

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.37元 貶值2.3分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+69.95	+46.30	+4.10	+120.35
上櫃	+35.41	+3.61	-11.10	+27.92

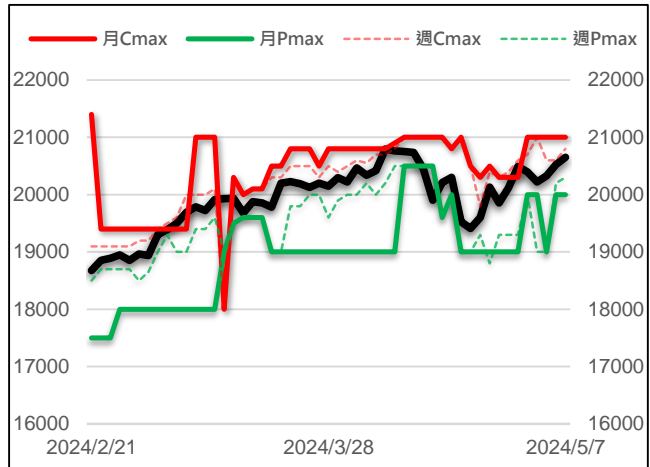
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	357	63.54%	567	30.58%
上櫃股票	337	40.74%	421	52.59%

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	7650	20800	14914
PUT	20000	8252	20300	8364

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	-19225	-467	-20.5%	+13370	+259	14.3%	-2490	-559	-2.7%
電子	-164	-21	-9.3%	+177	-10	10.1%	-313	+18	-17.8%
金融	-449	-75	-21.6%	+7	0	0.3%	-300	0	-14.4%
CALL	+26398	+504	11.0%	0	0	0	+6243	+1943	2.6%
PUT	+26333	+4242	8.5%	-66	0	-0.0%	+1035	-1982	0.3%

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	-5307	+765	-2727	-1849	+5787	-1961	+2053	+1972	93760
電子	-233	+4	0	0	+120	-15	-2	0	1760
金融	-860	-75	-1	0	+244	-6	+11	0	2082
CALL	+20811	+2382	+9118	-1672	-6774	+940	-14333	-5826	239162
PUT	-15317	-5594	-653	+6043	+9280	+3876	-17610	-8774	311166

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	20634.62	20689.19	20493.80	20653.53	+130.22	+0.63%	4115.8億		
台指期五月	20733	20756	20536	20648	+47	+0.23%	85595	71409	-1789
台指期六月	20712	20742	20533	20641	+51	+0.25%	2380	4989	+728
小型台指五月	20728	20755	20537	20648	+47	+0.23%	154648	43741	-1528
小型台指六月	20721	20742	20532	20641	+51	+0.25%	10060	12129	+591
小型台指(週)	20701	20713	20509	20622	+50	+0.24%	1571	917	-662
電子指數	1067.52	1071.27	1061.44	1071.27	+12.11	+1.14%	2495.34億		
電子期五月	1070.50	1072.55	1063.35	1069.65	+7.55	+0.71%	916	1507	-7
電子期六月	1070.80	1070.80	1063.85	1070.50	+8.75	+0.82%	18	55	+18
金融指數	1911.33	1916.15	1898.55	1908.13	-3.24	-0.17%	143.6億		
金融期五月	1916.4	1925.8	1904.6	1912.2	-4	-0.21%	866	1841	0
金融期六月	1909.0	1909.0	1909.0	1914.8	-2.8	-0.15%	2	30	0
櫃買指數	251.00	252.30	248.69	250.67	-0.12	-0.05%	1054.44億		
櫃買期五月	250.00	250.40	250.00	250.40	-0.7	-0.28%	2	60	0
非金電指數	16127.81	16191.29	15956.43	16039.83	-74.35	-0.46%	1262.65億		
非金電期五月	16220	16244	16030	16064	-126	-0.78%	86	151	+1

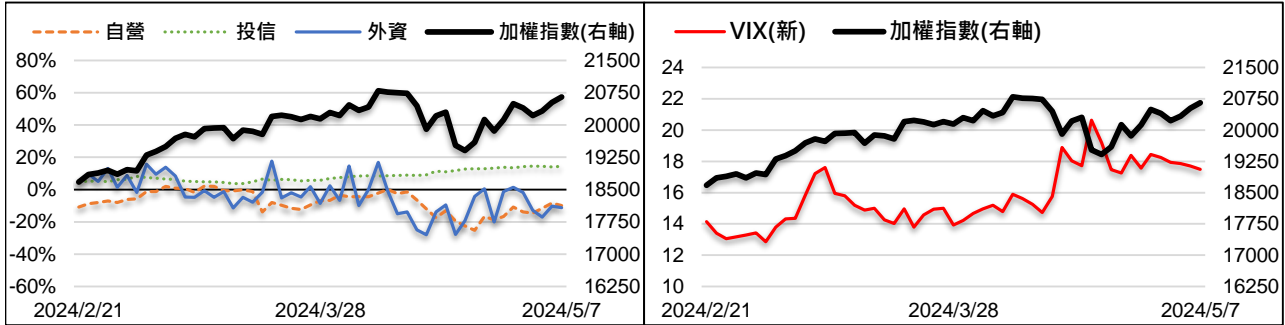
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38762.43	38886.47	38689.38	38852.27	+176.59	+0.46%			
道瓊六月	38995	39009	38677	38961	+101	+0.26%	107	576	-16
標普500指數	5142.42	5181.00	5142.42	5180.74	+52.95	+1.03%			
標普六月	5205	5208	5205	5208	+45.5	+0.88%	7	339	+13
Nasdaq 100指數	18093.57	18093.57	18093.57	18093.57	+202.77	+1.13%			
那斯達十二月	18187	18193	18174	18186	+179	+0.99%	238	2656	0

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

17.48 -0.23



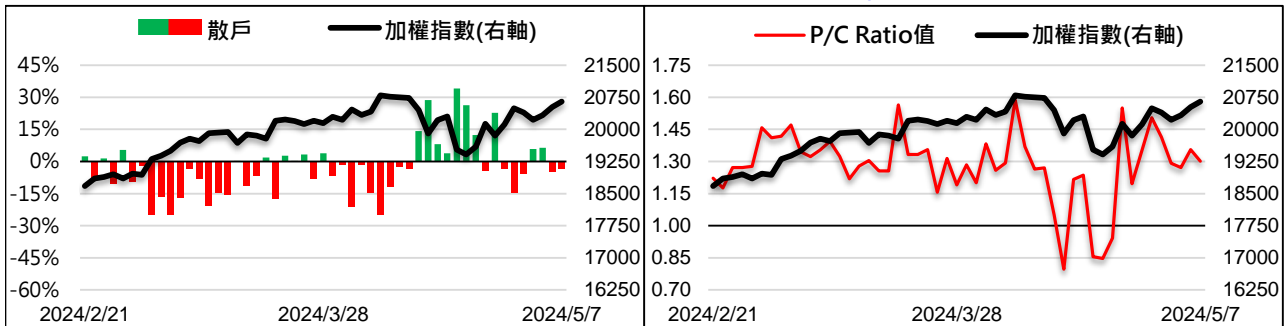
散戶小台指佔全市場OI比率

-3.31%

+1.74%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.30 -0.05



永豐期貨研調

電子股表現優異 台指震盪走升

台指期週二上漲47點至20648點。價差方面，台指期轉為逆價差-5.53點，電子期轉為逆價差-1.62點，金融期正價差縮至4.07點。現貨部分，三大法人買超120.35億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加767口至-8345口，其中外資多單減碼超過空單減碼，淨空單增加467口至-19225口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加1084口至-8034口。

聯準會FOMC的永久票委威廉斯表示，美國GDP成長率將在2024年一定程度地放緩，不過仍將表現不錯。Fed將根據整體數據情況決定是否降息，也強調最終聯準仍會降息。不過數據的起伏高概率是無法避免的。終場美國四大指數全數收紅，幅度介於+0.46%至+2.21%。週二台股開高走跌，盤中一度站上20600點大關，漲幅超過150點，隨後便拉回修正。大盤走勢與週一雷同，皆為夜盤上漲，日盤開高後拉回整理的型態。整體盤面漲跌互見，電器電纜類股表現最為亮眼，漲幅高達3%，大山、合機皆漲停作收。權值股部分，台積電及鴻海持續領漲，台積電大漲14元站上800元大關，而鴻海也是持續創高表現強勢，終場大盤上漲130.22點收20653.53點。整體來看，台股算是突破過去一週的箱型短壓，各期均線斜率也同步翻正，走勢有利多方。但鑑於近期台指開高後容易出現獲利了結賣壓，預期短線高檔震盪難以避免。

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20000點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.35降至1.3。VIX指數下跌0.23至17.48，整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

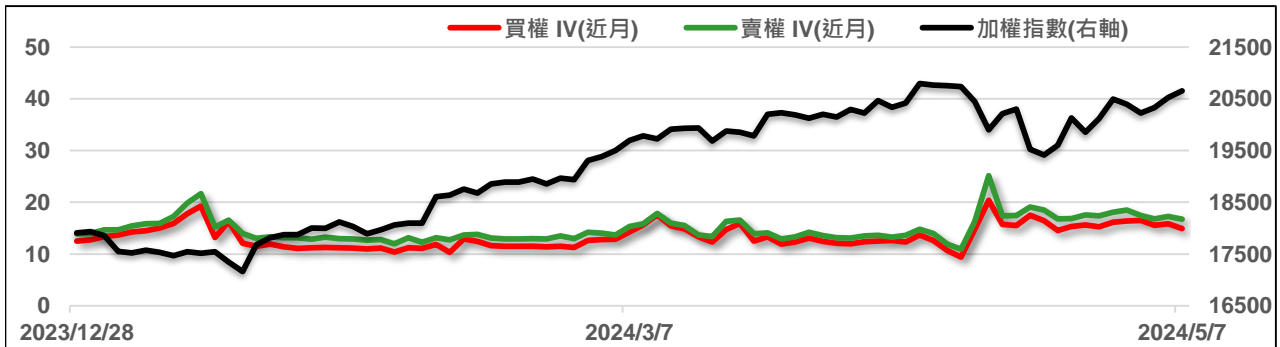
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 118.25% ▲				所有月份	P/C ratio = 130.11% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	36825	+995	90705	+7855	Call	418621	-13657	239162	+25930
Put	38268	-5201	107263	+9293	Put	408986	-61793	311166	+22265

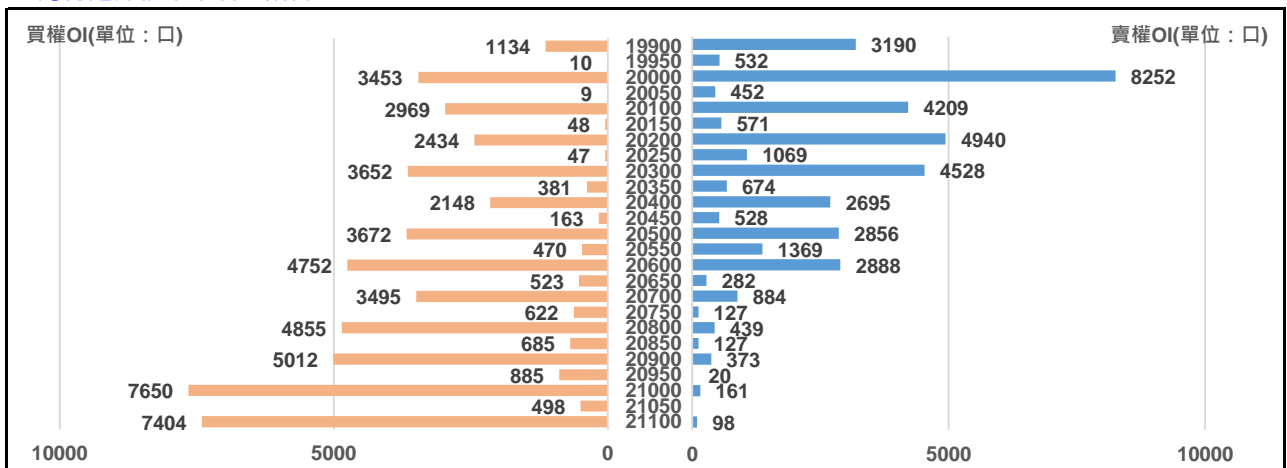
五月份台指選擇權

買權 IV = 14.92 ▼						賣權 IV = 16.72 ▼						
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
0.738	-70	2434	122	+30	510	20200	58	-20	2862	4940	+303	-0.262
0.716	-3	47	11	+22	465	20250	67	-22	1756	1069	+727	-0.284
0.692	-107	3652	103	+20	421	20300	76	-23	2361	4528	+1180	-0.308
0.668	-11	381	20	+30	390	20350	89	-25	837	674	+197	-0.332
0.643	-87	2148	348	+20	345	20400	100	-28	2662	2695	+970	-0.357
0.617	+11	163	71	+19	311	20450	115	-29	696	528	+270	-0.383
0.592	-515	3672	1569	+13	280	20500	129	-34	2796	2856	+1136	-0.408
0.565	+22	470	202	+16	248	20550	149	-35	1534	1369	+836	-0.435
0.539	+902	4752	2740	+9	217	20600	171	-35	2987	2888	+1534	-0.461
0.512	+107	523	1089	+14	189	20650	189	-41	912	282	+136	-0.488
0.485	-49	3495	2192	+4	163	20700	212	-48	1197	884	+147	-0.515
0.459	+119	622	958	+1	138	20750	239	-51	322	127	+66	-0.541
0.433	+197	4855	3453	+1	118	20800	270	-50	812	439	+173	-0.567
0.407	+161	685	1434	+1	99	20850	299	-48	251	127	+55	-0.593
0.381	+850	5012	3246	-3	81	20900	329	-54	224	373	+13	-0.619

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

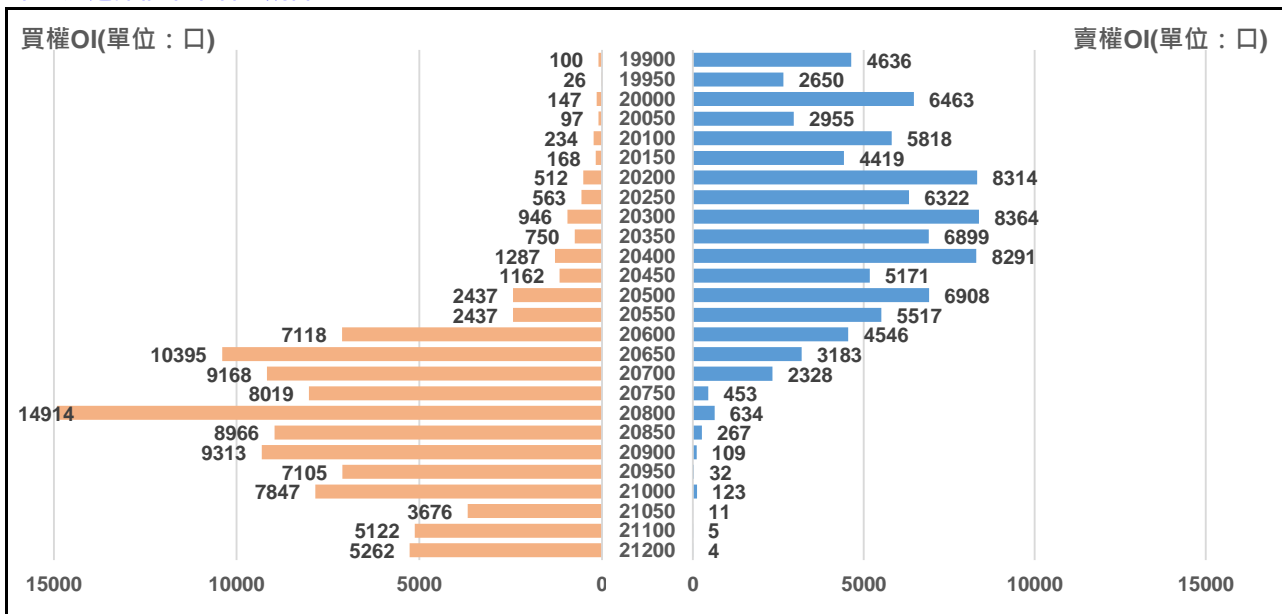
買權 IV = 0.00 ▼							賣權 IV = 22.94 ▲					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
1.000	0	1	0	+50	1270	19350	0.3	-0.6	102	1325	-214	0.000
1.000	0	3	0	+50	1220	19400	0.3	-0.6	304	1620	-310	0.000
1.000	0	21	0	+50	1170	19450	0.4	-0.6	25	627	-45	0.000
1.000	-1	2	1	+50	1120	19500	0.4	-0.9	73	2928	+52	0.000
1.000	0	0	0	+50	1070	19550	0.4	-1.1	194	1937	-128	0.000
1.000	+1	3	0	+45	1020	19600	0.4	-1.1	2008	2710	-680	0.000
1.000	+2	4	0	+50	975	19650	0.4	-1.2	293	2433	-207	0.000
1.000	0	10	0	+50	925	19700	0.5	-1.3	1028	3351	-1093	0.000
1.000	0	42	0	+50	875	19750	0.6	-1.4	348	3270	-354	0.000
1.000	+1	101	1	+50	825	19800	0.6	-1.7	499	5894	-454	0.000
0.999	-10	83	42	+50	775	19850	0.7	-2.3	365	3044	-3	-0.001
0.998	-1	100	3	+50	725	19900	0.8	-2.7	1141	4636	-694	-0.002
0.997	0	26	1	+50	675	19950	1.1	-3.3	906	2650	-121	-0.003
0.994	-1	147	5	+50	625	20000	1.2	-4.3	3559	6463	-1371	-0.006
0.990	-9	97	42	+45	575	20050	1.5	-5.6	2463	2955	-372	-0.010
0.983	-79	234	96	+43	525	20100	1.7	-7.3	4555	5818	-124	-0.017

週選擇權前十大交易者資料

Contract	特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	5765	-975	0	0	+5765	4.8%
PUT	0	0	0	0	0	0.0%

Contract	非特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	30065	+968	46725	+7118	-16660	-13.8%
PUT	41167	-666	43325	+666	-2158	-1.5%

第二週選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調