

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.38元 升值1.16角)

	外資	投信	自營	合計
上市	+168.63	+19.61	-14.05	+174.19
上櫃	+0.00	+0.00	+0.00	+0.00

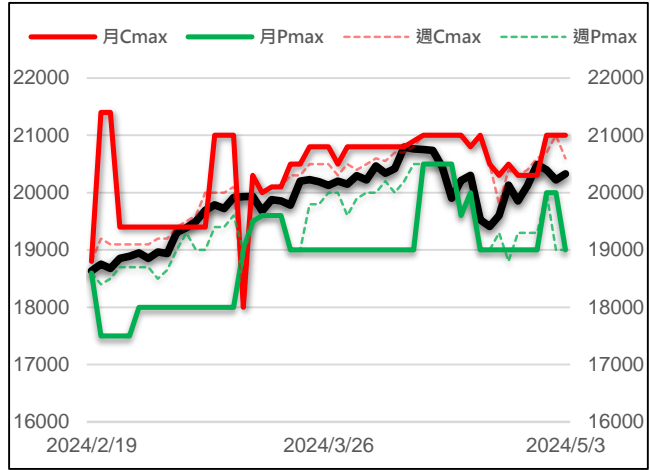
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	357	64.27%	532	26.68%
上櫃股票	302	42.61%	433	50.07%

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	7322	20600	11273
PUT	19000	7413	19000	6479

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	-19457	-1916	-21.3%	+12885	+70	14.1%	-2350	+870	-2.6%
電子	-78	+34	-4.6%	+187	0	11.1%	-390	-91	-23.2%
金融	-378	-10	-20.7%	+7	0	0.4%	-337	-3	-18.5%
CALL	+23161	+3591	12.0%	0	0	0	+6722	+7453	3.5%
PUT	+22193	+340	9.0%	-66	0	-0.0%	-415	+5446	-0.2%

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	-12281	-5950	+1210	+2011	+10218	+4879	-2055	-1455	91292
電子	-101	+113	0	0	+24	+43	-4	-5	1683
金融	-797	+18	-1	0	+223	-25	+11	0	1822
CALL	+18579	+2979	+8120	-87	-7558	-379	-5170	+1166	192926
PUT	-11412	-138	+2832	+6184	+7691	+344	-16634	-15212	245372

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	20381.98	20521.49	20272.34	20330.32	+107.88	+0.53%	4101.3億		
台指期五月	20548	20597	20306	20382	+90	+0.44%	100974	70362	+982
台指期六月	20558	20587	20297	20372	+89	+0.44%	1677	3845	+172
小型台指五月	20550	20597	20305	20382	+90	+0.44%	190668	43857	+239
小型台指六月	20544	20587	20296	20372	+89	+0.44%	12045	10942	+910
小型台指(週)	20540	20560	20280	20356	+87	+0.43%	767	1132	+464
電子指數	1052.58	1060.89	1044.79	1049.22	+8.41	+0.81%	2331.74億		
電子期五月	1058.80	1063.95	1047.05	1052.40	+8.45	+0.81%	1047	1474	+3
電子期六月	1062.00	1062.80	1052.50	1052.50	+9.05	+0.87%	3	32	+2
金融指數	1868.38	1882.11	1867.64	1870.32	+5.12	+0.27%	127.8億		
金融期五月	1880.2	1888.0	1871.0	1874.2	+3.2	+0.17%	854	1614	0
金融期六月	1877.0	1877.0	1877.0	1877.0	+3.2	+0.17%	0	24	-4
櫃買指數	251.01	253.26	249.72	249.99	-0.21	-0.08%	969.27億		
櫃買期五月	253.00	253.00	249.40	249.45	-0.05	-0.02%	11	60	-4
非金電指數	16090.73	16177.18	16051.08	16053.72	-20.84	-0.13%	1440.63億		
非金電期五月	16174	16201	16072	16075	-80	-0.50%	89	121	-4

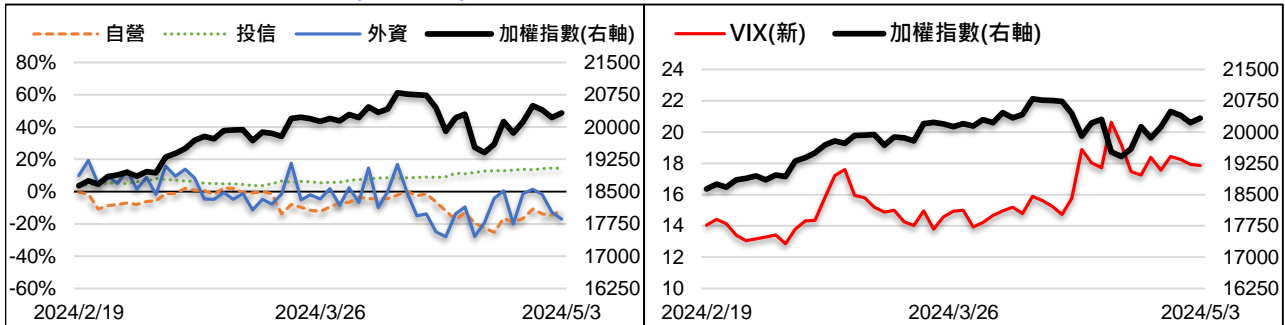
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38075.65	38295.29	37895.66	38225.66	+409.74	+1.08%			
道瓊六月	38620	38629	38580	38593	+357	+0.93%	159	626	-5
標普500指數	5049.32	5073.21	5011.05	5064.20	+28.51	+0.57%			
標普六月	5110.75	5111	5103.5	5105.75	+31.75	+0.63%	9	335	+4
Nasdaq 100指數	17541.54	17541.54	17541.54	17541.54	+100.85	+0.58%			
那斯達十二月	17769	17790	17748	17770	+205	+1.17%	951	2524	-412

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

17.86 -0.08



散戶小台指佔全市場OI比率

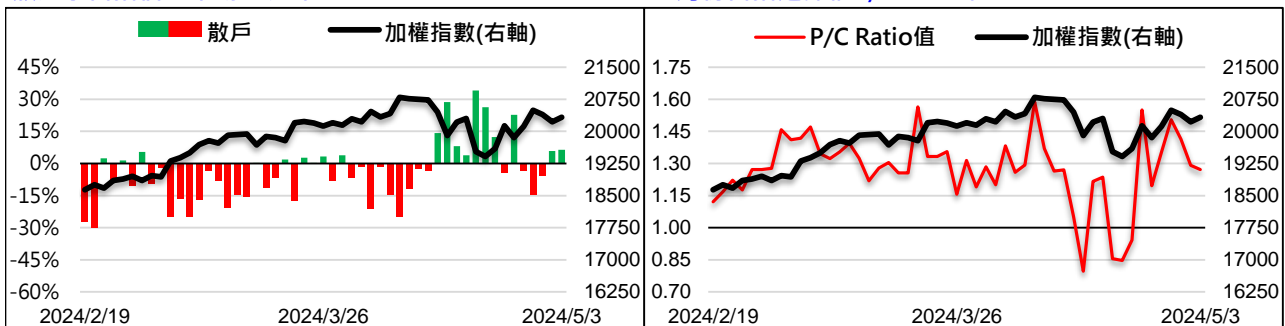
6.46%

+0.64%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.27

-0.02



永豐期貨研調

市場靜待非農就業 台股小漲收復月線

台指期週五上漲90點至20382點。價差方面，台指期正價差縮至51.68點，電子期正價差擴至3.18點，金融期正價差縮至3.88點。現貨部分，三大法人買超174.19億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加976口至-8922口，其中外資多單減碼且空單加碼，淨空單增加1916口至-19457口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加3939口至-11071口。

週四由於聯準會釋出的態度被市場解讀為較鴿派加上高通財報優於預期，使美股四大指數全數收紅，漲幅介在0.85%至2.17%，其中費半由高通領漲漲幅最高，而盤後由蘋果發布最新財報優於預期且宣布史上最大規模1100億美元的庫藏股計畫，激勵週五加權指數以跳空大漲299.05點開出，台股早盤較為震盪，但到九點半後台積電出現賣壓，漲幅持續收斂至773元，而今日營建股及被動元件族群為撐盤要角，最終尾盤台積電拉升780元，使得台股終場上漲107.88點以20330.32點作收，整體來看，雖今日台股最終收盤仍在月線與五日線上，但卻以開高走低的形式作收，顯示在美股尚未明確轉強前，台股的上檔反壓仍重，加上聯準會主席鮑威爾也表示若勞動力市場表持強勁將推遲降息，因此本週五晚間將公布的非農就業數據將更備受市場重視。

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19000點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.29降至1.27。期交所VIX指數下跌0.08至17.86，整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

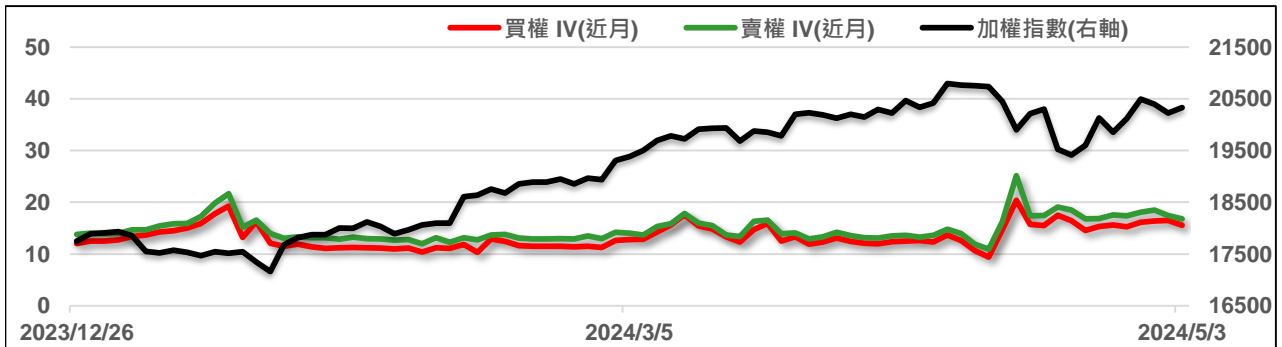
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 110.11% ▲				所有月份	P/C ratio = 127.18% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	34806	+10040	84723	+5065	Call	376788	-234496	192926	+54258
Put	37534	+16187	93292	+6554	Put	374179	-241890	245372	+66364

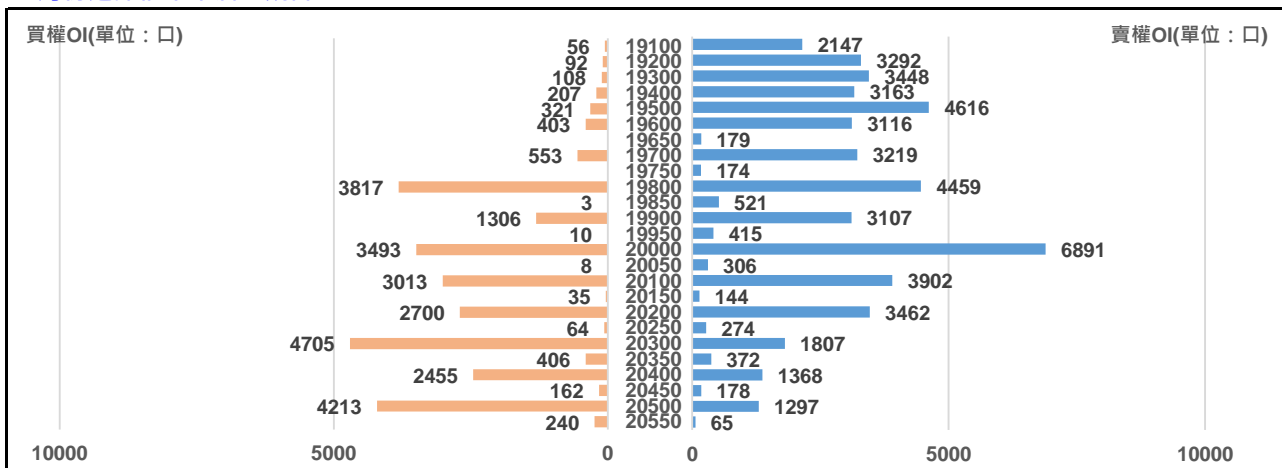
五月份台指選擇權

買權 IV = 15.57 ▼						賣權 IV = 16.77 ▼						
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
0.695	+10	1306	34	+55	560	19900	82	-33	1388	3107	+175	-0.305
0.675	+4	10	2	+54	525	19950	93	-36	465	415	+369	-0.325
0.655	-47	3493	171	+56	491	20000	104	-37	3363	6891	+332	-0.345
0.634	+2	8	3	+47	446	20050	114	-42	721	306	+287	-0.366
0.613	-75	3013	831	+48	415	20100	129	-44	1629	3902	+261	-0.387
0.591	+5	35	17	+43	377	20150	143	-48	431	144	+100	-0.409
0.570	-136	2700	579	+36	340	20200	160	-49	2681	3462	+898	-0.430
0.548	+27	64	72	+39	314	20250	178	-53	689	274	+184	-0.452
0.526	-355	4705	868	+32	281	20300	196	-55	2184	1807	+393	-0.474
0.504	+340	406	598	+29	253	20350	219	-58	795	372	+292	-0.496
0.482	-51	2455	1364	+24	223	20400	241	-64	1409	1368	+345	-0.518
0.460	+104	162	393	+22	197	20450	263	-65	410	178	+155	-0.540
0.439	-275	4213	3037	+20	175	20500	293	-69	965	1297	+93	-0.561
0.417	+178	240	752	+20	155	20550	317	-74	246	65	+54	-0.583
0.396	-460	4319	2335	+16	134	20600	346	-80	467	826	+7	-0.604

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

第二週台指選擇權

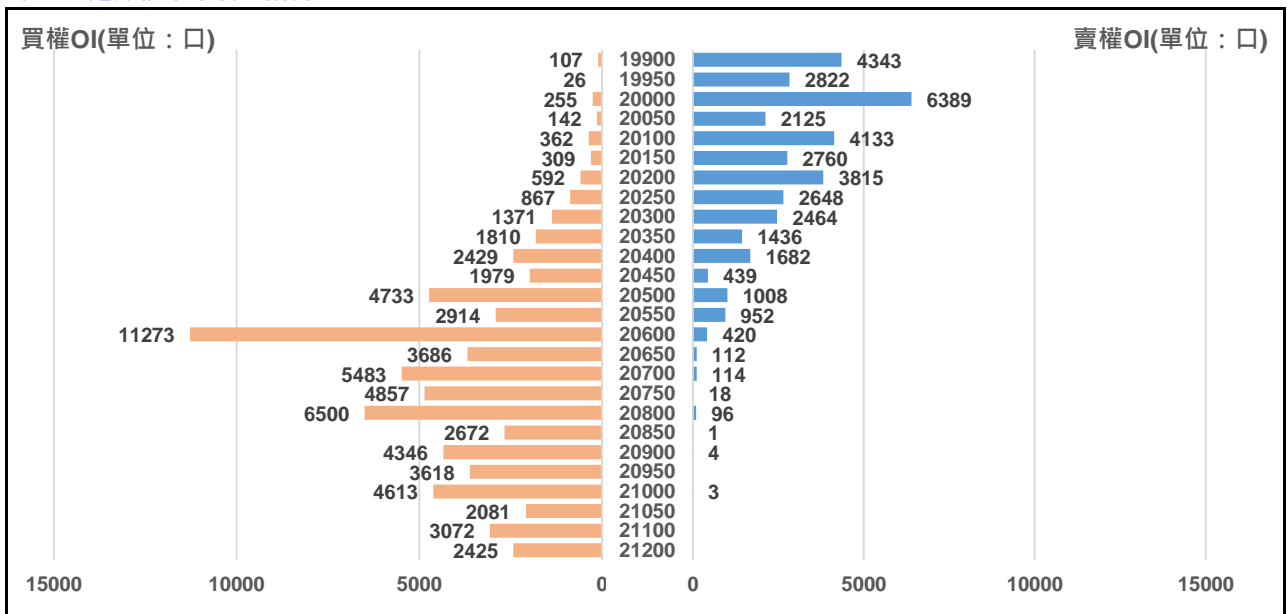
買權 IV = 18.32 ▼							賣權 IV = 16.22 ▼					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
0.966	0	1	0	+80	1010	19350	4.2	-5.8	1076	1444	+1113	-0.034
0.959	0	3	0	+80	960	19400	5	-6.5	2432	2366	+1791	-0.041
0.950	0	21	0	+75	910	19450	5.9	-7.6	971	700	+465	-0.050
0.940	0	3	0	+80	865	19500	6.9	-8.6	3385	3466	+2288	-0.060
0.929	0	0	0	+75	815	19550	7.6	-11.4	1288	3143	+2473	-0.071
0.916	0	26	0	+75	765	19600	9.1	-11.9	2939	3723	+862	-0.084
0.901	0	2	0	+70	715	19650	10	-14.5	1764	2957	+2342	-0.099
0.885	0	10	0	+70	670	19700	12.5	-16.5	5776	5019	+4062	-0.115
0.867	0	42	0	+65	620	19750	14.5	-22	3764	3724	+2751	-0.133
0.847	+69	90	12	+65	575	19800	18	-23	8413	5795	+3124	-0.153
0.826	+48	92	18	+58	525	19850	21.5	-27	4188	2481	+1730	-0.174
0.803	+11	107	14	+50	482	19900	26	-31	8321	4343	+3021	-0.197
0.777	+7	26	26	+54	439	19950	33	-33	5342	2822	+2206	-0.223
0.751	+114	255	271	+52	399	20000	39.5	-38.5	19094	6389	+4031	-0.249
0.722	+61	142	121	+45	355	20050	48.5	-42.5	5326	2125	+1376	-0.278
0.693	+32	362	515	+45	317	20100	59	-46	12730	4133	+2948	-0.307

週選擇權前十大交易人資料

Contract	特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	5355	+3531	0	0	+5355	6.5%
PUT	0	0	922	+572	-922	-1.0%

Contract	非特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	25121	+13257	35028	+15567	-9907	-12.0%
PUT	33425	+15580	38143	+23076	-4718	-5.0%

第二週選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調