

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.578元 貶值5分)

	外資	投信	自營	合計
上市	-246.32	+31.39	-27.81	-242.74
上櫃	-39.49	-2.48	-28.14	-70.11

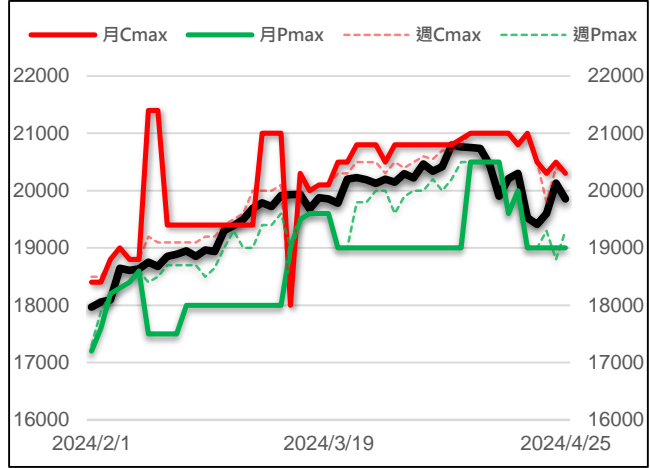
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	338	13.80%	560	82.29%
上櫃股票	260	27.84%	469	64.93%

台指選擇權大量區與未平倉量

	月選大量區 / OI		週選大量區 / OI	
CALL	20300	6113	20300	6064
PUT	19000	6301	19300	6007

加權指數 VS 選擇權最大未平倉量



永豐期貨研調

三大法人期權部位口數 (單位：口)

Contract	外資			投信			自營		
	淨部位	淨部增減	佔市場%	淨部位	淨部增減	佔市場%	淨部位	淨部增減	佔市場%
台指	-17160	-3827	-19.8%	+11346	-30	13.1%	-3276	+316	-3.8%
電子	-17	-23	-1.2%	+203	0	14.8%	-425	+26	-31.0%
金融	-292	-6	-20.1%	+7	0	0.5%	-280	+1	-19.3%
CALL	+22073	+2314	12.2%	0	0	0	+6437	+7643	3.6%
PUT	+25411	+2948	11.8%	-66	0	-0.0%	-5320	+1675	-2.5%

前十大交易人期權淨部位口數 (單位：口)

商品	特定法人				非特定法人				全市場未平倉量
	近月	增減	其他月	增減	近月	增減	其他月	增減	
台指	-6373	-2379	-847	-537	+4620	+488	-370	+231	86743
電子	-82	+7	0	0	-42	-22	-2	+6	1373
金融	-614	-48	0	0	+230	+36	-3	-2	1454
CALL	+17257	+3503	+9970	+2324	-8412	-1940	-5064	-3827	180606
PUT	-13547	-590	-1642	-1666	+4729	-553	-3841	-2682	216020

台指期現貨收盤行情表

Contract	開盤	最高	最低	結算	漲跌	漲跌幅	成交量	未平倉	OI增減
加權指數	20003.00	20003.00	19848.57	19857.42	-274.32	-1.36%	3650.7億		
台指期五月	19940	19979	19834	19880	-290	-1.44%	96972	67785	-2896
台指期六月	19930	19964	19825	19869	-281	-1.39%	1060	3221	+491
小型台指五月	19937	19978	19835	19880	-290	-1.44%	177840	43149	-4575
小型台指六月	19925	19965	19826	19869	-281	-1.39%	8205	7810	+2
小型台指(週)	19934	19951	19819	19856	-289	-1.43%	1394	567	+71
電子指數	1035.08	1035.57	1025.55	1025.82	-18.79	-1.80%	2157.1億		
電子期五月	1033.60	1034.75	1025.25	1027.90	-17.7	-1.69%	931	1169	+1
電子期六月	1029.65	1032.95	1025.15	1026.30	-18.6	-1.78%	22	20	+3
金融指數	1812.84	1812.84	1794.25	1796.79	-17.64	-0.97%	86.58億		
金融期五月	1811.8	1811.8	1792.2	1797.8	-20.8	-1.14%	639	1313	+1
金融期六月	1799.8	1799.8	1799.8	1801.0	-21.2	-1.16%	1	9	0
櫃買指數	244.49	244.49	242.57	242.65	-2.28	-0.93%	890.44億		
櫃買期五月	242.80	242.80	242.40	242.40	-2.7	-1.10%	4	49	0
非金電指數	15783.09	15788.16	15718.63	15755.81	-42.42	-0.27%	1212.59億		
非金電期五月	15815	15815	15730	15745	-94	-0.59%	86	122	-20

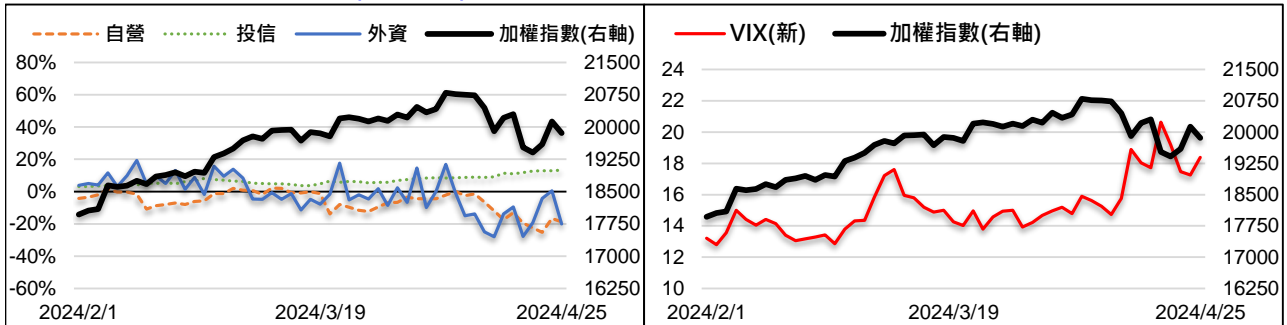
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

contract	開盤	最高	最低	結算	漲跌	漲跌幅	成交量	未平倉	OI增減
道瓊指數	38552.79	38552.79	38310.55	38460.92	-42.77	-0.11%			
道瓊六月	38631	38674	38581	38609	-191	-0.49%	112	606	-1
標普500指數	5084.86	5089.48	5047.02	5071.63	+1.08	+0.02%			
標普六月	5083.25	5083.25	5068	5070.75	-53	-1.03%	33	336	-2
Nasdaq 100指數	17526.80	17526.80	17526.80	17526.80	+55.329	+0.32%			
那斯達十二月	17503	17548	17435	17453	-292	-1.65%	400	2997	+87

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

18.38 +1.13

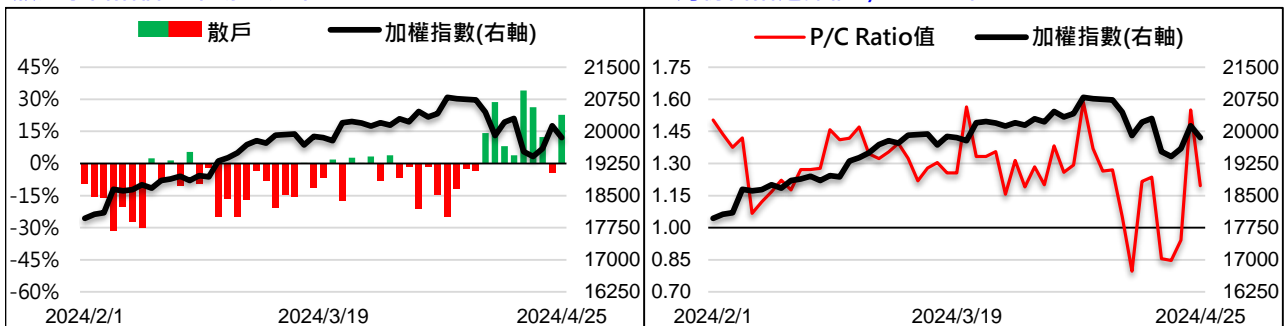


散戶小台指佔全市場OI比率

22.68% +27.15%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.20 -0.35



永豐期貨研調

電金傳熄火 台股量縮跌破兩萬大關

台指期週四下跌290點至19880點。價差方面，台指期正價差縮至22.58點，電子期正價差擴至2.08點，金融期正價差縮至1.01點。現貨部分，三大法人賣超242.74億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加3541口至-9090口，其中外資多單減碼且空單加碼，淨空單增加3827口至-17160口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加2916口至-7220口。

週三美國在公佈通膨數據PCE前夕，美債殖利率上揚，抑制美股四大指數走勢，終場僅道瓊指數小跌，漲幅介在-0.11%至1.06%，而盤後META也公佈財報，雖業績優於預期，但對於Q2的財測保守，盤後下跌15.13%，影響週四加權指數以下跌128.74點跳空開出，昨日漲多的AI類股成今日殺盤重心，約十點十五分權值股醞釀反彈，但仍不敵上檔壓力，而面板、營建、觀光類股仍較為強勢，終場大盤下跌274.32點收19857.42點。整體來看，台股以實體黑K再次攪破兩萬大關，未來若跌破昨日紅K棒，短線上較為弱勢，若未跌破則以震盪視之，而目前仍需靜待其餘美股七雄財報及週五美國PCE價格指數。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在20300點，賣權未平倉最大量集中在19000點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.55降至1.2。VIX指數上漲1.13至18.38。整體選擇權籌碼偏空。(永豐期貨研調)

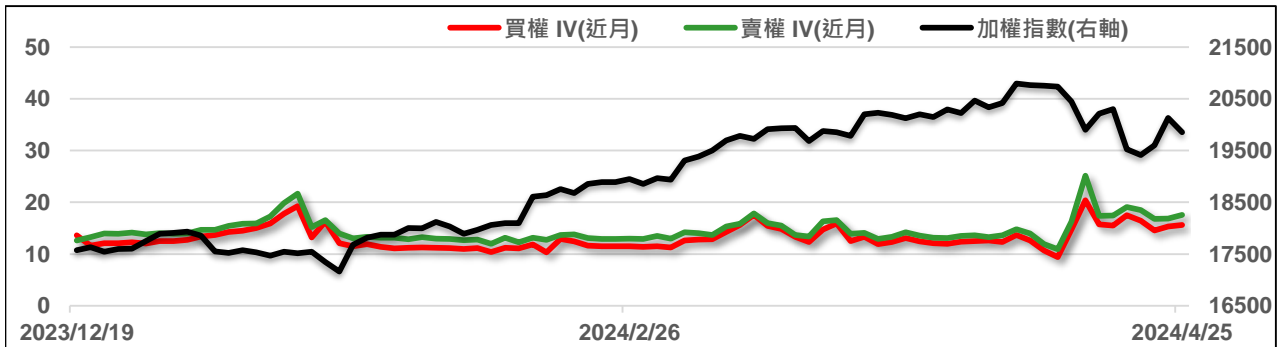
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 103.07% ▼				所有月份	P/C ratio = 119.61% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	29847	-16819	77420	+12654	Call	321282	-445396	180606	+68143
Put	26136	-24701	79797	+2605	Put	309908	-451462	216020	+41736

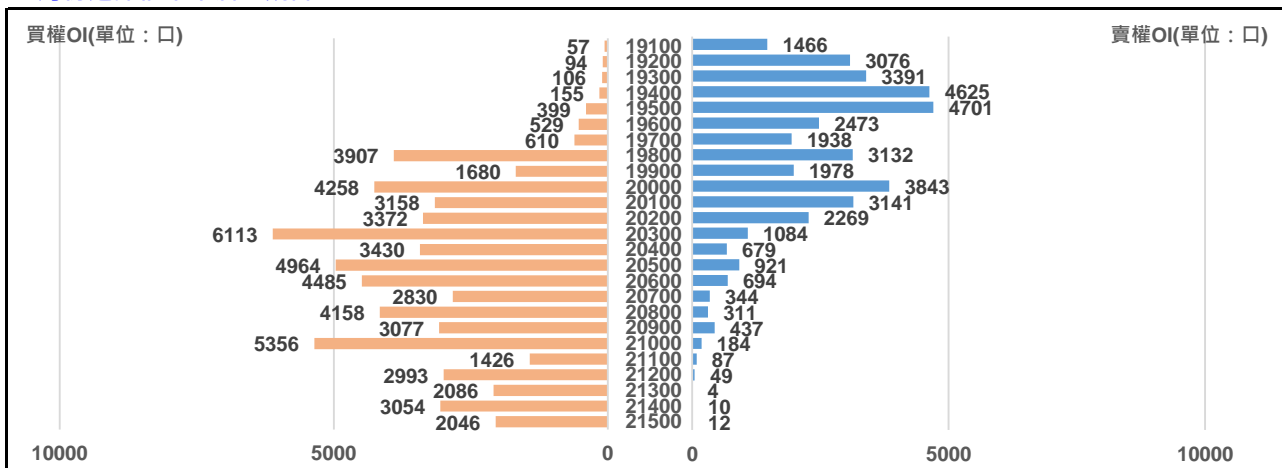
五月份台指選擇權

買權 IV = 15.61 ▲						賣權 IV = 17.54 ▲						
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
0.803	+6	68	7	-245	955	19000	74	+38	2465	6301	-91	-0.197
0.775	+31	57	31	-240	870	19100	85	+41	777	1466	-92	-0.225
0.745	+1	94	8	-240	780	19200	100	+47	2334	3076	+291	-0.255
0.713	-7	106	45	-235	700	19300	117	+52	3416	3391	-558	-0.287
0.680	-27	155	74	-230	625	19400	141	+62	3472	4625	+2126	-0.320
0.646	+26	399	112	-210	550	19500	168	+72	1249	4701	-92	-0.354
0.610	+11	529	262	-210	475	19600	194	+80	762	2473	+107	-0.390
0.574	+49	610	254	-194	411	19700	237	+98	1511	1938	+287	-0.426
0.537	+1888	3907	2628	-185	350	19800	271	+106	1280	3132	+186	-0.463
0.500	+398	1680	1222	-164	301	19900	315	+117	1342	1978	+71	-0.500
0.463	+663	4258	2652	-154	244	20000	366	+134	1119	3843	-240	-0.537
0.427	+482	3158	1383	-139	204	20100	424	+149	639	3141	-163	-0.573
0.392	+115	3372	1941	-126	163	20200	490	+173	254	2269	-63	-0.608
0.357	+2115	6113	4288	-108	132	20300	550	+180	166	1084	-24	-0.643
0.324	+224	3430	2533	-94	105	20400	625	+195	12	679	-19	-0.676

近月選擇權IV走勢圖



五月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調

第一週台指選擇權

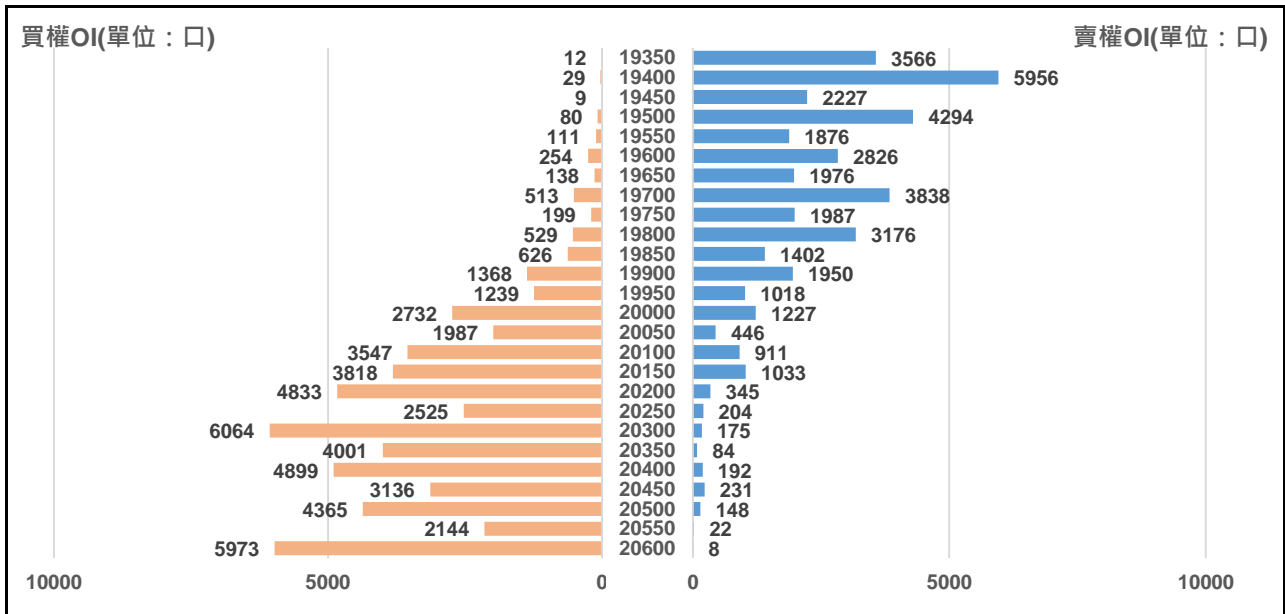
買權 IV = 16.51 ▼							賣權 IV = 18.63 ▲					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
0.887	0	1	0	-275	735	19150	27	+13.5	2112	1170	+764	-0.113
0.870	0	11	0	-270	690	19200	30.5	+16.5	4086	2864	+1605	-0.130
0.852	+1	2	1	-265	645	19250	36	+20	2834	2125	+1779	-0.148
0.832	-7	49	3	-265	595	19300	40	+23	6927	6007	+3894	-0.168
0.811	+2	12	2	-255	555	19350	46.5	+27.5	4237	3566	+1781	-0.189
0.788	0	29	7	-250	510	19400	54	+32	8965	5956	+3638	-0.212
0.764	-1	9	2	-241	469	19450	62	+35.5	5419	2227	+742	-0.236
0.739	+13	80	45	-229	431	19500	74	+44	9692	4294	+2412	-0.261
0.712	+11	111	3	-224	391	19550	84	+49	4142	1876	+1012	-0.288
0.684	+1	254	236	-235	345	19600	96	+53	8705	2826	+1205	-0.316
0.655	+58	138	623	-232	313	19650	112	+62	6114	1976	+1110	-0.345
0.625	+169	513	676	-220	280	19700	127	+69	10800	3838	+2574	-0.375
0.594	+50	199	661	-210	243	19750	147	+79	3849	1987	+783	-0.406
0.563	+279	529	1425	-202	214	19800	165	+86	9354	3176	+1279	-0.437
0.531	+431	626	1935	-191	188	19850	190	+99	5588	1402	+764	-0.469
0.500	+862	1368	5238	-177	163	19900	213	+108	7153	1950	+341	-0.500

週選擇權前十大交易人資料

Contract	特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	1468	-1267	0	0	+1468	1.8%
PUT	1071	+1071	1054	+384	+17	0.0%

Contract	非特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	26775	+15651	29369	+19091	-2594	-3.1%
PUT	34493	+7149	28901	+8832	+5592	6.4%

第一週選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調