

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.413元 升值4.7分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+168.05	+59.77	+6.91	+234.73
上櫃	+6.41	+7.40	-7.99	+5.82

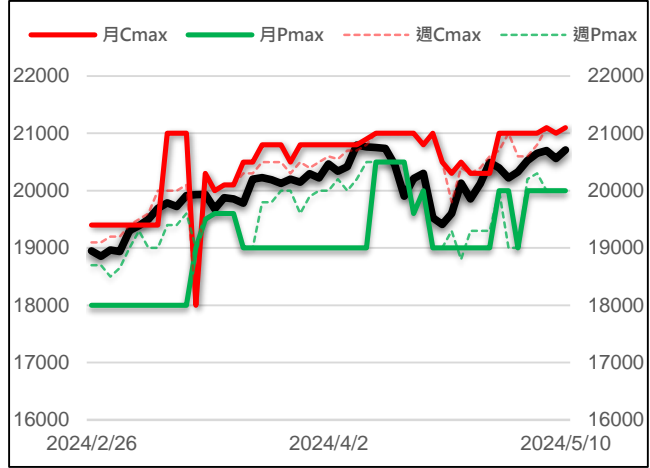
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	540	70.26%	389	24.41%
上櫃股票	395	54.52%	335	37.58%

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	21100	16342	-	-
PUT	20000	13025	-	-

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	-14869	+2347	-15.5%	+13252	-42	13.8%	-4191	-656	-4.4%
電子	-51	+16	-2.5%	+164	0	8.2%	-373	+6	-18.6%
金融	-353	+89	-15.4%	+7	0	0.3%	-285	+24	-12.4%
CALL	+19559	-530	10.0%	0	0	0	+22085	+1058	11.3%
PUT	+22447	+1503	8.0%	-66	0	-0.0%	-7776	-5788	-2.8%

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	-3682	+200	+1969	+3545	+5580	+1148	-3475	-3467	95979
電子	-277	-10	+157	+90	+279	+116	-154	-112	2004
金融	-603	+193	-58	-53	+130	-89	+33	+20	2298
CALL	+18547	-569	+2279	+875	-4776	-1196	+8277	+806	196249
PUT	-6139	+644	-5258	+1980	-7116	-6537	-4885	-1898	282172

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	20582.12	20765.82	20574.01	20708.84	+148.07	+0.72%	4404億		
台指期五月	20738	20828	20616	20812	+200	+0.97%	97925	63044	-4427
台指期六月	20730	20827	20615	20811	+199	+0.97%	10824	13644	+6025
小型台指五月	20730	20828	20617	20812	+200	+0.97%	150773	48723	+4822
小型台指六月	20725	20825	20616	20811	+199	+0.97%	18229	15989	+1432
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	1070.09	1076.45	1065.08	1071.60	+2.52	+0.24%	2348.84億		
電子期五月	1077.95	1079.60	1066.20	1078.65	+7.15	+0.67%	1344	1569	-16
電子期六月	1077.00	1079.00	1066.55	1077.85	+7.05	+0.66%	123	234	+110
金融指數	1897.38	1948.76	1897.38	1948.76	+51.96	+2.74%	228.42億		
金融期五月	1908.8	1948.0	1908.8	1944.8	+44.4	+2.34%	1956	1776	+189
金融期六月	1918.4	1952.2	1918.4	1950.4	+44.2	+2.32%	231	274	-2
櫃買指數	247.65	248.88	246.43	247.65	+0.21	+0.08%	838.89億		
櫃買期五月	247.50	247.50	246.00	247.00	-0.65	-0.26%	8	60	-2
非金電指數	15889.75	16069.67	15889.75	16053.3	+190.13	+1.20%	1561.69億		
非金電期五月	15967	16148	15947	16124	+212	+1.33%	103	143	+37

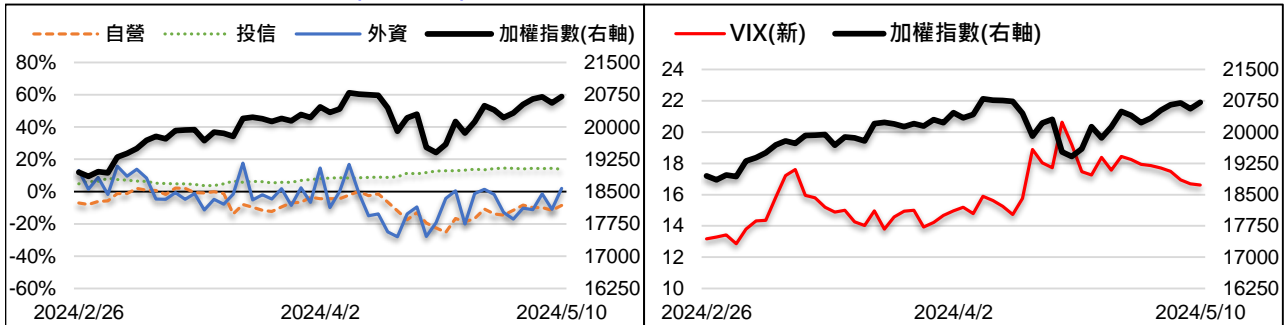
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	39064.27	39413.66	38988.85	39387.76	+331.37	+0.85%			
道瓊六月	39567	39617	39548	39617	+464	+1.19%	97	843	+165
標普500指數	5214.08	5214.08	5214.08	5214.08	+26.41	+0.51%			
標普六月	5244.75	5247	5244.25	5247	+41	+0.79%	8	351	+5
Nasdaq 100指數	18113.46	18113.46	18113.46	18113.46	+28.451	+0.16%			
那斯達十二月	18234	18243	18220	18239	+78	+0.43%	280	2748	-29

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

16.62 -0.07



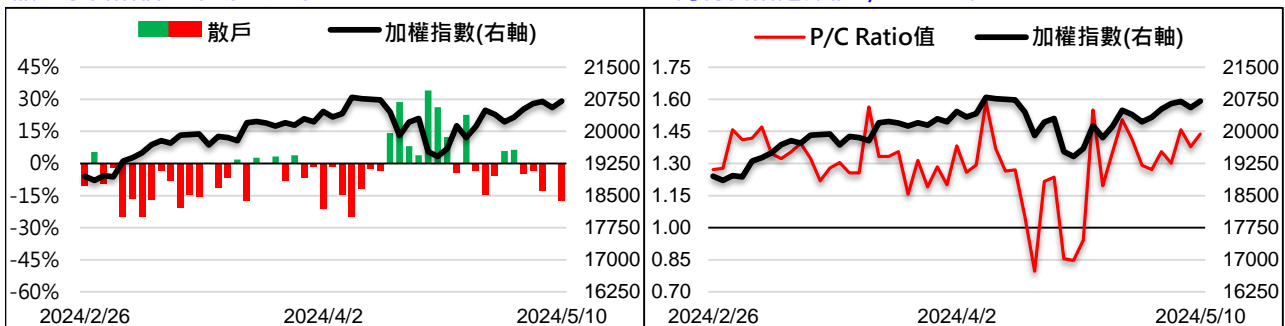
散户小台指佔全市場OI比率

-17.75%

-17.90%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.44 +0.06



永豐期貨研調

類股多點開花 指數翻揚守住五日線

台指期週五上漲200點至20812點。價差方面，台指期正價差擴至103.16點，電子期正價差擴至7.05點，金融期轉為逆價差-3.96點。現貨部分，三大法人買超234.73億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少1649口至-5808口，其中外資多單加碼且空單減碼，淨空單減少2347口至-14869口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單減少3745口至-1713口。

聯準會票委Daly表示，如果就業市場出現惡化，聯準會將考慮降息。上週初領失業救濟人數創去年8月以來新高，使連日回落的納指轉漲，道瓊指數延續一周多來連漲勢頭。美國四大指數除費半下跌-0.64%外，其餘皆上漲作收，漲幅介於+0.27%至+0.85%。今日(五)台指雖維持日前開高走低慣性，但各類股多點開花帶動下，指數午盤持續墊高，台指創過去一周新高。盤面上航運續強，陽明、萬海、台驛控股同步漲停，引領航運指拉出驚人的6%漲幅，金融類股同樣表現優異。尾盤更是在台積電拉抬下，指數上漲148.07點收20708.84點。整體來看，指數依然維持震盪格局，若非帶量突破前高，上方套牢賣壓仍重，短線仍建議區間操作，短單為宜。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在21100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1.38升至1.44。VIX指數下跌0.07至16.62。整體選擇權籌碼面偏多。(永豐期貨研調)

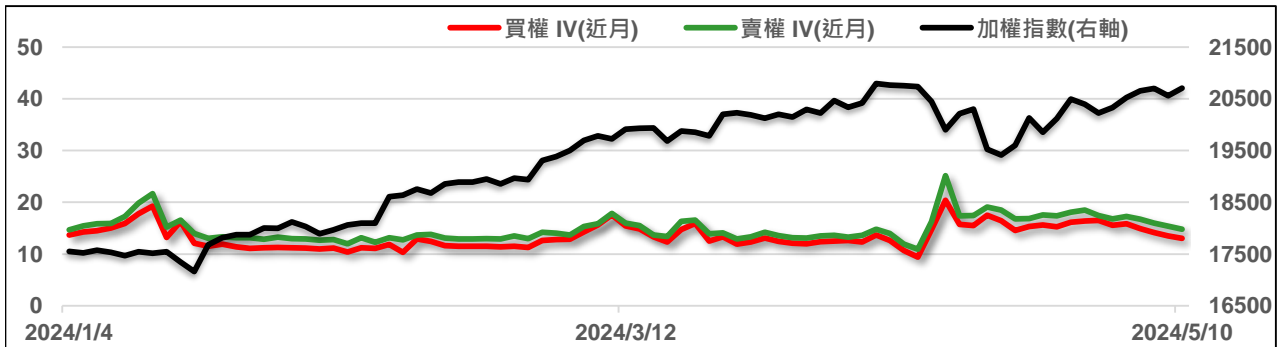
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 135.43% ▲				所有月份	P/C ratio = 143.78% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	193398	+55894	150772	+9464	Call	299136	+56923	196249	+16753
Put	208267	+66335	204187	+32150	Put	330880	+67371	282172	+34875

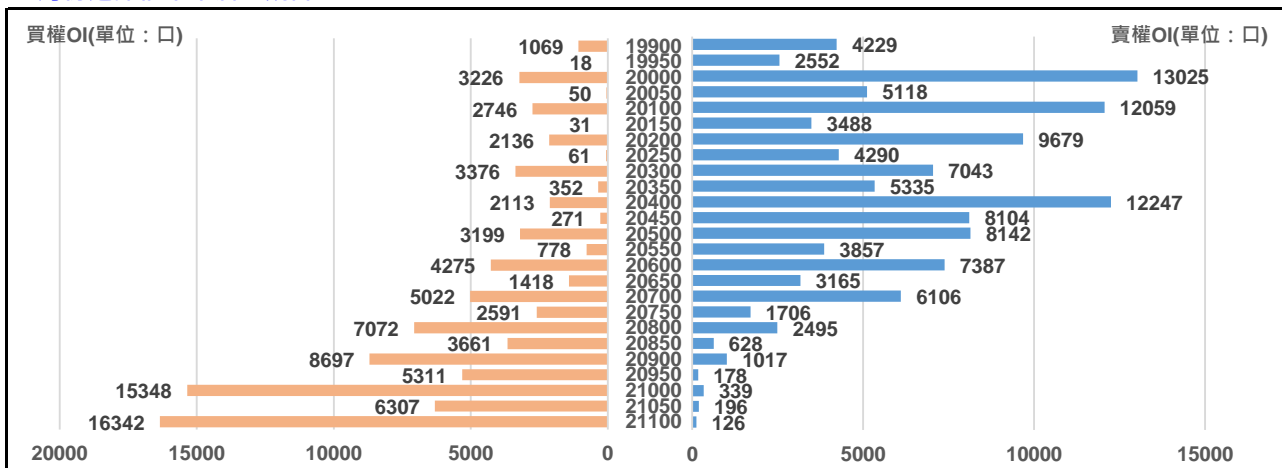
五月份台指選擇權

買權 IV = 13.05 ▼						賣權 IV = 14.8 ▼						
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
0.795	+5	61	16	+169	575	20250	14	-30.5	5427	4290	+472	-0.205
0.769	-122	3376	224	+165	530	20300	16.5	-36.5	8570	7043	+93	-0.231
0.741	-8	352	21	+158	488	20350	20	-43	9563	5335	+2147	-0.259
0.712	-108	2113	495	+150	438	20400	25	-50	19170	12247	+3495	-0.288
0.681	-2	271	263	+138	390	20450	30.5	-57.5	12344	8104	+2881	-0.319
0.649	-127	3199	2155	+133	348	20500	37.5	-66.5	17183	8142	+2391	-0.351
0.616	-77	778	2815	+125	309	20550	45.5	-75.5	12009	3857	+1127	-0.384
0.583	+27	4275	6380	+114	267	20600	56	-87	19066	7387	+2080	-0.417
0.549	+12	1418	7778	+104	231	20650	66	-100	13605	3165	+1224	-0.451
0.514	-421	5022	15734	+90	195	20700	83	-109	15341	6106	+3048	-0.486
0.480	+538	2591	14358	+77	160	20750	99	-123	7984	1706	+884	-0.520
0.445	-41	7072	25442	+70	134	20800	120	-134	8534	2495	+1144	-0.555
0.412	+1012	3661	13594	+57	108	20850	146	-143	1624	628	+252	-0.588
0.379	+1324	8697	21974	+46.5	85	20900	171	-157	1488	1017	+500	-0.621
0.347	+1129	5311	14838	+38	67	20950	201	-166	311	178	+82	-0.653

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