



## 法人籌碼動態

06月23日	臺股期貨		電子期貨		金融期貨	
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資及陸資	-32,464	-1,392	153	-229	-1,373	-109
投信	1,654	1,068	171	0	8	0
自營商	18,513	-929	199	289	-75	61

06月23日	非金電期貨		臺指選擇權CALL		臺指選擇權PUT	
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資及陸資	-11	-148	-6,591	3,456	-7,888	-2,267
投信	2	0	0	0	-62	0
自營商	20	153	-1,019	-2,107	4,667	9,646

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台積電	144.45	長榮	-25.67	台指期前十大 市場佔比	47.2%	56.6%
聯發科	19.80	萬海	-18.17			
鴻海	13.63	陽明	-12.94			
台塑化	12.49	中鋼	-3.88	電子期前十大 市場佔比	62.7%	74.2%
聯電	8.14	慧洋-KY	-2.42			
國泰金	7.23	裕民	-2.27			
和泰車	6.09	中鴻	-1.62	金融期前十大 市場佔比	57.5%	86.5%
日月光投控	4.31	微星	-1.25			
富邦金	4.15	欣興	-1.23			
研華	3.54	榮運	-1.21	非金電期前十大 市場佔比	91.6%	84.8%
前十名合計	223.82	後十名合計	-70.65			

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

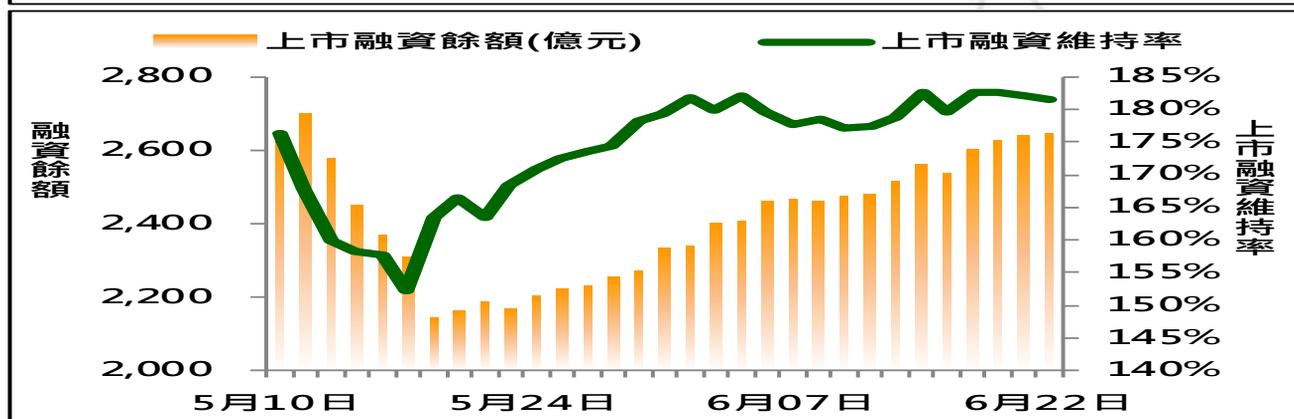
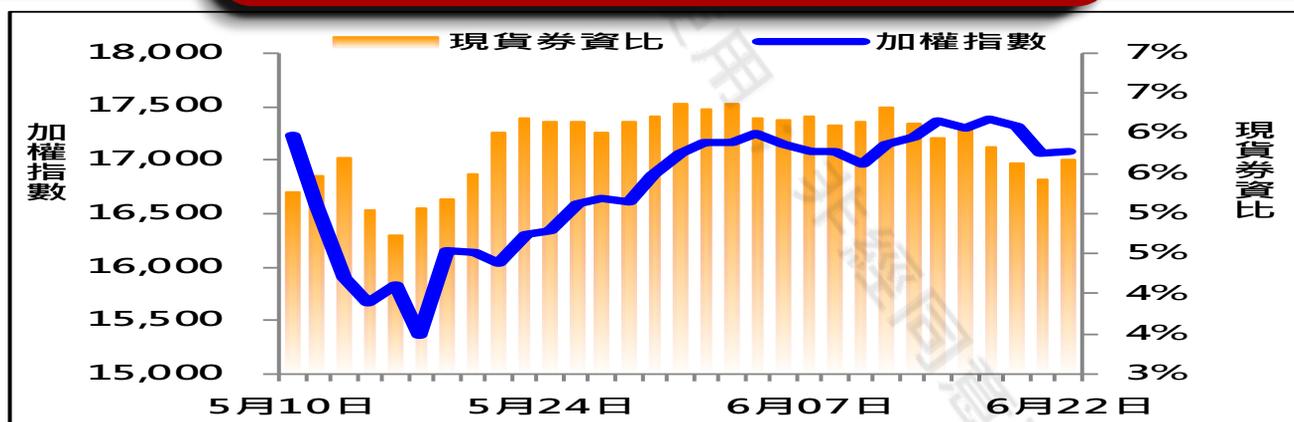


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

日期	外資現貨 & 期貨籌碼變化			自營商現貨 & 期貨籌碼變化		
	現貨買賣超(億)	期貨留倉(口)	留倉增減(口)	現貨買賣超(億)	期貨留倉(口)	留倉增減(口)
06月17日	-68.8	-33,088	-4,070	6.1	21,376	1,564
06月18日	-162.5	-31,612	1,476	-11.0	20,970	-406
06月21日	-335.9	-31,474	138	-48.4	21,080	110
06月22日	-111.3	-31,072	402	-12.3	19,442	-1,638
06月23日	109.5	-32,464	-1,392	141.9	18,513	-929

日期	外資選擇權籌碼變化			自營商選擇權籌碼變化		
	CALL 未平倉	PUT 未平倉	未平倉淨部位	CALL 未平倉	PUT 未平倉	未平倉淨部位
06月17日	-5,839	-10,695	4,856	-577	11,990	-12,567
06月18日	-6,689	-10,280	3,591	-13	5,832	-5,845
06月21日	-10,635	-5,061	-5,574	-9,915	5,361	-15,276
06月22日	-10,047	-5,621	-4,426	1,088	-4,979	6,067
06月23日	-6,591	-7,888	1,297	-1,019	4,667	-5,686

## 現貨券資比 & 上市融資維持率



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

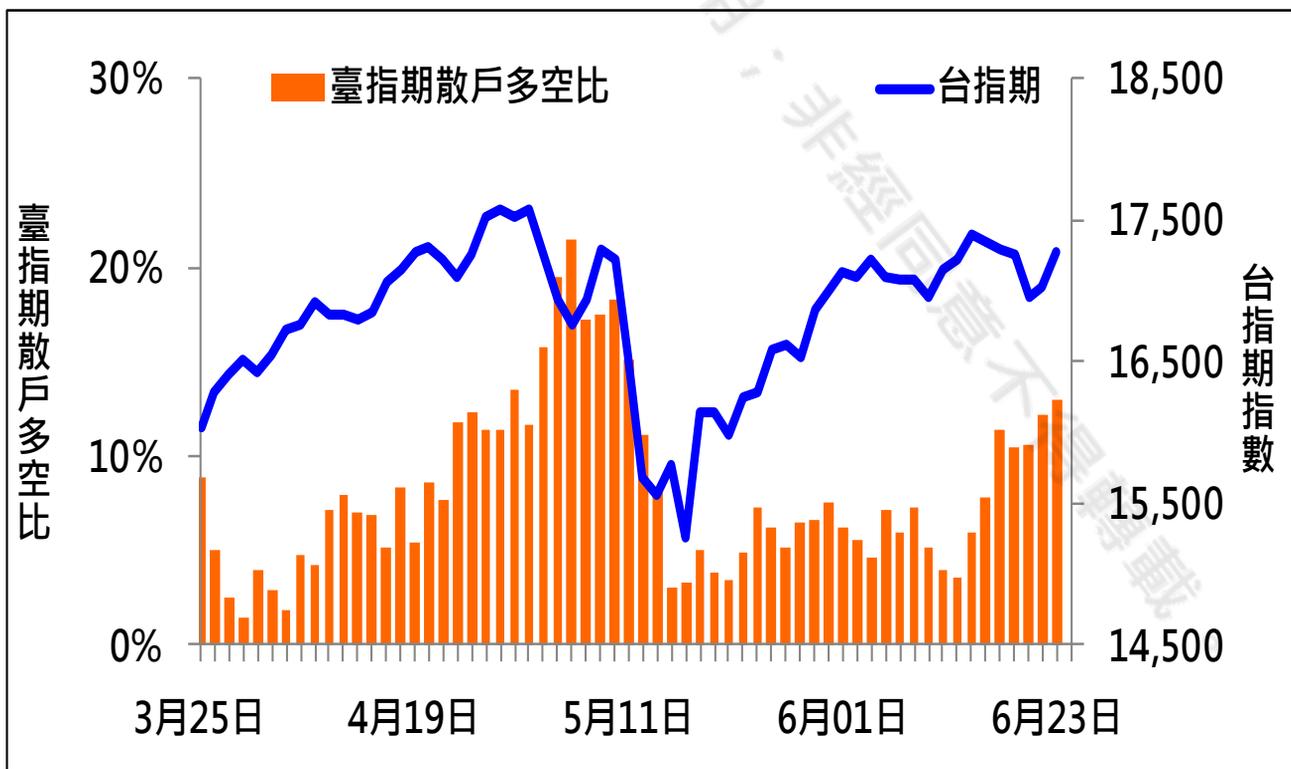
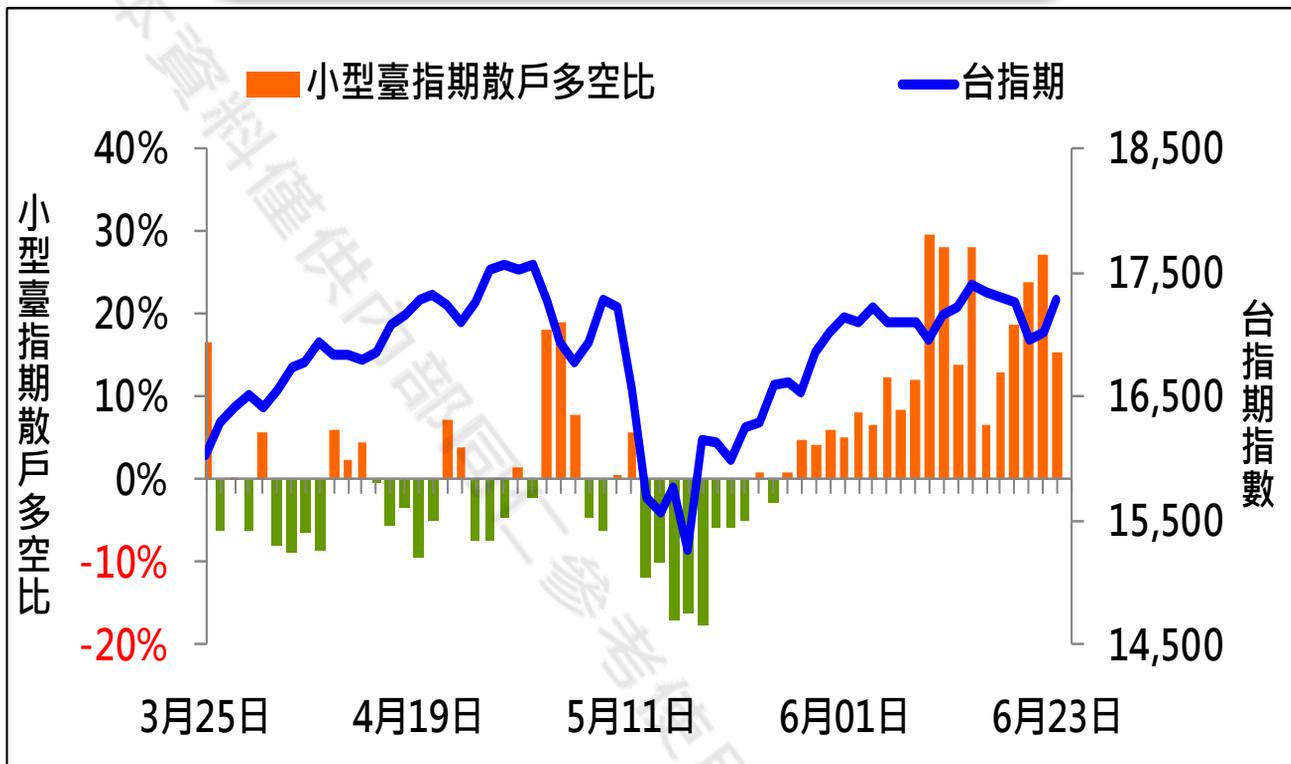
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 散戶多空比



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

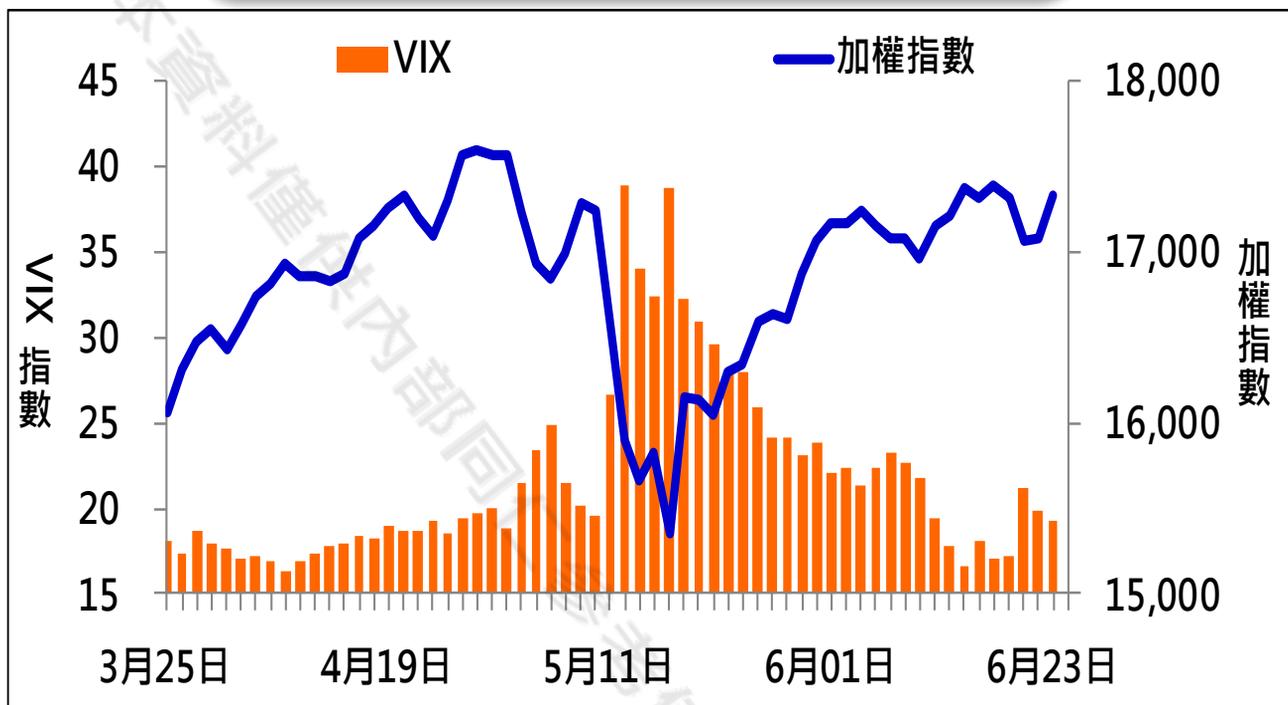
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

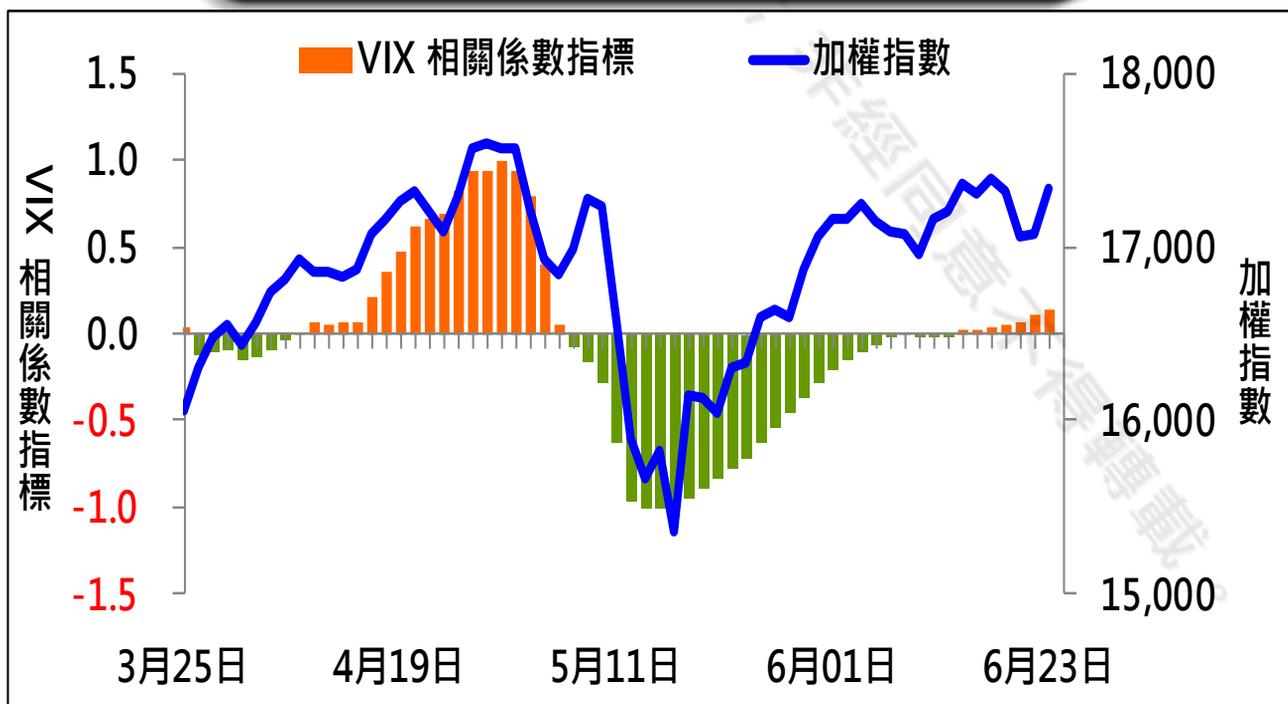
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

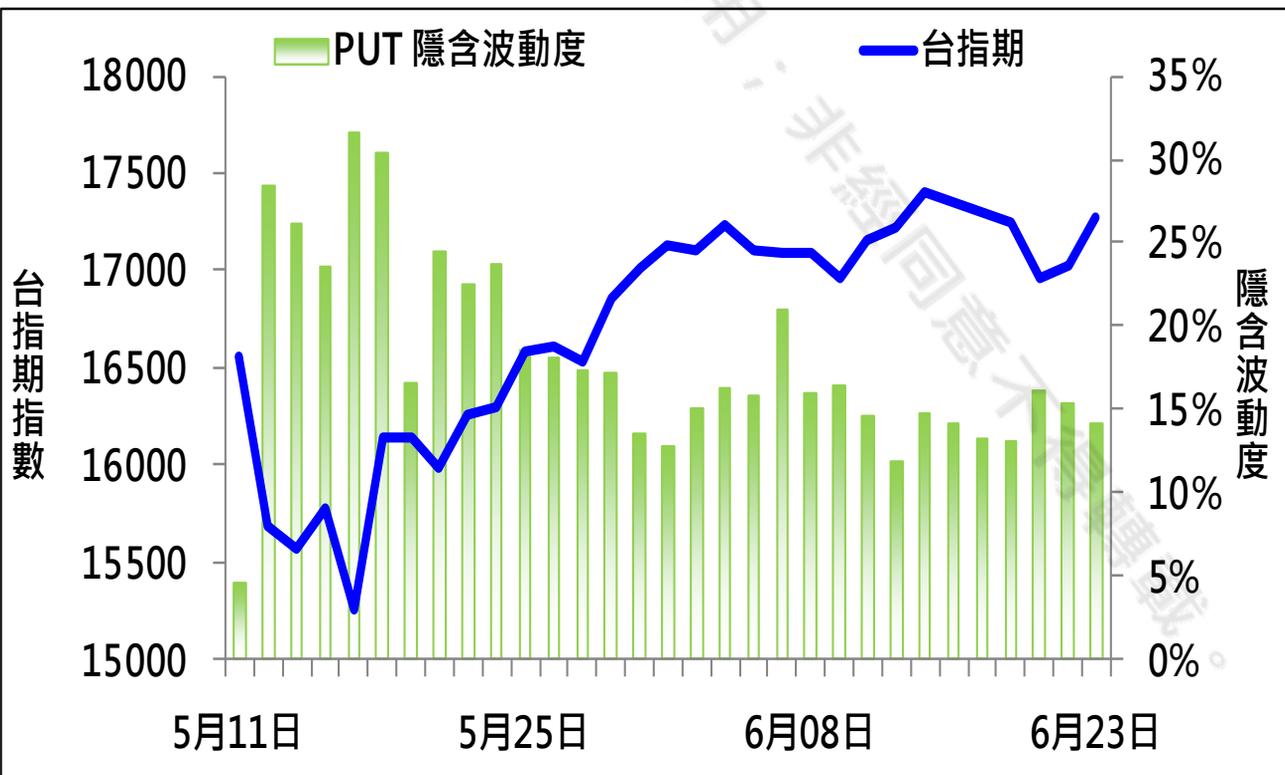
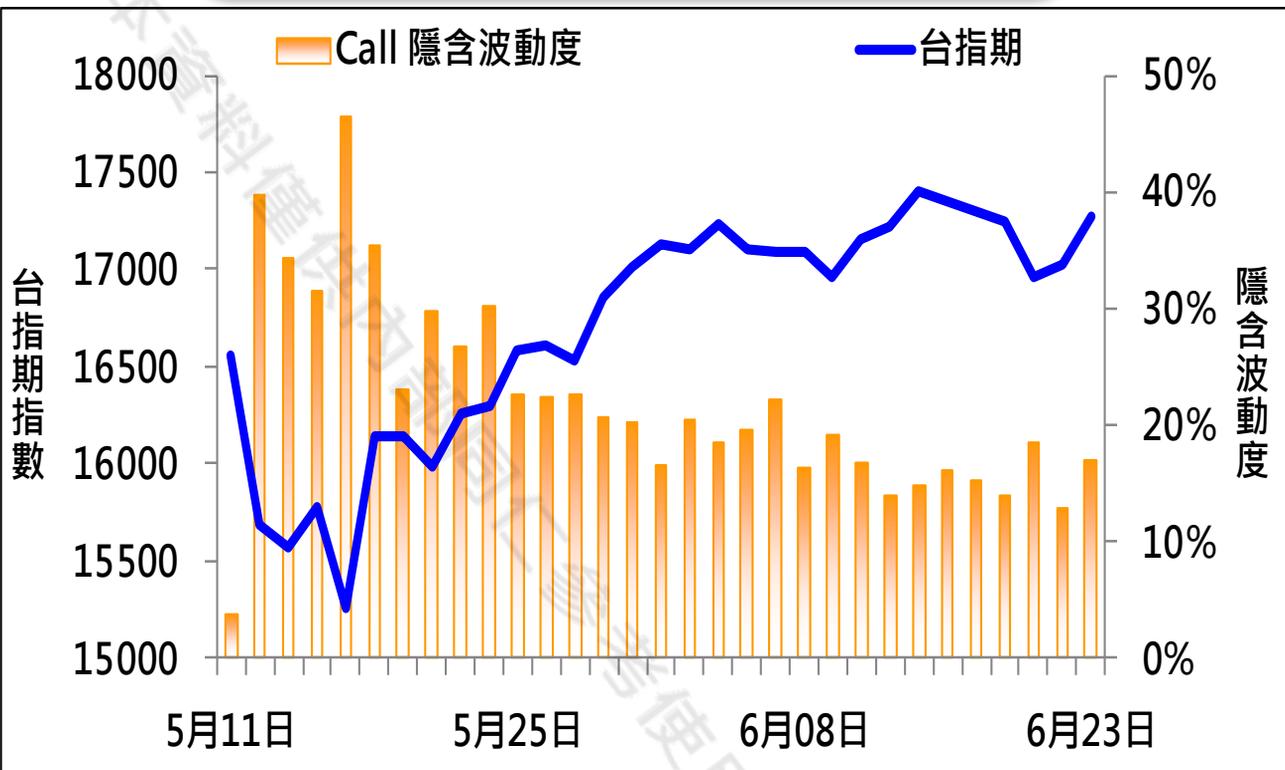
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## CALL、PUT隱含波動率



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 週選擇權OI變化

日期：2021/6/23

結算日：2021/6/30

OI 增減	Call	202106W5 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,500	1,377	1,377
0	0	16,600	2,084	2,084
0	0	16,650	659	659
0	0	16,700	871	871
0	0	16,750	566	566
6	6	16,800	2,039	2,039
5	5	16,850	1,729	1,729
14	14	16,900	1,473	1,473
24	24	16,950	833	833
96	96	17,000	1,802	1,802
48	48	17,050	488	488
112	112	17,100	1,951	1,951
162	162	17,150	1,006	1,006
311	311	17,200	1,547	1,547
360	360	17,250	1,126	1,126
1,374	1,374	17,300	4,393	4,393
768	768	17,350	487	487
1,994	1,994	17,400	1,117	1,117
809	809	17,450	128	128
1,445	1,445	17,500	111	111
1,144	1,144	17,550	59	59
1,940	1,940	17,600	55	55
※ 2,326	2,326	17,700	35	35
1,960	1,960	17,800	4	4
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
19,800	19,800	1.6016	31,711	31,711

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 近月選擇權OI變化

日期:

2021/6/23

OI 增減	Call	202107月 履約價	Put	OI 增減
0	12	15,800	1,591	31
0	102	15,900	2,996	81
0	113	16,000	6,207	346
-1	247	16,100	1,310	211
0	114	16,200	2,178	82
0	23	16,300	2,214	-410
0	118	16,400	2,683	50
4	94	16,500	3,799	315
-14	1,088	16,600	2,023	12
-35	991	16,700	2,733	-293
-13	837	16,800	3,527	58
-22	904	16,900	3,150	786
1	1,984	17,000	4,553	400
-168	1,620	17,100	3,245	613
248	3,021	17,200	2,938	1,366
-338	3,308	17,300	1,149	29
-194	4,910	17,400	648	116
668	6,337	17,500	148	30
349	4,420	17,600	203	118
-19	3,125	17,700	81	0
-282	3,970	17,800	19	6
69	2,773	17,900	24	0
25	4,377	18,000	26	1
283	2,335	18,100	5	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
1,798	65,939	1.1050	72,864	6,268

※

昨日 P/C

1.0383

今日增減變化

0.0667

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個入部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

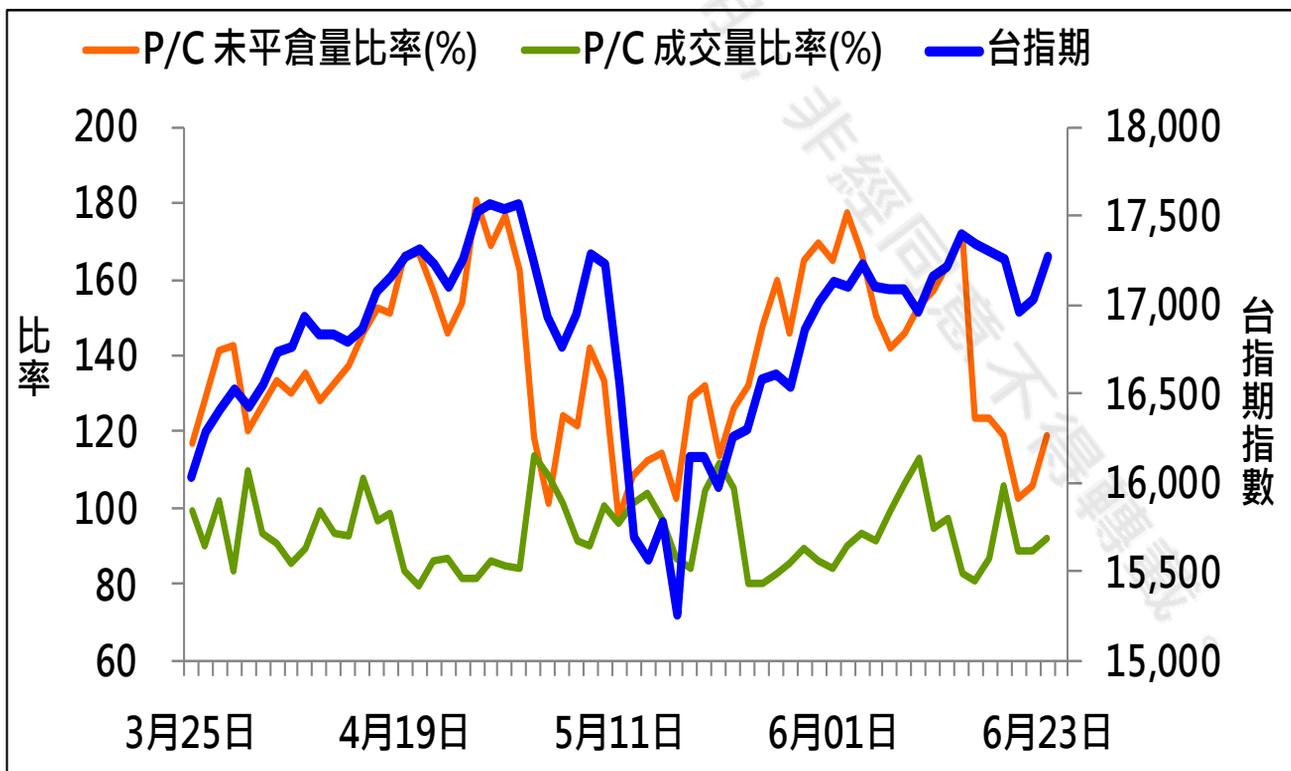
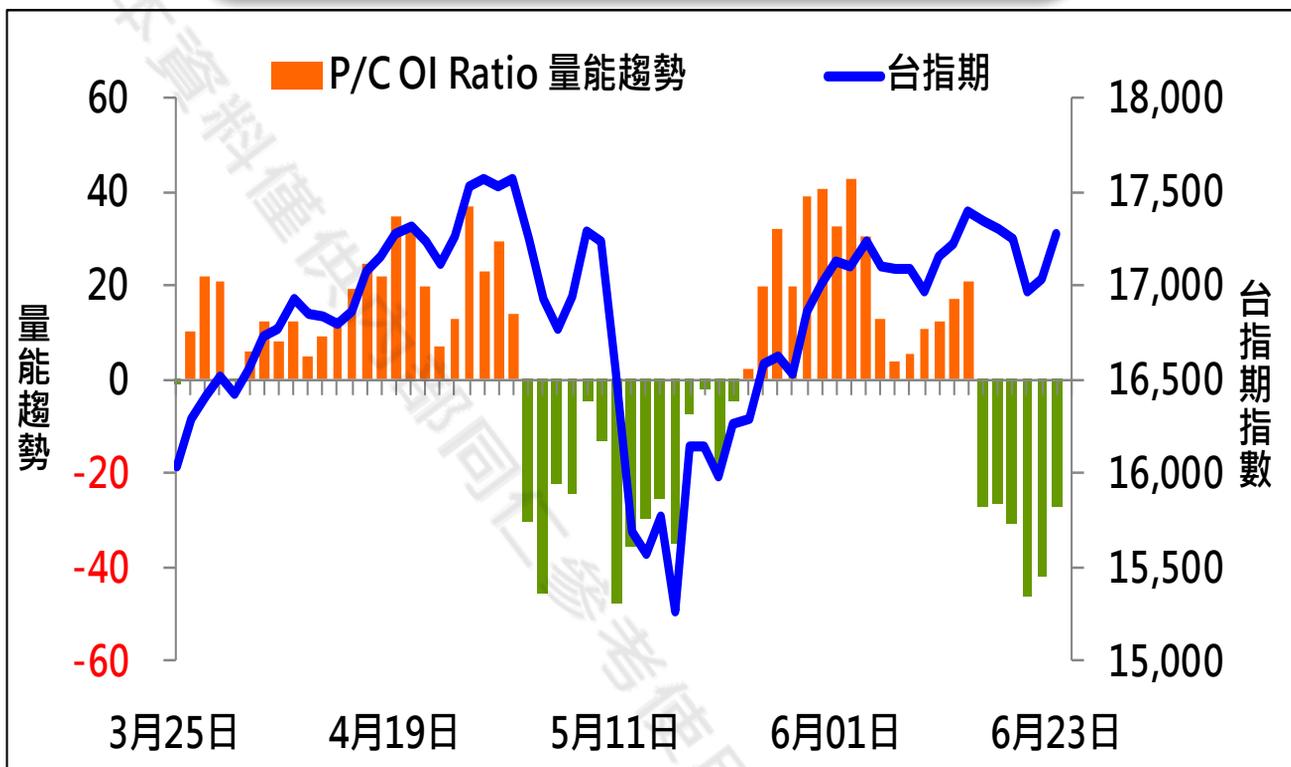
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX\*1) 日線圖 2021/06/23 開 17100 高 17319 低 17059 收 17272 ↑ 點量 127143 □ +246 (+1.44%)

SMA5 17162.00 ↓ SMA20 17082.45 ↑ SMA60 16847.28 ↑

價量累計圖 30



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 個股除權息公告表

除權息日期	除權息標的	股期代碼	現金股息	股票股利	預估扣除點數
2021/6/24	2409 友達	CHF	0.3	0.0	0.95
2021/6/24	2340 光磊	FYF	1.4	0.0	0.17
2021/6/24	6515 穎崴	--	13.0	0.0	0.14
2021/6/24	1760 寶齡富錦	--	0.7	0.0	0.02
2021/6/24	2480 敦陽科	--	4.3	0.0	0.15
2021/6/24	1615 大山	--	1.2	0.0	0.05
2021/6/25	2006 東和鋼鐵	--	1.5	0.0	0.54
2021/6/25	1598 岱宇	--	7.5	0.0	0.33
2021/6/25	4976 佳凌	--	0.0	0.0	0.00
2021/6/25	4564 元翎	--	1.3	0.0	0.08
2021/6/25	3557 嘉威	--	0.0	0.0	0.00
2021/6/28	1215 卜蜂	--	4.5	0.0	0.40
2021/6/28	1319 東陽	EHF	0.8	0.0	0.16
2021/6/28	6282 康舒	KFF	1.2	0.0	0.20
每週預估扣除點數					
	202106W5	202107W1	202107W2	202107	202107W4
單週點數	6.75	29.33	5.42	0.87	1.71
累計點數	6.75	36.07	41.49	42.37	44.08

1. 本公告表資訊來源為台灣證券交易所及嘉實資訊。
2. 本公告表資訊以報告當日該標的及加權指數之收盤價為基礎，其公式如下：

$$\text{預扣點數} = \frac{\text{標的除息之市值}}{\text{加權指數收盤總市值}} \times \text{加權指數收盤價}$$

3. 本資料僅供參考，詳情請查閱台灣證券交易所資訊。

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 免責聲明與警語

- 一、本報告中的訊息包括來自各項已公開或據信為可靠之資訊來源，為製作報告當時所知之資訊及基於特定時間或期間所作之意見，惟華南期貨股份有限公司（以下稱本公司）對本報告內容的準確性、完整性和及時性不作任何聲明或保證，本報告所載之資訊或意見日後如有任何變動，本公司將不作通知。
- 二、本報告內容僅供參考，不具有或隱含任何法律效果，本公司就其內容不負任何法律責任。本報告內容不代表未來獲利之預期或保證，交易人應審慎評估，慎重考量自身財務能力及承受風險能力，並特別留意控管風險，如有需要，應諮詢相關財務顧問或專業人士。
- 三、本報告內容不構成亦不得視為對任何投資標的或任何交易之招攬、要約、宣傳、廣告、遊說、引誘或推薦。在任何情況下，本公司不對任何人閱讀本報告或基於本報告觀點所進行的交易所引致的任何損益承擔任何責任。
- 四、本報告內容所涉相關圖表及數據可能採用特定軟體及程式、模型運算，以歷史數據進行繪製及統計，其結果並不代表具有預測未來之能力。
- 五、本報告內容所用技術分析指標可能隨參數設定之不同，而有不同的結果。技術分析指標係將過去歷史資料經由統計分析技術所得之指標數值，僅供參考性質，通常作為事後驗證之用途，且係依據過去歷史資料所得，不具領先意涵，亦不代表具有預測未來之能力。
- 六、本報告內容之著作權屬於本公司所擁有，非經本公司事先書面同意，禁止任何未經本公司授權擅自加以摘錄、引用、轉貼、下載、複製、編輯、翻譯或傳輸行為，任何侵犯本公司著作權之行為，本公司將予究責。
- 七、本報告僅限由本公司傳送予與本公司簽訂顧問契約之客戶閱讀，如有任何人未經本公司事先書面同意而將本報告傳送予他人，本公司將予究責。
- 八、期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號  
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700