

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32.377元 貶值4.7分)

	外資	投信	自營	合計
上市	+199.28	+2.59	+24.41	+226.28
上櫃	+16.08	+1.05	+12.59	+29.72

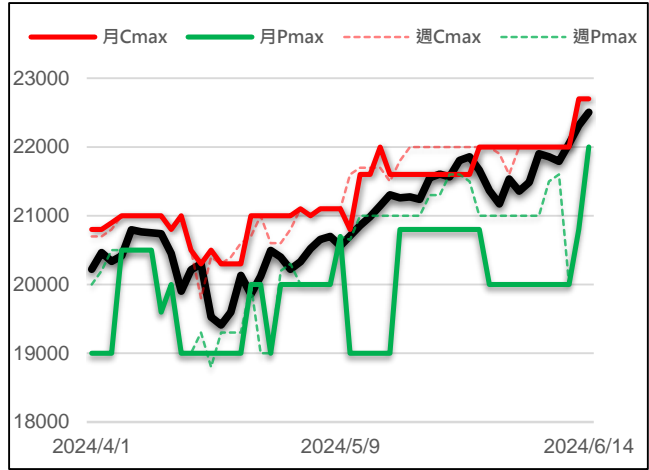
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	597	80.85%	321	13.39%
上櫃股票	423	52.02%	323	41.89%

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	13690	22700	13690
PUT	22000	12625	22000	12625

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	-12855	+463	-12.2%	+12449	+169	11.8%	-6879	-789	-6.5%
電子	-168	+26	-9.7%	+163	-1	9.4%	-53	+8	-3.1%
金融	-761	+23	-43.4%	+9	0	0.5%	-66	-9	-3.8%
CALL	+14196	+1642	7.8%	+30	0	0.0%	+13375	+1693	7.3%
PUT	+21172	+565	6.9%	+16	0	0.0%	-7320	-7039	-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	-2598	-525	-8116	-2239	+3557	-130	+6162	+2761	105498
電子	-282	+50	+34	+46	+246	+13	-91	-40	1727
金融	-577	+114	-305	-118	+212	-71	+126	+89	1752
CALL	+11523	+1030	+928	+2933	+6133	+575	-2478	-1803	182376
PUT	-9525	+499	+206	+3210	+4323	+7641	-9553	-4289	307998

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	22311.93	22504.72	22252.02	22504.72	+192.68	+0.86%	5040.9億		
台指期六月	22274	22514	22270	22510	+185	+0.83%	86467	71619	-3802
台指期七月	22142	22350	22135	22348	+156	+0.70%	10255	15750	+5666
小型台指六月	22268	22513	22268	22510	+185	+0.83%	146014	49496	+2675
小型台指七月	22142	22348	22137	22348	+156	+0.70%	13973	15122	+1267
電子指數	1192.94	1203.31	1185.31	1203.31	+9.74	+0.82%	3195.83億		
電子期六月	1193.85	1205.45	1186.00	1204.95	+11.5	+0.96%	892	1198	-52
電子期七月	1188.00	1198.70	1185.00	1198.70	+10.7	+0.90%	80	187	+37
金融指數	1969.49	1976.95	1966.94	1976.95	+7.66	+0.39%	85.43億		
金融期六月	1974.2	1979.6	1968.0	1977.6	+1.6	+0.08%	668	1062	-30
金融期七月	1968.2	1974.8	1964.6	1970.4	-1.4	-0.07%	167	551	+104
櫃買指數	266.42	267.47	266.13	266.93	+0.76	+0.29%	1134.63億		
櫃買期六月	267.50	267.50	266.45	267.00	+0.6	+0.23%	12	65	-5
非金電指數	16122.14	16304.29	16122.14	16297.23	+201.4	+1.25%	1474.8億		
非金電期六月	16155	16311	16077	16305	+183	+1.14%	83	143	-1

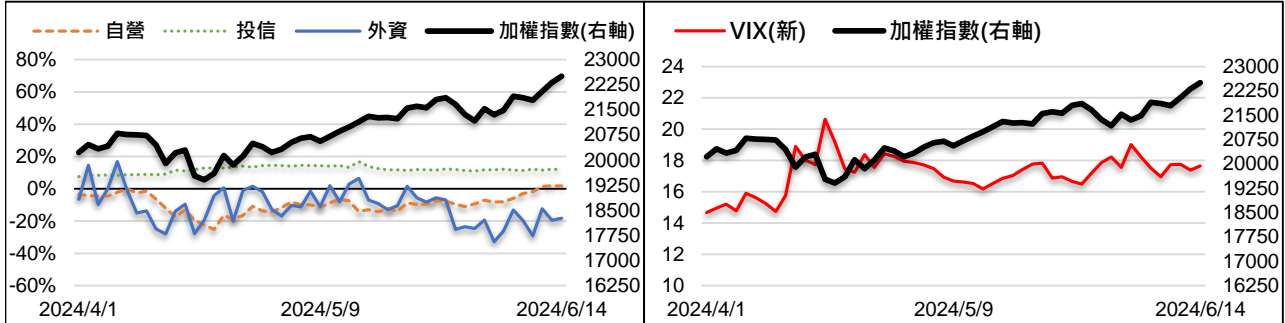
美指期貨現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

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	38677.12	38712.21	38407.70	38647.10	-65.11	-0.17%			
道瓊六月	38702	38702	38634	38682	-20	-0.05%	154	850	+84
標普500指數	5441.93	5441.93	5402.51	5433.74	+12.71	+0.23%			
標普六月	5440.25	5441.5	5440.25	5441.5	+0.75	+0.01%	17	369	-24
Nasdaq 100指數	19576.92	19576.92	19576.92	19576.92	+111.74	+0.57%			
那斯達十二月	19615	19648	19612	19645	+13	+0.07%	408	2492	-111

外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)

VIX波動率指數

17.65 +0.26



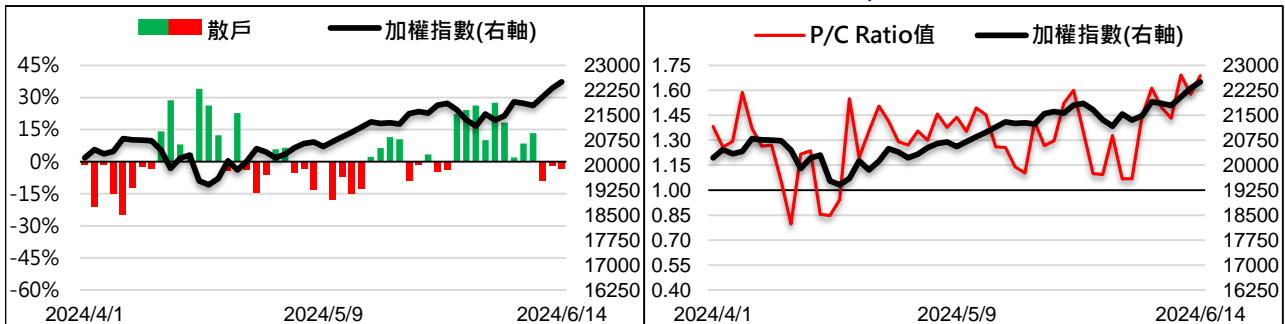
散戶小台指佔全市場OI比率

-3.38%

-1.47%

全月份台指選擇權P/C Ratio值

1.69 +0.11



永豐期貨研調

台積電小漲休息類股輪流撐盤 指數仍大漲近200點

指數週五上漲192.68點，收在22504.72點，成交量5040.91億元。台指期上漲185點至22510點，正價差為5.28點。籌碼面部分，三大法人買超226.27億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加157口至-7285口，其中外資淨空單減少463口至-12855口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加2764口至-10714口。

CPI超预期降溫後，PPI也延續這一態勢，5月美國PPI月增率從0.5%降至-0.2%，遠低於市場預期的0.1%，核心PPI月增率從0.5%降溫至0%，低於市場預期的0.2%。勞動市場也見到降溫的跡象，初次請領失業金人數從22.9萬人上升到24.2萬人，高於市場預期的22.5萬人。數據利好強化Fed今年降息兩碼預期，美債殖利率再度迎來下跌。目前美股依然是科技板塊一枝獨秀，昨日依然維持羅素2000與道瓊下跌，標普、納指、費半全數上漲的情況。台股資金流向則迎來改變，雖然大體上仍是電子股偏強，不過資金有流出台積電的跡象，台積電今日小漲0.33%僅對指數帶來24點貢獻，但指數卻上漲近200點。可發現資金大舉湧入高價股，千元股僅兩檔小跌、一檔平盤，其餘全數上漲，且大立光、祥碩、嘉澤等高價股都是經過整理後的補量噴出。航運股與重電族群更是在指標股漲停激勵下，成為撐盤要角，指數續創歷史新高。

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22000點；月買權最大OI落在23100點，月賣權最大OI落在21800點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.58上升至1.69。VIX指數上升0.26至17.65。外資台指期買權淨金額4.11億元；賣權淨金額-0.03億元。整體選擇權籌碼面中性。(永豐期貨研調)

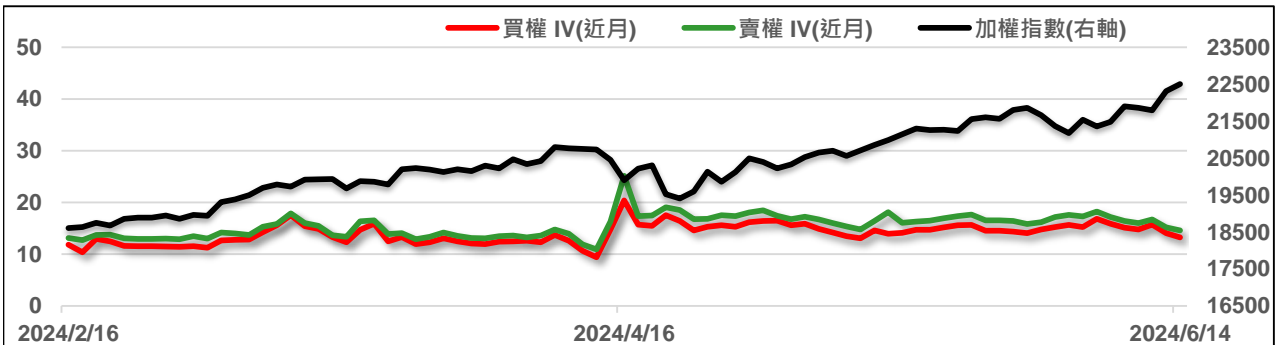
全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 180.32% ▲				所有月份	P/C ratio = 168.88% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	160447	-55179	142654	+6382	Call	309085	-91423	182376	+10080
Put	205825	-35233	257234	+29571	Put	359358	-87672	307998	+36216

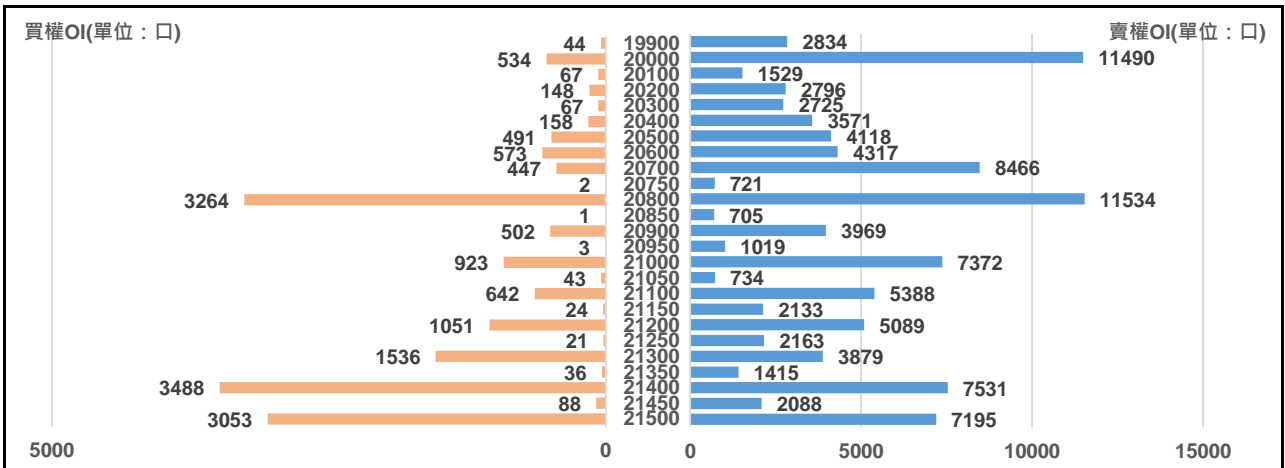
六月份台指選擇權

買權 IV = 13.24 ▼						賣權 IV = 14.58 ▼						
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
0.886	+15	688	355	+145	485	22050	24.5	-43.5	10866	5850	+3236	-0.114
0.859	-136	2511	1208	+138	440	22100	30	-49	14725	6632	+3045	-0.141
0.827	-109	905	1450	+128	397	22150	36.5	-58.5	11001	4344	+2439	-0.173
0.792	-972	4939	4615	+121	358	22200	44.5	-66.5	14893	5540	+2435	-0.208
0.752	+42	1499	4810	+104	313	22250	53	-80	11798	3195	+1641	-0.248
0.709	-366	5124	11179	+100	277	22300	66	-87	17973	4667	+2575	-0.291
0.663	-44	1926	10569	+90	241	22350	80	-95	8970	2037	+1170	-0.337
0.614	-616	4089	16920	+77	204	22400	96	-105	11702	3286	+2219	-0.386
0.564	+55	2718	13281	+69	175	22450	113	-115	3939	1219	+896	-0.436
0.512	+124	7279	17588	+58	146	22500	136	-127	5304	2020	+1534	-0.488
0.461	+51	2492	9225	+51	122	22550	162	-135	660	339	+278	-0.539
0.410	-41	7399	16555	+41	98	22600	187	-146	980	516	+179	-0.590
0.361	+1300	3175	8836	+33.5	80	22650	219	-152	126	58	+53	-0.639
0.314	+2527	13690	11858	+28	63	22700	253	-157	402	262	+19	-0.686
0.270	0	1483	3461	0	50	22750	288	0	29	26	0	-0.730

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