

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.02元 升值7.8分)

	外資	投信	自營	合計
上市	-2.41	-6.27	+3.86	-4.82
上櫃	+19.14	-4.90	-9.82	+4.42

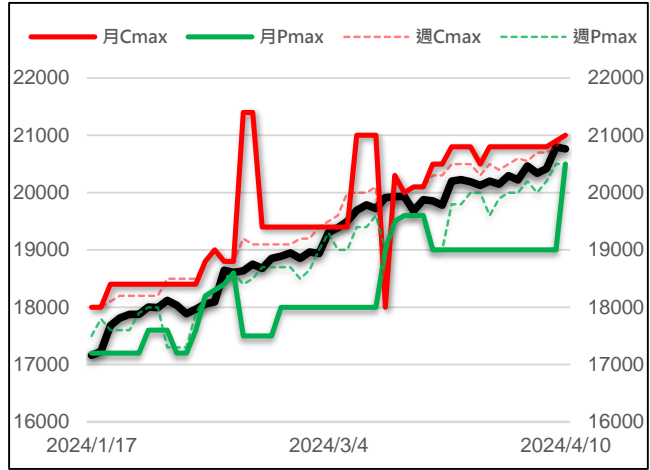
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	529	31.16%	380	64.03%
上櫃股票	425	53.87%	315	40.31%

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	21000	8240	-	-
PUT	20500	9361	-	-

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	-1710	-6874	-1.7%	+8306	-55	8.4%	-7214	+2044	-7.3%
電子	+123	-123	6.9%	+158	+26	8.9%	-525	+21	-29.5%
金融	-694	-20	-31.6%	+7	0	0.3%	-360	-16	-16.4%
CALL	+22549	+994	15.9%	+20	0	0.0%	+16745	-15385	11.8%
PUT	+32942	+3046	17.0%	-72	0	-0.0%	-5575	+13019	-2.9%

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	-39	-7402	-5	+1617	+2337	+3383	-44	-2308	98477
電子	-32	-72	-4	-50	-5	-28	+2	+33	1779
金融	-871	+7	-120	-48	+243	+5	+89	+8	2196
CALL	+19985	+1797	+1492	+519	-5397	-5878	+5948	-5334	141593
PUT	-24078	-1023	-5453	-1108	+19386	-2465	-10125	-10264	193925

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	20789.42	20883.69	20763.53	20763.53	-32.67	-0.16%	4316.2億		
台指期四月	20822	20892	20804	20848	-21	-0.10%	75731	74809	-2465
台指期五月	20863	20916	20828	20876	-15	-0.07%	2076	6375	+686
小型台指四月	20821	20892	20804	20848	-21	-0.10%	112679	47958	-6809
小型台指五月	20830	20914	20830	20876	-15	-0.07%	8493	13616	-36
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	1094.27	1099.92	1092.72	1092.72	-2.64	-0.24%	2676.95億		
電子期四月	1098.55	1100.55	1094.25	1098.10	-1.8	-0.16%	822	1415	-6
電子期五月	1097.65	1100.00	1096.80	1099.15	-0.85	-0.08%	30	78	+7
金融指數	1839.84	1844.31	1831.04	1832.24	-6.69	-0.36%	95.79億		
金融期四月	1846.4	1848.6	1835.0	1836.2	-10.2	-0.55%	525	1861	+63
金融期五月	1853.4	1853.4	1840.8	1841.6	-8.6	-0.46%	63	103	-6
櫃買指數	255.19	256.96	255.19	255.93	+1	+0.39%	1134.56億		
櫃買期四月	256.95	256.95	256.50	256.50	+1.55	+0.61%	6	76	-6
非金電指數	15763.97	15840.1	15756.93	15773.56	+30.66	+0.19%	1313.04億		
非金電期四月	15834	15840	15800	15821	+13	+0.08%	40	163	-2

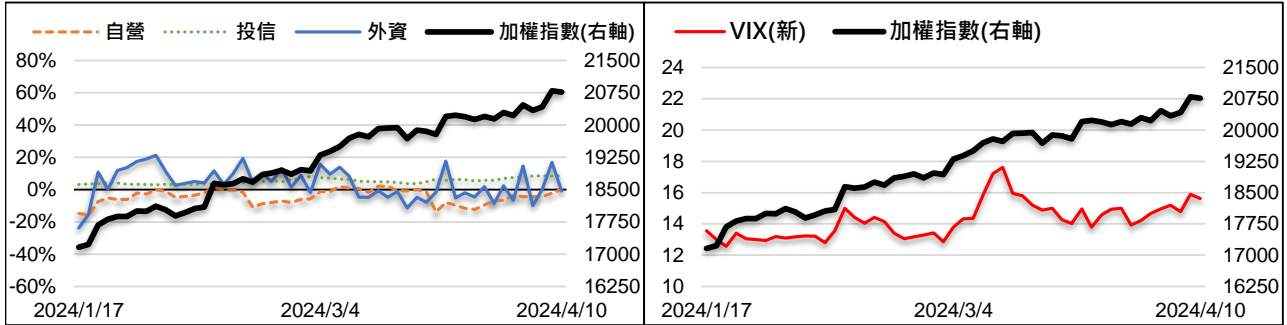
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38983.66	38992.89	38572.09	38883.67	-9.13	-0.02%			
道瓊六月	39230	39242	39209	39216	-19	-0.05%	81	610	-42
標普500指數	5217.03	5224.81	5160.78	5209.91	+7.52	+0.14%			
標普六月	5269.5	5269.5	5269.5	5269.5	+7.5	+0.14%	0	399	+13
Nasdaq 100指數	18169.90	18169.90	18169.90	18169.90	+69.713	+0.39%			
那斯達十二月	18392	18399	18373	18392	+54	+0.29%	236	2956	-185

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

15.62 -0.28

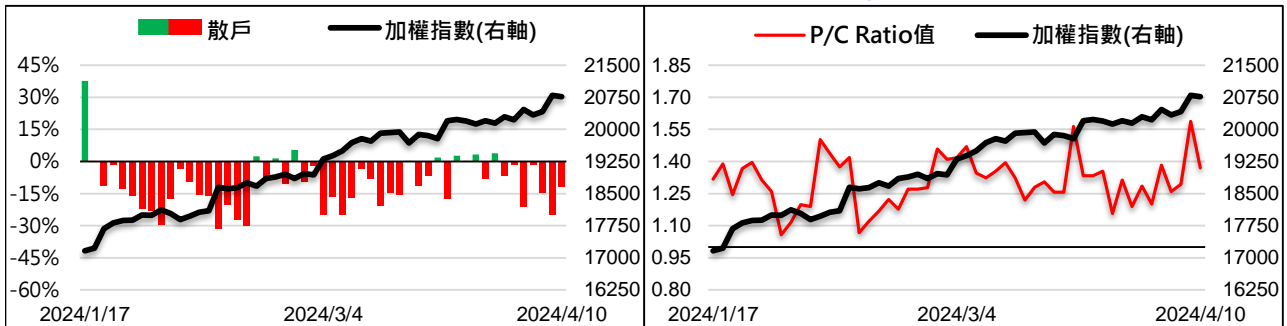


散户小台指佔全市場OI比率

-12.12% +12.96%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.37 -0.22



永豐期貨研調

生技、營建族群逆勢撐盤 台股創高後湧現賣壓

台指期週三下跌21點至20848點。價差方面，台指期正價差擴至84.47點，電子期正價差擴至5.38點，金融期正價差縮至3.96點。現貨部分，三大法人賣超4.82億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加4885口，使留倉部位轉為淨空單-618口，其中外資多單減碼且空單加碼，淨空單增加6874口，留倉部位轉為淨空單-1710口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加5785口，使留倉部位轉為淨空單-44口。

週二市場靜待通膨數據公布，目前經濟家預期3月CPI及核心CPI的月增率都將達到0.3%，雙雙低於2月的0.4%，美股四大指數漲多跌少，幅度介於-0.02%至+0.94%。週三加權指數早盤延續昨日強勁表現，其中部份主要權值股熄火，由生技、營建等族群接棒，盤中一度最高來到20883.69點創下歷史新高，然衝高之際引發獲利了結賣壓，拖累指數拉回平盤狹幅震盪，盤面上權值股的台積電、鴻海熄火，不過聯發科、聯電逆勢勁揚，生技族群為今日撐盤要角，其中沛爾生醫、光麗-KY等股強攻漲停，保瑞、台耀也同步走強，然終場大盤仍不敵賣壓，下跌32.67點收20763.53點。整體來看，受主要權值股熄火影響，台股日K以上影線黑K作收，加上指數臨近21000點關卡，買盤追價意願收斂，考量本周美國還有多項重磅經濟數據公布，預期盤勢延續高檔震盪格局。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在21000點，賣權未平倉最大量集中在20500點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.59降至1.37。VIX指數下跌0.28至15.62。整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

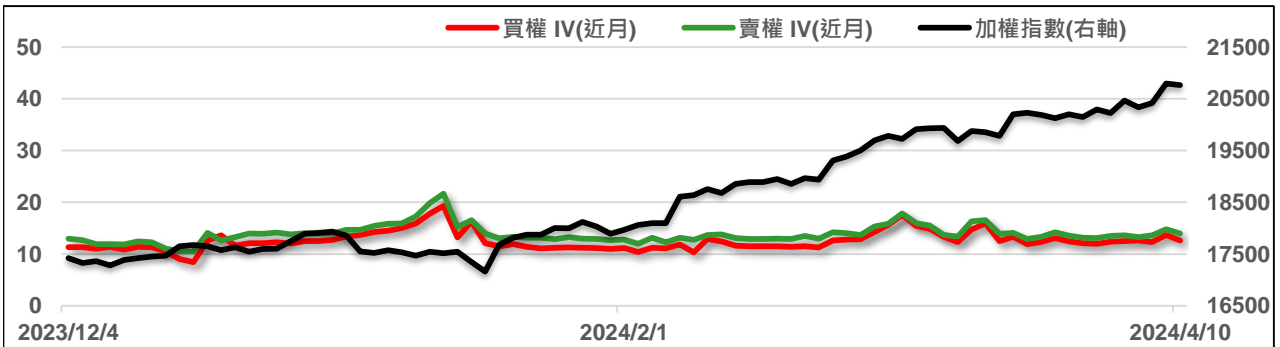
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 120.55% ▼				所有月份	P/C ratio = 136.96% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	73432	-9682	112056	+23401	Call	612979	+44260	141593	-61638
Put	79008	-19340	135088	+21947	Put	643748	-37833	193925	-128698

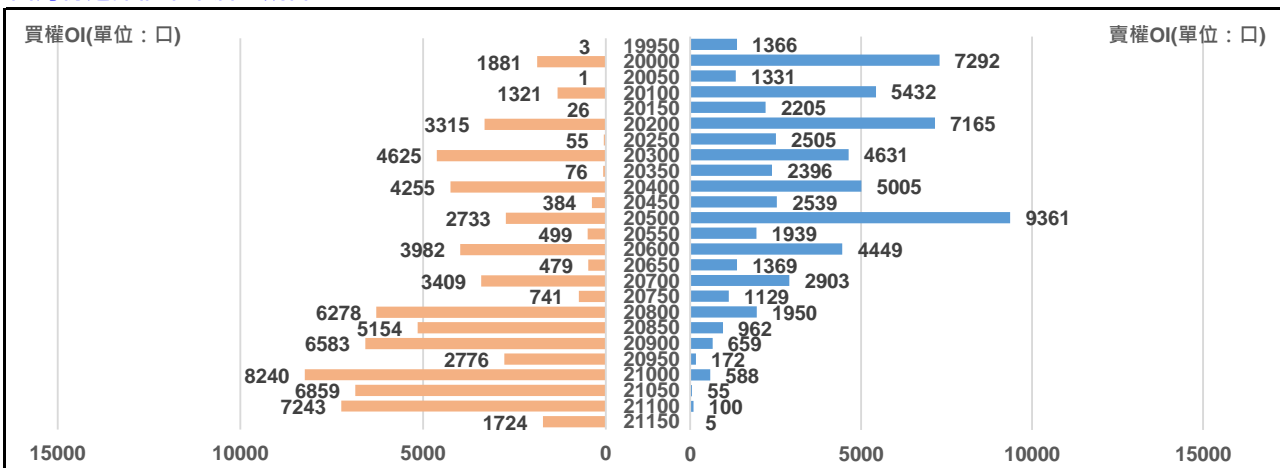
四月份台指選擇權

買權 IV = 12.62 ▼							賣權 IV = 13.98 ▼					
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
0.898	-53	4625	179	-35	560	20300	17.5	-8	3717	4631	+1585	-0.102
0.872	-3	76	23	-30	520	20350	21.5	-9	2323	2396	+1677	-0.128
0.841	+674	4255	266	-29	476	20400	27	-9	4808	5005	+1283	-0.159
0.806	+6	384	24	-24	435	20450	34	-9.5	2717	2539	+1656	-0.194
0.767	-75	2733	452	-30	390	20500	42	-10	8023	9361	+3937	-0.233
0.724	+63	499	156	-27	351	20550	50	-11	3527	1939	-78	-0.276
0.677	-86	3982	1235	-35	310	20600	62	-11	5320	4449	+952	-0.323
0.627	-27	479	301	-33	272	20650	74	-14	3714	1369	+724	-0.373
0.576	-258	3409	1698	-33	243	20700	90	-12	5764	2903	+1346	-0.424
0.523	-6	741	1034	-34	206	20750	107	-12	2995	1129	+662	-0.477
0.469	+218	6278	4150	-31	178	20800	128	-11	4495	1950	+1007	-0.531
0.417	+601	5154	4195	-34	148	20850	149	-13	2309	962	+730	-0.583
0.366	-66	6583	7001	-33	125	20900	176	-12	1471	659	+315	-0.634
0.317	+743	2776	3974	-33	103	20950	204	-14	662	172	+133	-0.683
0.272	+2044	8240	7063	-30	85	21000	234	-13	1152	588	+363	-0.728

近月選擇權IV走勢圖



四月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調