

三大現貨買賣超(億元) (台幣31.01元 貶值1.44角)

	外資	投信	自營	合計
上市	-228.06	+33.63	-90.94	-285.37
上櫃	-21.70	+1.33	-30.08	-50.45

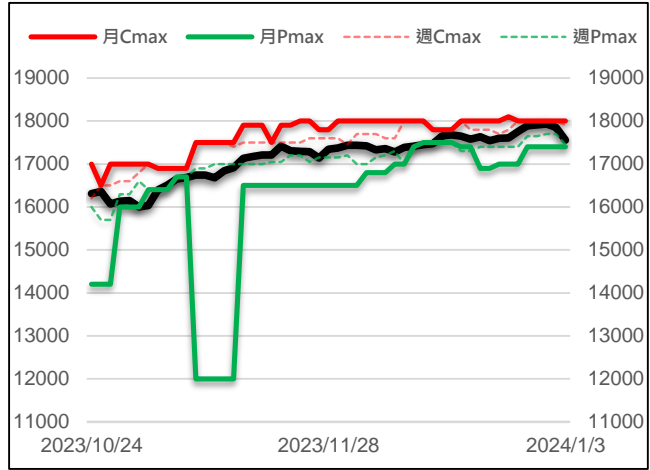
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	194	6.46%	725	89.28%
上櫃股票	195	19.73%	519	74.68%

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	18000	9585	17900	5792
PUT	17400	8195	17450	3335

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	-24035	-6606	-19.0%	+8811	-1218	7.0%	+595	-846	0.5%
電子	-196	-15	-11.6%	+209	-13	12.4%	-268	-113	-15.9%
金融	-628	-11	-41.3%	+8	-2	0.5%	-7	-25	-0.5%
CALL	+29039	+454	16.3%	0	0	0	-18013	-2342	-10.1%
PUT	+38094	+2074	21.5%	-42	0	-0.0%	+8092	-12709	4.6%

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	-14971	-4456	-631	+49	+2403	-2531	+9	+1	126409
電子	-165	+95	-17	-14	+56	-80	+1	+1	1690
金融	-630	+40	0	0	+180	-6	+2	+1	1521
CALL	+27139	+2863	-1651	-1976	-22656	-5918	+7974	+15379	178062
PUT	-23785	-2559	-5813	+6700	+4642	-515	-11892	+6406	177203

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	17829.28	17829.28	17518.19	17559.31	-294.45	-1.65%	3088.6億		
台指期一月	17658	17667	17507	17545	-255	-1.43%	97851	106526	+3122
台指期二月	17656	17656	17505	17540	-251	-1.41%	1154	2794	+513
小型台指一月	17658	17667	17508	17545	-255	-1.43%	137890	58300	+12485
小型台指二月	17657	17661	17506	17540	-251	-1.41%	7869	8849	+2508
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	886.80	886.80	868.20	870.59	-17.71	-1.99%	2041.14億		
電子期一月	876.00	876.00	867.30	869.25	-15.05	-1.70%	1247	1477	-40
電子期二月	875.20	875.20	869.00	869.00	-14.6	-1.65%	8	17	+4
金融指數	1719.15	1719.15	1695.85	1701.10	-21.4	-1.24%	79.09億		
金融期一月	1711.6	1711.6	1694.0	1700.2	-16.2	-0.94%	716	1418	-39
金融期二月	1703.0	1703.2	1696.8	1700.8	-16	-0.93%	11	17	+6
櫃買指數	232.94	232.94	230.69	231.05	-2.18	-0.93%	673.66億		
櫃買期一月	231.70	231.70	229.75	230.75	-1.45	-0.62%	3	46	0
非金電指數	15240.95	15240.95	15068.06	15101.87	-143.39	-0.94%	677.83億		
非金電期一月	15159	15159	15078	15109	-134	-0.88%	56	133	+6

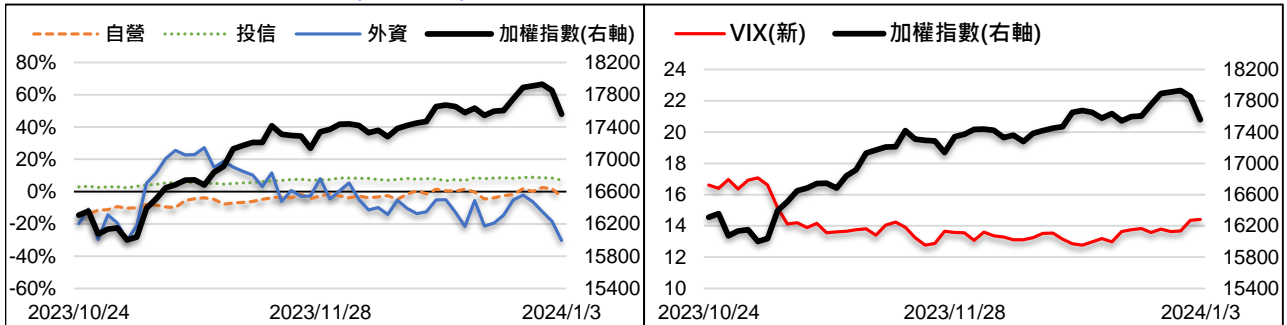
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	37566.22	37790.08	37495.91	37715.04	+25.5	+0.07%			
道瓊三月	37952	37977	37920	37920	-118	-0.31%	116	1616	+127
標普500指數	4745.20	4754.33	4722.67	4742.83	-27	-0.57%			
標普三月	4789	4789	4784.5	4785	-36.5	-0.76%	9	263	+14
Nasdaq 100指數	16543.94	16543.94	16543.94	16543.94	-281.993	-1.68%			
那斯達十二月	16730	16730	16684	16700	-315	-1.85%	374	1746	-131

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

14.42 +0.06

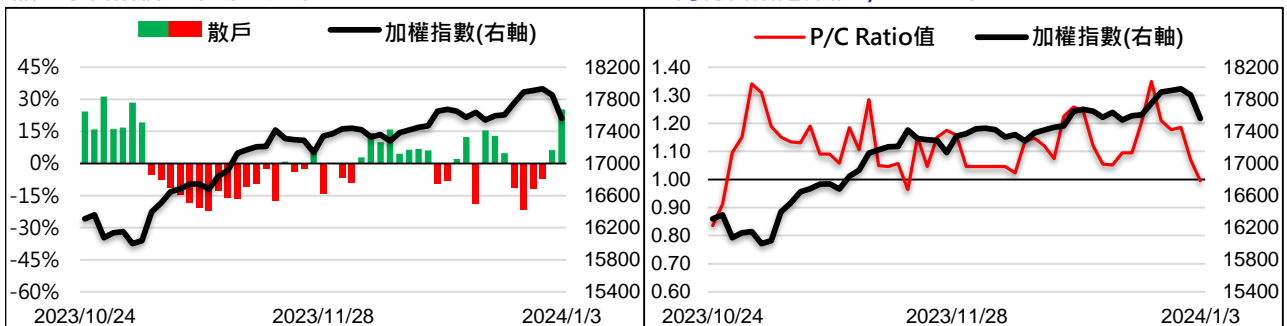


散户小台指佔全市場OI比率

25.25% +19.01%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.00 -0.07



永豐期貨研調

## 晶圓雙雄領跌下殺 台股長黑攪破月線

台指期週三下跌255點至17545點。價差方面，台指期逆價差縮至-14.31點，電子期逆價差縮至-1.34點，金融期逆價差縮至-0.9點。現貨部分，三大法人賣超285.37億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加8670口至-14629口，其中外資多單減碼且空單加碼，淨空單增加6606口至-24035口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加4407口至-15602口。

週二隨著美元、美債殖利率反彈回升，壓抑大型科技股漲多拉回，那指、標普500、費半在2024年首個交易日全面走軟，僅道瓊小漲0.07%，再創歷史收盤新高，終場四大指數漲跌幅落在-3.65%至+0.07%。受到美科技股下跌影響，週三台股以下跌24點跳空開出，由電子權值股領跌，加上台幣盤中再度走貶，形成股匯雙殺，指數一度重挫超過300點回測17500點關卡，盤面上電子權值股的台積電、聯電出現獲利了結賣壓，終場收跌超過2%，連帶祥碩、信驊等高價股延續跌勢，加上金融股無力撐盤，合庫金、兆豐金跌幅超過1.6%，大盤終場下跌294.48點收17559.31點。整體來看，台股以長黑K吞噬近一週以來漲幅，失守10日、月線，所幸價跌但量能沒有明顯增加，顯示市場較傾向觀望，而本週各國將陸續公布製造業 PMI 以及美國非農就業數據，投資人可密切注意相關資訊以及外資動向是否持續賣超台股。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在18000點，賣權未平倉最大量集中在17400點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.07降至1。VIX指數上漲0.06至14.42。整體選擇權籌碼面偏空。(永豐期貨研調)

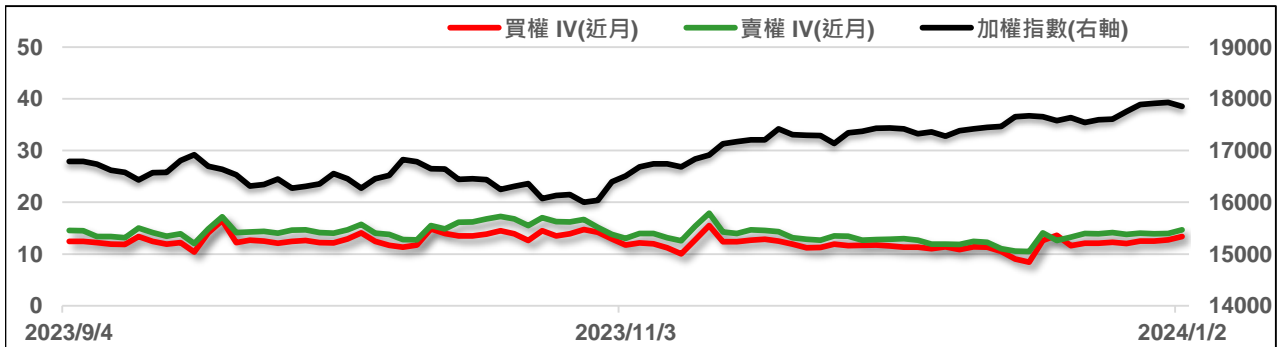
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 100.99% ▼				所有月份	P/C ratio = 99.52% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	46727	+16532	101666	+11268	Call	729547	+325316	178062	-68433
Put	32316	+7679	102669	+3583	Put	622854	+313271	177203	-86470

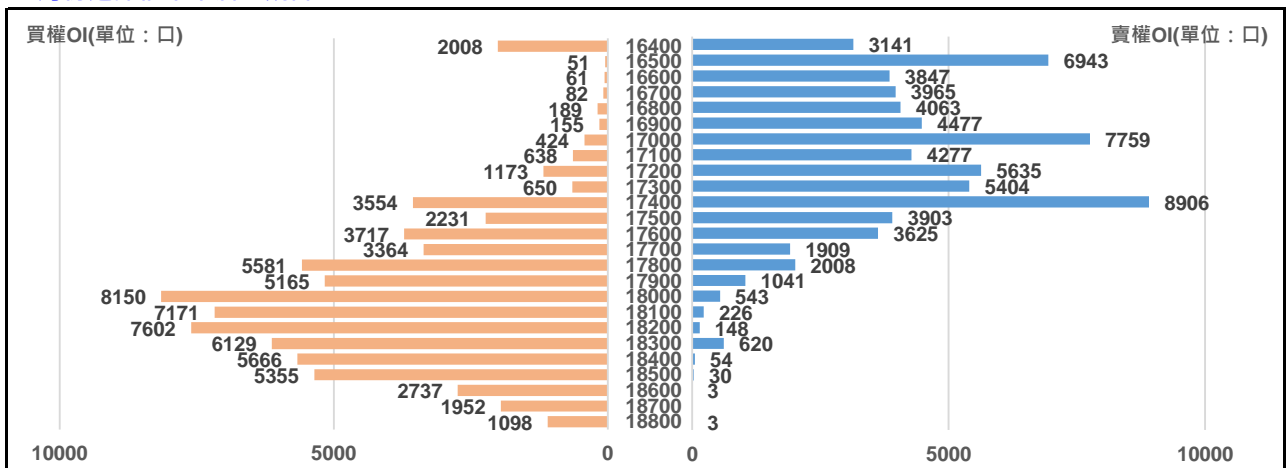
一月份台指選擇權

買權 IV = 13.5 ▲						賣權 IV = 14.87 ▲						
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
0.983	+1	156	7	-240	680	16900	29.5	+12.5	2090	4629	+152	-0.017
0.964	+3	427	23	-235	585	17000	40.5	+20	2943	7898	+139	-0.036
0.930	-13	625	119	-222	498	17100	53	+26	2583	4671	+394	-0.070
0.877	+41	1214	116	-218	417	17200	73	+36.5	2808	6278	+643	-0.123
0.801	+10	660	81	-210	345	17300	99	+51	3495	5141	-263	-0.199
0.754	0	5	48	0	307	17350	112	0	349	195	0	-0.246
0.702	+172	3726	440	-191	271	17400	130	+65	2983	8195	-711	-0.298
0.645	0	42	61	0	247	17450	150	0	271	160	0	-0.355
0.586	+276	2507	840	-173	217	17500	170	+83	2286	3795	-108	-0.414
0.524	0	293	472	0	190	17550	194	0	272	108	0	-0.476
0.463	+378	4095	1632	-152	166	17600	222	+105	2445	4107	+482	-0.537
0.402	0	346	606	0	145	17650	247	0	130	43	0	-0.598
0.343	+1130	4494	2529	-129	124	17700	275	+123	608	1765	-144	-0.657
0.289	0	420	755	0	104	17750	304	0	28	5	0	-0.711
0.239	+1851	7432	4335	-109	88	17800	342	+146	579	1718	-290	-0.761

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

第二週台指選擇權

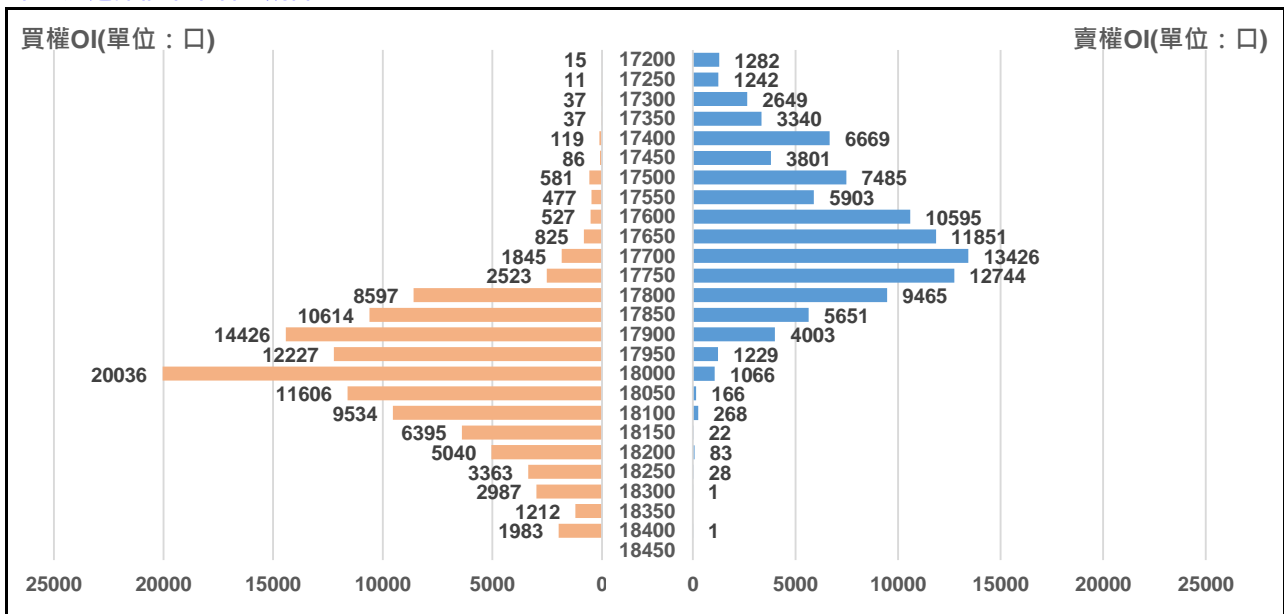
買權 IV = 11.39 ▲							賣權 IV = 12.16 ▼					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	結算	履約價	結算	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
0.976	+44	44	60	-245	475	17100	11	+7.4	3306	2339	+2082	-0.024
0.938	+14	14	28	-235	385	17200	18	+12.9	3854	2916	+2360	-0.062
0.906	+9	9	41	-227	343	17250	23.5	+16.9	2682	1789	+1482	-0.094
0.863	+7	13	17	-220	300	17300	31	+23.5	5778	3203	+925	-0.137
0.810	+50	52	72	-218	262	17350	39.5	+29.7	4059	2667	+2036	-0.190
0.745	+165	173	568	-216	217	17400	52	+39	4949	3148	+1989	-0.255
0.670	+331	336	512	-204	183	17450	68	+51	3530	3335	+1622	-0.330
0.588	+465	506	1183	-188	153	17500	84	+62.5	4295	2008	+902	-0.412
0.502	+712	719	1945	-177	123	17550	105	+74.5	3104	1610	+602	-0.498
0.416	+1734	1821	4523	-161	97	17600	129	+91	2969	1841	+635	-0.584
0.335	+1684	1819	3398	-144	76	17650	158	+107	1135	805	+342	-0.665
0.261	+4666	4893	7755	-125	57	17700	191	+124	2480	1038	+36	-0.739
0.196	+5583	5732	8181	-107	42	17750	227	+142	950	330	-56	-0.804
0.142	+3086	3577	7419	-89	30	17800	260	+154	616	429	-112	-0.858
0.100	+2519	3054	6260	-75	21	17850	303	+175	288	110	-66	-0.900
0.067	+4986	5792	15440	-60.5	13.5	17900	344	+182	152	86	-56	-0.933

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	0	0	0	0	0	0.0%
PUT	0	0	460	+460	-460	-1.3%

Contract	非特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	20058	+20058	23228	+23228	-3170	-6.0%
PUT	11530	+11530	15216	+15216	-3686	-10.5%

第二週選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調