

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.478元 升值1.2分)

	外資	投信	自營	合計
上市	-222.16	+14.66	-54.10	-261.60
上櫃	+14.17	+10.22	-56.30	-31.91

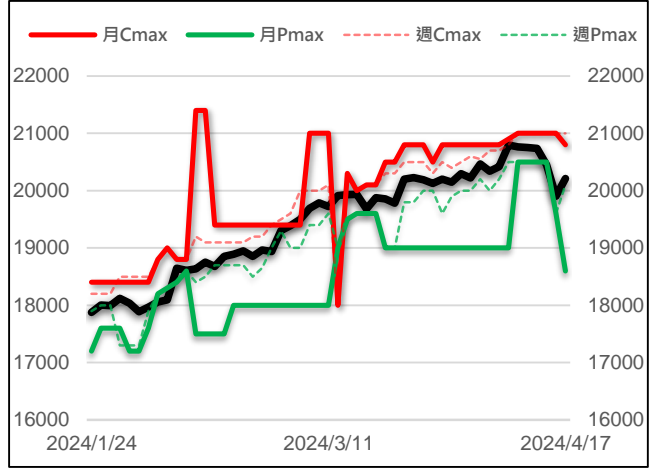
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	814	80.28%	135	15.15%
上櫃股票	684	81.18%	89	16.11%

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	20800	3178	-	-
PUT	18600	4147	-	-

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	-17952	+434	-22.0%	+9068	-138	11.1%	-2650	+660	-3.3%
電子	+147	+127	14.3%	+125	-22	12.2%	-333	+198	-32.4%
金融	-380	+116	-31.9%	+7	0	0.6%	-95	+144	-8.0%
CALL	+15286	-27627	13.1%	0	-100	0	+12583	+23371	10.8%
PUT	+25147	-15808	17.8%	-166	-254	-0.1%	+7510	+14479	5.3%

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	-8328	-4590	-76	+7845	+2400	+2508	-363	-2611	81460
電子	+118	+160	0	-107	-80	-106	0	+83	1028
金融	-521	-340	0	+493	+224	+234	0	-141	1192
CALL	+9204	-22163	+3446	-7681	-2902	+61800	+5416	+5217	116410
PUT	-10864	+9636	-4837	+4096	+3931	-12225	-12027	-142	141624

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	19986.62	20264.99	19986.62	20213.33	+311.37	+1.56%	4102.5億		
台指期四月	19942	20289	19927	20238	+291	+1.46%	73085	14384	-12868
台指期五月	19979	20242	19955	20189	+207	+1.04%	78050	68100	+10386
小型台指四月	19946	20284	19927	20238	+291	+1.46%	113801	12721	-18601
小型台指五月	19969	20241	19956	20189	+207	+1.04%	96426	33758	+9077
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	1046.67	1061.81	1046.67	1059.01	+18.4	+1.77%	2377.98億		
電子期四月	1043.00	1062.00	1041.90	1060.10	+14.85	+1.42%	642	703	-350
電子期五月	1045.45	1062.00	1045.45	1059.30	+12	+1.15%	1344	897	+192
金融指數	1778.33	1795.13	1775.10	1787.74	+10.07	+0.57%	101.91億		
金融期四月	1781.8	1794.0	1771.2	1792.6	+12.8	+0.72%	533	575	-245
金融期五月	1787.8	1798.0	1777.2	1795.6	+12.6	+0.71%	934	1115	+311
櫃買指數	245.81	250.41	245.81	250.33	+4.81	+1.96%	1061.15億		
櫃買期四月	249.00	250.20	248.50	250.25	+5.95	+2.44%	13	40	-2
非金電指數	15352.8	15584.59	15352.8	15549.33	+217	+1.42%	1359.56億		
非金電期四月	15441	15582	15436	15566	+296	+1.94%	129	133	-10

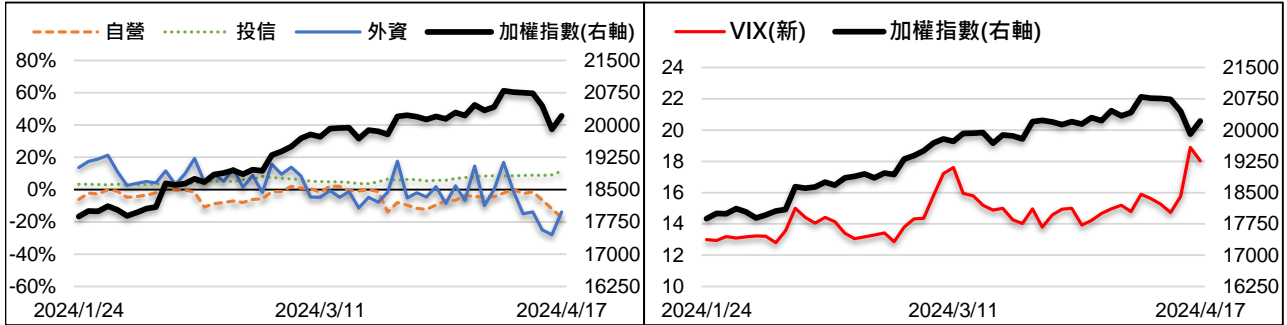
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	37992.22	37992.22	37713.70	37798.97	+63.86	+0.17%			
道瓊六月	38110	38164	38075	38130	+153	+0.40%	79	721	-53
標普500指數	5064.59	5079.84	5039.83	5051.41	-10.41	-0.21%			
標普六月	5099	5107.5	5099	5100	+9	+0.18%	8	429	-57
Nasdaq 100指數	17713.66	17713.66	17713.66	17713.66	+6.8318	+0.04%			
那斯達十二月	17915	17947	17898	17901	+21	+0.12%	320	2940	+24

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

18.03 -0.86

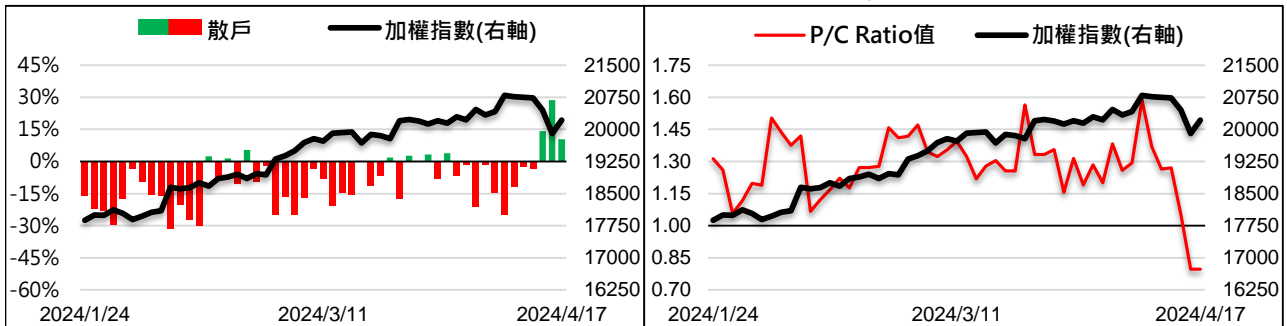


散戶小台指佔全市場OI比率

10.44%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.22 +0.42



永豐期貨研調

月結算強彈逾300點 台指開高走高收復2萬大關

5月份台指期週三上漲+206點至20189點。價差方面，台指期為逆價差-24.33點，電子期正價差0.29點，金融期為正價差7.86點。現貨部分，三大法人賣超261.6億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少956口至-11534口，其中外資空單減碼超過多單減碼，淨空單減少434口至-17952口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單減少3255口至-8404口。

週二美國聯準會主席鮑爾表示通膨欠缺進展，暗示央行不急著降息，使得2年期美債一度衝破5%，美股四大指數漲跌互見，幅度介於-0.21%至+0.89%。週二加權指數一開盤跳空開高突破兩萬大關，雖早盤較為震盪，但十點後台積電、鴻海再次展開攻勢向上收復失地，帶動台股突破20200關卡，下午1點後台指結算期間4月份台指期甚至一度衝高至20289，終場台股上漲311.37點收20213.33點，4月台指期則結算於20238點。權值股方面，台積電最終上漲2.03%、聯發科下跌0.47%、鴻海上漲3.9%、廣達上漲2%，而今日強勢的類股為政策主導以及近期事件所帶動的重電類股和散熱類股。整體來看，台股今日跳高開出並以長紅K突破2萬大關，表示2萬大關有強力支撐，且收復昨日近七成跌幅，但目前技術線型已轉弱，短期內盤勢恐成震盪整理格局，後續投資人也須密切關注以伊衝突。

4月合約結算後，目前5月選擇權未平倉最大量支撐壓力區為18600~20800點，但OI量仍僅3000~4000多口，參考性不大。全月份未平倉量put/call ratio值為1.22，但目前期交所VIX指數僅小跌0.86點至18.03點，屬於相對高位。整體選擇權籌碼面為中性。(永豐期貨研調)

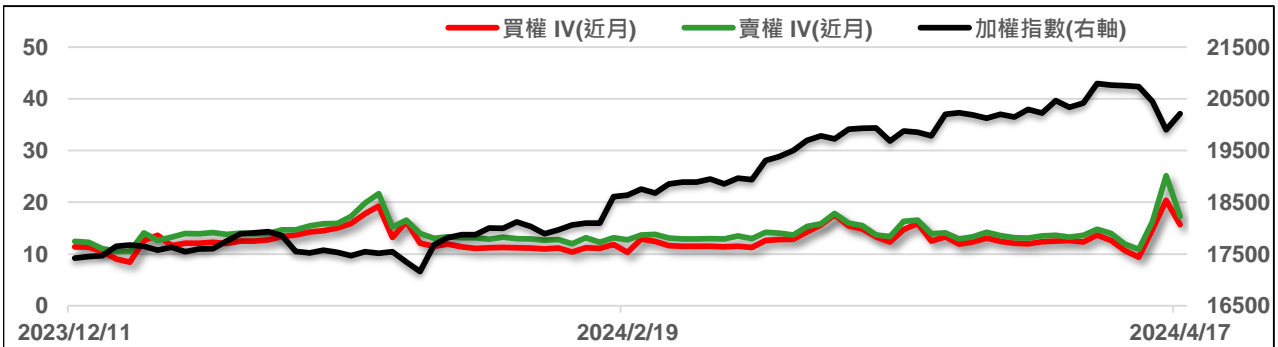
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 120.69% ▲				所有月份	P/C ratio = 121.66% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	543656	-68306	41786	-224905	Call	960327	+412708	350375	+67156
Put	540542	+12544	50430	-122350	Put	842372	+364160	279085	-18754

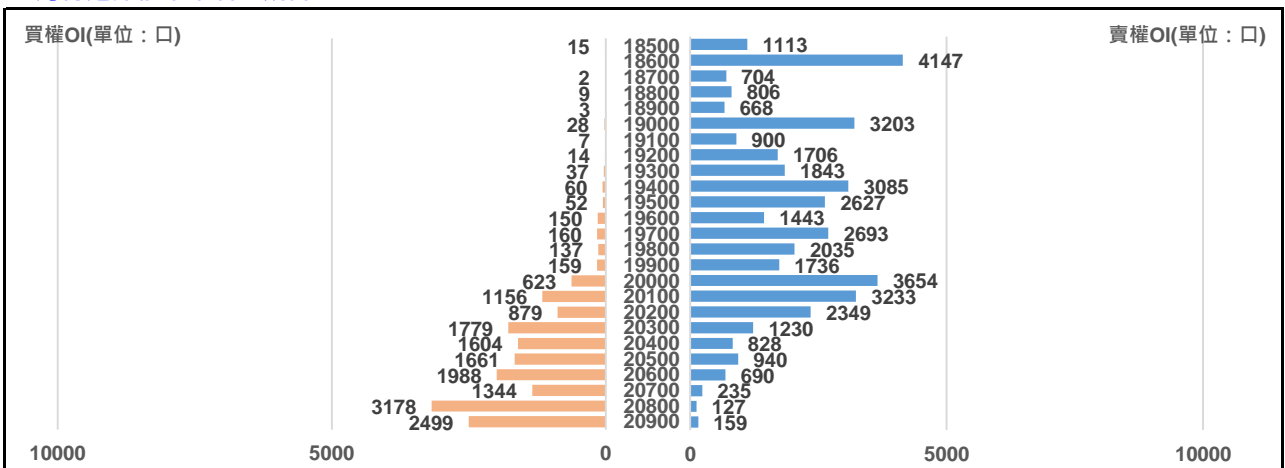
五月份台指選擇權

買權 IV = 15.66 ▼						賣權 IV = 17.28 ▼						
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
0.846	+5	37	5	+160	990	19300	103	-54	1258	1843	+430	-0.154
0.819	+21	60	45	+155	915	19400	120	-61	1062	3085	+465	-0.181
0.789	+13	52	16	+135	825	19500	137	-71	1946	2627	+1078	-0.211
0.756	+10	150	43	+125	750	19600	160	-79	1411	1443	+364	-0.244
0.721	-5	160	114	+115	670	19700	188	-82	642	2693	+80	-0.279
0.684	+10	137	119	+123	605	19800	214	-96	982	2035	+25	-0.316
0.645	-7	159	92	+98	535	19900	251	-97	757	1736	+277	-0.355
0.605	-35	623	379	+95	475	20000	283	-114	1422	3654	+368	-0.395
0.564	+118	1156	455	+81	414	20100	328	-117	930	3233	+61	-0.436
0.522	+524	879	1274	+78	364	20200	379	-120	766	2349	+472	-0.478
0.480	+1357	1779	2418	+67	310	20300	427	-128	230	1230	+7	-0.520
0.439	+867	1604	1569	+61	267	20400	485	-140	156	828	-6	-0.561
0.399	+410	1661	1737	+53	225	20500	535	-150	194	940	-70	-0.601
0.359	+565	1988	1590	+47	190	20600	600	-155	52	690	+19	-0.641
0.322	+86	1344	1053	+39	156	20700	670	-160	60	235	-13	-0.678

近月選擇權IV走勢圖



五月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調

永豐奇狐

兩岸華人操盤科技利器

當Alpha Go縱橫棋壇成為事實·未來勝負將由科技決定! 現在你也能使用電腦科技幫助你做決策!

永豐奇狐國內版、全球版

包含永豐期貨特有的豐指標及特色指標，還能用中文語法自行撰寫指標

欲瞭解詳情，立即聯絡營業員或來電(02)23823760

警語及功能限制

- 下單系統及輔助工具僅供參考，投資人仍需自行判斷，任何系統參數均需由投資人自行設定，假使資料內容錯誤、延誤或中斷傳輸，而導致交易損失，投資人應自行負責，本公司不負任何法律責任。
- 課程內容資料內均採用特定軟體，以歷史數據進行繪製及統計，過去之績效及表現不可作為日後獲利之保證。
- 期權交易財務槓桿高，投資人應依個人財務狀況審慎評估所能承擔之風險。
- 文中所提及之全球資訊為主管機關核准之所有國外期貨市場之商品。