

## 法人籌碼動態

06月16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	15,764	-2,516	-234	-32	-481	-6
投信	-2,657	234	143	3	27	0
自營商	-8,666	153	-60	72	-272	-7
06月16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	25	1	44,071	-94	19,656	3,902
投信	0	0	100	0	582	300
自營商	-21	-5	-21,168	-3,694	-12,688	764

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
南亞科	3.17	台積電	-16.60	台指期前十大市場佔比	52.6%	47.4%
長榮	2.71	聯發科	-7.68			
廣達	2.47	光寶科	-4.54			
南亞	1.78	智邦	-3.41			
中興電	1.75	台塑	-3.26	電子期前十大市場佔比	57.1%	59.1%
技嘉	1.73	兆豐金	-2.68			
東元	1.71	國泰金	-2.33			
仁寶	1.69	亞德客-KY	-2.24	金融期前十大市場佔比	67.4%	75.1%
統一	1.64	富邦金	-2.24			
台玻	1.58	鴻海	-2.22	非金電期前十大市場佔比	94.0%	87.5%
前十名合計	20.24	後十名合計	-47.20			

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

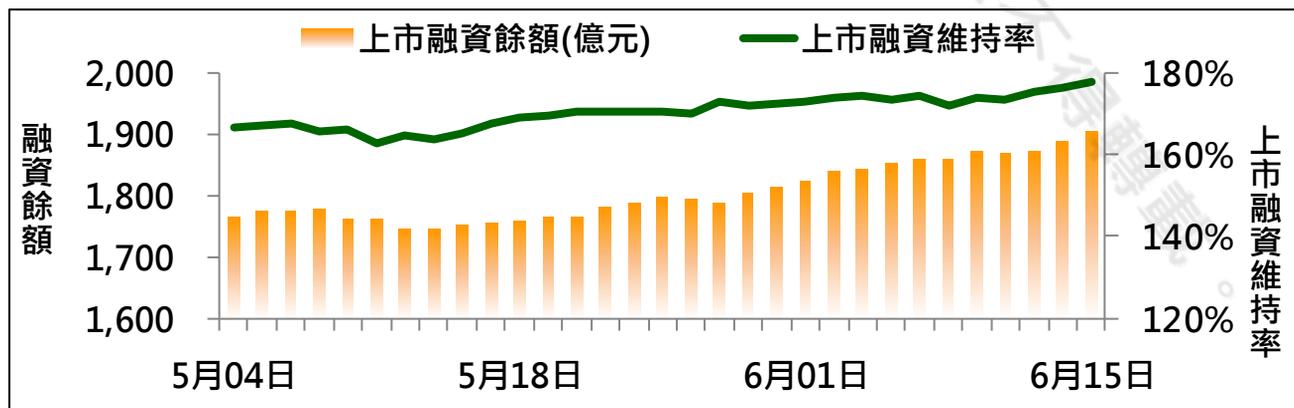
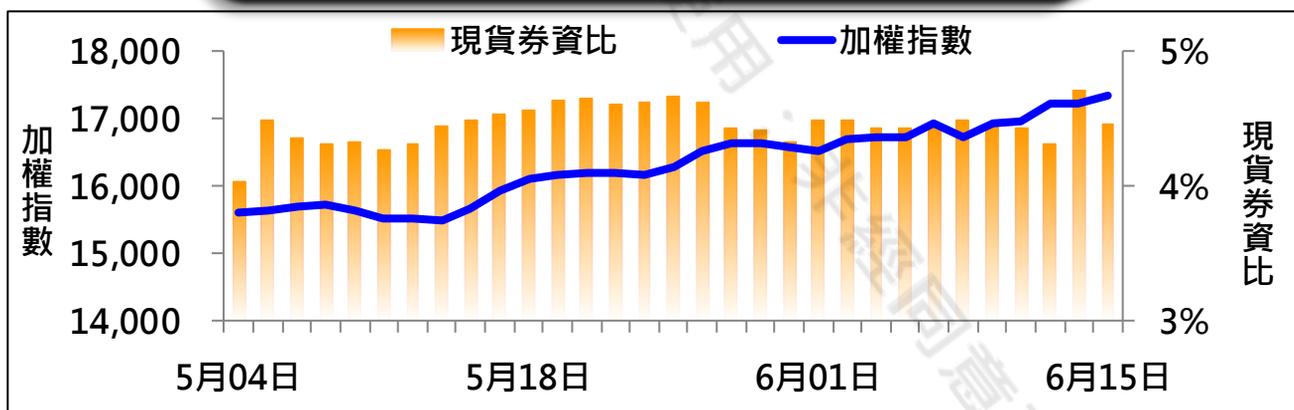
## 法人現貨、期貨 & 選擇權籌碼變化

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12日	92.1	20,648	-129	-16.8	-9,043	465
06月13日	377.4	19,535	-1,113	51.7	-8,694	349
06月14日	61.2	15,253	-4,282	57.7	-8,413	281
06月15日	85.6	18,280	3,027	53.4	-8,819	-406
06月16日	32.9	15,764	-2,516	54.6	-8,666	153

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12日	39,443	18,197	21,246	19,534	-7,757	27,291
06月13日	44,051	20,352	23,699	4,312	-16,019	20,331
06月14日	44,147	15,295	28,852	-9,999	-11,835	1,836
06月15日	44,165	15,754	28,411	-17,474	-13,452	-4,022
06月16日	44,071	19,656	24,415	-21,168	-12,688	-8,480

## 現貨券資比 & 上市融資維持率



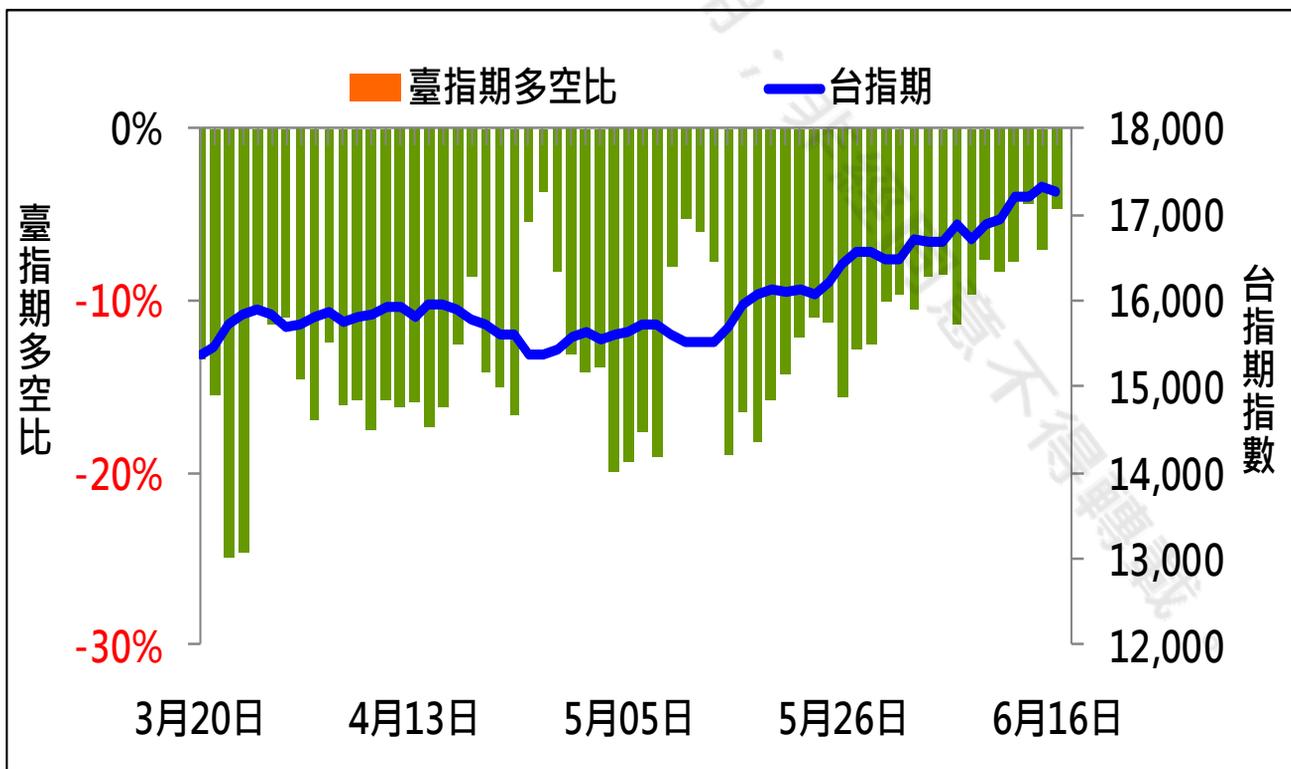
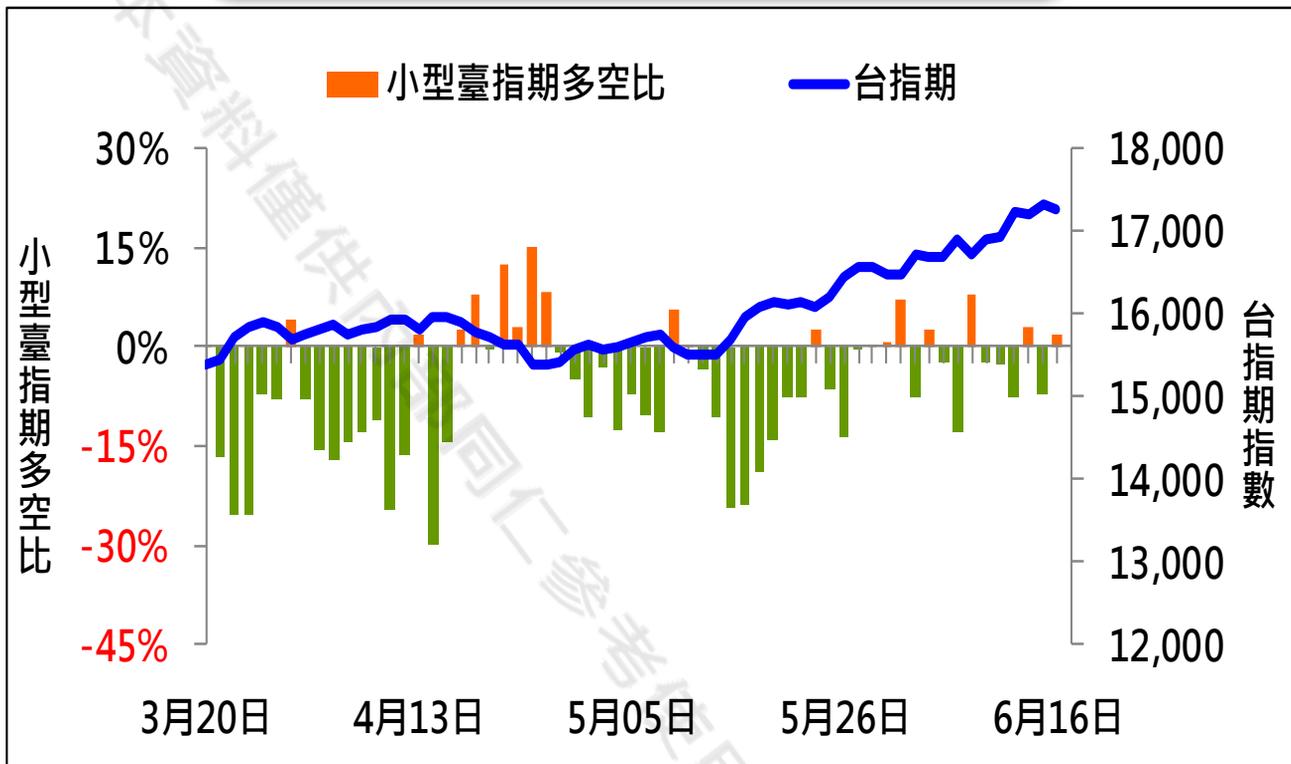
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

## 散戶多空比



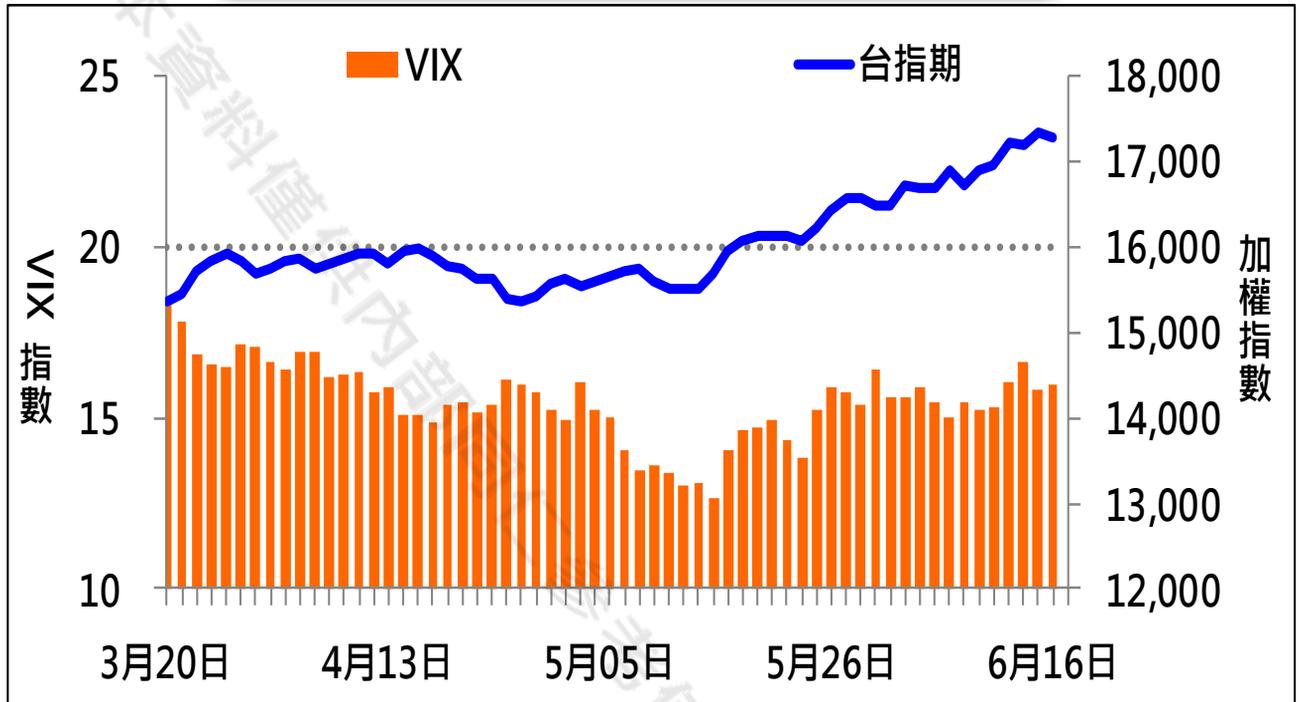
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

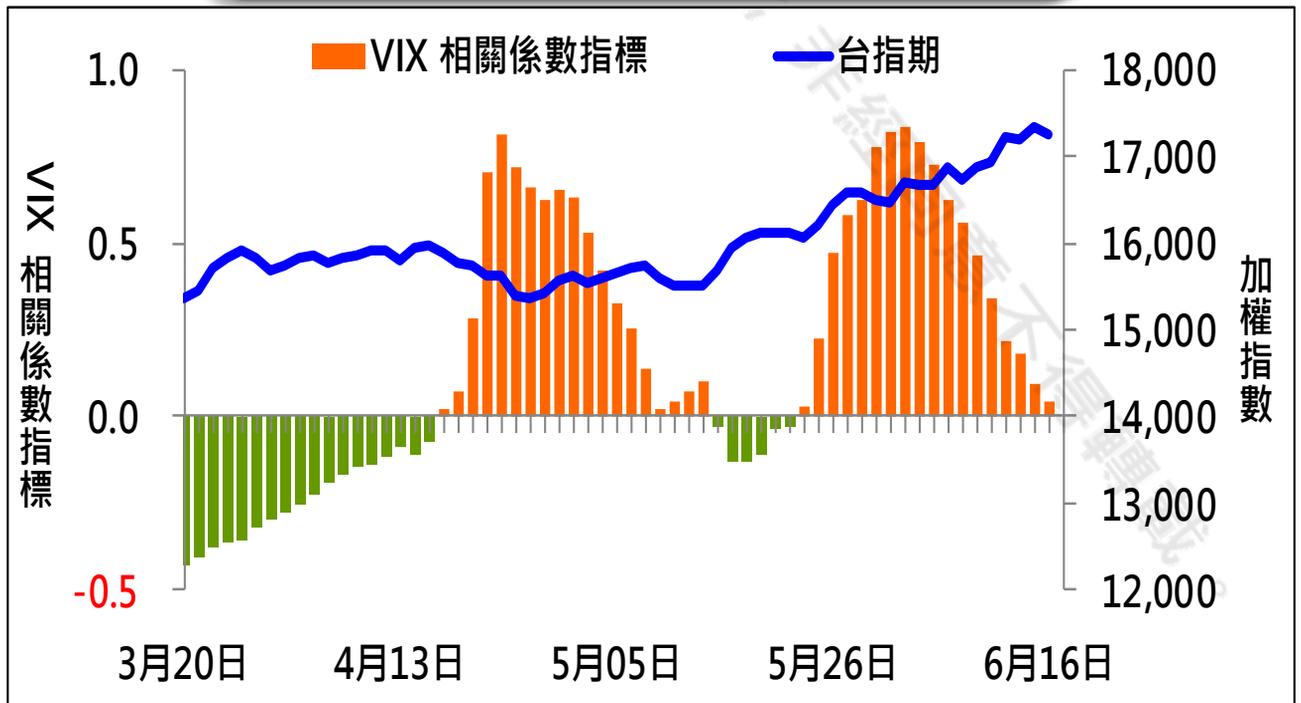
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



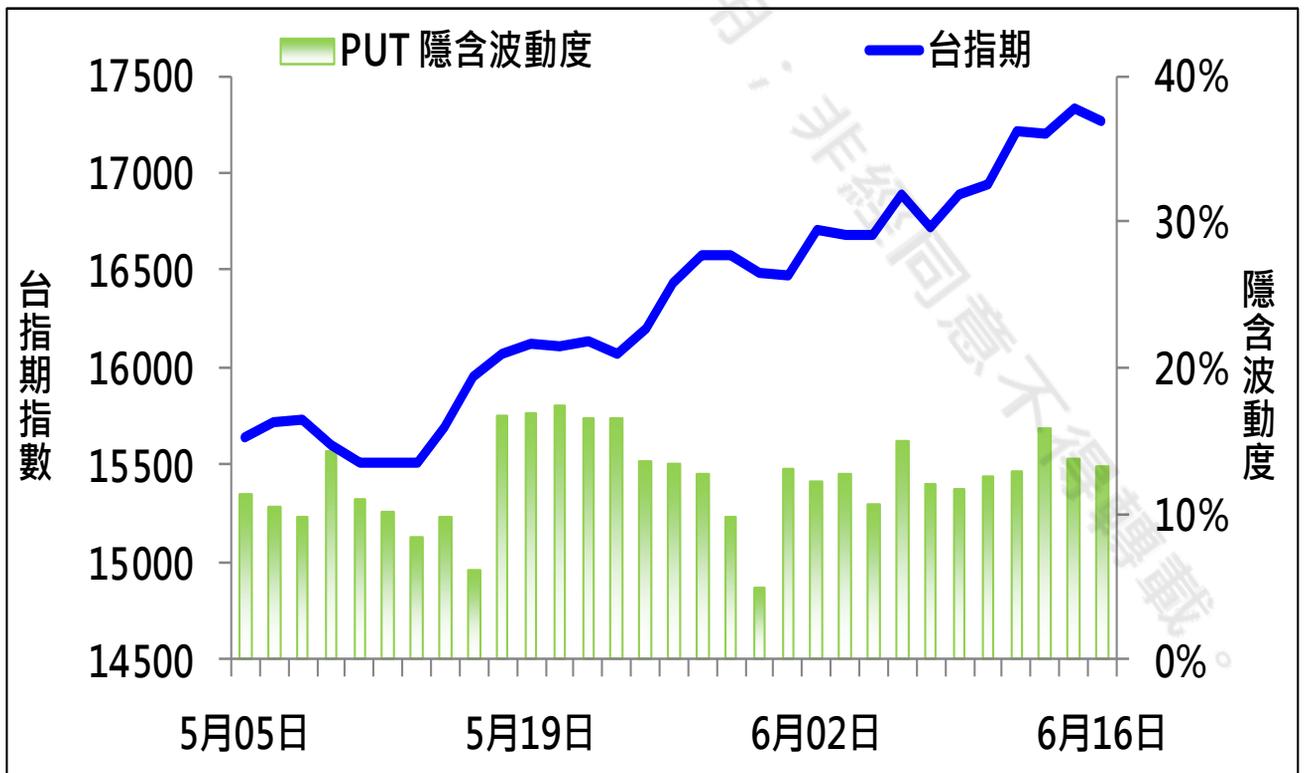
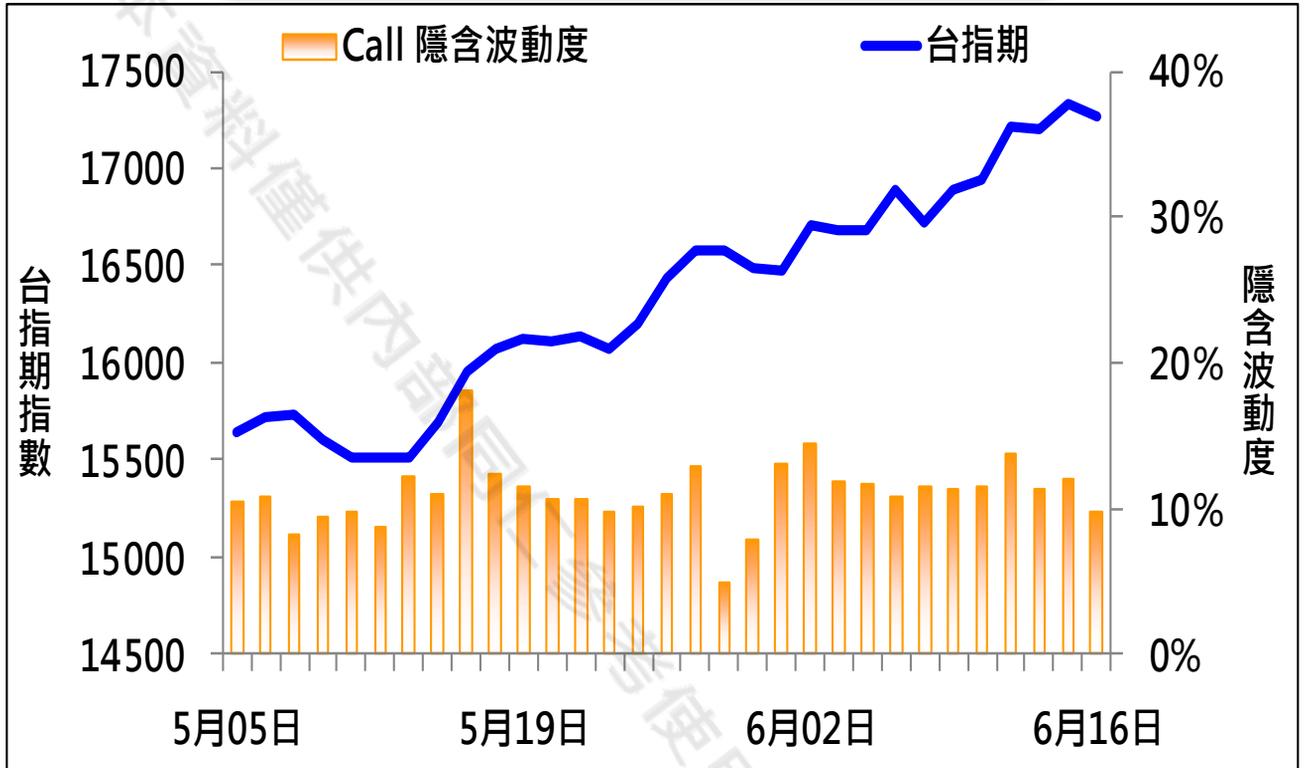
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

## 近月選擇權OI變化

日期：2023/6/16

結算日：2023/6/21

OI 增減	Call	202306月 履約價	Put	OI 增減
-2	115	16,550	3,144	-29
-34	5,333	16,600	10,365	-30
0	134	16,650	2,657	211
-4	404	16,750	4,415	384
-71	1,454	16,850	14,191	4,366
-142	6,807	16,900	9,433	720
-1	877	16,950	4,685	-432
-86	5,079	17,000	13,106	2,624
-679	1,614	17,050	6,884	1,830
38	4,899	17,100	10,496	2,963
56	1,970	17,150	6,124	2,622
1,073	6,622	17,200	8,104	1,867
437	3,768	17,250	3,693	512
893	14,694	17,300	4,547	977
2,379	7,240	17,350	1,468	170
※	3,251	17,400	1,602	-9
1,960	7,188	17,450	385	-162
1,555	13,699	17,500	702	-19
2,719	6,222	17,550	56	15
3,066	11,149	17,600	171	50
1,904	4,745	17,650	16	12
474	2,322	17,750	5	2
854	5,910	17,800	54	-6
1,874	1,874	17,850	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
23,724	205,623	1.1190	230,083	19,424
昨日 P/C	1.2058	今日增減變化		-0.0868

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

## 雙週選擇權OI變化

日期：2023/6/16

結算日：2023/6/28

OI 增減	Call	202306W4 履約價	Put	OI 增減
1	8	16,700	1,155	880
0	0	16,750	352	178
0	21	16,800	506	196
1	21	16,850	457	172
1	4	16,900	1,023	775
1	1	16,950	603	411
3	19	17,000	1,511	996 ※
23	25	17,050	546	269
15	32	17,100	575	153
35	103	17,150	276	94
-4	182	17,200	434	105
183	295	17,250	264	106
255	391	17,300	135	-111
83	235	17,350	85	49
101	456	17,400	115	80
171	323	17,450	73	22
169	386	17,500	54	51
103	371	17,550	1	1
114	524	17,600	0	0
-3	309	17,650	0	0
122	590	17,700	0	0
※ 309	408	17,750	0	0
46	709	17,800	0	-1
116	116	17,850	0	0
87	894	17,900	0	0
118	2,074	18,000	0	0
10	732	18,100	0	0
4	2,251	18,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
2,383	14,062	0.7061	9,929	4,945
昨日 P/C	0.4267	今日增減變化		0.2793

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

## 次月選擇權OI變化

日期：2023/6/16

結算日：2023/7/19

OI 增減	Call	202307 月 履約價	Put	OI 增減
-2	40	15,600	443	60
0	91	15,700	428	48
-1	81	15,800	465	17
0	70	15,900	813	101
3	153	16,000	2,821	43
0	101	16,100	1,579	707 ※
10	131	16,200	1,802	123
-1	755	16,300	1,879	116
-5	234	16,400	1,514	186
4	575	16,500	1,265	227
-1	692	16,600	1,243	133
-35	704	16,700	1,063	57
11	1,641	16,800	710	186
-31	1,293	16,900	391	163
-38	1,878	17,000	630	148
56	1,514	17,100	604	250
45	1,652	17,200	266	184
19	1,403	17,300	328	190
-36	1,413	17,400	146	74
※ 910	2,726	17,500	41	-6
213	2,228	17,600	1	1
4	1,901	17,700	2	0
-177	2,471	17,800	2	1
88	1,278	17,900	1	0
130	1,042	18,000	1	-1
904	1,338	18,100	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
2,828	32,902	0.8824	29,032	3,178
昨日 P/C	0.8597	今日增減變化		0.0227

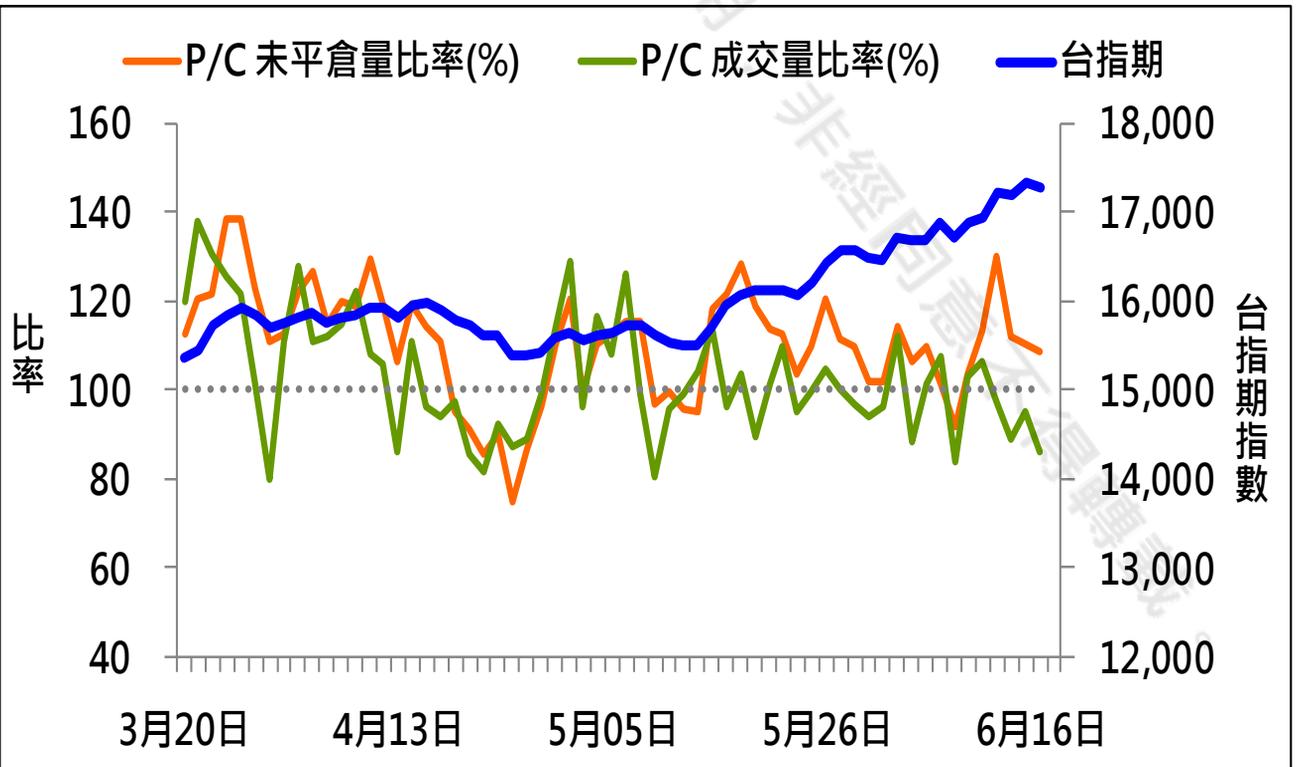
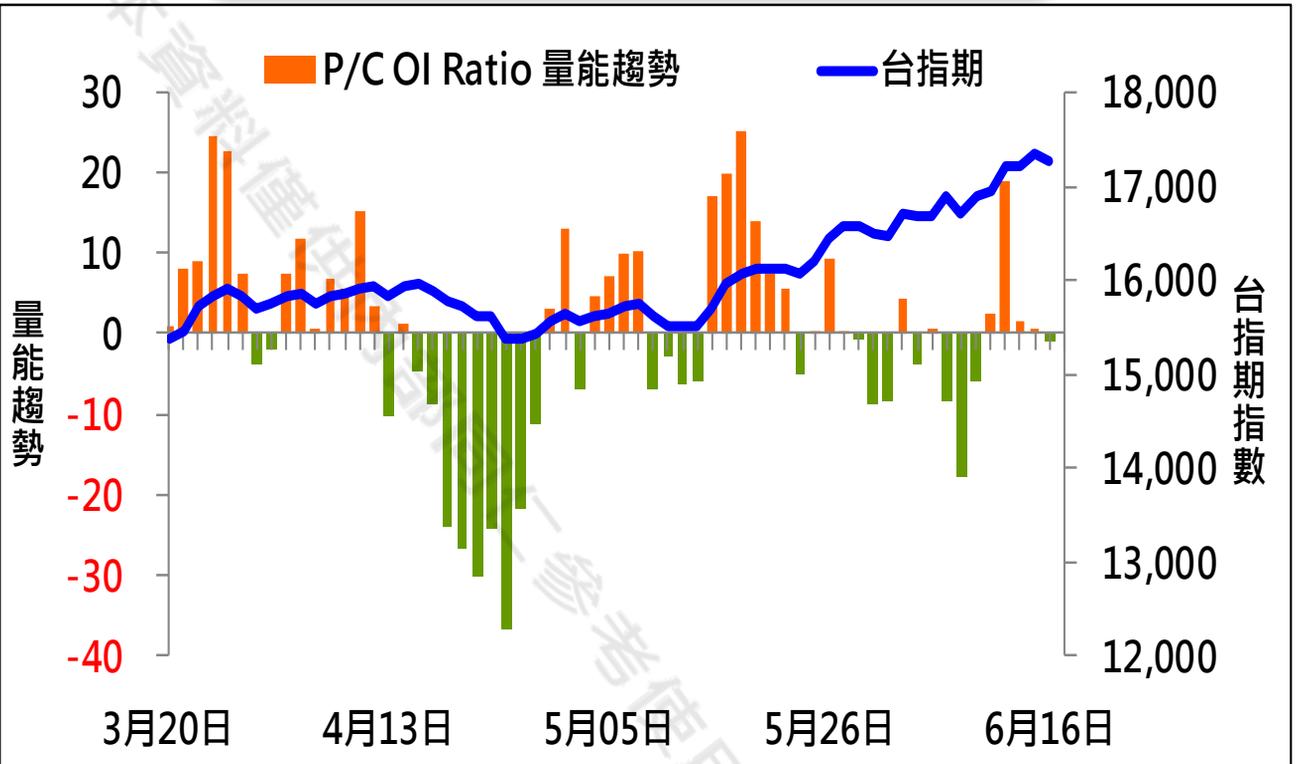
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

## 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。

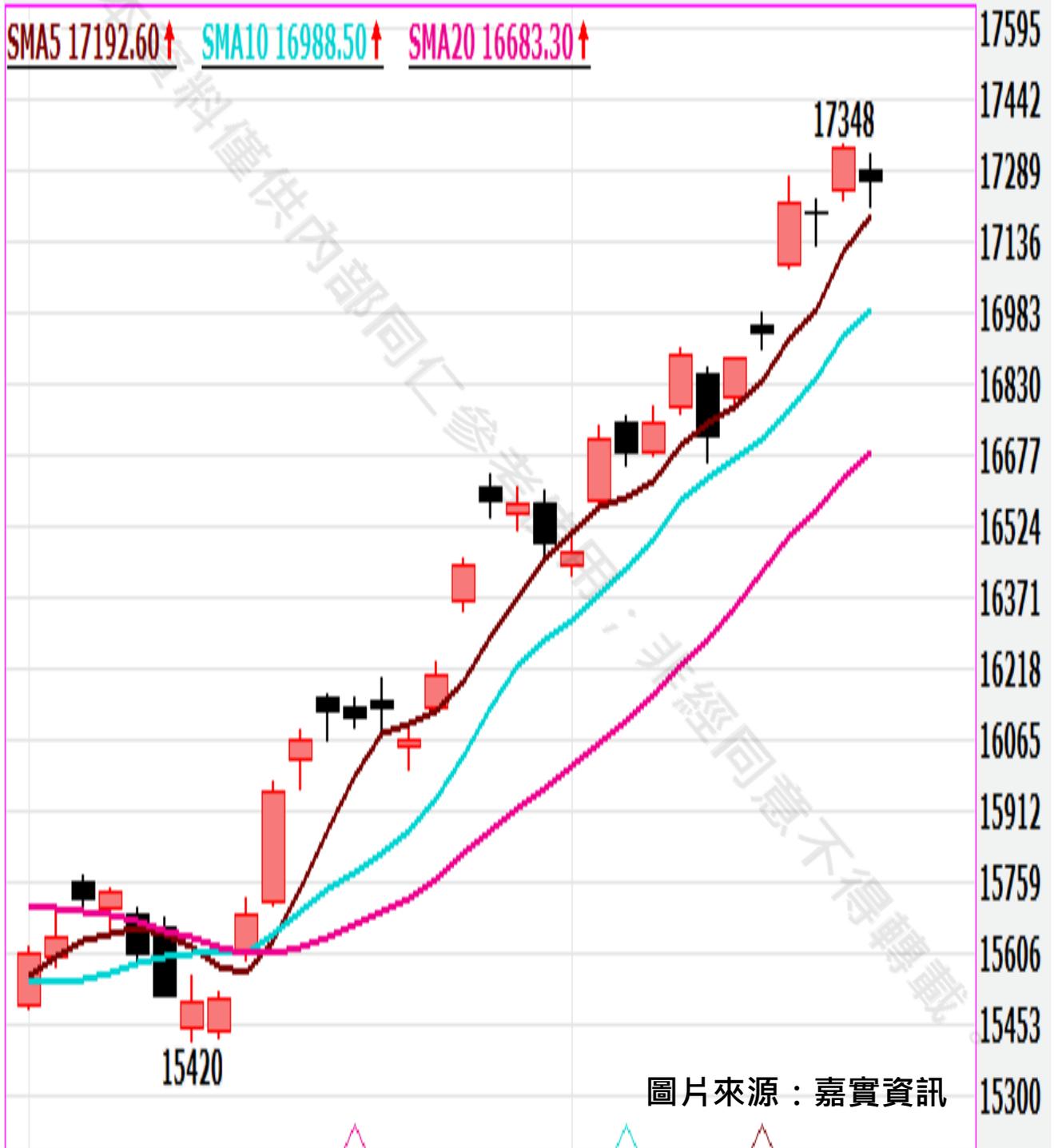
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號  
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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)(FITX\*1) 日線圖 2023/06/16 收 17268 ↓ 點 量 89207 口 -68 (-0.39%)

SMA5 17192.60 ↑ SMA10 16988.50 ↑ SMA20 16683.30 ↑



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

## 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

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