

三大現貨買賣超(億元) (台幣31.659元 貶值6.6分)

	外資	投信	自營	合計
上市	-86.35	+132.06	+3.93	+49.64
上櫃	-5.61	+13.10	-51.96	-44.47

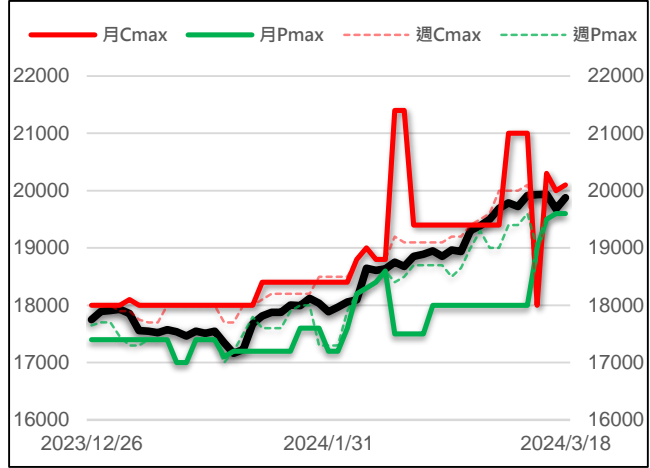
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	587	67.40%	333	28.76%
上櫃股票	466	62.98%	273	23.52%

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	20100	20251	-	-
PUT	19600	21119	-	-

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	-10404	+1294	-9.8%	+3789	-30	3.6%	-1933	-1008	-1.8%
電子	+202	-25	8.4%	+133	+1	5.5%	-450	-20	-18.6%
金融	-694	+11	-27.8%	+8	0	0.3%	-207	+13	-8.3%
CALL	+44024	+2991	15.3%	0	0	0	+16817	+6402	5.9%
PUT	+41461	+2974	11.3%	-72	0	-0.0%	+15759	+4959	4.3%

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	-11590	-358	-811	+3543	+7427	-1222	+861	-909	106128
電子	-126	-208	+239	+233	-18	+49	-70	-127	2413
金融	-909	+238	-121	-141	+406	-89	-80	+90	2499
CALL	+45063	+1816	+2906	+301	-12842	-716	+10882	+2729	287373
PUT	-26688	-810	-6140	-702	-9169	-5946	-4567	+1249	367608

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	19706.11	19879.86	19706.11	19879.85	+197.35	+1.00%	4255.4億		
台指期三月	19778	19920	19747	19914	+186	+0.94%	100312	54819	-19848
台指期四月	19787	19940	19773	19935	+187	+0.95%	30381	34356	+20167
小型台指三月	19786	19918	19747	19914	+186	+0.94%	120918	35622	-963
小型台指四月	19790	19936	19773	19935	+187	+0.95%	22296	20106	+2967
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	1028.72	1042.22	1028.72	1041.97	+15.13	+1.47%	2814.72億		
電子期三月	1032.85	1044.50	1031.65	1044.10	+13.25	+1.29%	1162	1574	-149
電子期四月	1034.00	1045.70	1033.05	1045.70	+14.05	+1.36%	339	491	+308
金融指數	1816.07	1820.58	1799.94	1806.13	-10.14	-0.56%	123.88億		
金融期三月	1821.0	1824.8	1806.0	1810.0	-4	-0.22%	1166	1323	+274
金融期四月	1828.6	1829.8	1812.4	1815.4	-4.4	-0.24%	430	917	+1
櫃買指數	246.63	249.69	246.63	249.63	+3.26	+1.32%	940.46億		
櫃買期四月	250.70	250.70	249.50	249.50	+3.00	+1.22%	3	18	0
非金電指數	15030.5	15082.25	15014.35	15082.25	+50.43	+0.34%	1009.99億		
非金電期四月	15063	15098	15055	15086	+51	+0.34%	31	45	+12

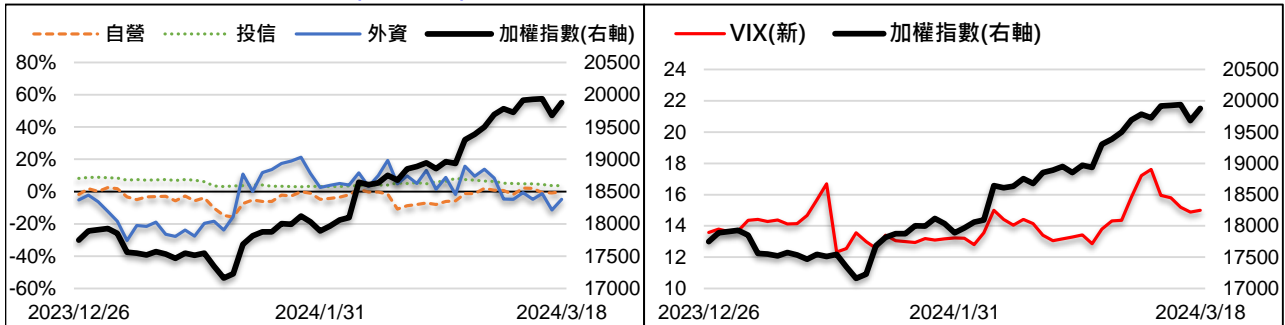
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38809.65	38928.13	38618.20	38714.77	-190.89	-0.49%			
道瓊六月	39115	39189	39110	39189	+310	+0.80%	96	605	+61
標普500指數	5123.31	5136.86	5104.35	5117.09	-33.39	-0.65%			
標普六月	5188	5198.75	5188	5198.75	+47.75	+0.93%	21	233	+121
Nasdaq 100指數	18014.81	18014.81	18014.81	18014.81	0	0			
那斯達十二月	18090	18165	18088	18165	+196	+1.09%	510	1301	-559

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

14.99 +0.10



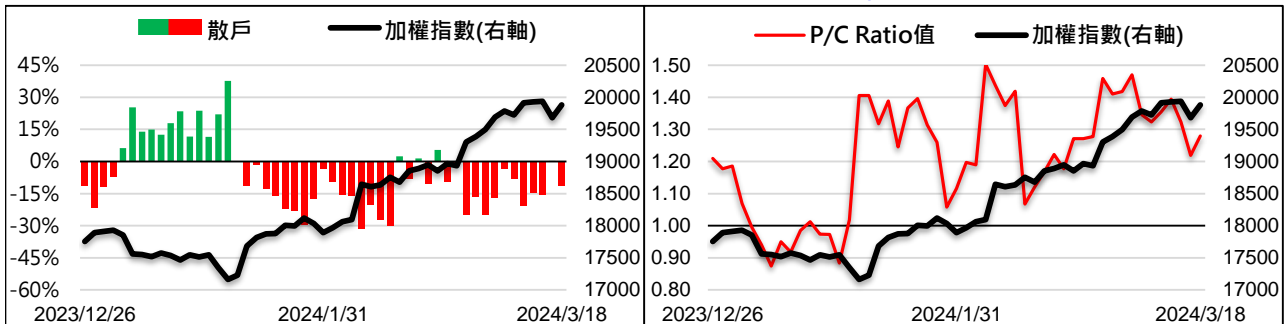
散戶小台指佔全市場OI比率

-11.67%

-11.90%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.28 +0.06



永豐期貨研調

台積電上演秒填息 大盤漲逾200點收復所有均線

台指期週一上漲186點至19914點。價差方面，台指期正價差縮至34.15點，電子期正價差縮至2.13點，金融期轉為正價差3.87點。現貨部分，三大法人買超49.64億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少256口至-8548口，其中外資多單加碼且空單減碼，淨空單減少1294口至-10404口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單減少3185口至-12401口。

上週五由於美股適逢三巫日、美債殖利率回升以及市場靜待本週央行會議，使投資人風險情緒轉弱，蘋果、微軟等大型科技股普遍走跌，美股四大指數全盤盡墨，跌幅介於-0.96%至-0.49%。週一台股與美股不同調，早盤以上漲23點跳空開出後，隨著主要權值股回神、重電及光電族群助攻下，推升大盤漲點擴大而逐步拉抬，盤面上權王台積電今開盤秒填息，終場勁揚1.87%，連帶鴻海、聯發科同步上攻，漲幅雙雙達3%之上，重電族群同樣偏強表現，其中士電攻上漲停，中興電、玖鼎電力、華城等漲幅都在4%-5%，帶動大盤終場勁揚197.35點收19879.85點。整體來看，台股今收短紅K棒，完全回補上週五黑K跌幅，並收復短均，不過成交量急凍至約4200億附近，顯示Fed在公布利率決議前，盤勢轉趨觀望，投資人仍須留意追高風險。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在20100點，賣權未平倉最大量集中在19600點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.22升至1.28。VIX指數上漲0.1至14.99點。整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

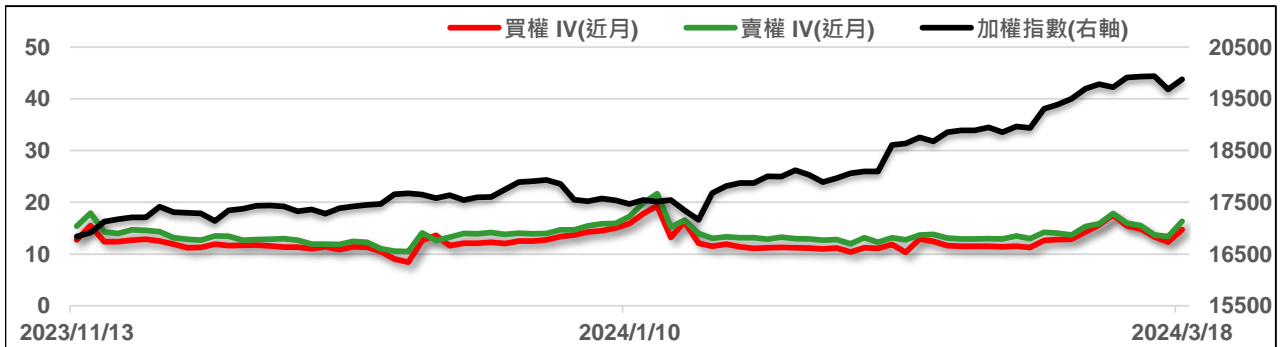
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 123.55% ▲				所有月份	P/C ratio = 127.92% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	199456	-28204	233607	+9701	Call	350437	-11717	287373	+17102
Put	234736	+27543	288615	+29169	Put	378264	+50619	367608	+38151

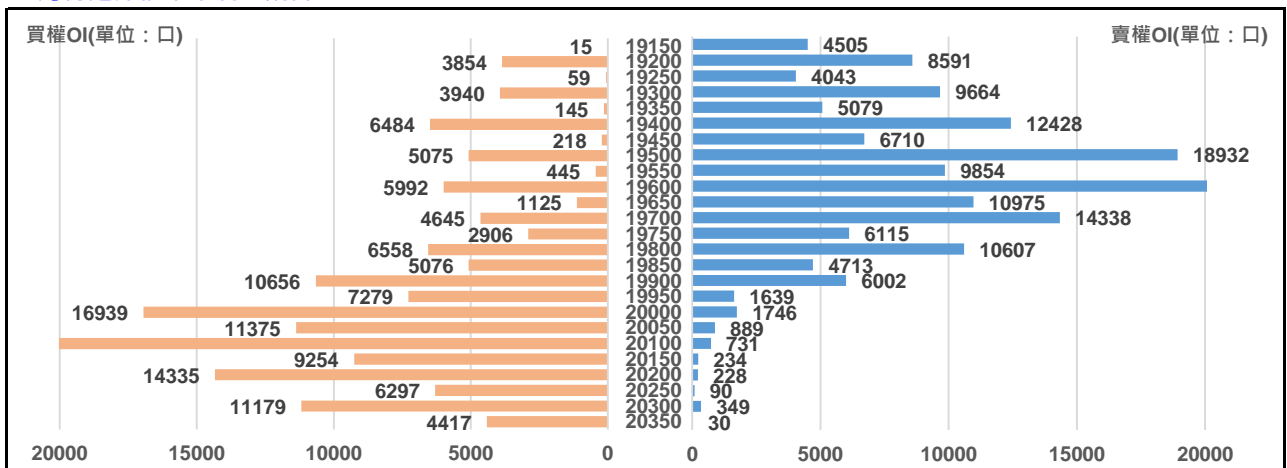
三月份台指選擇權

買權 IV = 14.72 ▲							賣權 IV = 16.34 ▲						
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	
0.997	-1	218	9	+159	468	19450	4	-27	9526	6710	+1042	-0.003	
0.992	+134	5075	580	+149	418	19500	5.4	-35.1	24541	18932	+2976	-0.008	
0.982	+164	445	348	+141	375	19550	7	-46	16303	9854	+2443	-0.018	
0.962	+115	5992	1187	+133	328	19600	10	-55	32911	21119	+4080	-0.038	
0.927	+132	1125	3598	+116	278	19650	14.5	-67.5	20758	10975	+3980	-0.073	
0.873	+334	4645	7805	+104	237	19700	20.5	-81.5	23634	14338	+4252	-0.127	
0.795	+450	2906	11928	+91	196	19750	30.5	-95.5	19235	6115	+2709	-0.205	
0.695	-373	6558	19737	+78	161	19800	43	-110	21280	10607	+3946	-0.305	
0.579	+998	5076	17671	+63	127	19850	60	-125	11489	4713	+2294	-0.421	
0.455	+709	10656	21310	+49.5	97	19900	80	-136	9545	6002	+1397	-0.545	
0.335	+2147	7279	18601	+39	74	19950	107	-148	2233	1639	+85	-0.665	
0.231	+469	16939	25237	+29	54	20000	137	-160	2289	1746	-169	-0.769	
0.148	+1793	11375	11863	+19.5	38	20050	171	-171	579	889	-3	-0.852	
0.088	+4447	20251	17389	+14.5	27.5	20100	212	-173	224	731	+25	-0.912	
0.048	+2320	9254	8067	+9	19	20150	259	-173	31	234	-22	-0.952	

近月選擇權IV走勢圖



三月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調