





元富期貨
MasterLink Futures

國內盤後日報

期貨顧問部

2024/5/10

520台股綠影重重

		前10日	前5日	當日	後5日	後10日	後20日
全部期間 2000-2023年	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%
 執政期間 2000-2008 2016-2023	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%
 執政期間 2008-2016	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%



ESG

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
- ✓ 企業道德/聲譽
- ✓ 財務透明
- ✓ 股東權益

OPEN DELTA

外資期權合計：為淨空單9002口大台
淨空單較前一日減少5287口大台

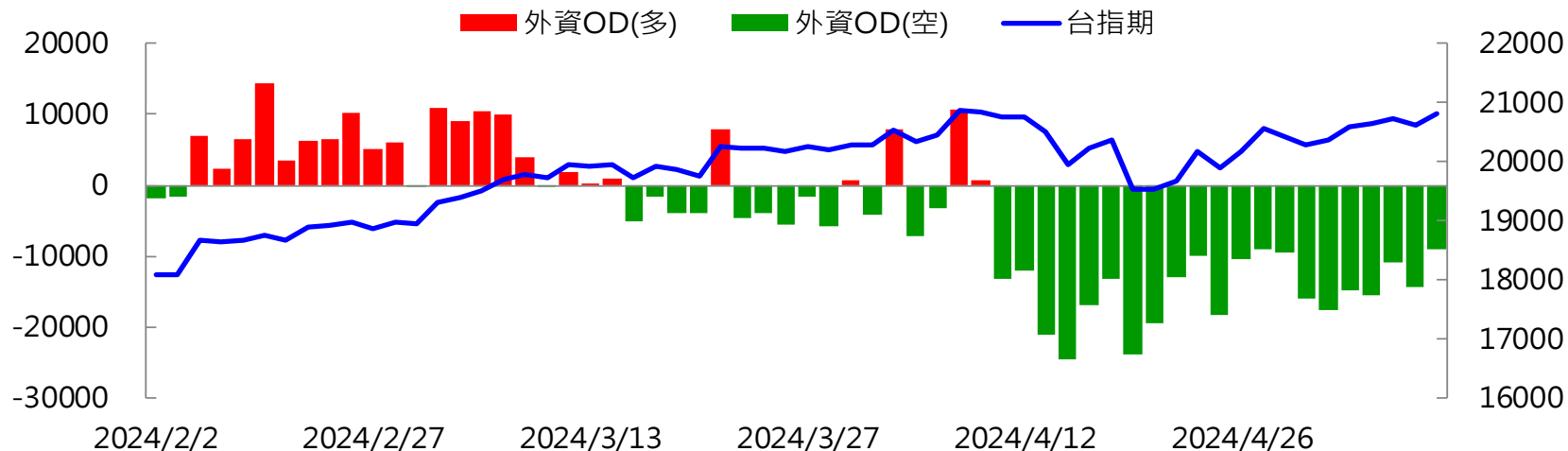
		未平倉口數	成本	約當履約價	總Delta	OPTIONS DELTA	增減
買權	買方	41484	337.0	20514	7825	1689	513
	賣方	21925	357.2	20490	-4229		
	淨買賣	19559			3596		
賣權	買方	56457	103.3	20755	-6308		
	賣方	34010	136.9	20833	4401		
	淨買賣	22447			-1907		
						FUTURES DELTA	增減
大台	淨多空	-14869			-14869	-10691	4774
小台	淨多空	16712			4178		
				總Delta		-9002	5287

自營期權合計：為淨空單1717口大台
淨空單較前一日減少201口大台

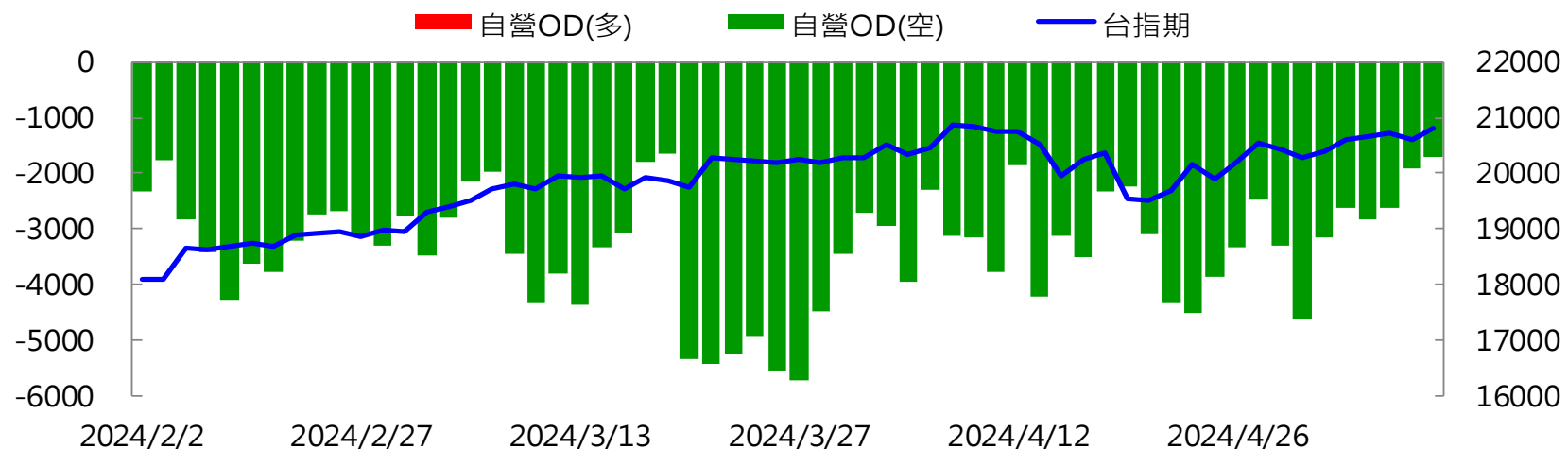
		未平倉口數	成本	約當履約價	總Delta	OPTION DELTA	增減
買權	買方	58651	314.7	20541	10753	3488	65
	賣方	36566	390.0	20453	-7271		
	淨買賣	22085			3482		
賣權	買方	67062	48.0	20557	-4672		
	賣方	74838	41.1	20519	4678		
	淨買賣	-7776			6		
						FUTURE DELTA	增減
大台	淨多空	-4191			-4191	-5206	137
小台	淨多空	-4058			-1015		
				總Delta		-1717	201

OPEN DELTA

外資Opendelta約-9002口

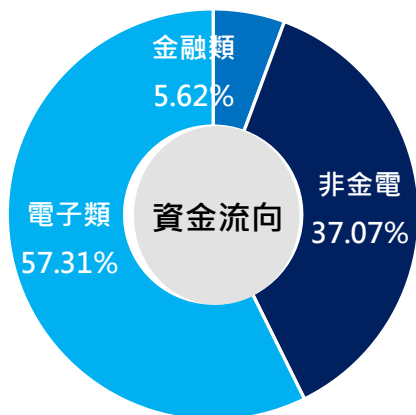


自營Opendelta約-1717口

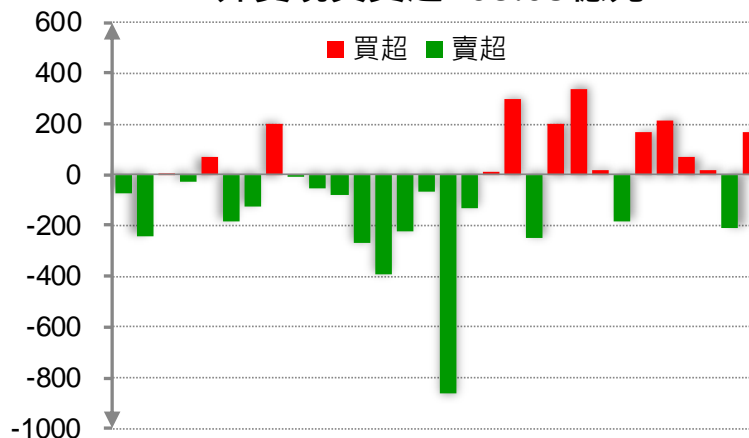


■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

三大法人籌碼



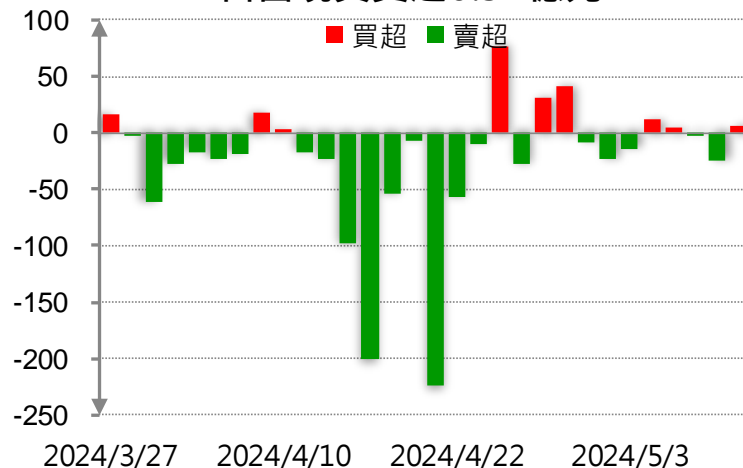
外資現貨買超168.05億元



投信現貨買超59.77億元



自營現貨買超6.91億元



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

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	168.05億	198.03億	0.01億	366.09億
自營商	6.91億	5.50億	0.07億	12.48億
投信	59.77億	-1.78億	0.00億	58.00億
Total	234.73億	201.76億	0.08億	436.57億

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	1898	1348	-1,506	78	392	1426
特定法人	-3682	200	1969	3545	-1713	3745

■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

三大法人期權未平倉量(口數)

Call								
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減		
外資	41484	2961	21925	3491	19559	-530		
自營商	58651	2103	36566	1045	22085	1058		
投信	80	0	80	0	0	0		
Put								
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減		
外資	56457	814	34010	-689	22447	1503		
自營商	67062	1588	74838	7376	-7776	-5788		
投信	100	0	166	0	-66	0		
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	-14869	2347	16712	9707	-51	16	-353	89
自營商	-4191	-656	-4058	3171	-373	6	-285	24
投信	13252	-42	119	-9	164	0	7	0

■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料 | 單位：口

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	699107	200198	391627	113976	307480	86222
自營商	922848	128660	713000	143291	209848	-14631
投信	3680	780	1068	456	2612	324

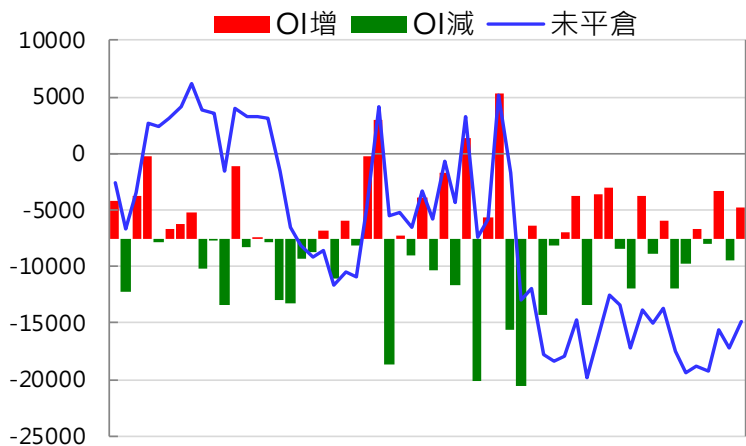
Put

	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減
外資	291669	-91654	232813	-79820	58856	-11834
自營商	160965	-40853	153789	-61454	7176	20601
投信	10	-2	45	-63	-35	61

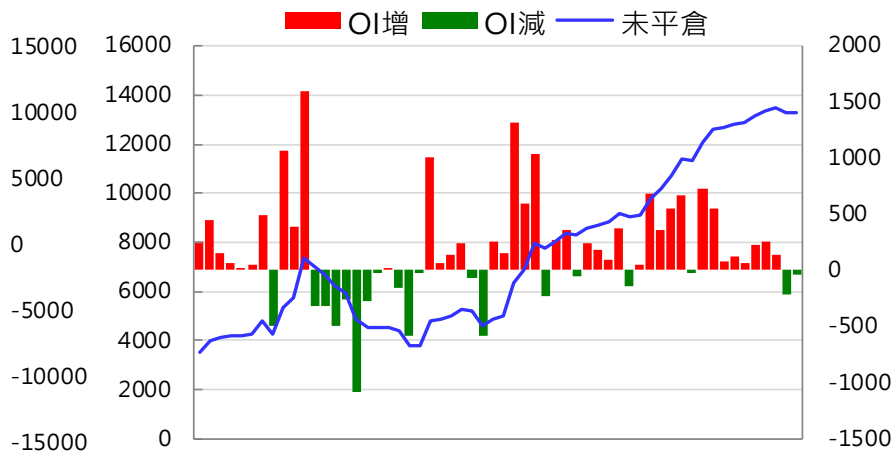
	大台指期		小台指期		電子期		金融期	
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資	-61859912	9086660	17390535	10171199	-220448	66832	-686688	153265
自營商	-17438058	-2874824	-4205132	3225163	-1608904	15338	-554191	33036
投信	55159346	356160	123832	-8084	707582	4661	13614	311

三大&十大OI

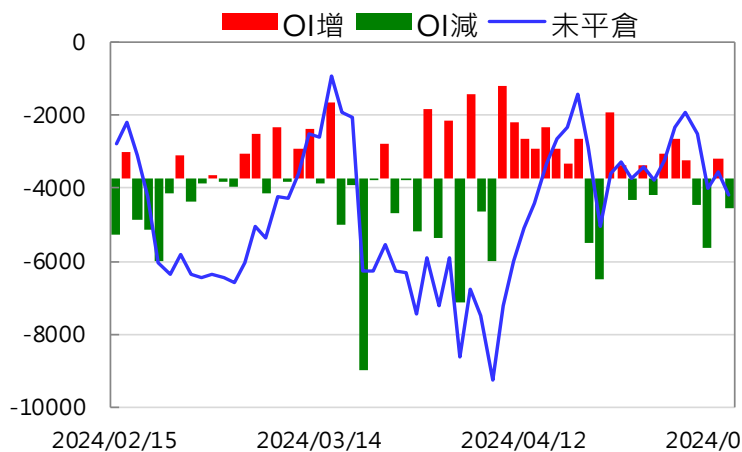
外資期貨未平倉-14869口



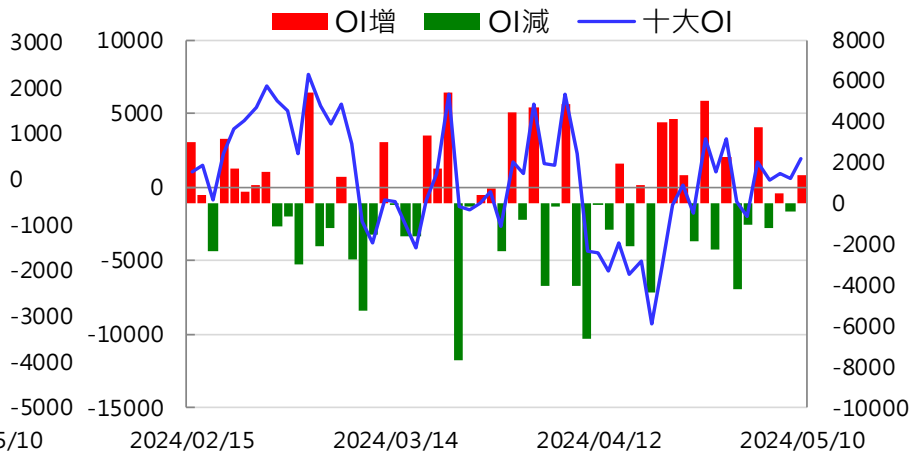
投信期貨未平倉13252口



自營期貨未平倉-4191口



近月十大未平倉1898口



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

雙週選未平倉量

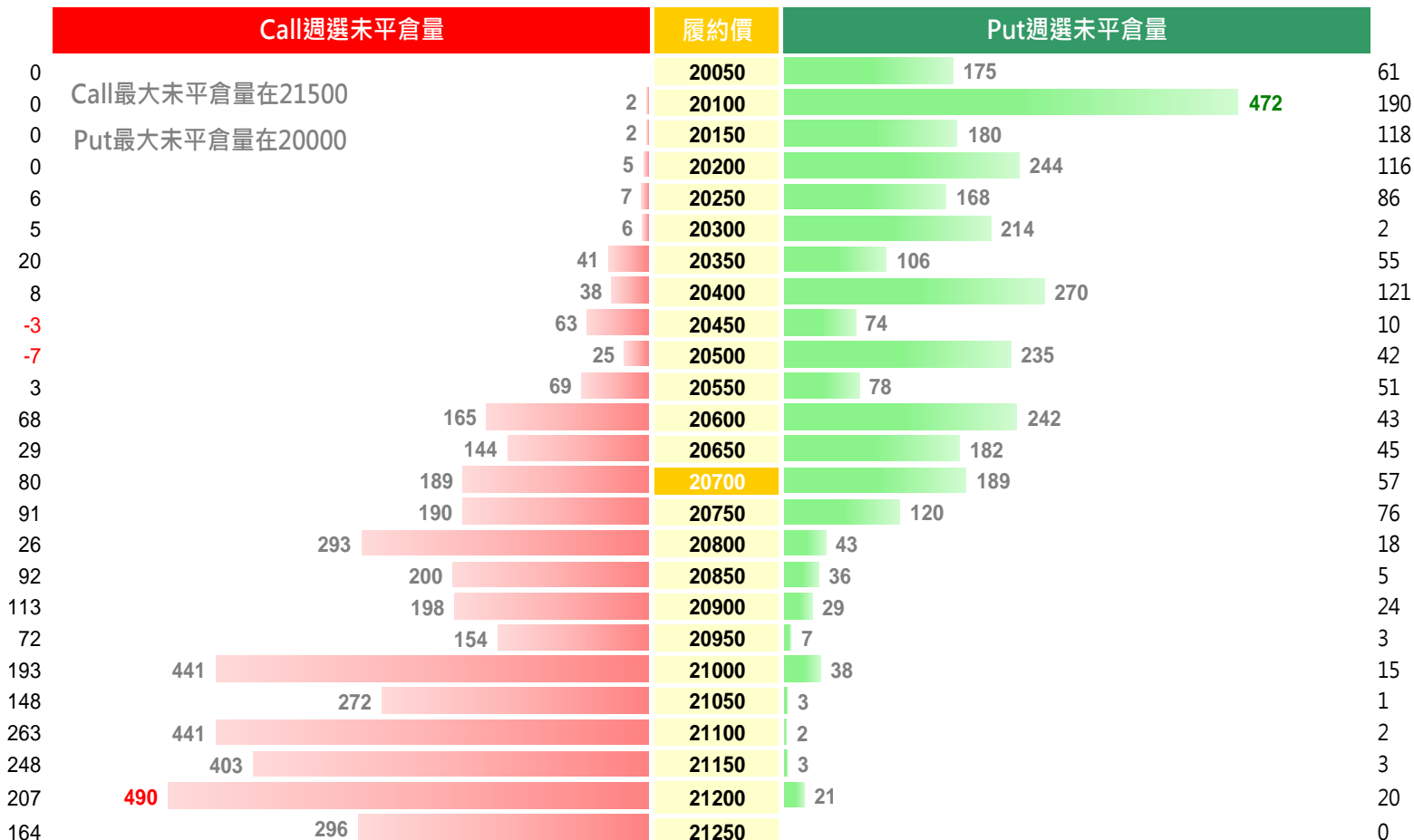
Call總未平倉量為9079口，增加3646口

Put總未平倉量為5810口，增加1958口

2024/5/10

202405W4

週選到期天數： 12天



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

近月未平倉量

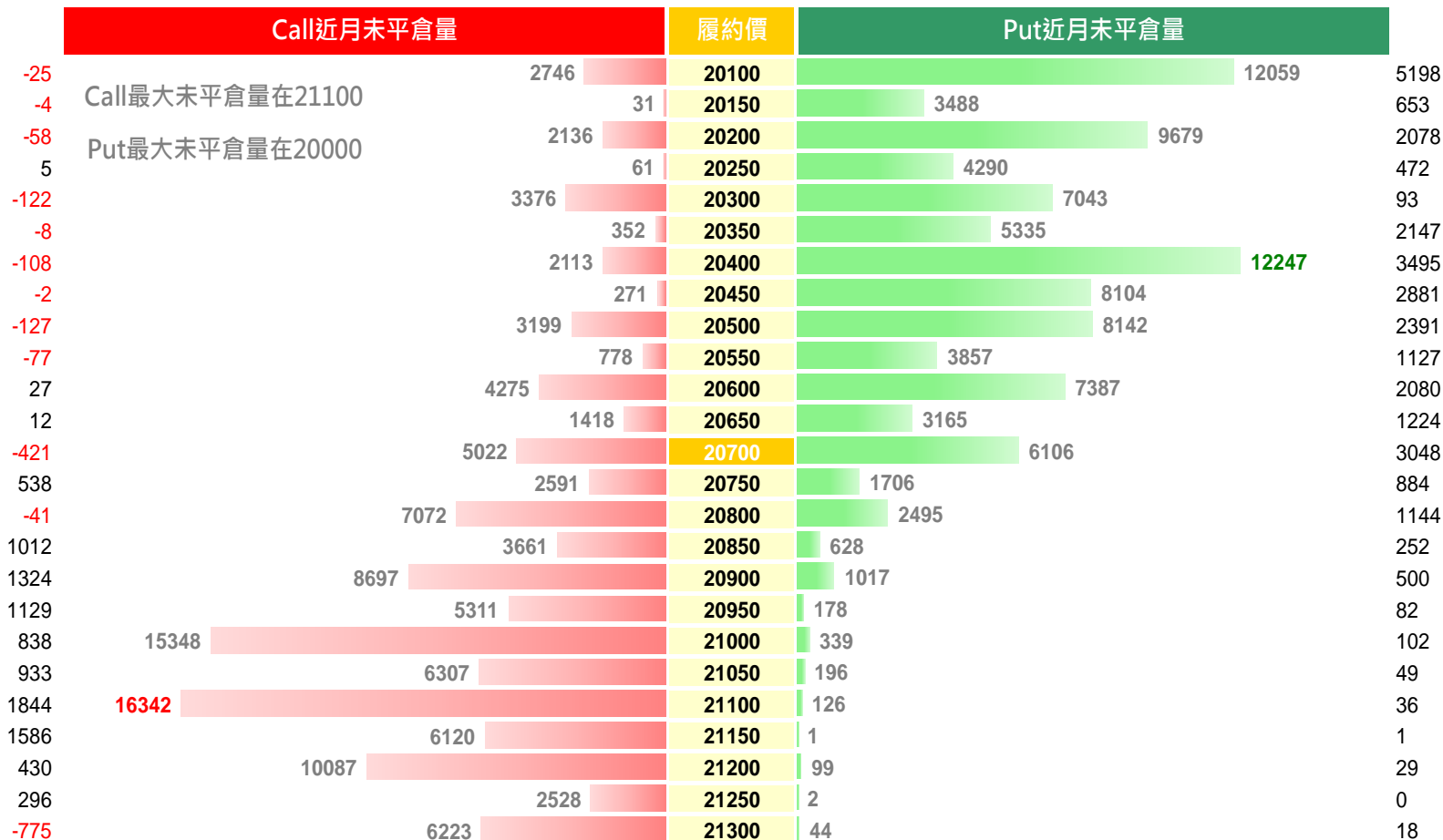
Call總未平倉量為150772口 · 增加9464口

Put總未平倉量為204155口 · 增加32150口

2024/5/10

202405

近月到期天數： 5天



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

次月未平倉量

Call總未平倉量為26232口，增加1695口

Put總未平倉量為61517口，增加508口

2024/5/10

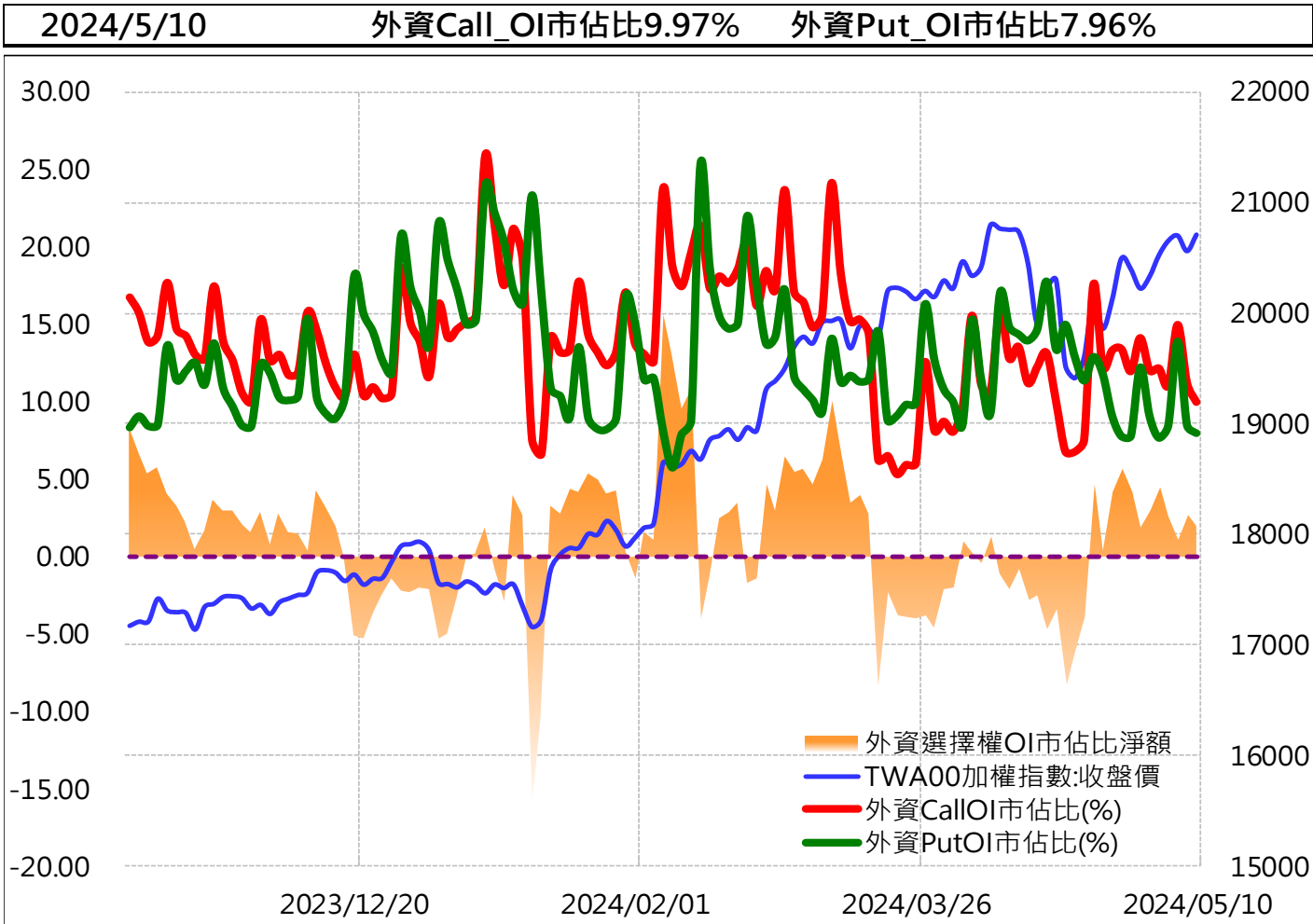
202406

次月到期天數： 40天

	Call次月未平倉量	履約價	Put次月未平倉量	
1	Call最大未平倉量在20800	125	19400	1156
0		218	19500	3222
0	Put最大未平倉量在19000	136	19600	1638
40		147	19700	2391
0		155	19800	780
2		40	19900	594
3		612	20000	2327
38		108	20100	693
10		171	20200	363
16		92	20300	464
-8		166	20400	227
-45		552	20500	470
15		307	20600	195
46		320	20700	3190
82	3784		20800	6561
33		492	20900	122
30		1313	21000	413
293		1189	21100	33
115	2859		21200	32
59		1322	21300	72
31	2742		21400	526
106		1166	21500	202
191		912	21600	20
21		1070	21700	1
116		694	21800	0

■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

外資選擇權未平倉市佔比



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

VIX&P/C RATIO

台指期

20809

漲跌 ▲ 197

P/C ratio

1.44

漲跌 ▲ 0.06

VIX

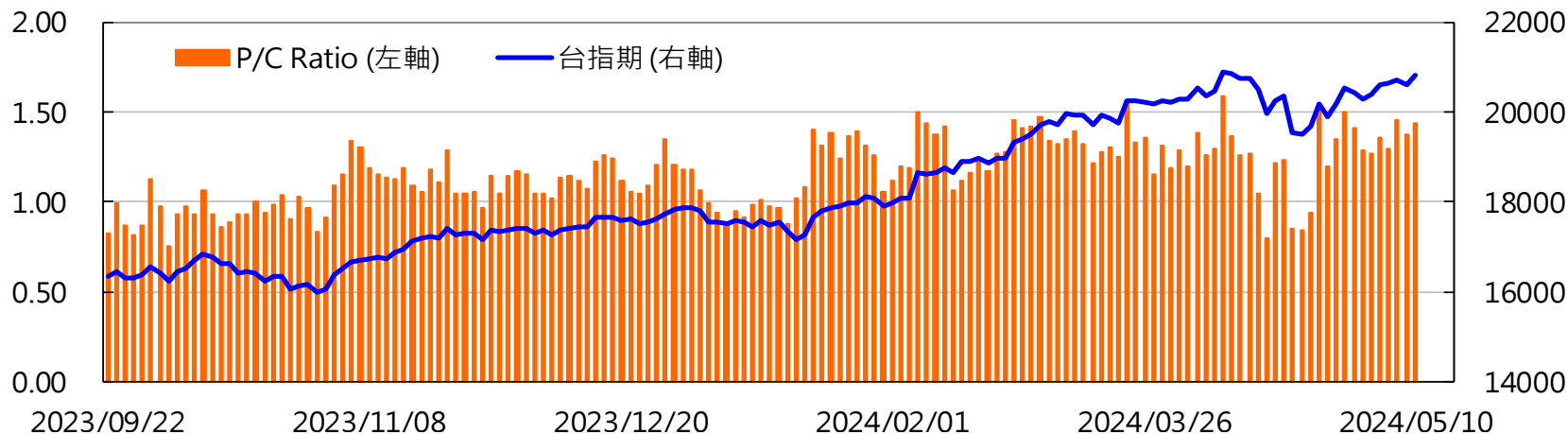
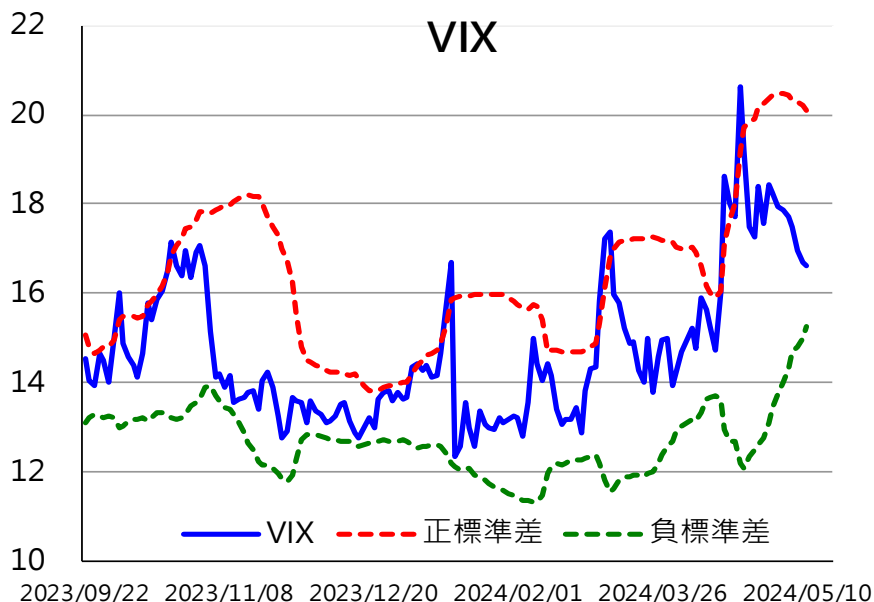
16.62

漲跌 ▼ -0.07

2個標準差(正) 20.10

2個標準差(負) 15.25

成本線 19.76



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

獨家籌碼指標

多空能量指標 50136口、淨多單較前一日增加 29121口，佔比46.46%



逆勢籌碼 -12773口、淨空單較前一日增加 12869口，佔比17.75%



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料



權值股貢獻點數

加權指數 20708.84 上漲148.07點 漲跌幅0.72%

排序	代號 股票	收盤價	漲跌幅	上漲影響點數
1	2330 台積電	802	0.75%	49.01
2	2882 國泰金	55.5	7.35%	17.55
3	2603 長榮	193.5	9.01%	10.84
4	2891 中信金	37.45	3.74%	8.35
5	2881 富邦金	71.8	2.72%	7.79
6	2609 陽明	60.6	9.98%	6.05
7	2615 萬海	63.8	10%	5.12
8	3711 日月光投控	151.5	2.36%	4.84
9	2880 華南金	26.25	4.37%	4.73
10	2345 智邦	461.5	3.94%	3.09
合計前十大 上漲 影響點數				117.37

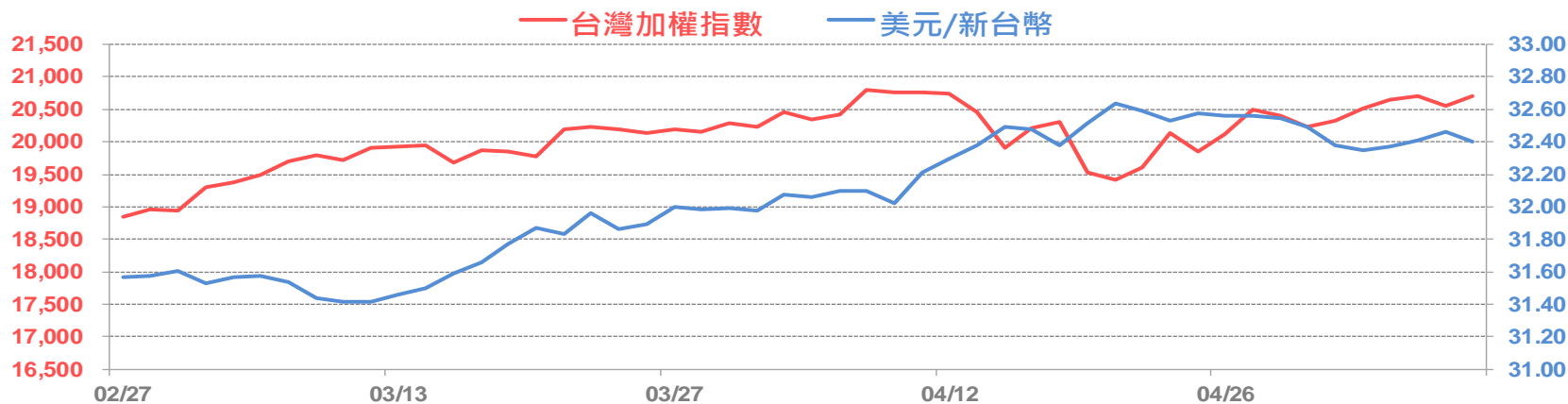
排序	代號 股票	收盤價	漲跌幅	下跌影響點數
1	2382 廣達	270.5	-1.46%	-4.87
2	2317 鴻海	169.5	-0.59%	-4.37
3	2308 台達電	319	-1.24%	-3.27
4	1519 華城	798	-4.43%	-3.04
5	6669 緯穎	2405	-1.84%	-2.48
6	2379 瑞昱	517	-2.82%	-2.42
7	2313 華通	72.5	-7.99%	-2.36
8	3044 健鼎	225	-5.46%	-2.15
9	3017 奇鋆	638	-2.45%	-1.93
10	3661 世芯-KY	2550	-2.86%	-1.86
合計前十大 下跌 影響點數				-28.75

加權指數VS.台幣匯率

請選擇指數 → 台灣加權指數

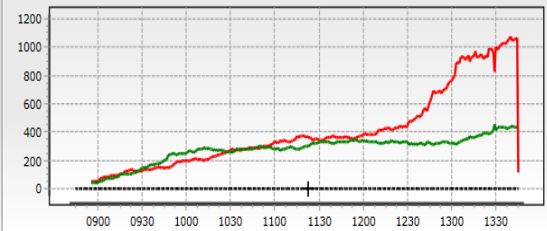
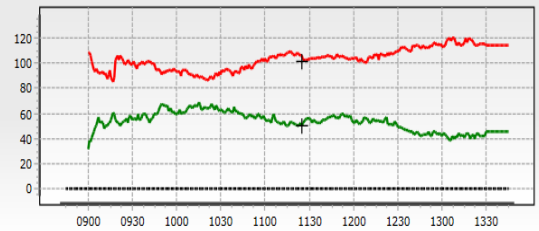
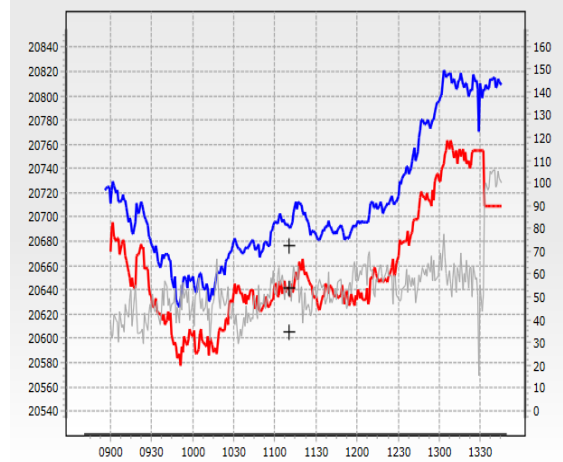
請選擇幣別 → 美元/新台幣

相關係數 → 0.50

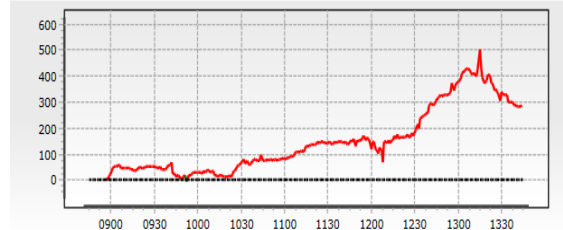


籌碼分析器

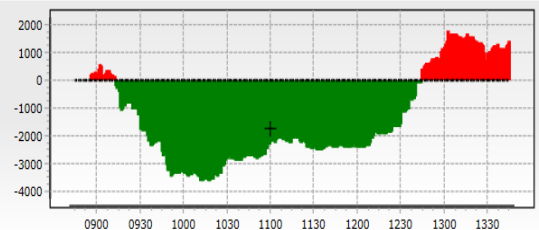
期貨走勢(即時) 20,708.8 20,809 100.2 權值強弱(即時) 114 46 週選力道(單位-百萬)(即時) 114.9 0
 昨量:4061.54 現量:4343 預估量:4343.37



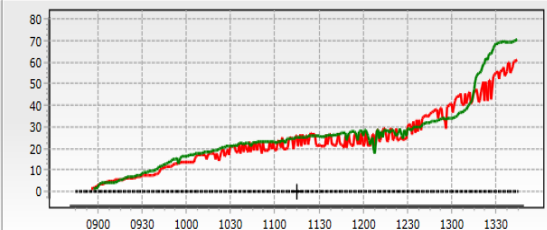
籌碼先鋒(即時) 291.1



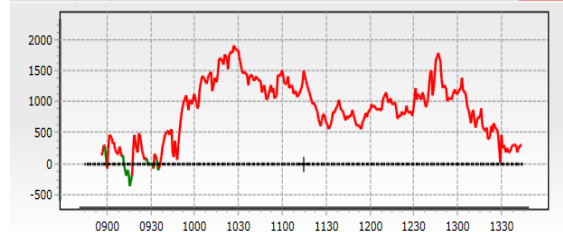
期貨趨勢(即時) 1,382



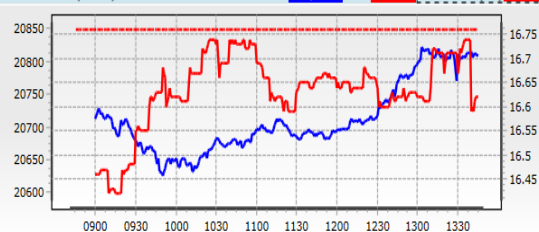
月選力道(單位-百萬)(即時) 61.1 70.4



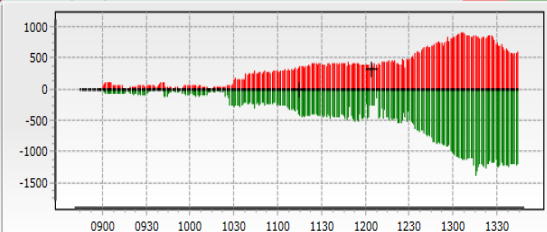
逆空飛翔(即時) 299



台指期 VIX(即時) 台指期 20,809 VIX 16.6 VIX均價(昨) 16.8

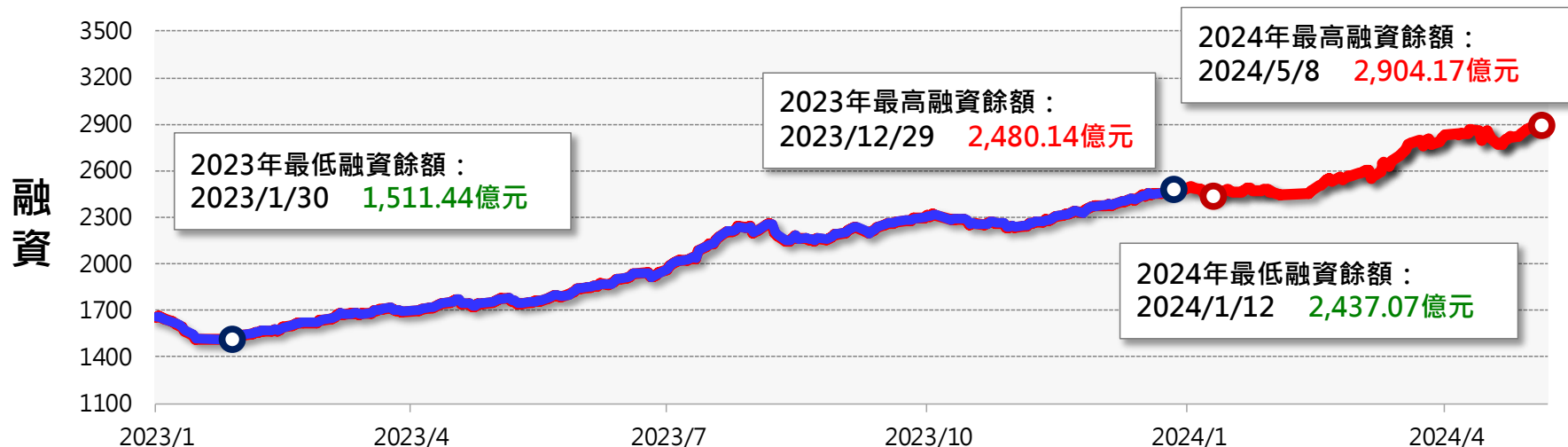


月選走勢(即時) 610 -1,207

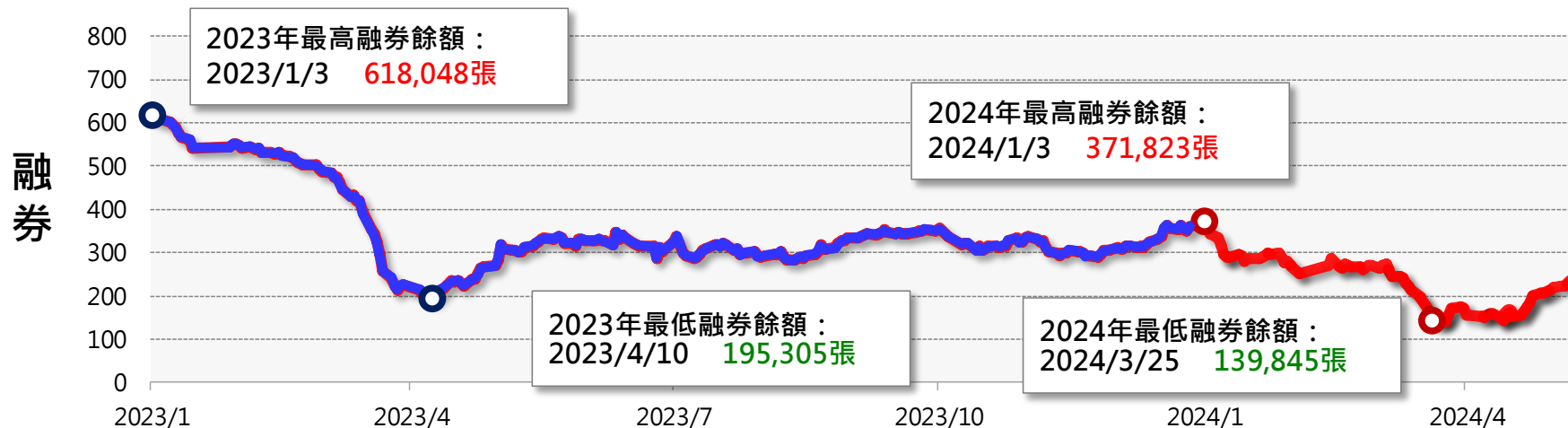


最高最低融資融券餘額

2024/05/09 融資餘額 2899.83億 · 減少 4.35億



2024/05/09 融券餘額 236,077張 · 增加 5,855張





台灣3月份製造業PMI為47.9，較2月份下降0.2個百分點，近期已連續13個月緊縮。根據分項指數來看，新訂單及生產分別下降2點及4.2點，其餘三項則呈現上升；六大產業中有五項回升至擴張區，僅交通工具產業雖有反彈，但仍位於緊縮區。

47.9%



中國3月份製造業PMI為50.8，較前月上升1.7個百分點，優於市場預期的50.1，終結先前連續五個月的緊縮。就分項指數來看，新訂單較前月大幅彈升4點至53，生產指數則同步上升至52.2；就企業規模來看，中、小型企業隨大型企業腳步，重新回到擴張區。

50.8%



在財新製造業PMI的部份，3月份數據為51.1，較前月小幅上升0.2點，且優於預期的51，創下近一年來新高，且連續5個月呈現擴張。當月製造業生產指數、新訂單指數延續2月的上升走勢，前者為近10個月高點，新出口訂單則創2023年3月來新高。

51.1%



美國3月份標普全球製造業PMI終值為51.9，較前月下跌0.3點，且低於初值及預期的52.5，不過近期仍連續三個月擴張。就分項指數來看，就業創造速度加快，但新訂單增長呈現放緩，在通膨方面，投入成本和產出價格皆出現較大幅度上漲。

51.9%



美國3月份製造業PMI為50.3，遠高於市場預期的48.5，也較2月份數據47.8大幅上升2.5個百分點，睽違17個月後再度擴張。就分項指數來看，新訂單指數從49.5彈升至51.4，生產指數由48.4上漲至54.6，雙雙回到擴張區，就業指數則同樣自45.9上升至47.4。

50.3%



德國3月份製造業PMI由42.5下降0.6點至41.9，較初值及預期的41.6上修，連續兩個月回落，且連續20個月位於榮枯線之下。報告中顯示，新訂單及產出減速放緩，出口銷售持續急跌，投入成本呈現下行壓力，但近期連續四個月放緩。

41.9%



法國方面，3月份製造業PMI終值為46.2，略高於初值及預期的45.8，但較2月份數據下跌0.9個百分點，且近期仍呈現連續十四個月緊縮。報告中顯示，新訂單進一步減少，但跌勢是2023年1月以來第二弱，另外在投入成本及收費則是進一步下降。

46.2%



英國3月份製造業PMI終值為50.3，較前月大幅反彈2.8個百分點，且高於初值及預期的49.9，終結先前連續十九個月的緊縮。報告中指出，製造商產出自去年2月以來首度上升，而海外需求則是連續26個月下跌，但跌幅較不顯著。

50.3%



日本3月份製造業PMI終值為48.2，與預期相符，較2月份上升1個百分點，但連續十個月緊縮。報告中顯示，新出口訂單下降速度創2023年2月以來最快，投入物價上升幅度為2021年2月以來最低，而產出物價近一年來首次加速上升，並且創下3個月高點。

48.2%



歐元區3月製造業PMI終值為46.1，較前月46.5下降0.4點，優於初值及預期的45.7，不過近期仍連續二十一個月緊縮。報告中指出，衡量製造業產出的指標，從2月的46.6攀升至47.1，高於初值的46.8，但仍低於榮枯分界線50之下。

46.1%

5/6-5/10 焦點數據

5/6

星期一

5/5-5/10

習近平訪歐

日內

英、日、韓股休市一日

9:45

中國 財新服務業PMI

15:50

法國 服務業PMI終值

15:55

德國 服務業PMI終值

16:00

歐元區 服務業PMI終值

16:20

台灣 外匯存底

16:30

歐元區 投資者信心指數

17:00

歐元區 PPI(YoY)

5/7

星期二

8:30

日本 服務業PMI終值

14:00

德國 淨出口額

14:45

法國 淨出口額

16:00

台灣 CPI(YoY)

中國 外匯存底

17:00

歐元區 零售銷售

22:00

蘋果 2024春季發表

5/8

星期三

日內

Intel年度股東大會

4:30

美國 API原油庫存

16:00

台灣 淨出口額

22:30

美國 EIA原油庫存

5/9

星期四

9:30

中國 淨出口額

19:00

英國 BoE公布利率決策

20:30

美國 初請失業金人數

5/10

星期五

7:50

日本 淨出口額

14:00

英國 Q1GDP(YoY)修正值

英國 3月GDP(MoM)

英國 淨出口額

16:00

台灣 Q1GDP(YoY)修正值

19:30

歐元區 ECB公布會議紀要

22:00

美國 密大消費者信心

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證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。