	增減
買權	買方	29821	428.0	21505	4009		
貝惟	賣方	20122	401.8	21553	-2621		
	淨買賣	9699			1388	996	827
賣權	買方	45622	80.4	20425	-1601	990	021
貝惟	賣方	24896	113.6	20657	1209		
	淨買賣	20726			-392		
						FUTURES DELTA	增減
大台	淨多空	-5663			-5663	2000	4502
小台	淨多空	7098		1775		-3889	4593
		-		總D	elta	-2892	5420

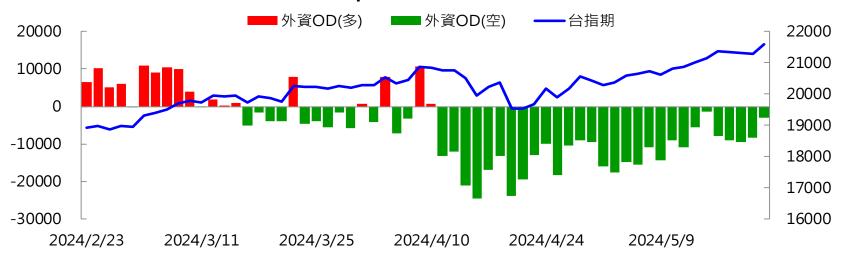
自營期權合計:為淨空單6060口大台 淨空單較前一日減少404口大台

		未平倉口數	成本	約當履約價	總Delta	OPTION DELTA	增減
買權	買方	36517	562.6	21286	5608		
貝惟	賣方	30899	467.1	21434	-4347		
	淨買賣	5618			1261	1281	970
賣權	買方	45589	72.6	20345	-1418	1201	-879
貝惟	賣方	50928	67.4	20284	1438		
	淨買賣	-5339			20		
						FUTURE DELTA	增減
大台	淨多空	-6937			-6937	7244	4202
小台	淨多空	-1615		-404		-7341	1283
				總D	elta	-6060	404

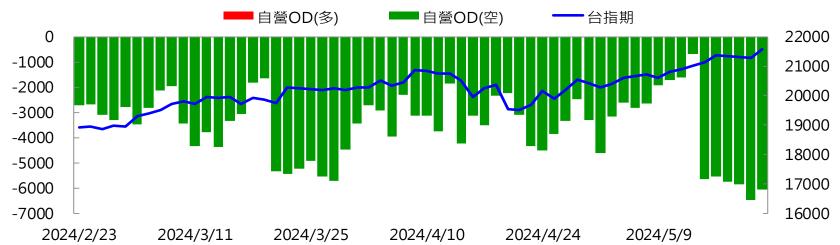


OPEN DELTA

外資Opendelta約-2892口



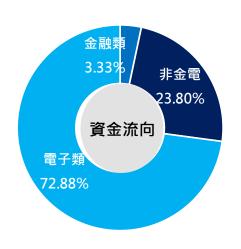
自營Opendelta約-6060口

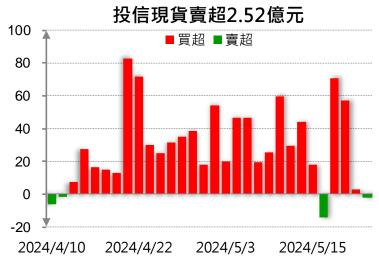


■ 以上為日盤資料,不包括夜盤資料



三大法人籌碼











台指盤後籌碼

三大法人 證,期,權 買賣超 (金額)

	現貨	期貨	選擇權	Total
外資	321.11億	198.70億	0.40億	520.21億
自營商	39.64億	49.70億	0.00億	89.34億
投信	-2.52億	26.95億	0.00億	24.43億
Total	358.23億	275.35億	0.40億	633.98億

台指期十大交易人 Futures OI (口)

	近月	增減	遠月	增減	全月	增減	
十大合計	2326	2930	-2585	-142	-259	2788	
特定法人	-2189	2989	-2585	-142	-4774	2847	



三大法人期權未平倉量(口數)

	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增源	苋		
外資	29821	-6190	20122	-7643	969	9 14	53		
自營商	36517	-16116	30899	-12146	561	8 -39	70		
投信	80	0	50	0	0 30		0		
			Pu	t					
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	位增減			
外資	45622	-9100	24896	-4252	2072	6 -48	348		
自營商	45589	-15787	50928	-9294	-533	9 -64	93		
投信	200	0	184	0	1	6	0		
	大台	計期	1	小台指期		電子	·期	金融	浊期
	未平倉	增減	未平倉	增流	咸	未平倉	増減	未平倉	
外資	-5663	2572	709	8 8	3082	-18	107	-458	
自營商	-6937	476	-161	5	3228	-284	-7	-173	
投信	10891	624	9	9	0	182	-8	9	



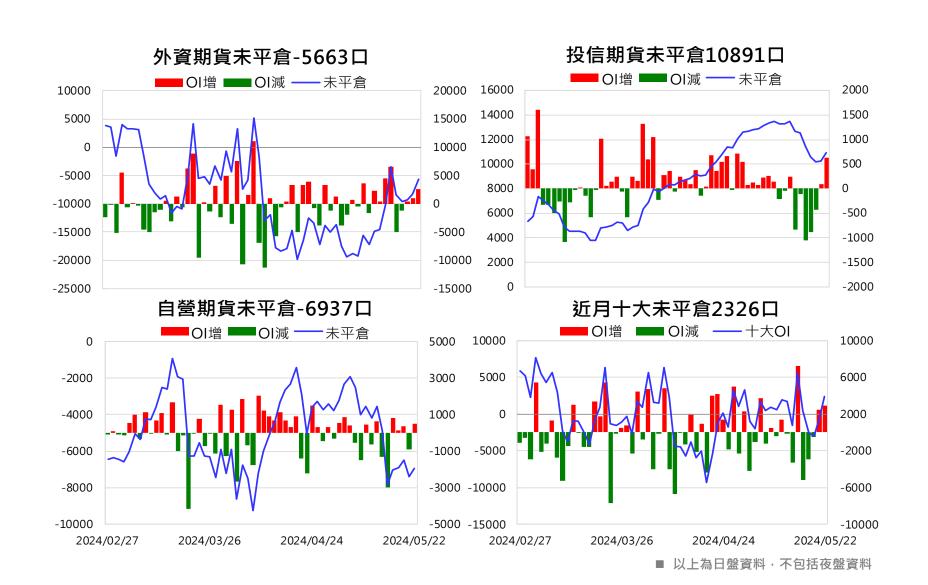
三大法人期權未平倉量(金額)

		Call										
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減						
外資	638133	146385	404267	79990	233866	66395						
自營商	1027261	134067	721683	154839	305578	-20772						
投信	言 2720 7		705	295	2015	481						
	Put											
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減						
外資	183489	-116016	141404	-54127	42085	-61889						
自營商	165397	-40288	171532	-67752	-6135	27464						
投信	260	-80	1472	-718	-1212	638						
				·. 15-45								

	大台指期		小台	指期	電子	- 期	金融期		
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	
外資	-24370888	10613589	7661195	8704863	-81513	473577	-902260	-8683	
自營商	-29951634	1600825	-1735610	3396929	-1287717	-57437	-340589	-93859	
投信	47007734	3307275	106826	1480	825297	-18607	17730	94	



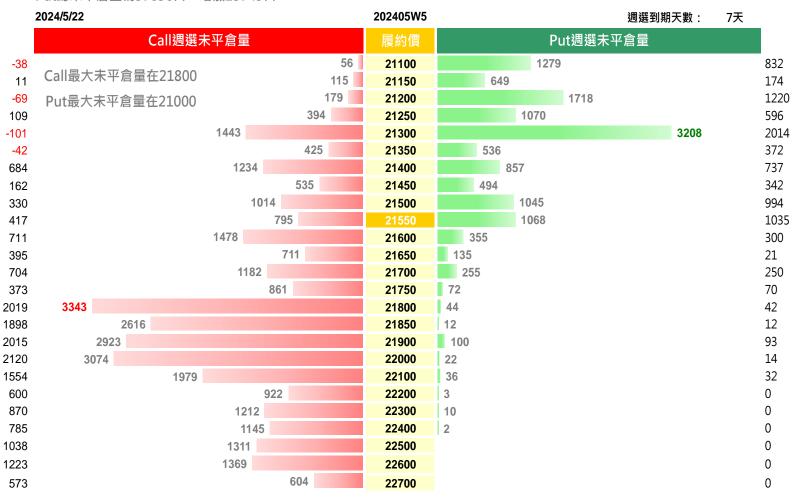
三大&十大OI





週選未平倉量

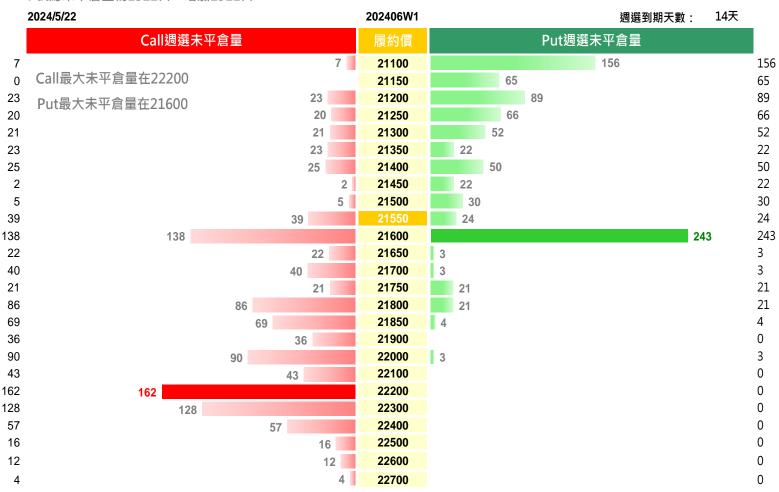
Call總未平倉量為32145口,增加18683口 Put總未平倉量為37096口,增加23749口





雙週選末平倉量

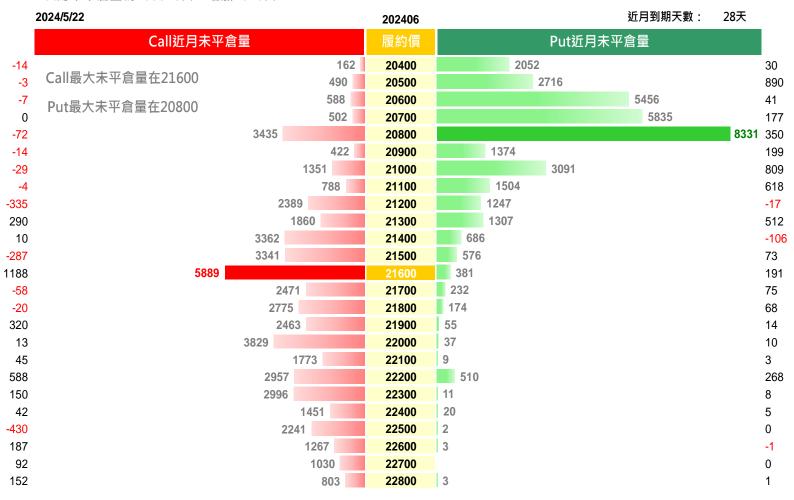
Call總未平倉量為1114口,增加1114口 Put總未平倉量為1511口,增加1511口





近月未平倉量

Call總未平倉量為59977口,增加1998口 Put總未平倉量為168820口,增加4076口





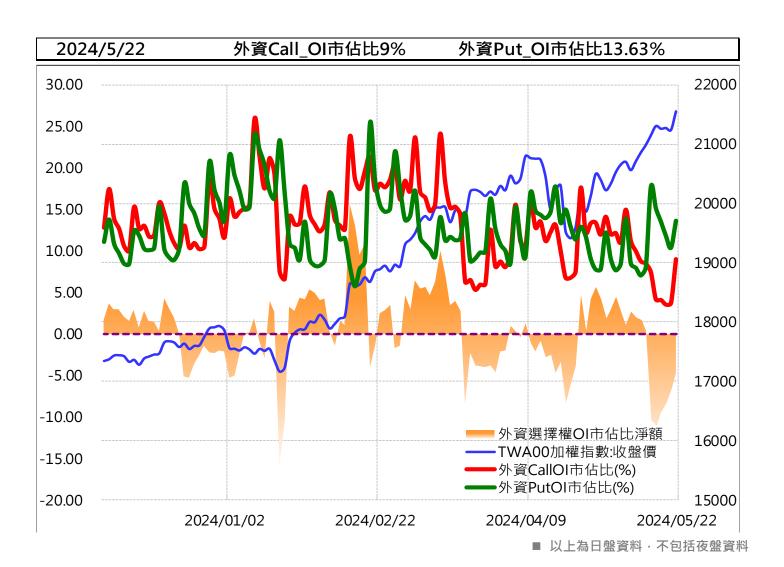
次月未平倉量

Call總未平倉量為9029口,減少-1820口 Put總未平倉量為8291口,增加400口

	2024/5/22			202407			次月到期天數:	56天	
	Call次月未平倉量			履約價		Put次月未 ^፯	P倉量		
0	Call最大未平倉量在22200		72	20300			2163		18
0			38	20400	137				0
0	Put最大未平倉量在20300		16	20500	133				5
0			32	20600	35				22
0			22	20700	121				106
1			23	20800	28				-1
0			65	20900	96				0
0			43	21000	9				-4
4			20	21100	48				10
-939		340		21200	30				-1
-23			37	21300	118				1
-4			30	21400	6				0
2			101	21500	2				0
10 7			47	21600 21700	40				0
2	81	0	41	21800	11 3				0
3	01	0	86	21900					0
-940		489	00	22000	1 2				0
18			164	22100	1				0
-10	3205		104	22200	2				2
0	0200	,	179	22300	2				2
-27			19	22400	-				0
4			161	22500					0
9			114	22600					0
5			98	22700					0
-									-

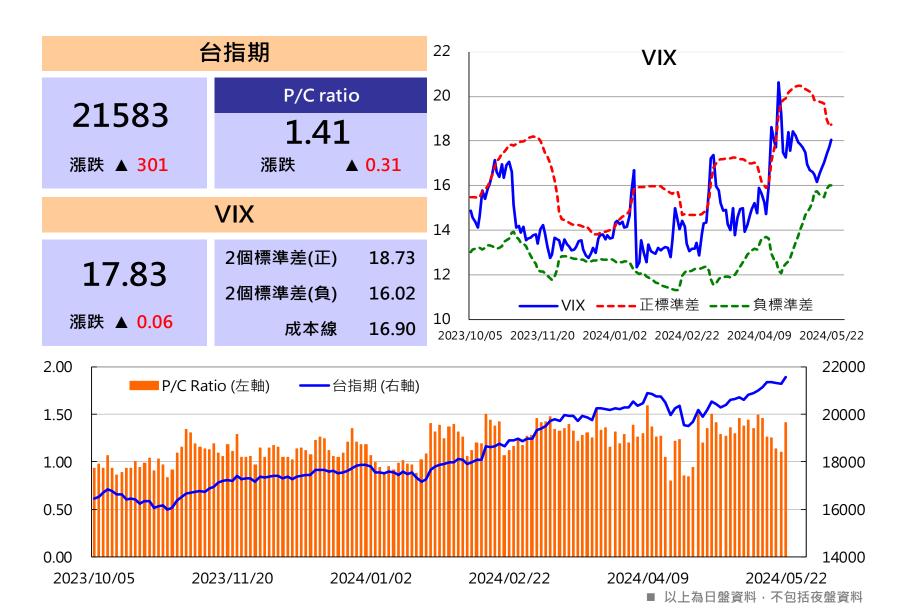


外資選擇權未平倉市佔比



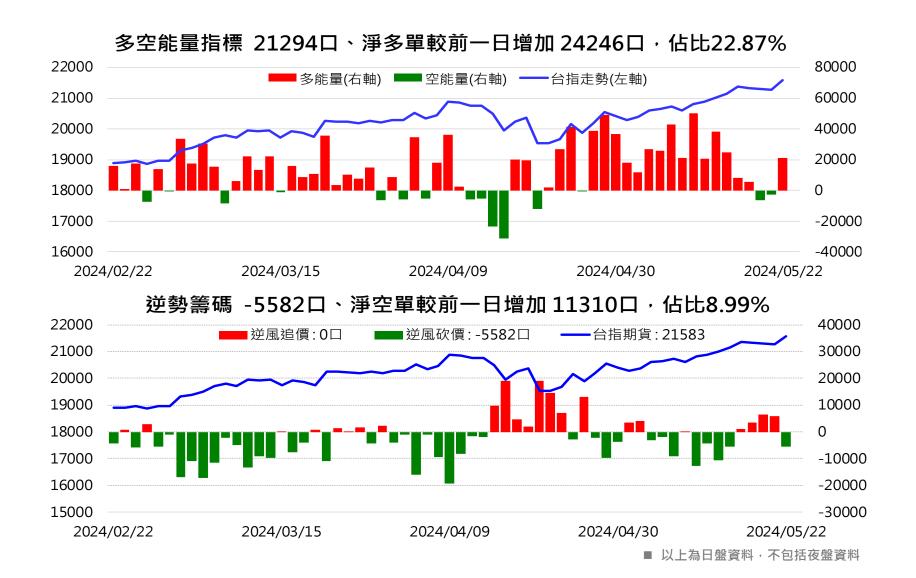


VIX&P/C RATIO





獨家籌碼指標





權值股貢獻點數

加權指數 21551.83 上漲315.08點 漲跌幅1.48%

排序	代號 股票	收盤價	漲跌幅	上漲影響點數	排序	代號 股票	收盤價	漲跌幅	下跌影響點數
1	2330 台積電	864	2.73%	187.80	1	1519 華城	690	-5.48%	-3.29
2	2317 鴻海	169	1.81%	13.10	2	1303 南亞	54.5	-2.15%	-2.99
3	2357 華碩	522	6.75%	7.71	3	6446 藥華藥	406.5	-5.47%	-2.52
4	2308 台達電	327.5	2.83%	7.36	4	2884 玉山金	28.5	-1.21%	-1.73
5	2105 正新	59.3	9.81%	5.41	5	2002 中鋼	24.6	-1.2%	-1.48
6	2885 元大金	33.35	4.06%	5.19	6	2890 永豐金	22.7	-1.3%	-1.17
7	2454 聯發科	1185	0.85%	5.04	7	1503 士電	242	-2.81%	-1.15
8	2324 仁寶	40.3	9.66%	4.92	8	2347 聯強	81.3	-2.4%	-1.05
9	2353 宏碁	53	9.84%	4.56	9	2610 華航	22.3	-2.19%	-0.95
10	2303 聯電	55	2.04%	4.34	10	5880 合庫金	26.6	-0.75%	-0.93
	合計前十大 上漲 影響點數			245.43	É	-17.25			

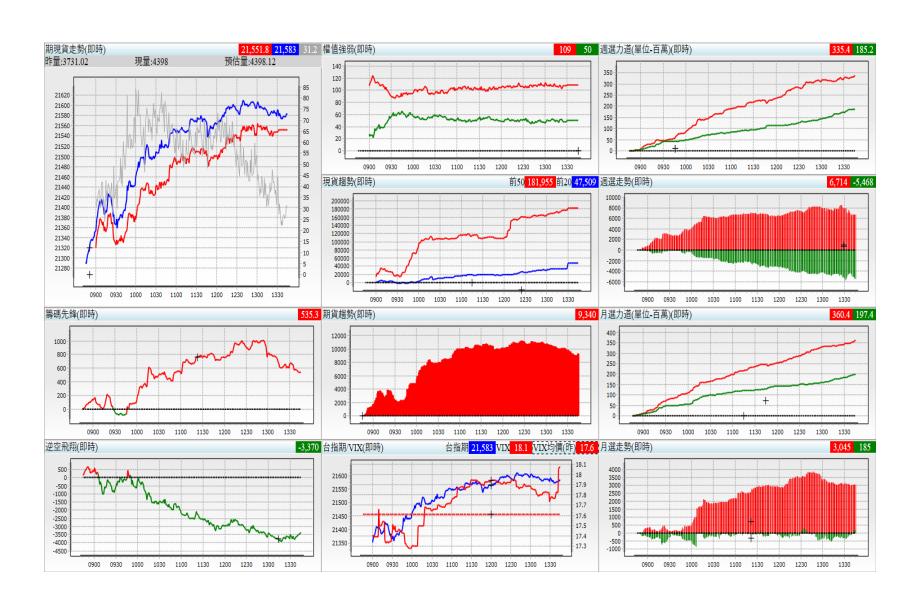


加權指數VS.台幣匯率





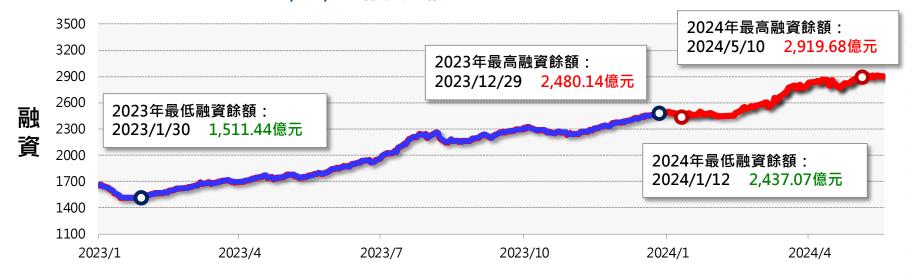
籌碼分析器



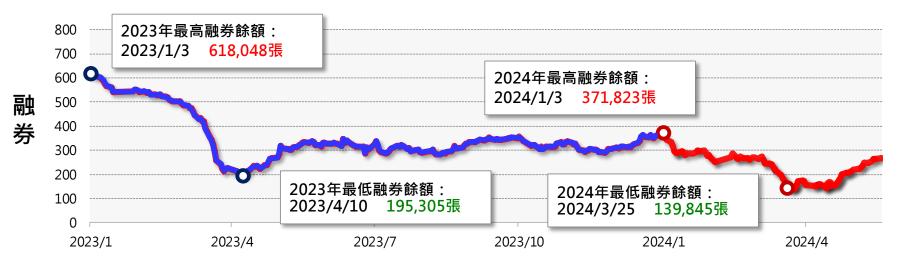


最高最低融資融券餘額

2024/05/21 融資餘額 2904.41億,增加 3.92億



2024/05/21 融券餘額 266,682張,減少 1,818張





2024年4月份各國PMI



台灣4月份製造業PMI為49.4,較前月上升1.5點,創2023年2月後新高,但近期連續14個月呈現緊縮。根據分項指數來看,五個指數全數上漲,其中新訂單及生產分別上升3.2點及2.8點為最多;六大產業僅基礎原物料及交通工具產業呈現緊縮,其餘則呈現擴張。

49.4%



中國4月份製造業PMI為50.4,較前月下跌0.4個百分點,優於市場預期的50.3,連續兩個月呈現擴張。就分項指數來看,新訂單較前月下跌1.9點至51.1,生產指數則上升至52.9;就企業規模來看,不論是大、中、小型企業皆維持在擴張區。





在財新製造業PMI的部份,4月份數據為51.4,較前月上升0.3點,且優於預期的51,創下2023年2月後新高,且連續6個月擴張。當月生產指數、新訂單指數分別在擴張區間升至2023年6月、2023年3月以來最高,4月新出口訂單指數則為2020年12月來最高。





美國4月份標普製造業PMI終值為50,較前月下跌1.9點,但高於初值及預期的49.9,近期連續四個月擴張。就分項指數來看,4月份就業分項指數由前月的52.2,升至52.3,為2023年7月來的高點;新訂單分項指數則是較前月下滑,來到2023年12月來低點。





美國4月份製造業PMI為49.2、低於市場預期的50、也較3月份數據50.3大幅下降1.1個百分點,再度跌落至緊縮區。就分項指數來看,新訂單指數由51.4降至49.1、生產指數由54.6降至51.3、物價指數則從55.8增至60.9創2022年6月以來新高。

49.2%



2024年4月份各國PMI



德國4月份製造業PMI由41.9上升0.6點至42.5、較初值及預期的42.2上修、結束前兩個月的回落、且連續21個月位於榮枯線之下。報告中顯示、整體指數的成長部分是由於產量下降速度放緩、產量下降速度為三個月來最慢、新訂單總量則創11月以來最大降幅。

42.5%



法國方面 · 4月份製造業PMI終值為45.3 · 略高於初值及預期的44.9 · 但較3月份數據下跌0.9個百分點 · 且近期呈現連續十五個月緊縮 · 報告中顯示 · 4月大幅下滑的主因是新訂單急劇加速下降 · 另方面由於材料成本上漲 · 投入物價通膨達 14 個月高价 ·

45.3%



英國4月份製造業PMI終值為49.1,較前月下跌1.2個百分點,但高於初值及預期的48.7,再度回到緊縮區。報告中指出,由於市場不確定性高、客戶去庫存和供應鏈中斷阻礙擴張的機會,產出和新訂單在3月份短暫好轉之後,4月份再次跌落至緊縮區。

49.1%



日本4月份製造業PMI終值為49.6.低於預期及初值的49.9.但較3月份上升1.4個百分點,近期連續十一個月緊縮。報告中顯示,4月產出和新訂單連續第11個月下滑,但下滑速度有所放緩,新出口訂單萎縮則源自於大陸和美國等主要出口市場需求低迷。

49.6%



歐元區4月製造業PMI終值為45.7,較前月46.1下降0.4點,優於初值及預期的45.6,近期仍連續二十二個月緊縮。報告中指出,新訂單流入下降幅度更大,創下今年最大幅度。同時,產出收縮連續第二個月放緩至一年來最慢的速度,就業水準也持續下降。

45.7%



5/20-5/24 焦點數據



星期一

3:00

美國 Fed主席發表談話

9:15

中國 1年期LPR

中國 5年期LPR

14:00

德國 生產者物價



星期二

17:00

歐元區 淨出口額

16:00

美國 財政部長發表談話



星期三

4:30

美國 API原油庫存

7:50

日本 淨出口額

14:00

英國 消費者物價

22:00

美國 成屋銷售

22:30

美國 EIA原油庫存



星期四

2:00

美國 Fed公布會議紀要

8:30

日本 製造業PMI初值

15:15

法國 製造業PMI初值

15:30

德國 製造業PMI初值

16:00

歐元區 製造業PMI初值 22:00

16:30

英國 製造業PMI初值

20:30

美國 初請失業金人數

21:45

美國 製造業PMI初值

22:00

歐元區 消費者信心初值

美國 新屋銷售

5/24

星期五

7:01

英國 GfK消費者信心

7:30

日本 消費者物價

14:00

德國 Q1GDP成長率

英國 零售銷售

20:30

美國 耐久財訂單

美國 密大消費者信心

資料來源:元富期貨顧問部整理



本報告純屬研究性質,僅供元富集團內部同仁參考,不保證其完整性及精確性,且不提供或嘗試遊說客戶做為交易買賣之投資依據。報告中所有的意見與預估,係取自本公司相信為可靠之資料來源,且為特定日期所為之判斷,有其時效性,爾後若有變更,本公司將不做預告或主動更新。期貨及選擇操作為低保証金之高度財務槓桿特性,在可能產生極大利潤的同時也可能產生極大損失,投資人應審慎考慮考本身的財務能力及經濟狀況所能承擔的風險。