

## 改版預告 (日報整合併入盤後快訊)

Dear all

永豐期貨考量以下兩點，希望將盤後日報整合併入盤後快訊中，請見諒：

- 重複性：目前寄送的盤後日報與盤後快訊的資料重複性高。
- 更新時間：盤後日報更新時間超過4點，而盤後快訊的更新時間為3點，未來進行整合後，日報將能更早地發送出來，提供給先進們參考。

我們預計將在 2024/06/17 (星期一) 後進行全面改版，若有任何問題，再請與我們聯繫，感謝!!

盤後快訊網址：

<https://www.spf.com.tw/sinopacSPF/research/list.do?id=1709f20d3ff0000d8e2039e8984ed51>

### 盤後快訊

選擇年度

2024年

台指期籌碼快訊 2024/06/11

台指期盤後快訊 2024/06/11

台指期籌碼快訊 2024/06/07

台指期盤後快訊 2024/06/07

台指期籌碼快訊 2024/06/06

台指期盤後快訊 2024/06/06

台指期籌碼快訊 2024/06/05

台指期盤後快訊 2024/06/05

三大現貨買賣超(億元) (台幣32.3555元 升值4分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+168.17	+22.31	-24.66	+165.82
上櫃	+26.94	+24.69	-8.80	+42.83

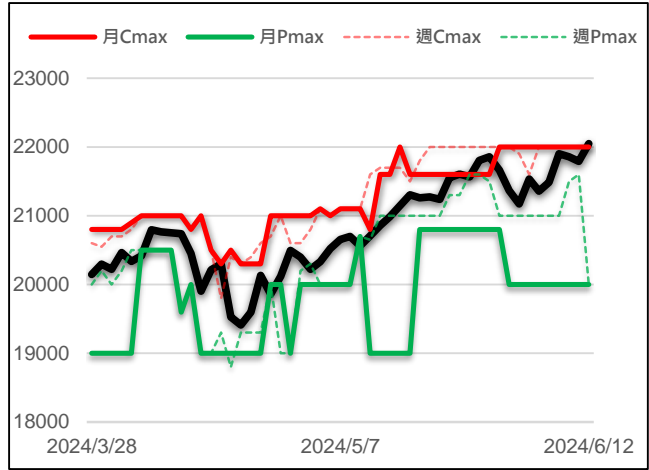
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	387	65.34%	546	26.20%
上櫃股票	368	60.14%	390	34.54%

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	22000	6134	22000	6134
PUT	20000	13784	20000	13784

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	-11139	+4711	-10.7%	+11862	+337	11.4%	-6789	-1189	-6.5%
電子	-135	+5	-7.5%	+165	+3	9.2%	-133	+30	-7.4%
金融	-594	-60	-36.8%	+9	0	0.6%	-70	+7	-4.3%
CALL	+10891	+889	8.7%	+30	0	0.0%	-1267	-10953	-1.0%
PUT	+24822	-1685	11.7%	+16	0	0.0%	-4602	-7210	-2.2%

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	-1672	+6195	-4559	-2150	+5006	-1559	+2744	+2221	103805
電子	-291	-130	-3	+12	+223	+121	-33	-1	1790
金融	-592	+69	-83	-94	+176	-63	-6	+44	1612
CALL	+7462	-604	+2311	-1154	+8520	-1525	-6669	+6374	125235
PUT	-11743	+1970	-6469	+347	-1295	+3091	+1033	+195	211885

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	21841.81	22094.94	21841.81	22048.96	+256.84	+1.18%	4545.9億		
台指期六月	21829	22063	21790	22046	+245	+1.12%	95615	78963	+3643
台指期七月	21700	21927	21662	21914	+246	+1.14%	2655	6287	+1174
小型台指六月	21830	22062	21790	22046	+245	+1.12%	166608	51419	+8324
小型台指七月	21703	21925	21661	21914	+246	+1.14%	15467	13161	+2012
電子指數	1155.48	1177.79	1155.48	1174.82	+23.44	+2.04%	2852.25億		
電子期六月	1153.25	1176.00	1152.45	1174.10	+22.55	+1.96%	1249	1377	-12
電子期七月	1156.00	1170.00	1156.00	1168.65	+22.75	+1.99%	51	85	+16
金融指數	1974.17	1974.17	1958.95	1964.27	-11.44	-0.58%	152.89億		
金融期六月	1973.4	1973.6	1959.8	1967.2	-6.2	-0.31%	768	1338	-135
金融期七月	1960.2	1961.4	1956.0	1962.8	-4.6	-0.23%	102	158	+89
櫃買指數	261.49	264.13	261.49	264.13	+2.78	+1.06%	1117.09億		
櫃買期六月	262.00	262.70	262.00	263.50	+3.1	+1.19%	6	75	+2
非金電指數	16141.81	16186.03	16010.09	16039.79	-106.09	-0.66%	1272.48億		
非金電期六月	16163	16163	15983	16028	-142	-0.88%	180	141	-44

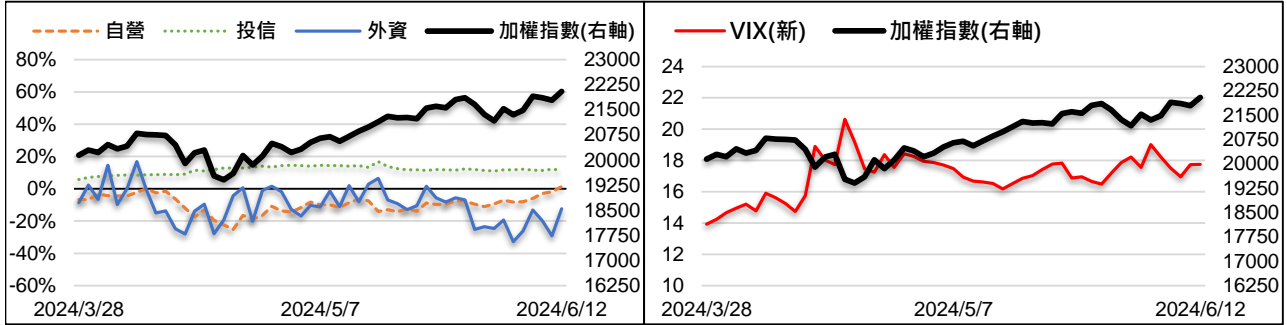
美指期貨現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38795.71	38795.71	38446.24	38747.42	-51.57	-0.13%			
道瓊六月	38763	38820	38751	38820	-40	-0.10%	75	800	+1
標普500指數	5353.00	5375.95	5327.25	5375.32	+28.33	+0.53%			
標普六月	5383	5389	5383	5388.25	+32	+0.60%	41	386	-22
Nasdaq 100指數	19210.18	19210.18	19210.18	19210.18	+209.23	+1.10%			
那斯達十二月	19253	19275	19242	19269	+171	+0.90%	469	3037	-69

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

17.76 +0.02



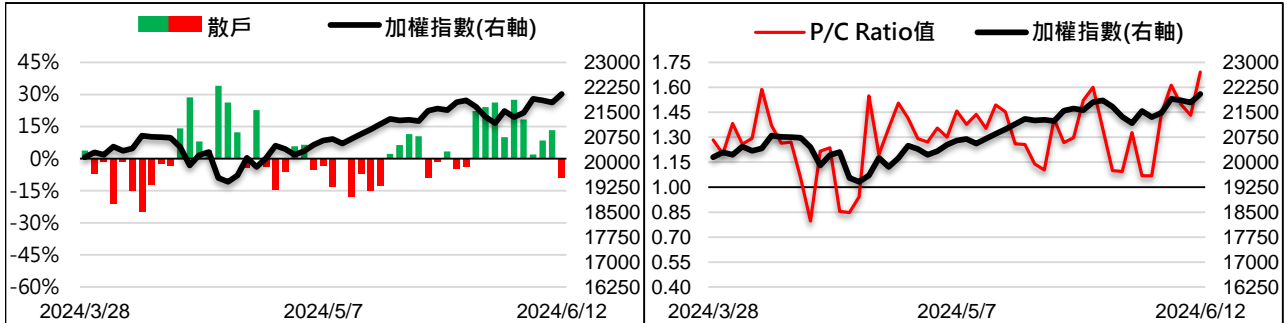
散戶小台指佔全市場OI比率

-8.99%

-22.34%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.69 +0.26



永豐期貨研調

## 台積電、聯發科、鴻海聯手拉抬 指數再創高點

指數週三上漲256.84點，收在22048.96點，成交量4545.94億元。台指期上漲245點至22046點，逆價差為-2.96點。籌碼面部分，三大法人買超165.83億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單減少3859口至-6066口，其中外資淨空單減少4711口至-11139口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單減少4045口至-6231口。

由於昨日以巴停火協議衝擊，貨櫃集運指數閃崩，台股運輸類股重挫，連帶影響晚間美股表現。金融與傳產成分較重的道瓊與小型股羅素2000指數跌幅落在0.3%-0.4%之間。而電子股部份則相對強勢，納指上漲0.88%強勢創高，美股盤面格局與台股雷同。台股今日強勢上漲256點，再創歷史新高，電子三雄扮演關鍵要角，台積電貢獻213點、鴻海貢獻30點、聯發科貢獻15點，基本上佔據指數所有漲幅。而剔除電子類股，整體盤面下跌居多，跌幅較重族群仍是貨櫃航運，散裝航運指標也是全數收跌，金融股表現同樣不佳，富邦金、國泰金與開發金佔據指數負貢獻前10。由於今天台積電的拉抬已消耗相當程度的漲幅，若今晚CPI數據並為優於預期，台指夜盤再度噴出的可能性較低，建議觀察CPI數據過後的市場反應，短線刷洗後若量縮價穩可能才是相對安全的點位。

選擇權未平倉量部分，週買權最大OI落在22000點，週賣權最大OI落在20000點；月買權最大OI落在23500點，月賣權最大OI落在21000點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.43上升至1.69。VIX指數上升0.02至17.76。外資台指期買權淨金額2.75億元；賣權淨金額0.25億元。整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

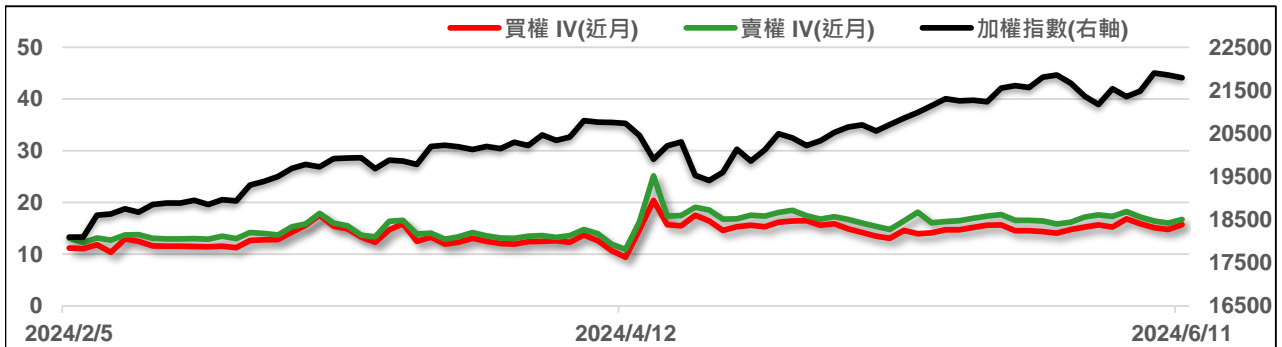
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 187.28% ▲				所有月份	P/C ratio = 169.19% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	86963	+53906	96108	+10427	Call	734422	+301133	125235	-89819
Put	100860	+64183	179989	+26039	Put	741050	+326212	211885	-95961

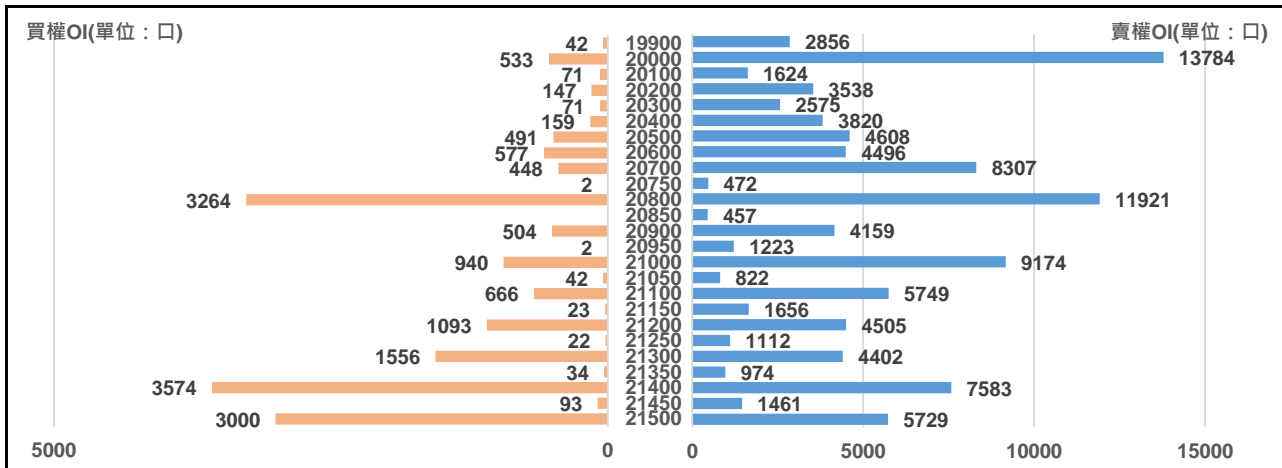
六月份台指選擇權

買權 IV = 16.31 ▲							賣權 IV = 17.37 ▲						
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	
0.855	-283	4352	500	+180	505	21600	62	-65	6957	4737	+2092	-0.145	
0.827	-57	236	274	+168	461	21650	73	-70	2571	1101	+690	-0.173	
0.795	-176	2754	1348	+161	424	21700	83	-77	5346	2707	+1184	-0.205	
0.761	+50	241	1007	+158	389	21750	95	-88	3529	826	+497	-0.239	
0.724	-392	2516	2970	+152	356	21800	108	-96	4648	2350	+1090	-0.276	
0.684	+51	411	1294	+140	319	21850	122	-107	2873	1027	+673	-0.316	
0.642	-182	3487	3954	+131	287	21900	140	-115	3778	1866	+783	-0.358	
0.598	+72	490	1635	+122	257	21950	158	-126	1975	745	+594	-0.402	
0.553	-392	6134	7903	+113	228	22000	179	-136	4032	2279	+1167	-0.447	
0.508	+650	991	2926	+100	198	22050	202	-145	1453	642	+517	-0.492	
0.462	+429	3445	5668	+91	175	22100	226	-155	1065	639	+436	-0.538	
0.417	+732	1062	2895	+83	152	22150	256	-162	270	224	+184	-0.583	
0.374	+361	5876	6963	+72	130	22200	288	-169	671	778	+286	-0.626	
0.332	+739	1044	3469	+63	112	22250	316	-189	92	82	+80	-0.668	
0.292	+281	5743	6249	+54.5	95	22300	349	-191	272	199	+80	-0.708	

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