

三大現貨買賣超(億元) (台幣31.129元 貶值2.6分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+27.39	+8.19	-42.30	-6.72
上櫃	-25.64	+6.56	-19.89	-38.97

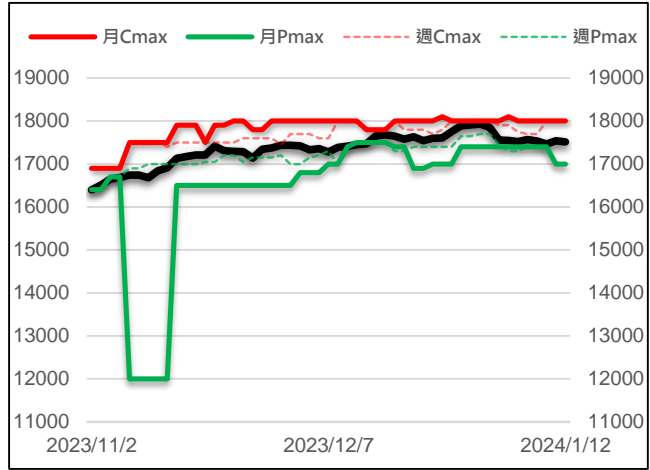
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	279	27.46%	609	64.58%
上櫃股票	251	26.34%	452	63.46%

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	23459	-	-
PUT	17000	14188	-	-

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	-26404	-1095	-21.3%	+8504	-577	6.9%	+1285	+607	1.0%
電子	-262	-151	-14.4%	+173	-5	9.5%	-255	+43	-14.0%
金融	-593	+10	-37.4%	+8	0	0.5%	-100	+8	-6.3%
CALL	+45128	-2010	17.5%	0	0	0	-8046	+4795	-3.1%
PUT	+51027	+1499	20.3%	-42	0	-0.0%	+10370	+6924	4.1%

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	-19180	+405	-1469	-2393	+5595	+706	+150	+2364	123674
電子	-377	-197	+36	+43	+97	-40	+8	+6	1824
金融	-651	-79	+23	+61	+274	+111	-20	-56	1585
CALL	+35238	+2239	+4139	-8686	-12080	+8930	+3049	+8144	257906
PUT	-21766	+3227	-19611	-5967	-2653	-12434	+943	+4238	251139

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	17536.05	17570.63	17469.87	17512.83	-32.49	-0.19%	2829.8億		
台指期一月	17466	17570	17447	17487	-83	-0.47%	83946	90295	-10358
台指期二月	17477	17562	17447	17481	-86	-0.49%	13081	16259	+9142
小型台指一月	17470	17570	17447	17487	-83	-0.47%	119975	45748	-5266
小型台指二月	17477	17560	17449	17481	-86	-0.49%	12610	13922	+1690
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	873.55	875.87	868.83	871.73	-2.42	-0.28%	2011.6億		
電子期一月	871.60	874.45	867.50	870.15	-5.65	-0.65%	1252	1441	-23
電子期二月	868.70	873.75	868.00	869.85	-5.3	-0.61%	103	131	+80
金融指數	1700.05	1700.05	1690.50	1695.68	-5.69	-0.33%	51.15億		
金融期一月	1696.2	1701.6	1689.4	1692.6	-12	-0.70%	619	1297	-74
金融期二月	1696.0	1701.0	1692.0	1693.8	-11.6	-0.68%	153	190	+139
櫃買指數	231.60	231.76	230.42	230.47	-1.24	-0.54%	702.39億		
櫃買期一月	231.05	231.05	230.40	230.40	-1.35	-0.58%	4	68	-2
非金電指數	14893.56	14928.27	14883.37	14911.88	+18.29	+0.12%	574.7億		
非金電期一月	14802	14953	14802	14900	-10	-0.07%	47	128	+4

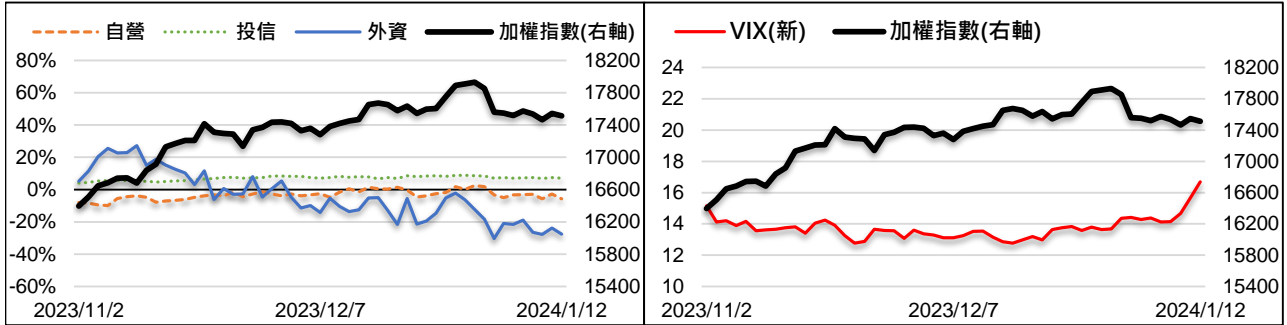
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	37747.14	37801.90	37424.28	37711.02	+15.29	+0.04%			
道瓊三月	37887	37909	37850	37855	-62	-0.16%	76	1434	-61
標普500指數	4792.13	4798.50	4739.58	4780.24	-3.21	-0.07%			
標普三月	4808	4808	4807.5	4807.5	-20.5	-0.42%	2	311	+48
Nasdaq 100指數	16820.90	16820.90	16820.90	16820.90	+27.856	+0.17%			
那斯達十二月	16963	16963	16928	16946	-56	-0.33%	349	2296	+57

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

16.69 +1.02



散户小台指佔全市場OI比率

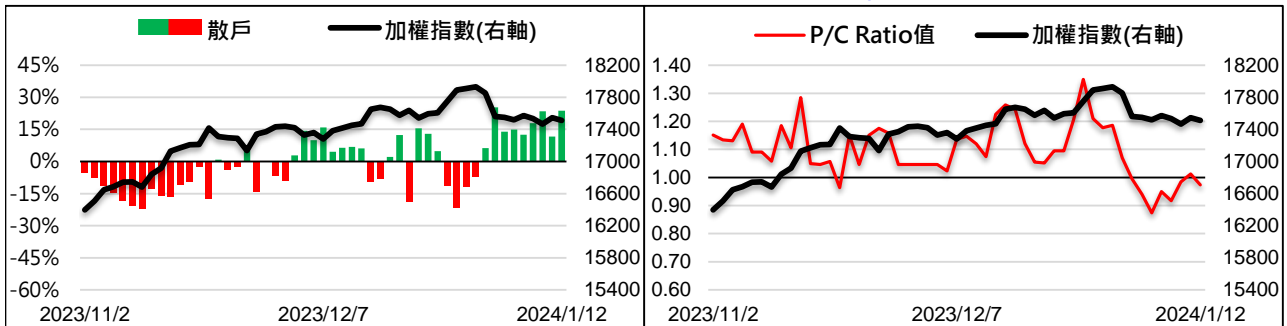
23.74%

+12.06%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

0.97

-0.04



永豐期貨研調

航運、光學族群撐盤 台股守17500點週線連二黑

台指期週五下跌83點至17487點。價差方面，台指期轉為逆價差-25.83點，電子期轉為逆價差-1.58點，金融期轉為逆價差-3.08點。現貨部分，三大法人賣超6.72億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加1065口至-16615口，其中外資多單減碼且空單加碼，淨空單增加1095口至-26404口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加1988口至-20649口。

週四在美國公布關鍵通膨12月CPI高於預期後，美股早盤走低，隨後因市場仍相信未來物價壓力將持續趨緩，美債殖利率下滑，帶動美股收復跌幅於平盤附近作收，終場四大指數漲跌幅落在-0.07%至+0.47%。隨著美股漲跌互見，週五加權指數以下跌9點開出，在航運、光學族群獲買盤挹注下，拉抬指數盤中一度翻紅小漲，但受到追價買盤無力拖累，指數再度翻黑，盤面上隨著紅海緊張情勢持續升溫，航運族群的貨櫃三雄表現強勁，軍工概念股漢翔、雷虎同樣收在平盤之上，大立光公布單季毛利重返五成，帶動先進光、玉晶光等光學族群收紅，然大盤終場仍不敵賣壓，下跌32.49點收17512.83點。整體來看，今日K開低震盪走低留上下影線黑棒作收，盤中回測17500點有守，顯示下檔有撐，隨著本週大選結果出爐，預計下週多空局勢將會較為明朗。

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17000點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.01降至0.97。VIX指數上漲1.02至16.69。整體選擇權籌碼面偏空。(永豐期貨研調)

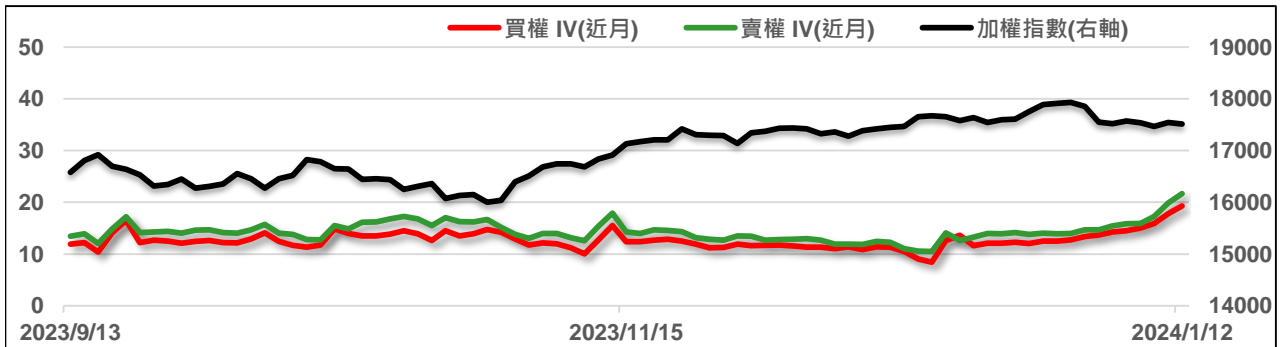
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 90.31% ▼				所有月份	P/C ratio = 97.38% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	104664	-19352	203448	+29716	Call	243486	+16308	257906	+37272
Put	94703	-15850	183730	+18592	Put	203780	+12685	251139	+27688

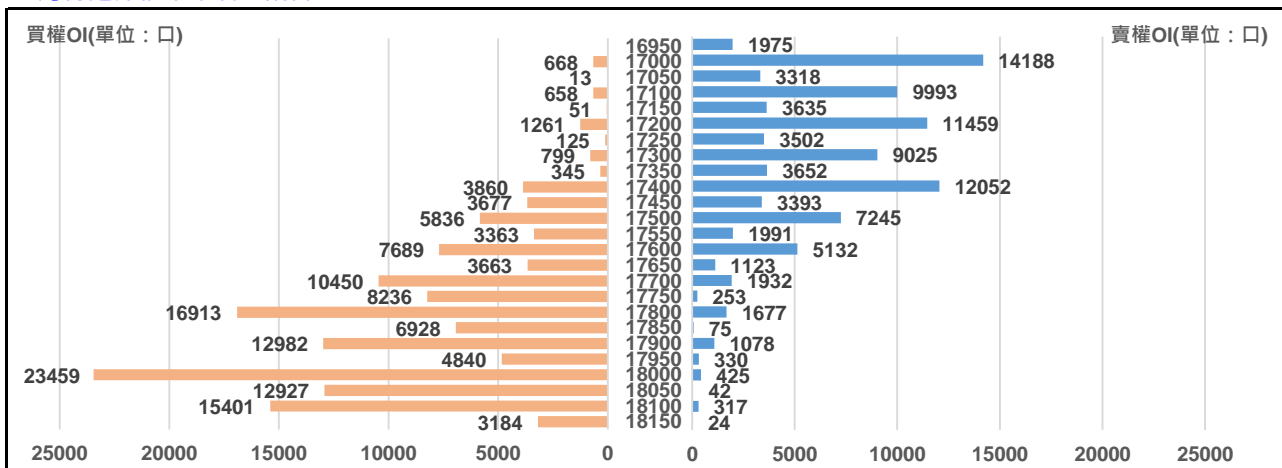
一月份台指選擇權

買權 IV = 19.29 ▲						賣權 IV = 21.68 ▲						
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
0.994	+1	13	3	-66	484	17050	47	+14.5	2247	3318	+742	-0.006
0.988	+10	658	139	-64	441	17100	53	+15.5	5963	9993	+1559	-0.012
0.977	-9	51	8	-66	399	17150	62	+17	3455	3635	+1118	-0.023
0.957	+30	1261	207	-64	361	17200	72	+19	6749	11459	+764	-0.043
0.925	+45	125	110	-61	321	17250	84	+22	4363	3502	+595	-0.075
0.879	-33	799	352	-61	284	17300	99	+25	8650	9025	+1079	-0.121
0.815	+53	345	695	-53	252	17350	113	+28	3132	3652	+128	-0.185
0.735	-282	3860	2160	-52	218	17400	130	+30	8963	12052	+45	-0.265
0.640	+903	3677	3402	-47	189	17450	153	+35	4065	3393	+54	-0.360
0.535	+938	5836	8372	-50	158	17500	173	+38	8829	7245	+364	-0.465
0.429	+918	3363	5267	-45	135	17550	199	+43	3976	1991	-11	-0.571
0.327	+985	7689	8976	-41	112	17600	224	+44	2587	5132	-212	-0.673
0.238	+516	3663	5638	-35	94	17650	254	+48	950	1123	+300	-0.762
0.164	+1269	10450	8790	-33	75	17700	290	+55	668	1932	+217	-0.836
0.107	+2269	8236	5467	-28	61	17750	317	+51	233	253	-5	-0.893

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