

三大現貨買賣超(億元) (台幣31.425元 貶值6.7分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+562.57	-11.09	+64.08	+615.56
上櫃	-6.25	-1.05	-70.76	-78.06

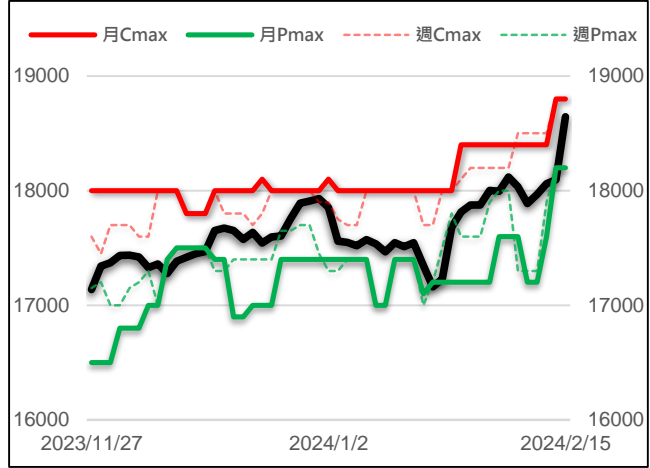
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	580	69.75%	329	25.63%
上櫃股票	490	65.39%	268	31.53%

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	18800 7121	- -
PUT	18200 10539	- -

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	-2653	+2841	-2.6%	+3546	+253	3.5%	-2784	-1209	-2.7%
電子	+236	+60	12.6%	+134	0	7.2%	-301	-17	-16.1%
金融	-719	-86	-43.7%	+9	0	0.5%	-9	+37	-0.5%
CALL	+32585	+7088	23.7%	-45	0	-0.0%	-8515	-4678	-6.2%
PUT	+16742	-10978	8.1%	+147	0	0.1%	-10368	-17769	-5.0%

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	-3512	-850	-3461	-2012	+4533	+3875	-1	-1	101920
電子	-59	-1	+75	+60	-41	-20	-16	-14	1872
金融	-918	-146	+33	+46	+173	+21	-19	-21	1646
CALL	+31489	+8429	+3752	-663	-14729	-5155	+1900	-7676	137270
PUT	-2433	+5708	-3927	+7336	-9495	-2667	-3529	+5065	206320

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	18664.45	18725.47	18550.86	18644.57	+548.5	+3.03%	5027.4億		
台指期二月	18590	18696	18531	18666	+581	+3.21%	112201	76320	+76320
台指期三月	18521	18666	18520	18641	+573	+3.17%	7943	10174	+10174
小型台指二月	18578	18696	18522	18666	+581	+3.21%	139042	39001	+39001
小型台指三月	18443	18666	18443	18641	+573	+3.17%	19895	15489	+15489
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	969.44	974.66	960.94	967.66	+42.49	+4.59%	3857.98億		
電子期二月	960.00	970.00	959.00	967.55	+44.4	+4.81%	1771	1375	+1375
電子期三月	949.30	968.60	949.30	966.90	+43.7	+4.73%	142	128	+128
金融指數	1674.87	1694.00	1674.81	1682.09	+6.76	+0.40%	95.12億		
金融期二月	1678.0	1696.6	1674.8	1682.2	+7.8	+0.47%	1190	1351	+1351
金融期三月	1678.0	1695.0	1678.0	1684.8	+8.2	+0.49%	58	93	+93
櫃買指數	240.34	242.52	240.02	242.51	+3.84	+1.61%	1350.41億		
櫃買期二月	241.50	242.60	241.00	242.60	+4	+1.68%	6	34	+34
非金電指數	14633.15	14633.15	14498.62	14614.31	-18.59	-0.13%	671.35億		
非金電期二月	14706	14706	14516	14664	+5	+0.03%	106	173	+173

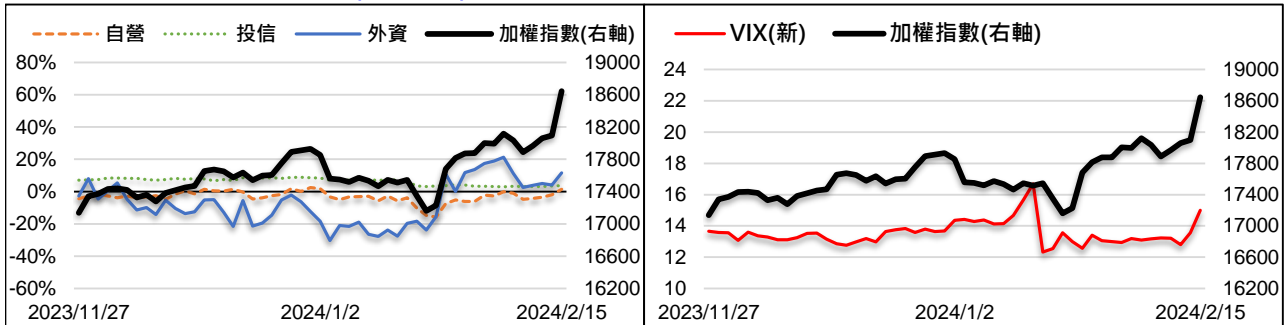
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38372.67	38442.56	38194.62	38424.27	+151.52	+0.40%			
道瓊三月	38500	38518	38460	38516	-144	-0.37%	267	1186	+1186
標普500指數	4976.44	5002.52	4956.45	5000.62	+47.45	+0.96%			
標普三月	5017.25	5019	5012	5016.5	+48.25	+0.97%	27	183	+183
Nasdaq 100指數	17728.90	17815.18	17619.92	17807.63	+207.21	+1.18%			
那斯達十二月	17874	17890	17856	17885	+197	+1.11%	643	2564	+2564

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

14.99 +1.43



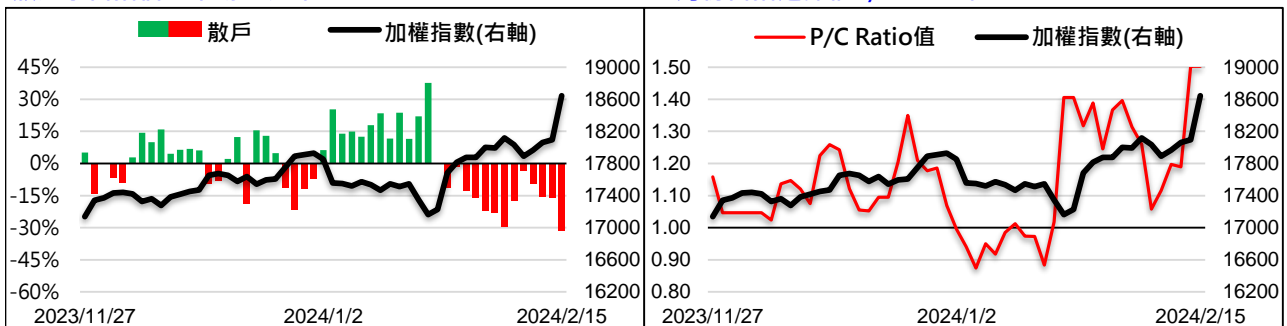
散户小台指佔全市場OI比率

-31.78%

-15.45%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.50 +0.31



永豐期貨研調

金龍年開紅盤 台積電助攻台股創歷史新高

台指期週四上漲581點至18666點。價差方面，台指期轉為正價差21.43點，電子期逆價差縮至-0.11點，金融期轉為正價差0.11點。現貨部分，三大法人買超615.56億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少1885口至-1891口，其中外資多單加碼超過空單加碼，淨空單減少2841口至-2653口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加2862口至-6973口。

由於週二公佈美國CPI意外呈通膨回升跡象，重挫市場降息預期，不過在Lyft、Uber飛漲，以及Nvidia公布財報前夕，股價勁揚2.46%創歷史新高所激勵下，終場四大指數全面跳高，漲幅+0.4%至+2.18%。隨著美股走揚，週四加權指數開紅盤啟動補漲行情，由權值股領軍帶動台股開盤漲逾600點，一舉突破歷史新高，其中權王台積電大漲51元，收697元創新高，市值二哥聯發科漲幅超過3.7%，AI概念族群漲勢強勁，奇鋐、技嘉、昆盈等股同步亮燈漲停，PCB伺服器族群的台積電大漲逾9%，金像電放量漲停作收，終場大盤漲幅微幅收斂，上漲548點收18644.57點。整體來看，美股持續盤堅向上，帶動台股價漲量增突破歷史新高價，多方格局不變，惟短線漲多要提防獲利了結賣壓，投資人仍須居高思危。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在18800點，賣權未平倉最大量集中在18200點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.19升至1.5。VIX指數上漲1.43至14.99。整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

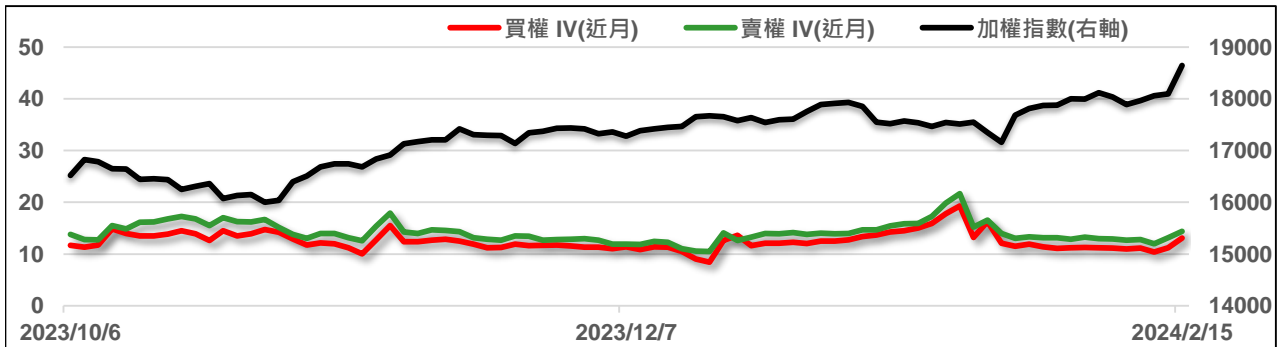
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 163.01% ▲				所有月份	P/C ratio = 150.30% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	110119	+83194	95089	+5769	Call	465100	+270645	137270	-65224
Put	130336	+105598	155007	+42856	Put	455336	+256967	206320	-34528

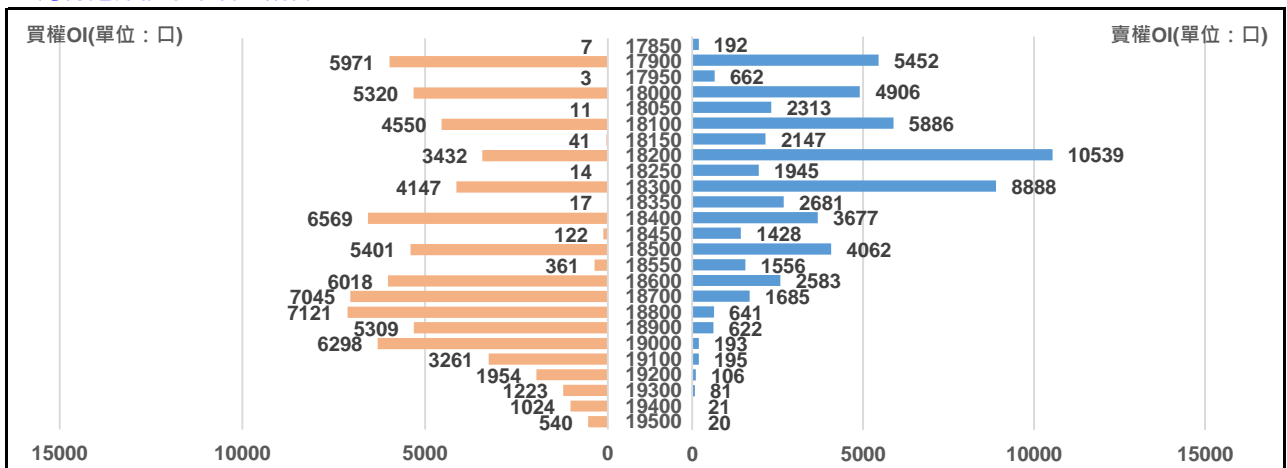
二月份台指選擇權

買權 IV = 13.12 ▲							賣權 IV = 14.36 ▲					
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
0.908	0	41	45	0	530	18150	11.5	0	3135	2147	0	-0.092
0.884	-1672	3432	3551	+362	482	18200	15.5	-221.5	13976	10539	+9679	-0.116
0.856	0	14	23	0	435	18250	18.5	0	3342	1945	0	-0.144
0.823	-1817	4147	4514	+306	390	18300	25.5	-275.5	13825	8888	+8519	-0.177
0.787	0	17	55	0	347	18350	31	0	5038	2681	0	-0.213
0.746	-2140	6569	7713	+248	304	18400	39	-331	8694	3677	+3347	-0.254
0.702	0	122	319	0	265	18450	49.5	0	2607	1428	0	-0.298
0.655	-3014	5401	9404	+193	228	18500	62	-392	9670	4062	+3780	-0.345
0.605	0	361	986	0	196	18550	77	0	3435	1556	0	-0.395
0.554	-2285	6018	13911	+141	163	18600	96	-439	7124	2583	+2477	-0.446
0.450	+1026	7045	13869	+94	108	18700	141	-489	7220	1685	+1661	-0.550
0.350	+4499	7121	14536	+60.6	69	18800	200	-530	1599	641	+618	-0.650
0.260	+2821	5309	12688	+37	42	18900	278	-542	976	622	+568	-0.740
0.184	+4573	6298	10424	+20.4	24	19000	354	-566	412	193	+172	-0.816
0.124	+2335	3261	5243	+8.9	11.5	19100	448	-572	526	195	+194	-0.876

近月選擇權IV走勢圖



二月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調