

三大現貨買賣超(億元) (台幣28,424元 升值8.4分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+232.98	-14.52	+32.82	+251.28
上櫃	+13.60	+8.98	+7.89	+30.47

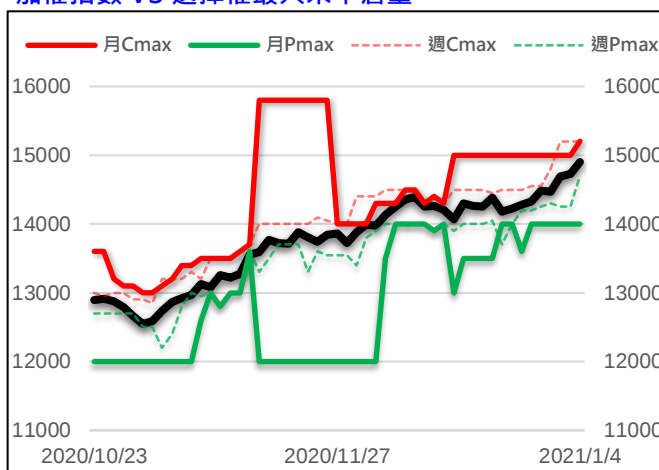
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	541	70.14%	338	24.46%
上櫃股票	383	60.98%	305	29.52%

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	15200 11206	15200 12588
PUT	14000 10035	14700 10529

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)

合約	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	-10220	-898	-8.1%	-12165	+1032	-9.6%	+21573	+1078	17.1%
電子	-1151	-173	-33.7%	+109	+4	3.2%	+1510	+230	44.2%
金融	-1774	+62	-54.5%	+6	0	0.2%	+167	-102	5.1%
CALL	+23557	+7677	11.2%	-400	0	-0.2%	-11305	+4159	-5.4%
PUT	+19056	+2121	6.5%	+1116	0	0.4%	+2648	-7191	0.9%

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	-16061	-2575	+7367	+747	0	0	-697	-80	126519
電子	-136	-110	+158	-29	-81	+72	+3	+82	3420
金融	-1412	+228	-364	-120	+724	-86	+160	+68	3255
CALL	+23063	+3743	+3869	+3590	-7126	+1771	-8756	-480	209950
PUT	-11480	-2557	-3433	-5150	+2498	+2522	+9258	+14720	291020

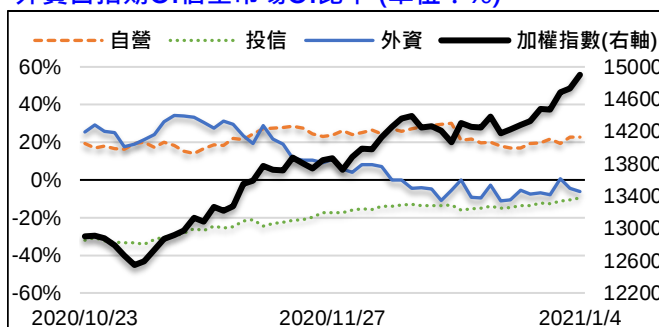
台指期現貨收盤行情表

合約	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	14720.25	14937.13	14720.25	14902.03	+169.5	+1.15%	3479.5億		
台指期一月	14640	14925	14635	14873	+195	+1.33%	137069	96894	+1705
台指期二月	14581	14852	14569	14802	+194	+1.33%	2313	9568	+1076
小型台指一月	14641	14926	14636	14873	+195	+1.33%	166062	38810	+1279
小型台指二月	14581	14852	14570	14802	+194	+1.33%	5942	7102	+130
小型台指(週)	14696	14941	14686	14899	+179	+1.22%	919	551	+210
電子指數	719.34	734.90	719.34	732.17	+11.85	+1.65%	2385.69億		
電子期一月	715.70	734.00	715.15	730.65	+13.35	+1.86%	3949	3219	+92
電子期二月	713.65	730.20	713.55	727.25	+13.25	+1.86%	81	196	+41
金融指數	1284.17	1284.18	1271.20	1279.73	-5.97	-0.46%	72.81億		
金融期一月	1280.0	1280.0	1263.0	1270.4	-8.2	-0.64%	2388	2795	-112
金融期二月	1272.6	1272.6	1255.8	1263.6	-9	-0.71%	155	451	+125
櫃買指數	184.29	185.80	184.29	185.80	+1.7	+0.92%	709.36億		
櫃買期一月	182.95	184.50	182.30	184.50	+2.55	+1.40%	26	61	0
非金電指數	13686.7	13778.5	13619	13759	+80.64	+0.59%	884.05億		
非金電期一月	13599	13778	13505	13719	+93	+0.68%	536	406	-18

美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

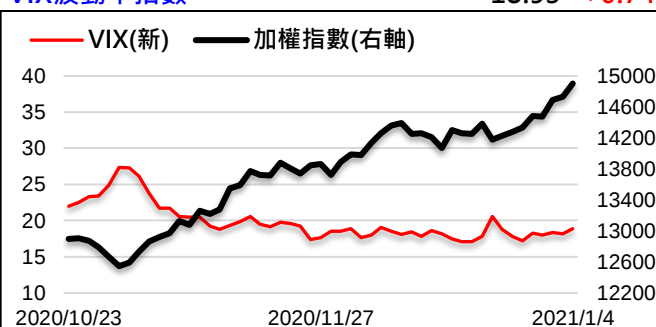
合約	開盤	最高	最低	結算	漲跌	漲跌幅	成交量	未平倉	OI增減
道瓊指數	30417.64	30637.47	30344.50	30606.48	+196.92	+0.65%			
道瓊三月	30450	30526	30418	30478	+153	+0.50%	390	1510	-8
標普500指數	3733.27	3760.20	3726.88	3756.07	+24.03	+0.64%			
標普三月	3742	3751	3739.25	3746	+22	+0.59%	107	456	+41
Nasdaq 100指數	12852.96	12904.09	12804.75	12888.28	+42.92	+0.33%			
那斯達十二月	12838	12878	12827	12866	+28	+0.22%	291	1224	-61

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)



VIX波動率指數

18.93 +0.74



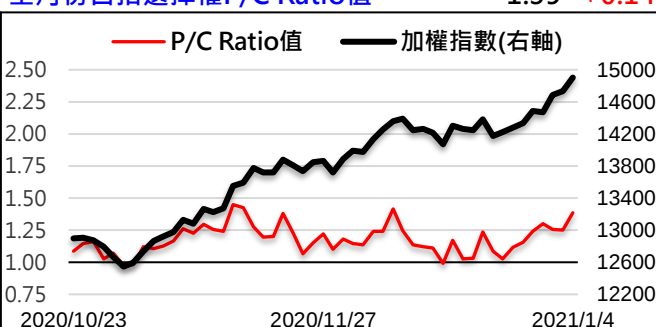
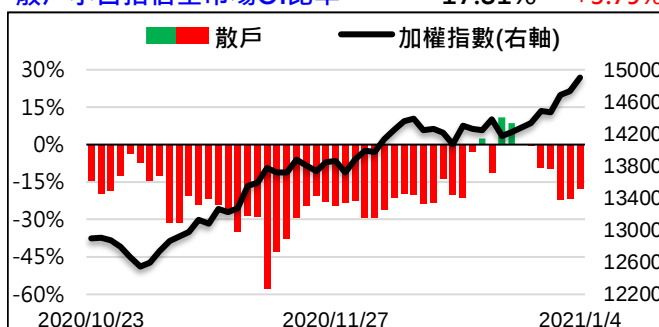
散戶小台指佔全市場OI比率

-17.81%

+3.79%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.39 +0.14



永豐期貨研調

資金回流電子族群 台股站上14900點關卡

台指期週一上漲195點至14873點。價差方面，台指期逆價差縮至-29.03點，電子期逆價差縮至-1.52點，金融期逆價差擴至-9.33點。現貨部分，三大法人買超251.28億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少1212口至-812口，其中外資空單加碼超過多單加碼，淨空單增加898口至-10220口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加1828口至-8694口。

今天是2021年第一個交易日，台股延續去年強勁漲勢，開平盤附近後走高，買盤持續推升大盤向上大漲，由電子權值股台積電、鴻海及大立光領軍，終場加權指數大漲1.15%，收14902.03點，成交量大增，離萬五關卡僅一步之遙。今天主要由電子族群主導盤勢，權值股來看，台積電大漲1.13%，收536元，鴻海則大漲逾8%，盤中一度攻上100元關卡，終場收99.9元，台積電及鴻海都站上波段新高，其他如航運族群、LED族群也表現強勁，長榮、陽明亮漲停紅燈，漲價題材持續發酵，台股雖然在歷史新高的位置，但資金及噁空行情延續，資金也回流電子股，多頭格局不變，終場帶量大漲，將挑戰萬五關卡，後續可留意外資態度，是否助攻台股再攻高。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在15200點，賣權未平倉最大量集中在14000點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.25升至1.39。VIX指數上漲0.74至18.93。整體選擇權籌碼面持續有利多方上攻。(永豐期貨研調)

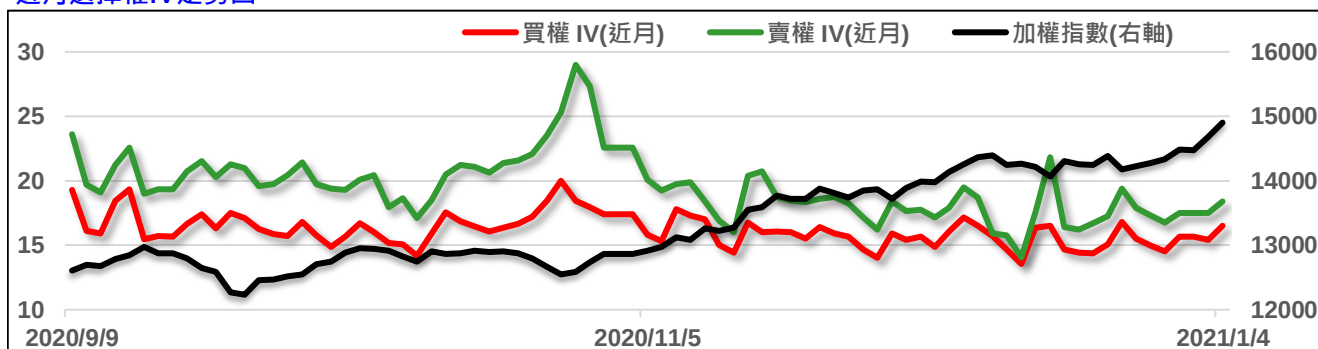
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 127.03% ▲				所有月份	P/C ratio = 138.61% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	65765	+28912	90412	+2725	Call	362995	+120926	209950	+30473
Put	70906	+17688	114849	+6621	Put	409683	+156691	291020	+66196

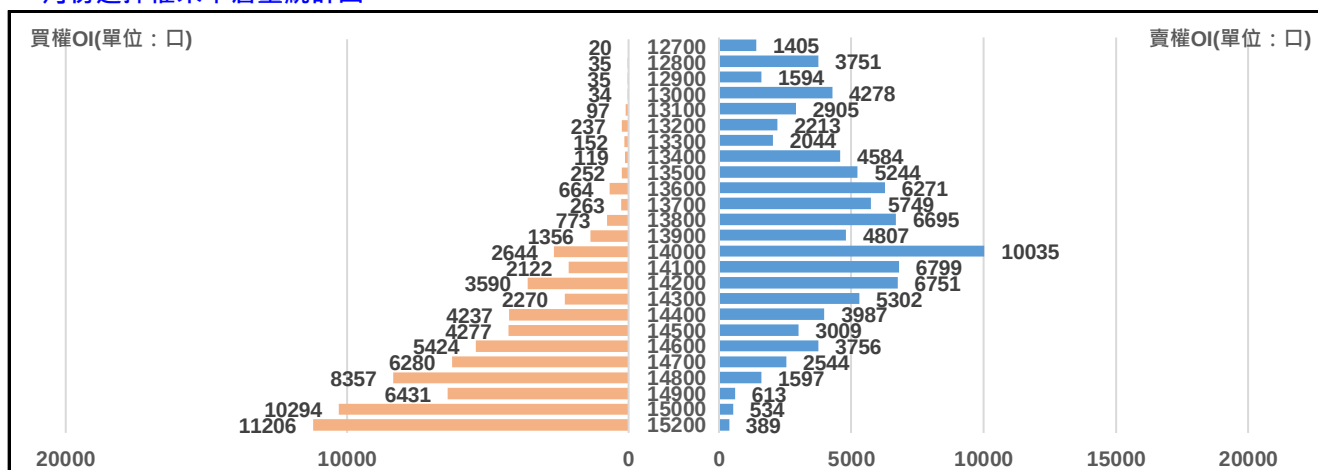
一月份台指選擇權

買權 IV = 16.52 ▲							賣權 IV = 18.42 ▲					
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
0.989	-114	2644	155	+175	900	14000	26	-15	4982	10035	+827	-0.011
0.979	-179	2122	257	+170	800	14100	30.5	-20.5	5098	6799	+248	-0.021
0.962	-214	3590	429	+165	710	14200	38	-28	8625	6751	+1467	-0.038
0.936	-177	2270	483	+153	620	14300	46.5	-38.5	7130	5302	+1082	-0.064
0.898	-181	4237	784	+143	530	14400	59	-49	4833	3987	+284	-0.102
0.845	-580	4277	1834	+129	449	14500	77	-61	5561	3009	+1216	-0.155
0.778	-1272	5424	3645	+117	371	14600	98	-78	4430	3756	+994	-0.222
0.697	-157	6280	3835	+104	307	14700	129	-95	3089	2544	+1075	-0.303
0.606	-1464	8357	6699	+84	241	14800	167	-110	3530	1597	+976	-0.394
0.510	-287	6431	4915	+66	186	14900	213	-129	1705	613	+520	-0.490
0.413	-152	10294	11178	+50	142	15000	266	-146	1008	534	+450	-0.587
0.241	+2301	11206	17683	+25	78	15200	403	-172	548	389	+369	-0.759
0.119	+3386	8586	7731	+14	41.5	15400	570	-185	58	34	+25	-0.881
0.050	+716	3690	3221	+2.5	18	15600	750	-185	54	6	+4	-0.950
0.017	+434	2403	1520	+3.7	11	15800	940	-190	0	0	0	-0.983

近月選擇權IV走勢圖



一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

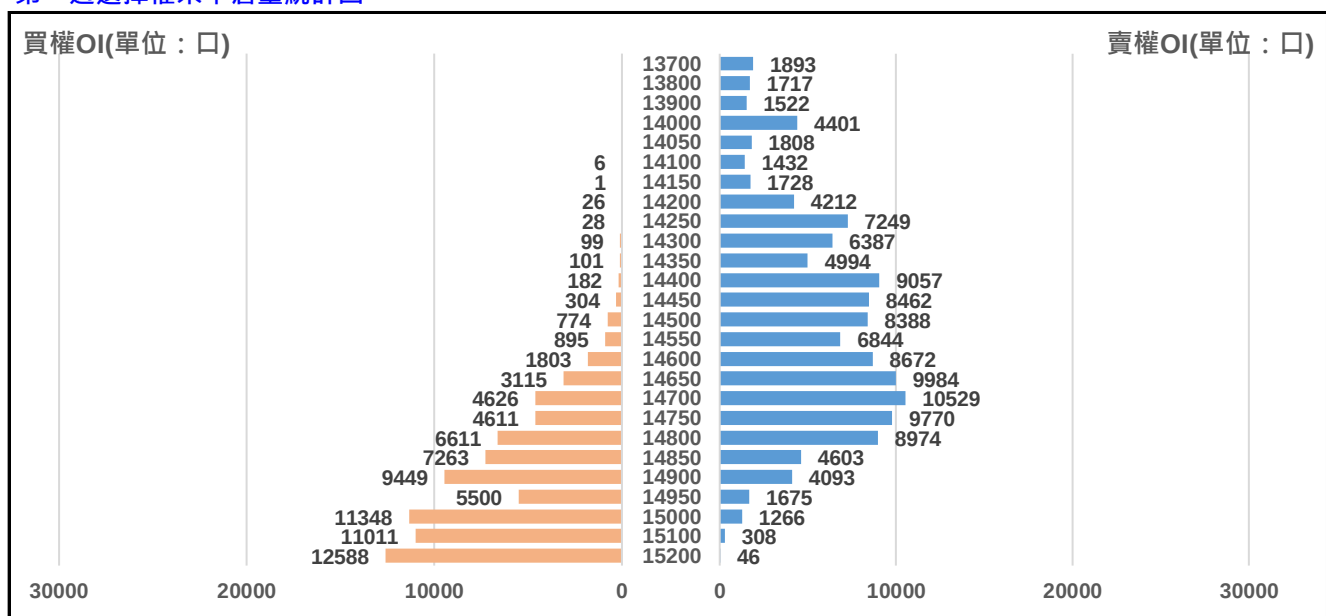
買權 IV = 16.39 ▲							賣權 IV = 19.56 ▲						
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	結算	履約價	結算	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta	
1.000	+4	6	8	+180	800	14100	1.4	-1.9	1059	1432	-319	0.000	
1.000	0	1	0	+175	750	14150	1.5	-2.4	943	1728	+131	0.000	
1.000	+16	26	25	+175	700	14200	1.8	-3.1	2150	4212	+42	0.000	
1.000	+20	28	20	+175	650	14250	1.8	-4.4	2834	7249	-826	0.000	
1.000	+43	99	128	+175	600	14300	2.1	-6.1	7618	6387	+383	0.000	
1.000	+23	101	51	+168	550	14350	2.3	-8.7	7916	4994	-416	0.000	
0.999	-39	182	115	+168	500	14400	2.8	-11.2	14472	9057	+1826	-0.001	
0.998	-43	304	362	+161	452	14450	3.5	-15.5	14623	8462	+2716	-0.002	
0.994	-48	774	511	+157	403	14500	4.4	-22.1	22582	8388	+1930	-0.006	
0.985	-166	895	999	+147	354	14550	5.6	-31.4	19060	6844	+2822	-0.015	
0.967	-385	1803	4210	+136	306	14600	7.4	-43.6	28189	8672	+4050	-0.033	
0.934	-246	3115	9048	+124	260	14650	10.5	-54.5	29049	9984	+6283	-0.066	
0.879	-548	4626	19916	+109	216	14700	14	-73	35038	10529	+5603	-0.121	
0.798	+910	4611	18968	+89	172	14750	21.5	-90.5	32476	9770	+8165	-0.202	
0.691	+184	6611	28498	+71	134	14800	32.5	-108.5	32366	8974	+8045	-0.309	
0.566	+1535	7263	27820	+54	100	14850	48	-127	18357	4603	+4378	-0.434	

週選擇權前十大交易人資料

合約	特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	2219	+1419	4277	+1467	-2058	-2.4%
PUT	3680	+500	1325	-823	+2355	1.8%

合約	非特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	31270	+13072	36344	+12353	-5074	-5.8%
PUT	41339	+20491	39566	+12017	+1773	1.3%

第一週選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調