

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.168元 升值1.9分)

	外資	投信	自營	合計
上市	-24.00	-17.92	+19.27	-22.65
上櫃	+16.88	-14.70	-30.83	-28.65

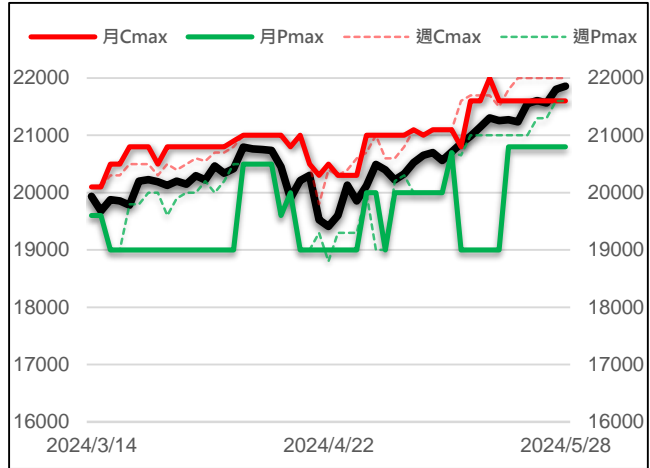
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	731	43.14%	214	53.55%
上櫃股票	506	66.19%	234	29.43%

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	21600	4990	22000	14741
PUT	20800	9285	21600	9571

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	-10160	-863	-10.4%	+11846	+725	12.1%	-6432	-312	-6.6%
電子	+20	-7	1.1%	+191	-1	10.8%	-277	+27	-15.7%
金融	-563	-65	-38.6%	+9	0	0.6%	-168	+44	-11.5%
CALL	+9326	-168	4.9%	+30	0	0.0%	+16844	-394	8.9%
PUT	+28038	+4022	9.3%	+16	0	0.0%	-7263	-7094	-2.4%

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	-3527	-789	-2756	-420	+4566	-19	0	0	98121
電子	-147	+60	-15	-3	+70	-62	+2	0	1761
金融	-746	-59	0	0	+265	0	+1	0	1458
CALL	+5761	-318	+1008	+452	+6473	+560	-7038	-1221	188405
PUT	-6517	-1041	-11617	-5448	-1337	-294	+7864	+10664	301490

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	21812.20	21937.40	21812.20	21858.41	+54.64	+0.25%	4780.4億		
台指期六月	21892	21994	21845	21951	+81	+0.37%	71888	79564	+606
台指期七月	21745	21857	21717	21813	+77	+0.35%	542	2700	+113
小型台指六月	21884	21995	21846	21951	+81	+0.37%	126141	47403	+193
小型台指七月	21750	21860	21717	21813	+77	+0.35%	5963	6482	+280
電子指數	1155.43	1162.58	1154.56	1156.43	+1.32	+0.11%	3445.13億		
電子期六月	1159.60	1165.05	1157.10	1161.30	+2.5	+0.22%	812	1448	-3
電子期七月	1156.55	1157.55	1153.45	1155.00	+2.35	+0.20%	9	35	+1
金融指數	1949.84	1960.00	1943.67	1953.50	+2.83	+0.15%	131.43億		
金融期六月	1954.2	1968.8	1946.2	1959.8	+4.6	+0.24%	736	1325	+22
金融期七月	1945.8	1945.8	1945.8	1948.2	+2.4	+0.12%	1	29	0
櫃買指數	257.13	259.60	257.13	259.36	+2.52	+0.98%	1328.95億		
櫃買期六月	258.10	260.05	258.10	260.00	+2.5	+0.97%	5	49	-4
非金電指數	16139.64	16259.54	16138.44	16239.32	+117.66	+0.73%	973.83億		
非金電期六月	16343	16370	16165	16282	+155	+0.96%	67	188	+27

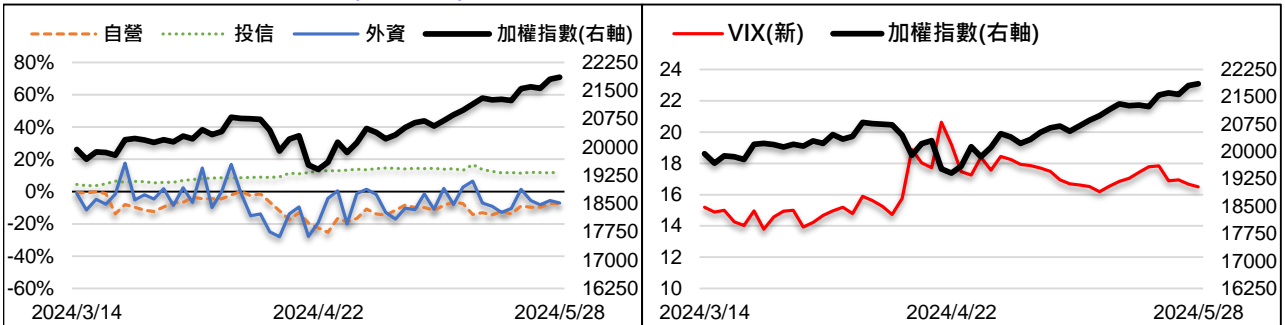
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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				休市					
道瓊六月	39176	39202	39176	39185	-2	-0.01%	33	694	+49
標普500指數				休市					
標普六月	5332.25	5332.25	5332.25	5332.25	+12.5	+0.23%	1	462	+15
Nasdaq 100指數				休市					
那斯達十二月	18910	18943	18901	18937	+61	+0.32%	289	3890	+155

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

16.49 -0.18



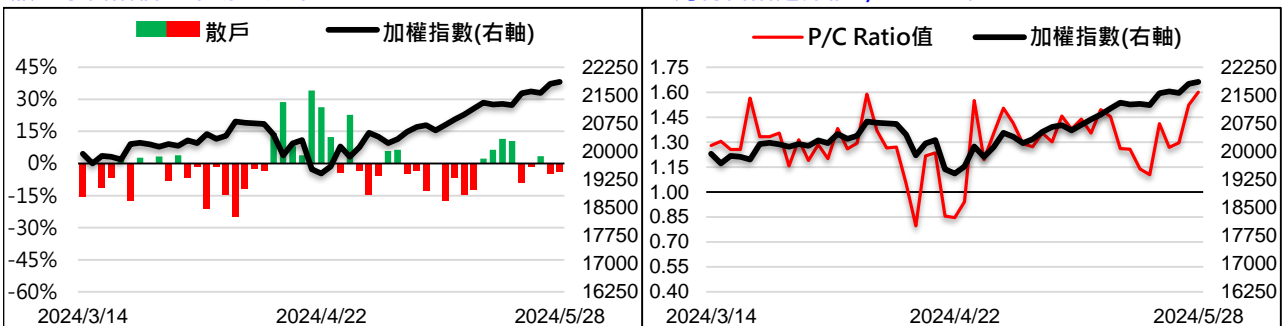
散戶小台指佔全市場OI比率

-3.92%

+0.91%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.60 +0.08



永豐期貨研調

權值股表現漲跌互見 指數小漲作收

台指期週二上漲81點至21951點。價差方面，台指期正價差擴至92.59點，電子期正價差擴至4.87點，金融期正價差縮至6.3點。現貨部分，三大法人賣超22.65億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加450口至-4746口，其中外資空單加碼超過多單加碼，淨空單增加863口至-10160口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加1209口至-6283口。

周一美國陣亡將士紀念日休市。上週聯準會官員鷹派談話連發，FOMC會議紀要更顯示票委對於Fed貨幣政策局限性的擔憂，本週五將公布萬眾矚目的美國PCE數據，若通膨狀況未緩解，可能加重目前的利率市場的緊縮氛圍。今日(二)台股在美股未開盤的情況下，權值股表現漲跌互見，台積電則是尾盤翻黑，跌4元收865元，終場指數小漲54點收在21858點。盤面上各類股表現多點開花，觀光大漲3%，航運指在回測十日線後再度創高。今至數貢獻排行前五名為聯發科、國泰金、奇鋹、萬海、台塑化，脫離只有科技股撐盤的盤面，資金健康輪動，各類股皆有所貢獻。目前指數持續創高，不預設高點，留意週五PCI數據前後五日線防守狀況。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在21600點，賣權未平倉最大量集中在20800點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.52升至1.6。VIX指數下跌0.18至16.49，整體選擇權籌碼面偏多。(永豐期貨研調)

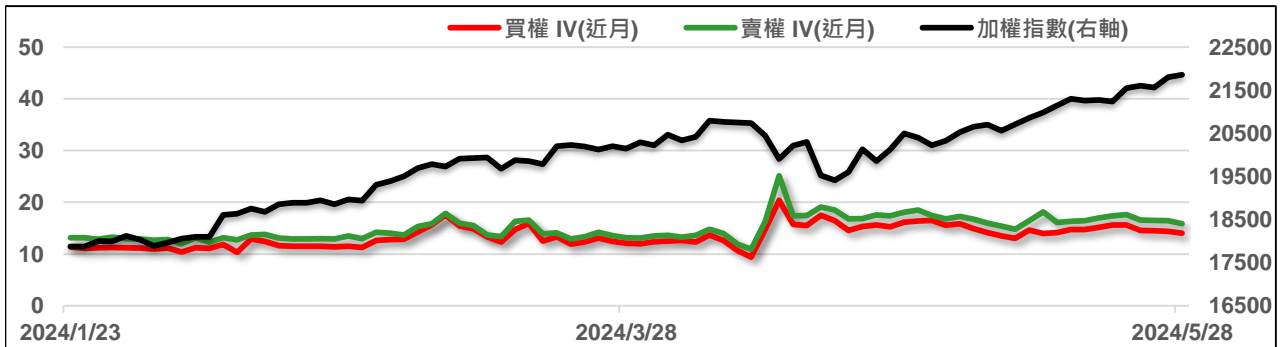
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 167.06% ▲				所有月份	P/C ratio = 160.02% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	18176	-7032	65719	-414	Call	299765	-68680	188405	+8972
Put	19743	-13400	109791	+4174	Put	344539	-79875	301490	+28389

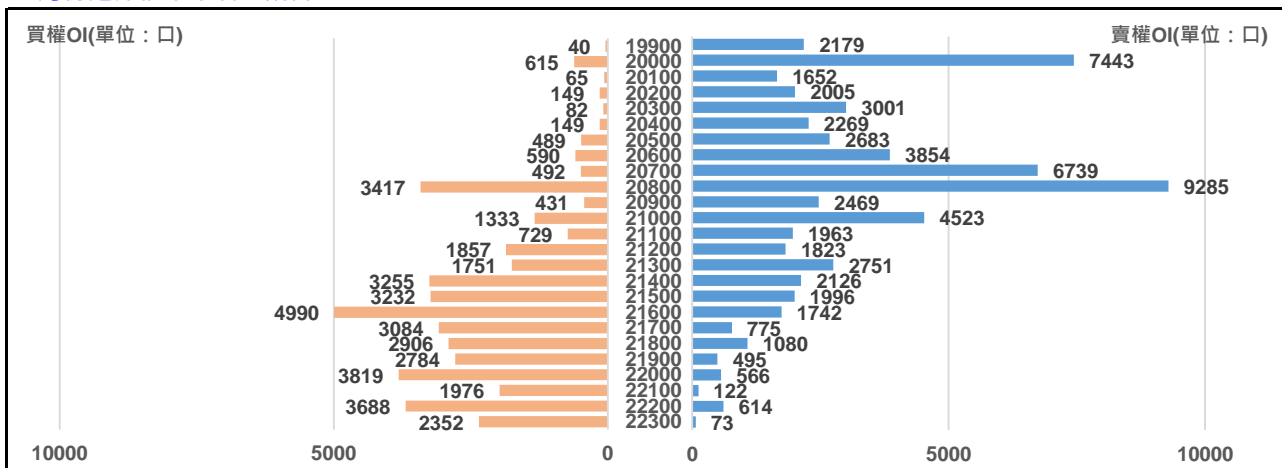
六月份台指選擇權

買權 IV = 14.06 ▼						賣權 IV = 15.83 ▼						
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
0.939	-10	1333	17	+60	1010	21000	63	-20	1784	4523	+379	-0.061
0.914	-17	729	29	+55	925	21100	75	-24	507	1963	+65	-0.086
0.883	-147	1857	285	+50	830	21200	89	-25	1204	1823	+238	-0.117
0.845	-11	1751	21	+50	755	21300	106	-29	1625	2751	+31	-0.155
0.799	-37	3255	384	+40	665	21400	125	-32	1055	2126	+548	-0.201
0.746	-98	3232	461	+45	600	21500	149	-38	1144	1996	+551	-0.254
0.687	-143	4990	304	+40	525	21600	179	-40	784	1742	+139	-0.313
0.623	-29	3084	614	+36	459	21700	211	-40	609	775	+117	-0.377
0.556	-337	2906	1713	+30	393	21800	247	-46	1006	1080	+461	-0.444
0.488	+171	2784	817	+30	340	21900	289	-47	668	495	+241	-0.512
0.420	-308	3819	1524	+28	288	22000	337	-54	589	566	+179	-0.580
0.355	+140	1976	778	+24	240	22100	390	-56	178	122	+65	-0.645
0.294	+164	3688	1422	+23	200	22200	457	-48	184	614	+79	-0.706
0.239	-1329	2352	2422	+16	161	22300	520	-55	39	73	+57	-0.761
0.190	+272	2153	506	+14	130	22400	580	-70	42	45	+26	-0.810

近月選擇權IV走勢圖



六月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調

第五週台指選擇權

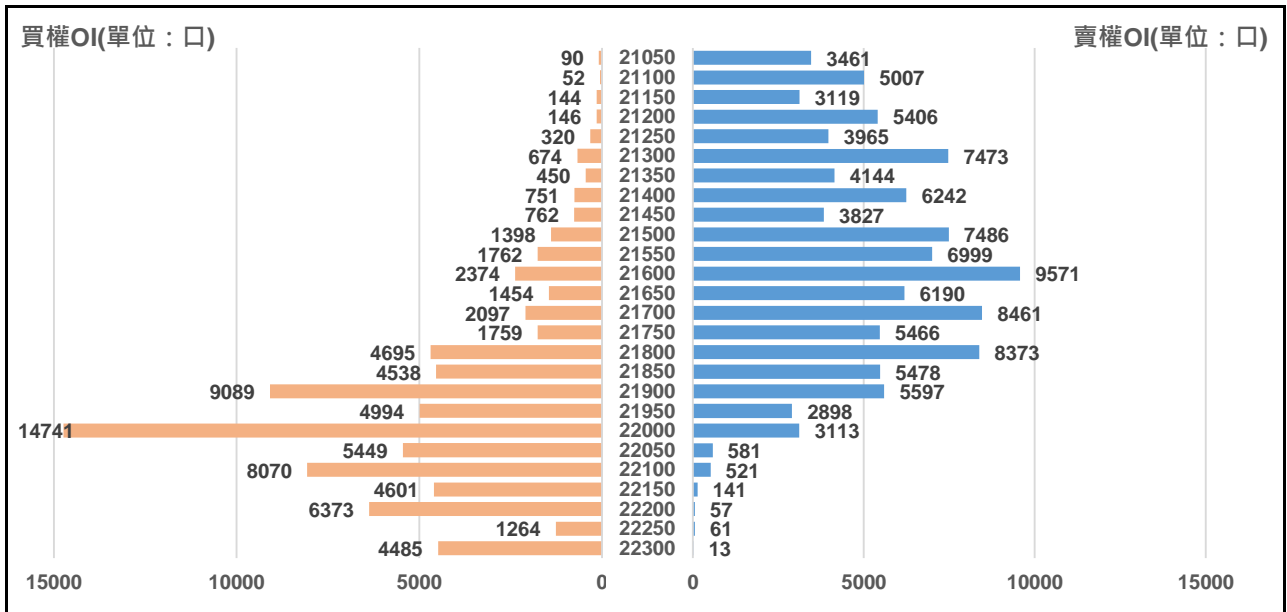
買權 IV = 44.39 ▲							賣權 IV = 18.81 ▲					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
1.000	0	4	0	+70	1270	20650	0.3	-0.6	94	795	-19	0.000
1.000	0	4	1	+70	1220	20700	0.3	-0.7	134	2626	-33	0.000
1.000	0	9	0	+70	1170	20750	0.3	-0.8	306	1209	-295	0.000
1.000	0	11	0	+70	1120	20800	0.3	-0.8	109	3268	-148	0.000
1.000	0	2	0	+70	1070	20850	0.3	-1	470	3413	-416	0.000
1.000	0	3	0	+70	1020	20900	0.3	-1.1	1227	4008	-375	0.000
1.000	0	19	0	+70	970	20950	0.4	-1.1	202	1781	-173	0.000
1.000	-11	54	2	+70	920	21000	0.5	-1.3	1543	7987	-744	0.000
1.000	0	90	0	+70	870	21050	0.7	-1.3	520	3461	+11	0.000
1.000	-3	52	4	+70	820	21100	0.7	-1.5	1192	5007	-527	0.000
1.000	-1	144	1	+70	770	21150	0.8	-1.8	1043	3119	-892	0.000
1.000	-27	146	38	+70	720	21200	0.8	-2.2	976	5406	-657	0.000
1.000	-23	320	34	+70	670	21250	0.9	-2.5	1640	3965	-775	0.000
1.000	-33	674	50	+70	620	21300	1.2	-3	4243	7473	-2107	0.000
1.000	-2	450	10	+70	570	21350	1.3	-4	4389	4144	-1255	0.000
1.000	-143	751	176	+70	520	21400	1.5	-5	5829	6242	-12	0.000

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	3256	0	0	0	+3256	3.0%
PUT	0	0	10430	+2217	-10430	-6.1%

Contract	非特定法人					
	買方	增減	賣方	增減	淨部位	市場%
CALL	31049	+1669	41324	+3500	-10275	-9.6%
PUT	48091	+10138	31536	+690	+16555	9.7%

第五週選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調