

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.3825元 升值9.6分)

	外資	投信	自營	合計
上市	-66.59	+12.97	-6.81	-60.43
上櫃	+3.59	+1.92	-23.57	-18.06

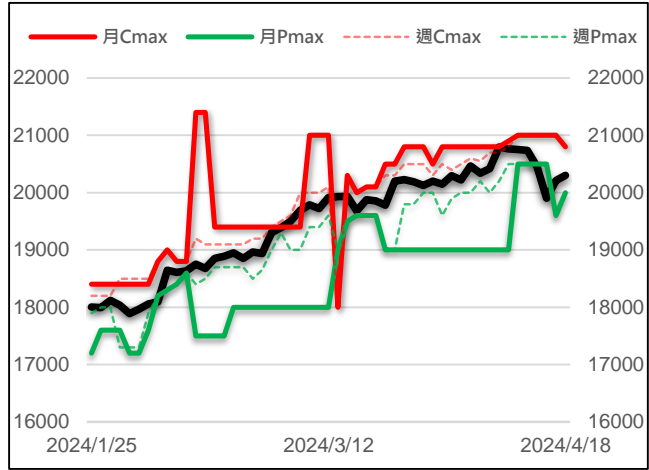
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	561	40.18%	362	19.06%
上櫃股票	395	53.82%	348	41.64%

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	3479	20800	3479
PUT	20000	4301	20000	4301

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	-14700	+3252	-17.0%	+9114	+46	10.6%	-2328	+322	-2.7%
電子	+78	-69	6.6%	+176	+51	15.0%	-336	-3	-28.6%
金融	-364	+16	-27.7%	+7	0	0.5%	-139	-44	-10.6%
CALL	+17203	+1917	10.0%	0	0	0	+20544	+7961	12.0%
PUT	+28383	+3236	13.4%	-66	+100	-0.0%	+13128	+5618	6.2%

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	-8888	-560	+1408	+1484	+3879	+1479	-1694	-1331	86290
電子	+37	-81	0	0	-81	-1	-5	-5	1176
金融	-515	+6	0	0	+163	-61	-1	-1	1313
CALL	+10441	+1237	+7667	+4221	-2451	+451	+2915	-2501	171742
PUT	-12881	-2017	-5120	-283	+5280	+1349	-19132	-7105	212280

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	20126.57	20363.09	20057.81	20301.20	+87.87	+0.43%	4539.5億		
台指期五月	20070	20359	20025	20353	+164	+0.81%	120221	70527	+2427
台指期六月	20084	20355	20040	20352	+164	+0.81%	1483	1740	+387
小型台指五月	20068	20359	20025	20353	+164	+0.81%	197267	39343	+5585
小型台指六月	20070	20355	20037	20352	+164	+0.81%	11722	6189	+1307
小型台指(週)	20035	20345	20010	20345	+178	+0.88%	1668	1387	+140
電子指數	1052.25	1065.83	1046.61	1061.20	+2.19	+0.21%	2384.26億		
電子期五月	1049.60	1067.30	1046.85	1067.00	+7.7	+0.73%	1792	1006	+109
電子期六月	1061.05	1063.20	1061.05	1066.95	+7.3	+0.69%	7	11	+6
金融指數	1787.16	1807.66	1781.02	1802.67	+14.93	+0.84%	121.3億		
金融期五月	1790.2	1811.8	1784.0	1806.8	+11.2	+0.62%	1031	1222	+3
金融期六月	1811.0	1811.4	1807.8	1811.4	+11.6	+0.64%	3	4	+5
櫃買指數	249.94	251.59	249.23	250.68	+0.35	+0.14%	1027.95億		
櫃買期五月	249.50	250.50	249.50	250.15	+0.4	+0.16%	12	31	+5
非金電指數	15552.44	15726.77	15524.71	15695.04	+145.71	+0.94%	1795.66億		
非金電期五月	15369	15680	15369	15635	+166	+1.07%	214	128	+60

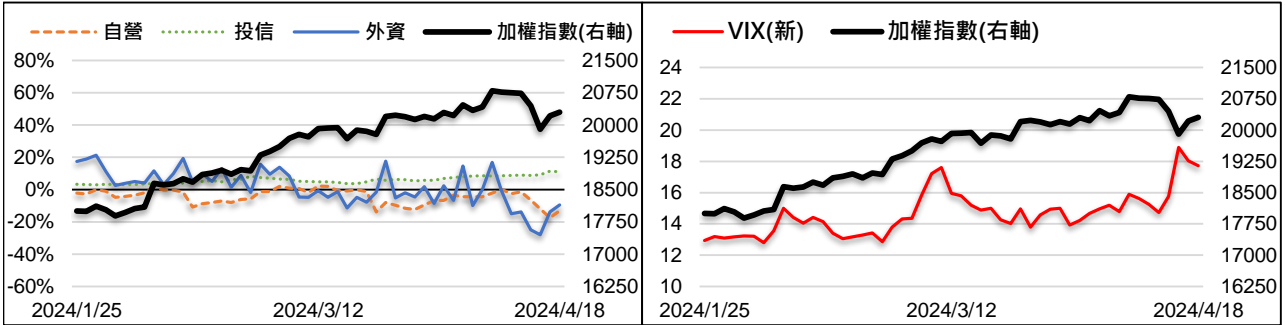
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	37949.67	38036.70	37611.56	37753.31	-45.66	-0.12%			
道瓊六月	38007	38120	38007	38110	-20	-0.05%	123	773	+52
標普500指數	5068.97	5077.96	5007.25	5022.21	-29.2	-0.58%			
標普六月	5077.75	5083	5076.75	5083	-17	-0.33%	53	437	+8
Nasdaq 100指數	17493.62	17493.62	17493.62	17493.62	-220.043	-1.24%			
那斯達十二月	17707	17770	17694	17768	-133	-0.74%	552	3169	+229

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

17.73 -0.30



散户小台指佔全市場OI比率

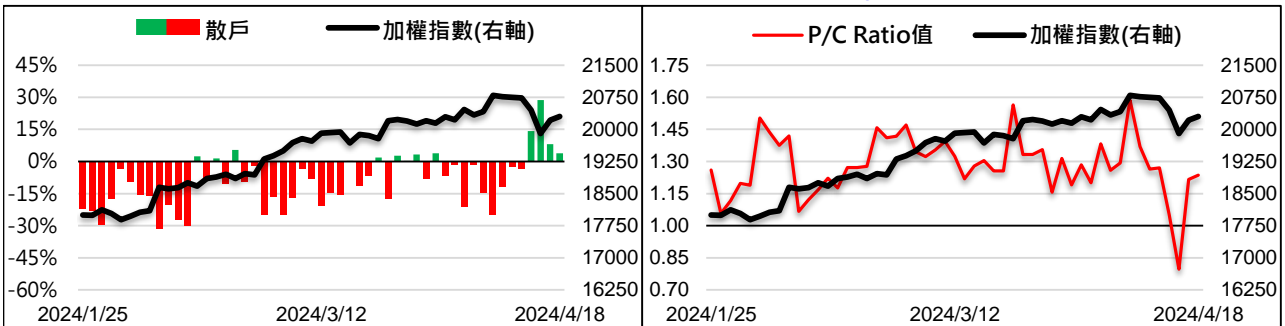
3.87%

-4.24%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.24

+0.02



永豐期貨研調

## 法說前台積收平盤 台股力守2萬大關

台指期週四上漲115點至20353點。價差方面，台指期正價差擴至51.8點，電子期正價差擴至5.8點，金融期正價差縮至4.13點。現貨部分，三大法人賣超60.43億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少3620口至-7914口，其中外資多單加碼且空單減碼，淨空單減少3252口至-14700口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單減少924口至-7480口。

週二荷蘭半導體設備龍頭ASML公布財報遜於預期加上市場對於聯準會是否會在今年降息感到擔憂，使得美股四大指數下跌，幅度介於-3.25%至-0.12%，其中費半指數下跌最深，而標普指數已連四黑。週三受到主要權值股開低影響，加權指數以下跌86跳空開出，台股盤中一度跌逾145點回測2萬點大關，隨後約9:45出現低接買盤進場，帶動大盤急拉翻紅走揚，盤面上權值股漲多跌少，台積電在法說會前夕持穩在800元之上，鴻海、台達電等均在盤上表現，連帶高價股的信驊、力旺等同步上攻，建材營造、電器電纜族群強勢表態，終場大盤上漲87.87點收20301.2點。整體來看，雖然台股呈現連兩日強彈，惟上檔仍面臨月線及4/16長黑K反壓，加上美國股市近期技術面仍偏弱勢，後續投資人仍須留意行情轉空風險。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在20800點，賣權未平倉最大量集中在20000點，但OI目前仍不到5000口參考性較低。全月份未平倉量put/call ratio值由1.22升至1.24。期交所VIX指數連兩日下跌，目前為17.73，但仍位處於2023年以來相對高位。整體選擇權籌碼面偏向中性。(永豐期貨研調)

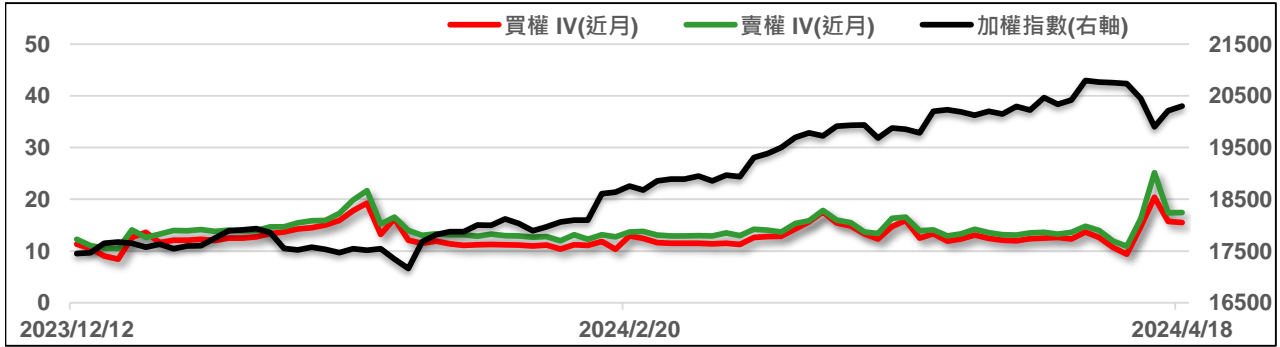
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 117.43% ▼				所有月份	P/C ratio = 123.60% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	27360	-516296	50284	+8498	Call	386784	-516685	171742	+55332
Put	28140	-512402	59050	+8620	Put	378179	-569608	212280	+70656

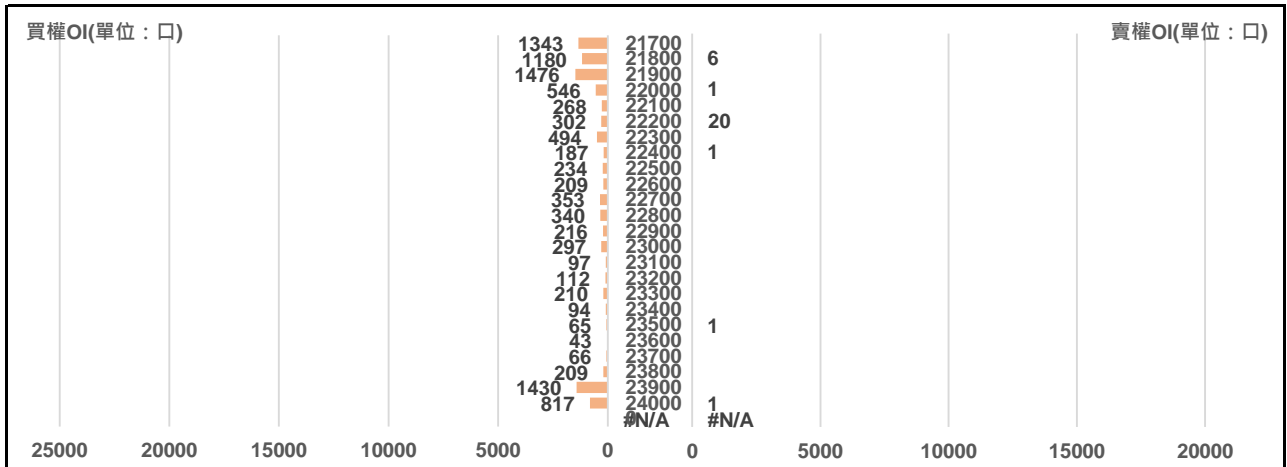
五月份台指選擇權

買權 IV = 15.47 ▼							賣權 IV = 17.45 ▲					
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
0.850	+5	65	8	+125	1040	19400	88	-32	1445	3547	+462	-0.150
0.822	0	52	9	+130	955	19500	104	-33	2147	3580	+953	-0.178
0.791	-31	119	138	+125	875	19600	122	-38	1581	2025	+582	-0.209
0.758	-50	110	158	+125	795	19700	142	-46	1782	3057	+364	-0.242
0.722	+598	735	65	+110	715	19800	165	-49	1435	2566	+531	-0.278
0.684	+388	547	316	+105	640	19900	190	-61	1137	1918	+182	-0.316
0.644	+494	1117	1136	+90	565	20000	220	-63	2436	4301	+647	-0.356
0.602	+549	1705	918	+85	499	20100	254	-74	1146	3395	+162	-0.398
0.560	+588	1467	1667	+83	447	20200	293	-86	1843	3036	+687	-0.440
0.517	+956	2735	2042	+72	382	20300	334	-93	655	1310	+80	-0.483
0.474	+389	1993	1965	+68	335	20400	382	-103	482	905	+77	-0.526
0.431	+173	1834	1367	+64	289	20500	438	-97	300	981	+41	-0.569
0.390	+299	2287	1624	+49	239	20600	488	-112	90	673	-17	-0.610
0.350	+727	2071	2389	+48	204	20700	550	-120	53	225	-10	-0.650
0.312	+301	3479	1791	+41	168	20800	615	-120	47	156	+29	-0.688

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。