

期貨盤後日報

2022年5月27日

台股指數收盤概況

台新證券期貨業務部

台股相關	收盤	漲跌	漲跌幅%	開盤	最高	最低
加權指數	16266.22	297.39	1.86%	16075.91	16266.22	16075.91
台股指數近月	16230	280	1.76%	16110	16245	16100
櫃買指數	196.91	3.59	1.86%	193.75	197.04	193.75
電子	751.23	15.63	2.12%	742.41	751.23	742.41
電子指數近月	749.7	15.25	2.08%	743.85	749.85	742.65
金融保險	1654.97	33.38	2.06%	1622.72	1657.82	1622.72
金融指數近月	1653.4	31.8	1.96%	1636.2	1658.4	1629.6

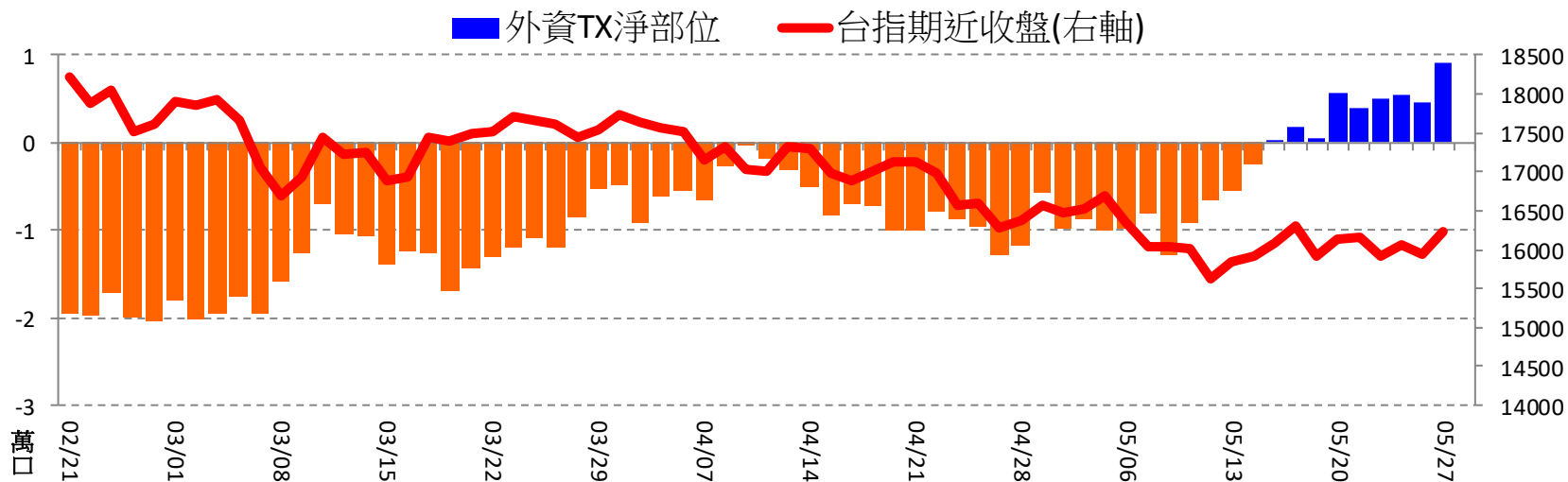
股票期貨下跌交易量排行

台新證券期貨業務部

	證券代號	標的證券	商品代碼	收盤價	漲跌	漲跌幅	日交易量	交易稅
1	3035	智原	FIIPF	232	-6.5	-2.73%	5498	9
2	2313	華通	FIFTF	47.2	-0.85	-1.77%	2451	2
3	3443	創意	FIJBF	553	-6	-1.07%	791	22
4	5009	榮剛	FINJF	31.05	-0.05	-0.16%	623	1
5	4958	臻鼎-KY	FILUF	114.5	-2	-1.72%	515	5
6	3324	雙鴻	FIPTF	175	-2	-1.13%	340	7
7	2383	台光電	FIPJF	231.5	-1.5	-0.64%	226	9
8	6153	嘉聯益	FIJZF	21.9	-0.7	-3.10%	148	1
9	9939	宏全	FIKOF	74.7	-0.3	-0.40%	137	3
10	006205	富邦上証ETF	FIOAF	31.38	-0.03	-0.10%	122	6
11	2347	聯強	FIGAF	70.5	-0.2	-0.28%	75	3
12	2356	英業達	FILQF	25.7	-0.15	-0.58%	73	1
13	1402	遠東新	FICRF	31.2	-0.5	-1.58%	63	1
14	6274	台燿	FIOVF	75.6	-0.5	-0.66%	50	3

三大法人期貨未平倉

台新證券期貨業務部



期貨市場	台指期		電子期		金融期	
	淨增減	淨部位	淨增減	淨部位	淨增減	淨部位
自營商	-871	9,048	31	-72	212	-191
投信	494	-10,064	1	134	0	39
外資	4,684	9,212	158	414	-149	-739

自營商&外資選擇權當日交易狀況

台新證券期貨業務部

台指選	交易口數與契約金額					
	買方		賣方		買賣差額	
買權	口數	金額	口數	金額	口數	金額
CALL						
自營商	86,504	34,071	81,464	31,603	5,040	2,468
外資	62,246	28,235	55,186	27,419	7,060	816
賣權	買方		賣方		買賣差額	
PUT	口數	金額	口數	金額	口數	金額
自營商	90,609	27,141	98,094	30,162	-7,485	-3,021
外資	65,955	27,730	64,801	27,501	1,154	229

單位：口；萬元

外資選擇權OI統計

台新證券期貨業務部

外資		買方部位		賣方部位		淨部位	
選擇權	日期	口數	金額	口數	金額	口數	金額
買權 CALL	05/26	21,993	10,233	13,216	10,910	8,777	-677
	05/27	34,111	18,149	18,274	19,179	15,837	-1,031
賣權 PUT	05/26	30,944	63,608	14,347	20,385	16,597	43,222
	05/27	32,620	50,597	14,869	14,298	17,751	36,299

單位：口；萬元

自營商選擇權OI統計

台新證券期貨業務部

自營商		買方部位		賣方部位		淨部位	
選擇權	日期	口數	金額	口數	金額	口數	金額
買權 CALL	05/26	64,766	27,760	41,250	10,943	23,516	16,817
	05/27	70,048	46,773	41,492	19,568	28,556	27,205
賣權 PUT	05/26	37,679	31,484	40,994	74,065	-3,315	-42,581
	05/27	41,712	23,512	52,512	56,646	-10,800	-33,134

單位：口；萬元

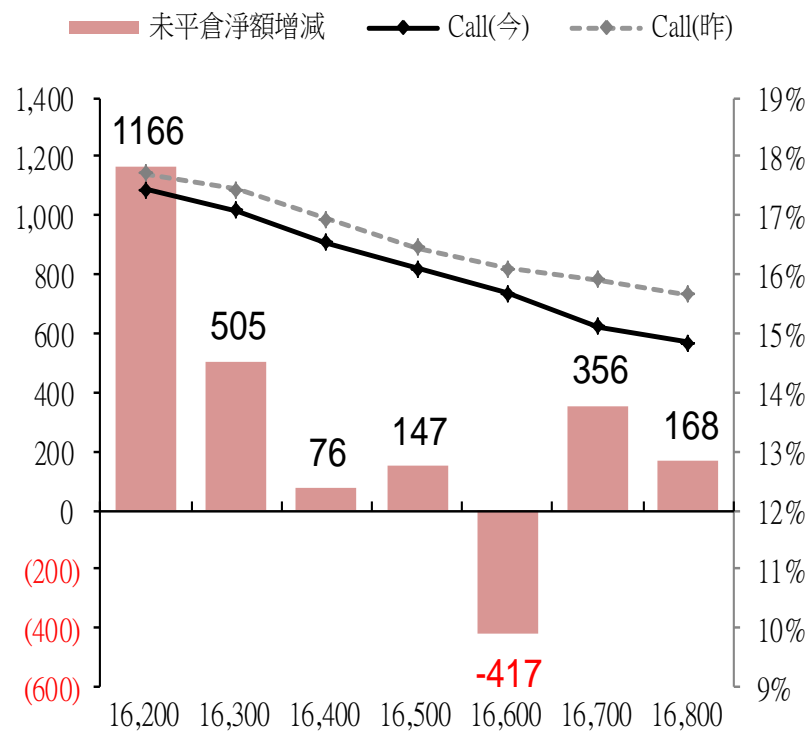
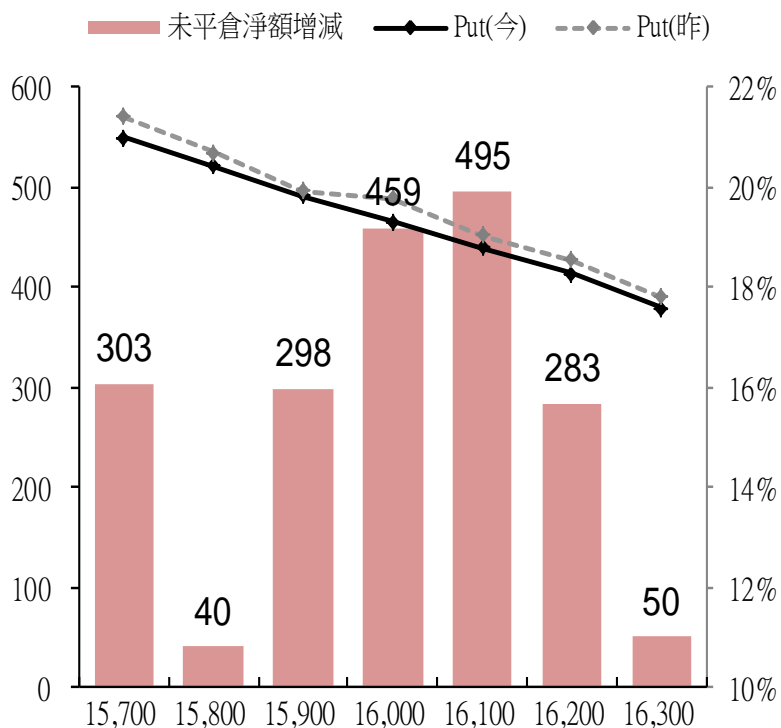
台指選擇權交易概況

台新證券期貨業務部

6月買權						6月賣權						
今IV	IV增減	今OI	OI增減	成交量	收盤	履約價	收盤	成交量	今OI	OI增減	今IV	IV增減
19.99%	-0.09%	492	24	110	715	15,600	91	1,162	3,975	272	21.55%	-0.52%
19.84%	-0.61%	513	-11	149	635	15,700	108	2,050	3,294	303	20.99%	-0.42%
19.78%	0.23%	1,183	-2	170	560	15,800	128	1,890	3,954	40	20.43%	-0.26%
18.68%	-0.75%	1,987	81	455	476	15,900	151	1,419	4,909	298	19.83%	-0.10%
18.65%	-0.15%	3,256	-237	1,048	410	16,000	179	2,590	5,866	459	19.30%	-0.47%
18.58%	0.39%	2,767	17	1,127	349	16,100	212	1,202	2,524	495	18.79%	-0.25%
17.45%	-0.26%	4,385	1,166	3,338	278	16,200	250	1,266	2,150	283	18.27%	-0.26%
17.08%	-0.36%	3,965	505	2,667	224	16,300	291	872	1,263	50	17.57%	-0.23%
16.55%	-0.40%	5,205	76	2,384	174	16,400	348	466	799	77	17.54%	0.03%
16.11%	-0.34%	6,984	147	3,317	132	16,500	402	224	754	114	16.86%	0.05%
15.68%	-0.41%	6,382	-417	2,686	97	16,600	468	116	444	61	16.59%	-1.52%
15.11%	-0.80%	8,946	356	3,828	67	16,700	540	75	282	15	16.33%	0.69%
14.85%	-0.80%	11,125	168	3,679	47	16,800	620	35	554	11	16.31%	2.90%
14.57%	-1.23%	4,137	33	2,058	31	16,900	700	8	173	-5	15.80%	--
16.59%	+1.53%	102,177	+2,417	30,727	合計			22,016	53,943	+3,718	18.94%	-1.20%
近成交量	P/C	71.65%	+13.28%					次成交量	P/C	32.29%	-44.83%	
近留倉	P/C	52.79%	+2.45%					次留倉	P/C	67.77%	-36.77%	

TXO主序列隱波率與OI增減

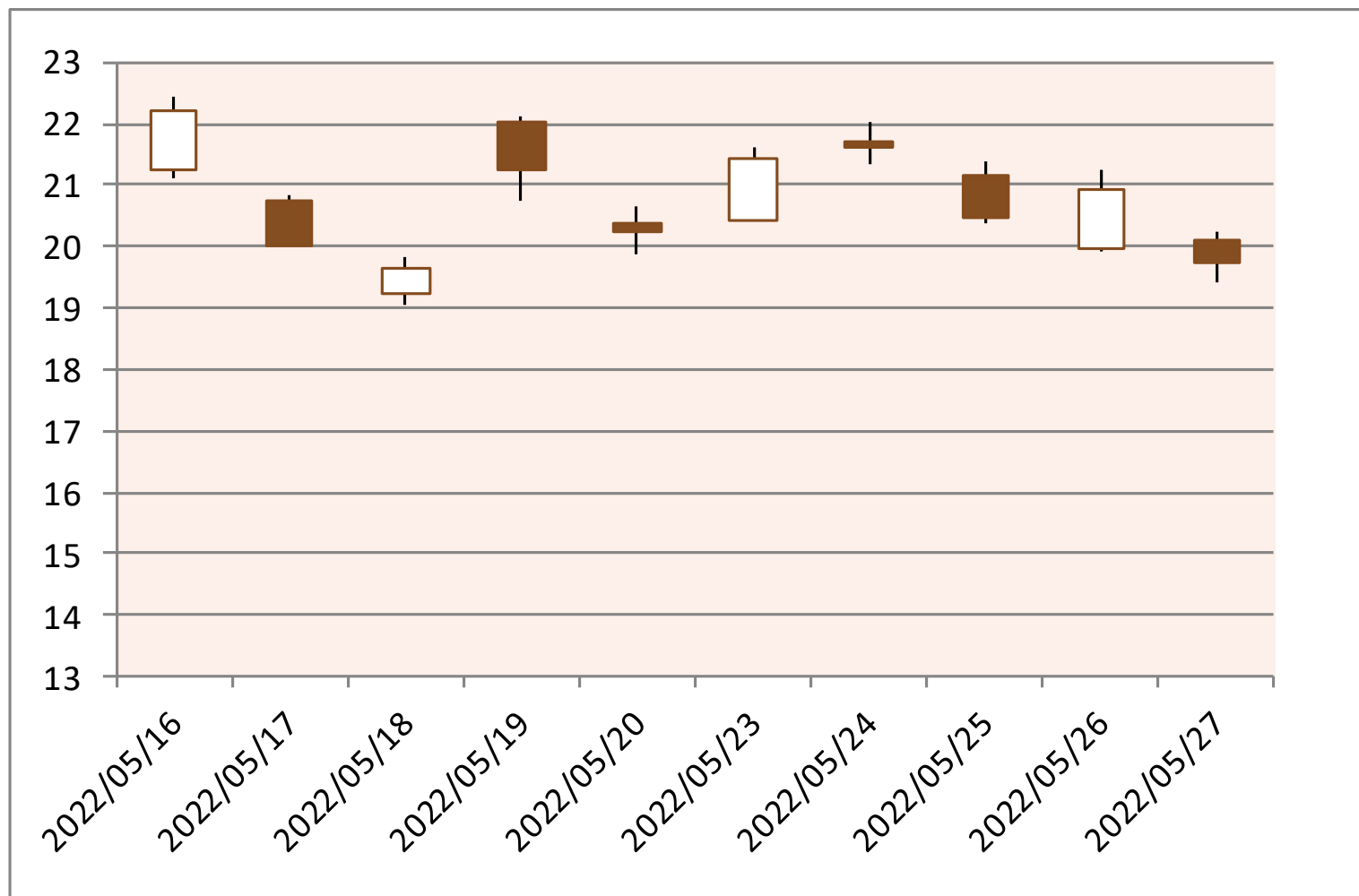
台新證券期貨業務部



■ 賣方力道上升

■ 賣方力道上升

恐慌指數(VIX)



Thank You

