

## 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32.3303元 升值5.6分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+323.05	+5.40	+17.90	+346.35
上櫃	+57.50	+3.22	-1.81	+58.91

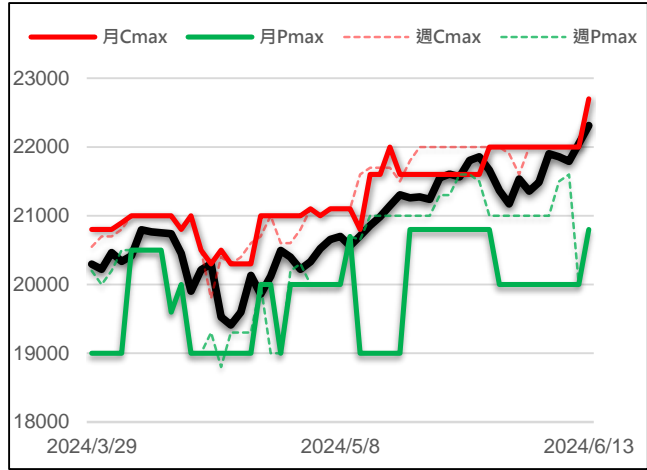
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	518	78.00%	380	15.25%
上櫃股票	398	51.13%	341	36.77%

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	22700	11163	22700	11163
PUT	20800	11768	20800	11768

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	-13318	-2179	-13.0%	+12280	+418	12.0%	-6090	+699	-5.9%
電子	-194	-59	-11.2%	+164	-1	9.5%	-61	+72	-3.5%
金融	-784	-190	-46.9%	+9	0	0.5%	-57	+13	-3.4%
CALL	+12554	+1663	7.3%	+30	0	0.0%	+11682	+12949	6.8%
PUT	+20607	-4215	7.6%	+16	0	0.0%	-281	+4321	-0.1%

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	-2073	-401	-5877	-1318	+3687	-1319	+3401	+657	102600
電子	-332	-41	-12	-9	+233	+10	-51	-18	1725
金融	-691	-99	-187	-104	+283	+107	+37	+43	1673
CALL	+10493	+3031	-2005	-4316	+5558	-2962	-675	+5994	172296
PUT	-10024	+1719	-3004	+3465	-3318	-2023	-5264	-6297	271782

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	22217.64	22440.10	22211.08	22312.04	+263.08	+1.19%	5257.3億		
台指期六月	22308	22473	22207	22325	+279	+1.27%	114828	75421	-3542
台指期七月	22184	22333	22078	22192	+278	+1.27%	5958	10084	+3797
小型台指六月	22310	22473	22208	22325	+279	+1.27%	196115	46821	-4598
小型台指七月	22180	22332	22076	22192	+278	+1.27%	17762	13855	+694
電子指數	1186.38	1202.46	1184.60	1193.57	+18.75	+1.60%	3586.44億		
電子期六月	1188.20	1202.50	1183.60	1193.45	+19.35	+1.65%	1195	1250	-127
電子期七月	1185.40	1192.85	1181.10	1188.00	+19.35	+1.66%	66	150	+65
金融指數	1967.74	1978.49	1967.74	1969.29	+5.02	+0.26%	125.88億		
金融期六月	1974.6	1989.0	1973.8	1976.0	+8.8	+0.45%	1152	1092	-246
金融期七月	1974.0	1977.2	1971.0	1971.8	+9	+0.46%	295	447	+289
櫃買指數	264.51	267.31	264.51	266.17	+2.04	+0.77%	1235.77億		
櫃買期六月	266.95	267.00	265.00	266.40	+2.9	+1.10%	20	70	-5
非金電指數	16095.1	16154.86	16087.66	16095.83	+56.04	+0.35%	1146.61億		
非金電期六月	16126	16211	16037	16122	+94	+0.59%	149	144	+3

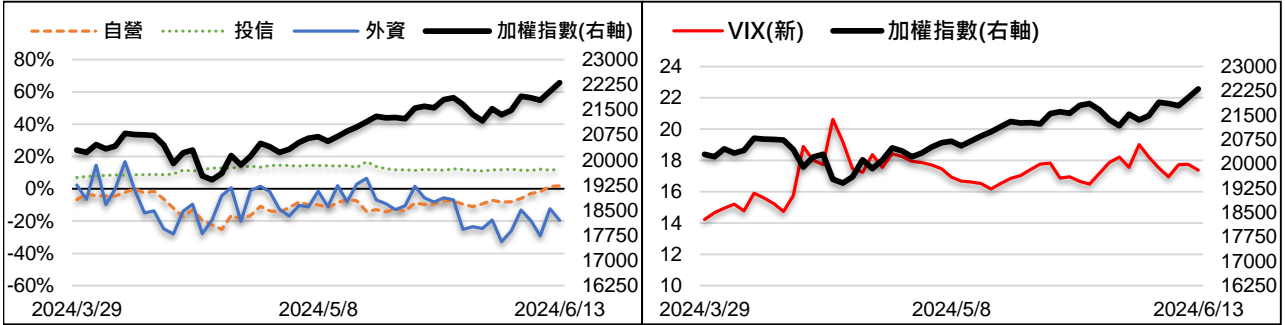
美指期貨現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38950.65	39120.26	38621.45	38712.21	-35.21	-0.09%			
道瓊六月	38705	38751	38701	38702	-118	-0.30%	127	766	-34
標普500指數	5409.13	5447.25	5409.13	5421.03	+45.71	+0.85%			
標普六月	5441.75	5442	5440.75	5440.75	+52.5	+0.97%	26	393	+7
Nasdaq 100指數	19465.18	19465.18	19465.18	19465.18	+254.99	+1.33%			
那斯達十二月	19618	19643	19605	19632	+363	+1.88%	897	2603	-434

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

17.39 -0.37



散戶小台指佔全市場OI比率

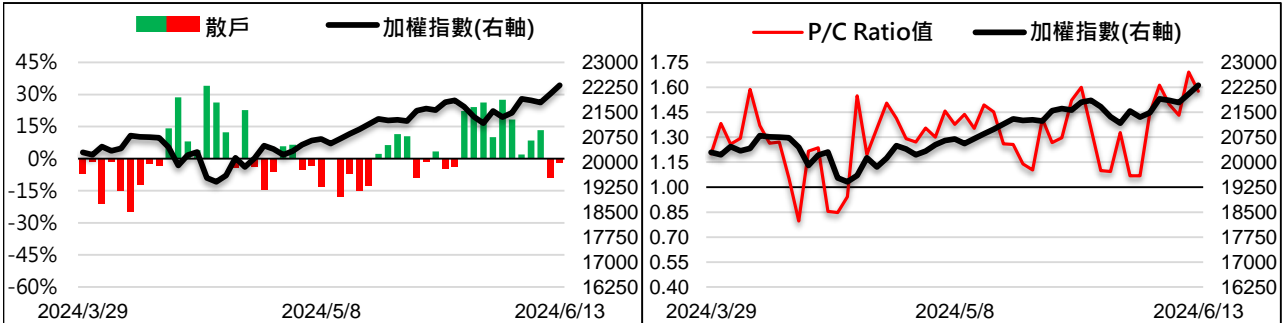
-1.91%

+7.08%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.58

-0.11



永豐期貨研調

## 台積電、聯發科、鴻海聯手拉抬 指數再創高點

指數週四上漲263.08點，收在22312.04點，成交量5257.33億元。台指期上漲279點至22325點，正價差為12.96點。籌碼面部分，三大法人買超346.36億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加1062口至-7128口，其中外資淨空單增加2179口至-13318口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加1719口至-7950口。

美國勞工統計局週三公佈的數據顯示，美國5月CPI年增3.3%，較前值和預期值3.4%小幅下降；剔除食品和能源成本後的5月核心CPI年增3.4%，低於預期3.5%，也低於前值3.6%，為三年多來的最低水準。5月CPI數據激勵美國十年債期貨回補上週非農造成的跌幅，美國電子族群也是全線噴出，僅道瓊開高走低。台股受今年降息機率大增影響下，指數開高逾150點，不過早盤激情結束後小幅拉回，隨後震盪至尾盤。台積電早盤一度漲幅達3%，不過由於昨日週結算，拉抬台積電已用掉過多漲幅，今日走勢開高走低，終場上漲1.43%，貢獻指數106點。10點後主要由聯發科與廣達撐盤，加上鴻海2.4%漲幅三者貢獻指數超過70點。而日前弱勢的航運，轉向殺航空股，海運則相對震盪。資金從傳產類股抽離後流向大型電子股，目前資金流動型態相對有利大盤。

選擇權未平倉量部分，週買權最大OI落在22700點，週賣權最大OI落在20800點；月買權最大OI落在24100點，月賣權最大OI落在21600點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.69下降至1.58。VIX指數下降0.37至17.39。外資台指期買權淨金額3.44億元；賣權淨金額-0.07億元。整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

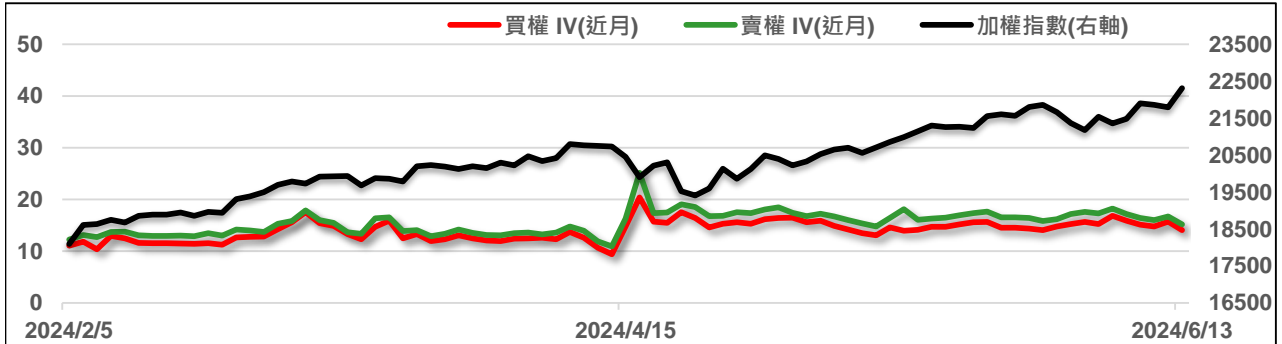
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 167.07% ▼				所有月份	P/C ratio = 157.74% ▼			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	215626	+128663	136272	+40164	Call	400508	-333914	172296	+47061
Put	241058	+140198	227663	+47674	Put	447030	-294020	271782	+59897

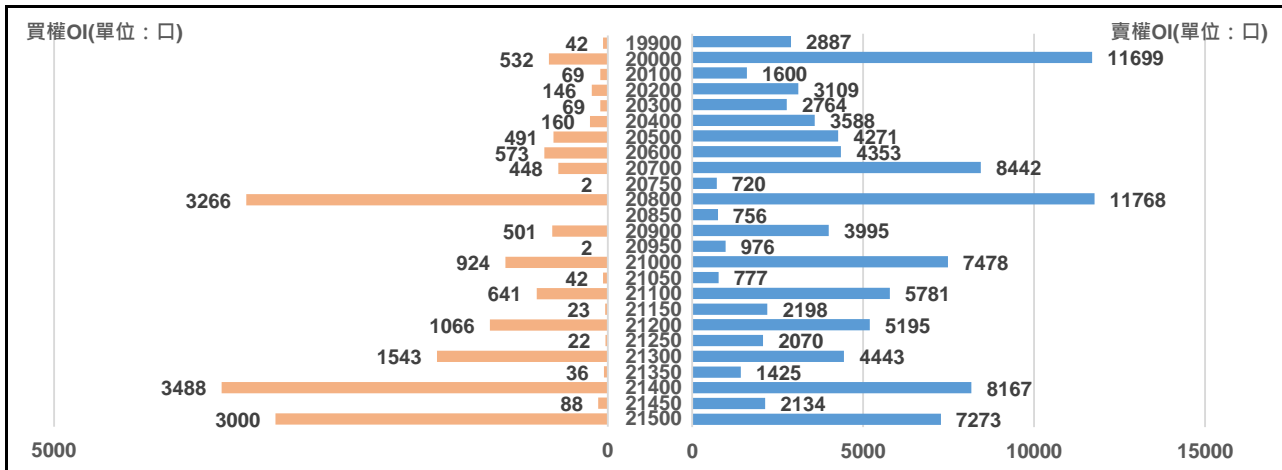
六月份台指選擇權

買權 IV = 14.06 ▼							賣權 IV = 15.2 ▼						
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	
0.872	+46	457	112	+191	510	21850	33.5	-88.5	8707	3504	+2477	-0.128	
0.844	-888	2599	802	+175	462	21900	40.5	-99.5	14486	5617	+3751	-0.156	
0.814	-36	454	646	+163	420	21950	48.5	-109.5	9527	2579	+1834	-0.186	
0.779	-1049	5085	2533	+155	383	22000	58	-121	24422	8898	+6619	-0.221	
0.742	-318	673	2246	+142	340	22050	68	-134	14443	2614	+1972	-0.258	
0.701	-798	2647	4215	+127	302	22100	79	-147	15299	3587	+2948	-0.299	
0.658	-48	1014	3630	+117	269	22150	95	-161	11176	1905	+1681	-0.342	
0.613	+35	5911	9023	+107	237	22200	111	-177	18113	3105	+2327	-0.387	
0.567	+413	1457	6365	+97	209	22250	133	-183	9494	1554	+1472	-0.433	
0.519	-253	5490	14877	+82	177	22300	153	-196	12464	2092	+1893	-0.481	
0.472	+548	1970	10844	+69	151	22350	175	-211	5981	867	+866	-0.528	
0.425	+174	4705	18462	+58	127	22400	201	-223	6839	1067	+983	-0.575	
0.379	+1149	2663	12724	+49	106	22450	228	-235	1658	323	+284	-0.621	
0.335	+2406	7155	21705	+40	88	22500	263	-242	2093	486	+340	-0.665	
0.293	+1490	2441	10881	+31	71	22550	297	-248	543	61	+59	-0.707	

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