

## 法人籌碼動態

05月28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	-10,160	-863	20	-7	-563	-65
投信	11,846	725	191	-1	9	0
自營商	-6,432	-312	-277	27	-168	44
05月28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	53	0	9,326	-168	28,038	4,022
投信	0	0	30	0	16	0
自營商	-104	6	16,844	-394	-7,263	-7,094

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
聯發科	12.72	台積電	-33.00	台指期前十大 市場佔比	44.4%	46.2%
國泰金	6.19	中信金	-5.12			
奇鋆	5.49	廣達	-4.92			
萬海	4.37	光寶科	-3.37	電子期前十大 市場佔比	54.4%	59.5%
台塑化	4.24	華碩	-3.07			
祥碩	3.64	長榮	-3.03			
矽力*-KY	3.30	亞德客-KY	-2.23	金融期前十大 市場佔比	40.2%	73.1%
聯詠	3.10	智邦	-2.14			
南電	2.78	日月光投控	-2.09			
中華電	2.47	宏碁	-2.04	非金電期前十大 市場佔比	87.8%	79.6%
前十名合計	48.29	後十名合計	-61.00			

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 (112)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

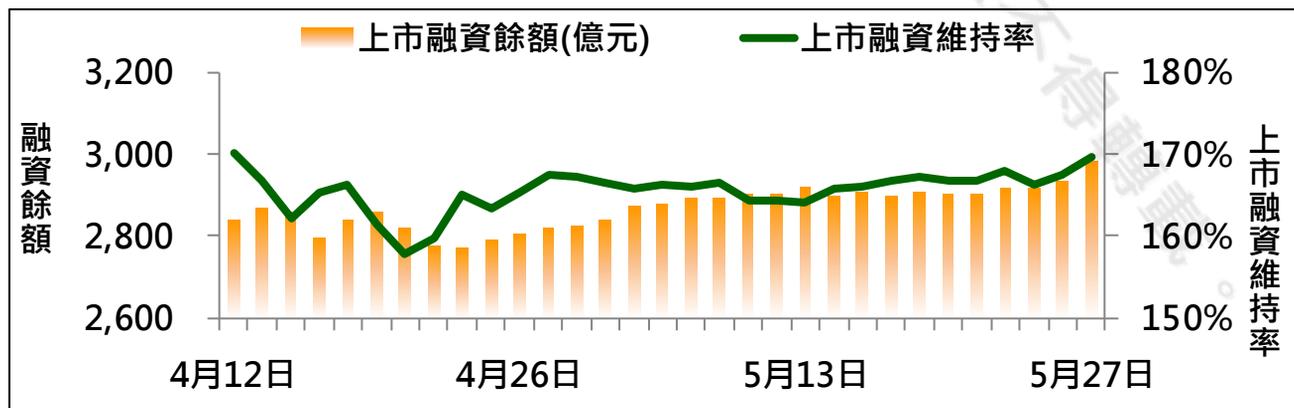
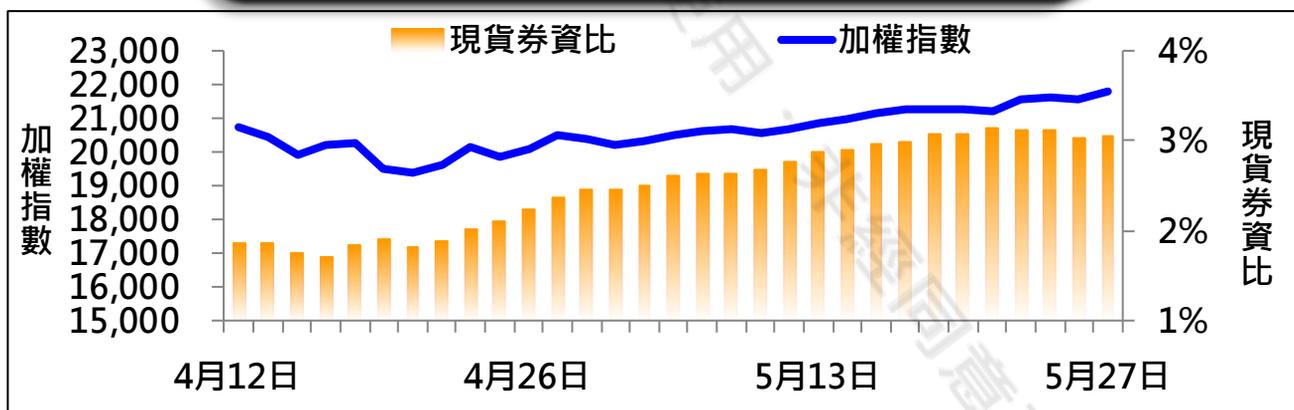
## 法人現貨、期貨 & 選擇權籌碼變化

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)
05月22日	321.1	-5,663	2,572	39.6	-6,937	476
05月23日	166.8	-8,725	-3,062	-2.0	-6,281	656
05月24日	60.6	-8,402	323	26.0	-6,314	-33
05月27日	34.0	-9,297	-895	69.2	-6,120	194
05月28日	-24.0	-10,160	-863	19.3	-6,432	-312

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
05月22日	9,699	20,726	-11,027	5,618	-5,339	10,957
05月23日	8,523	19,781	-11,258	15,274	1,705	13,569
05月24日	7,721	21,472	-13,751	20,317	-1,634	21,951
05月27日	9,494	24,016	-14,522	17,238	-169	17,407
05月28日	9,326	28,038	-18,712	16,844	-7,263	24,107

## 現貨券資比 & 上市融資維持率



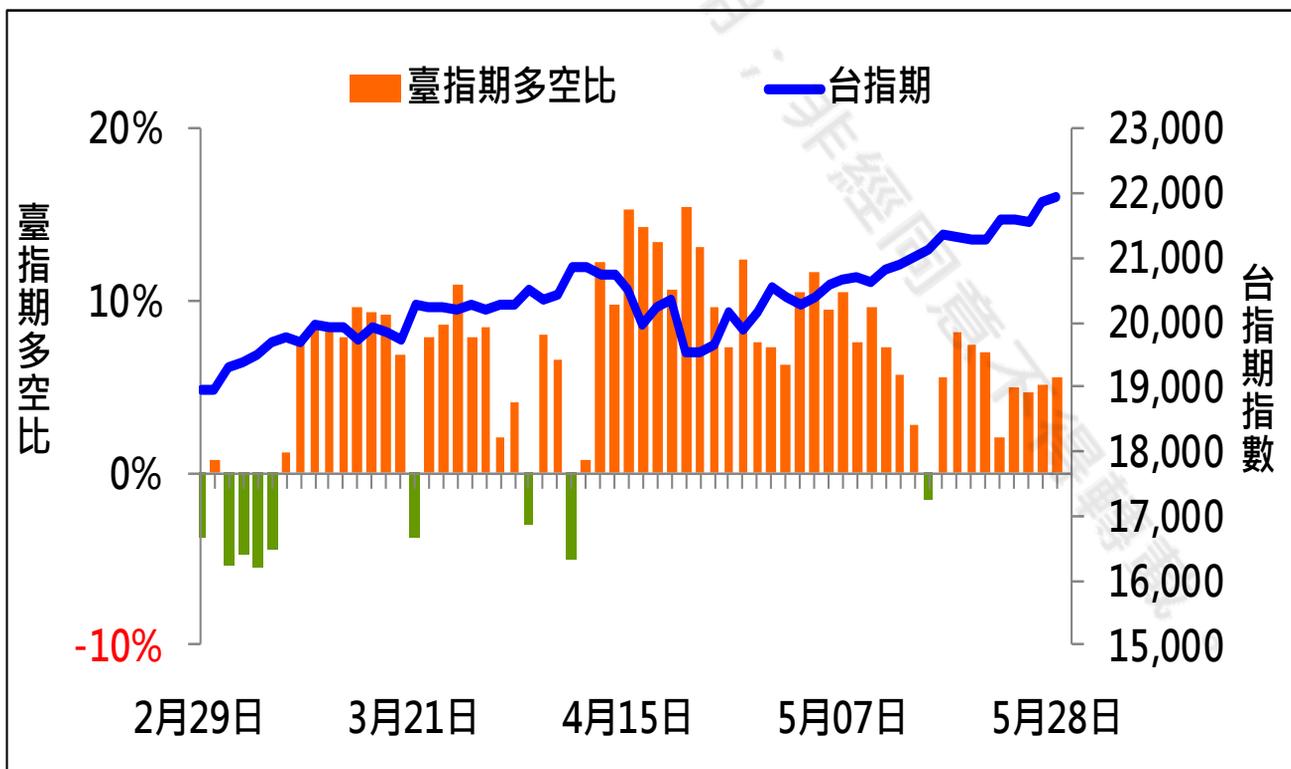
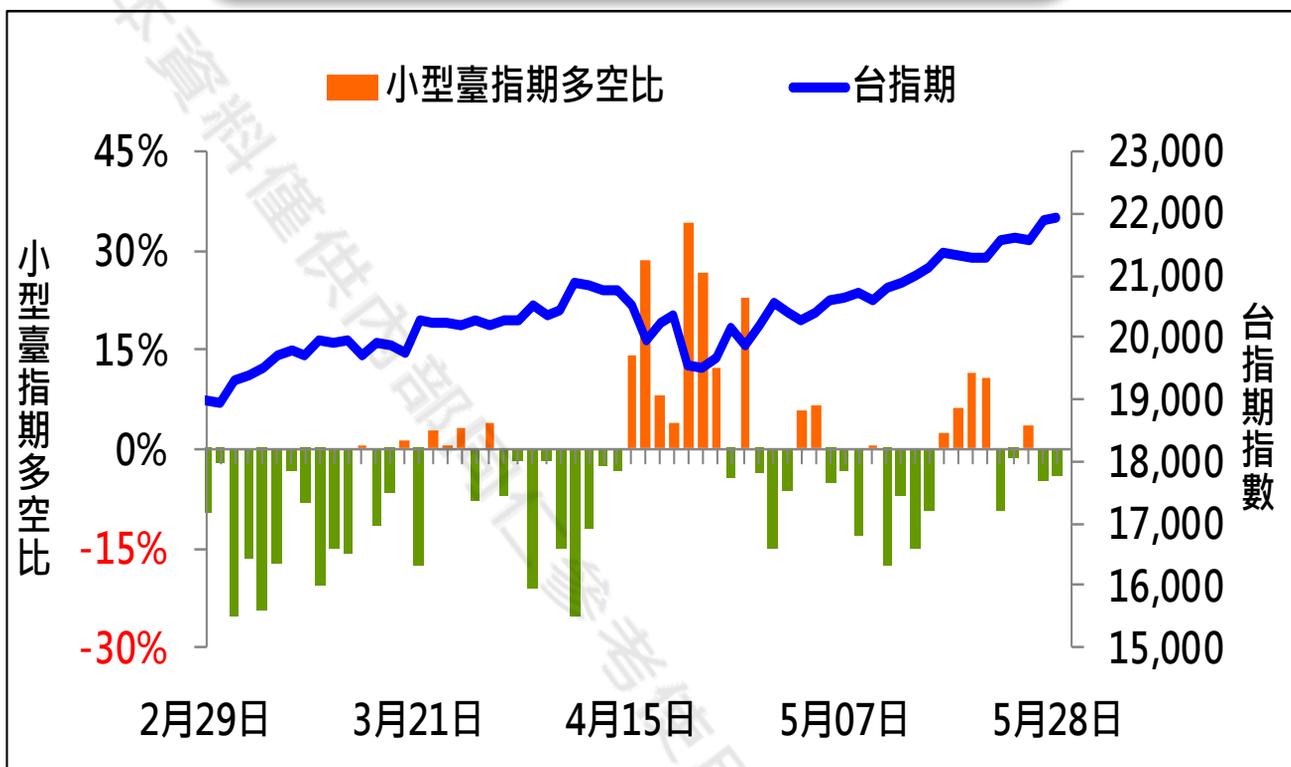
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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

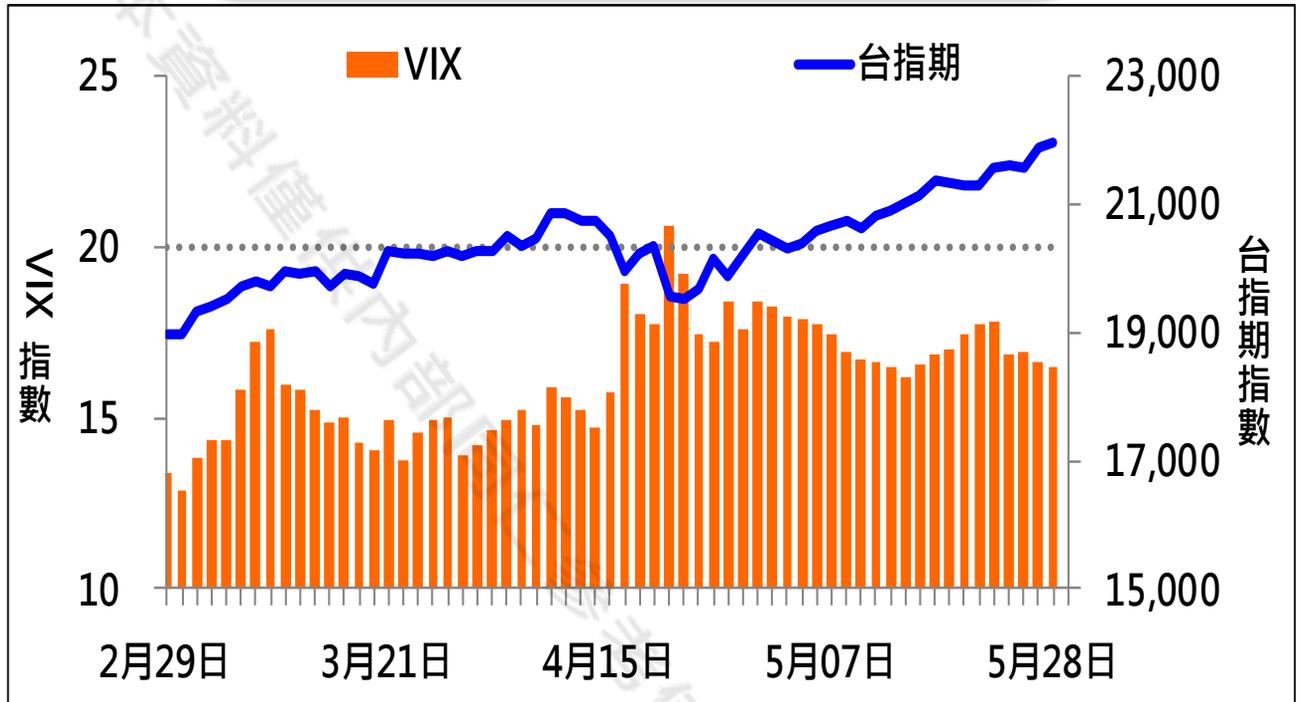


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

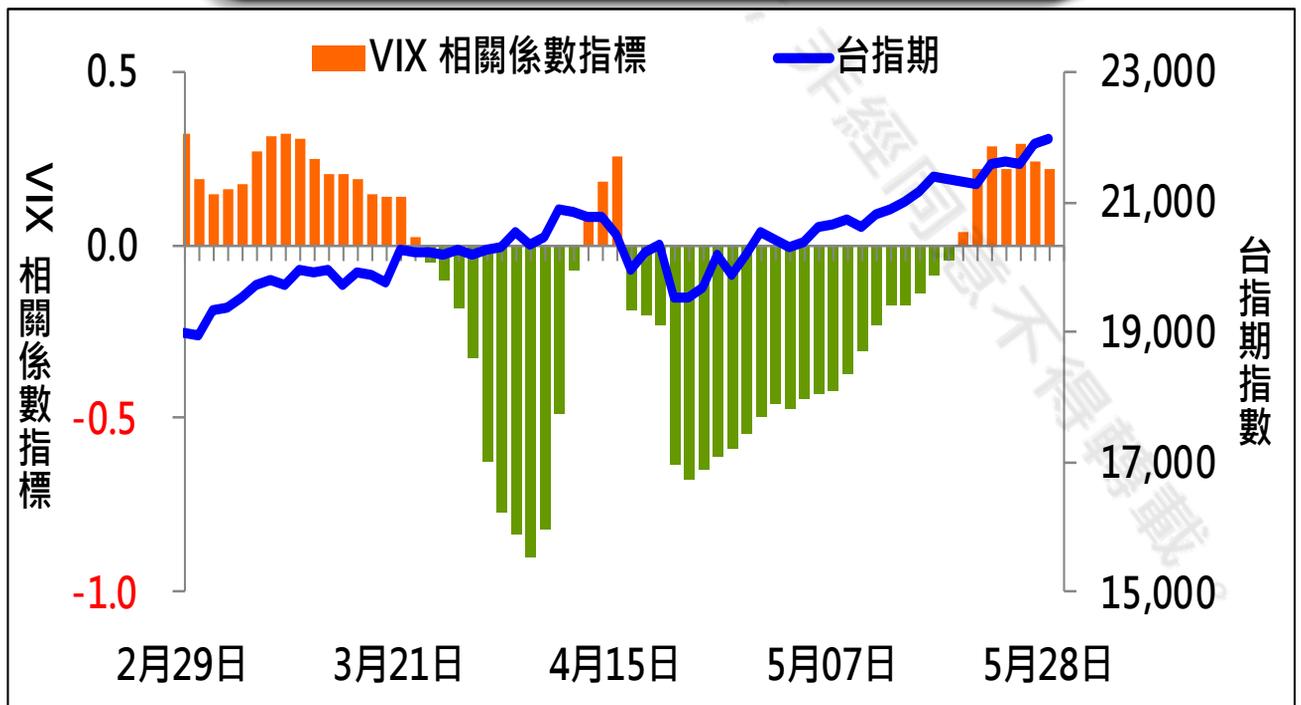
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號  
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

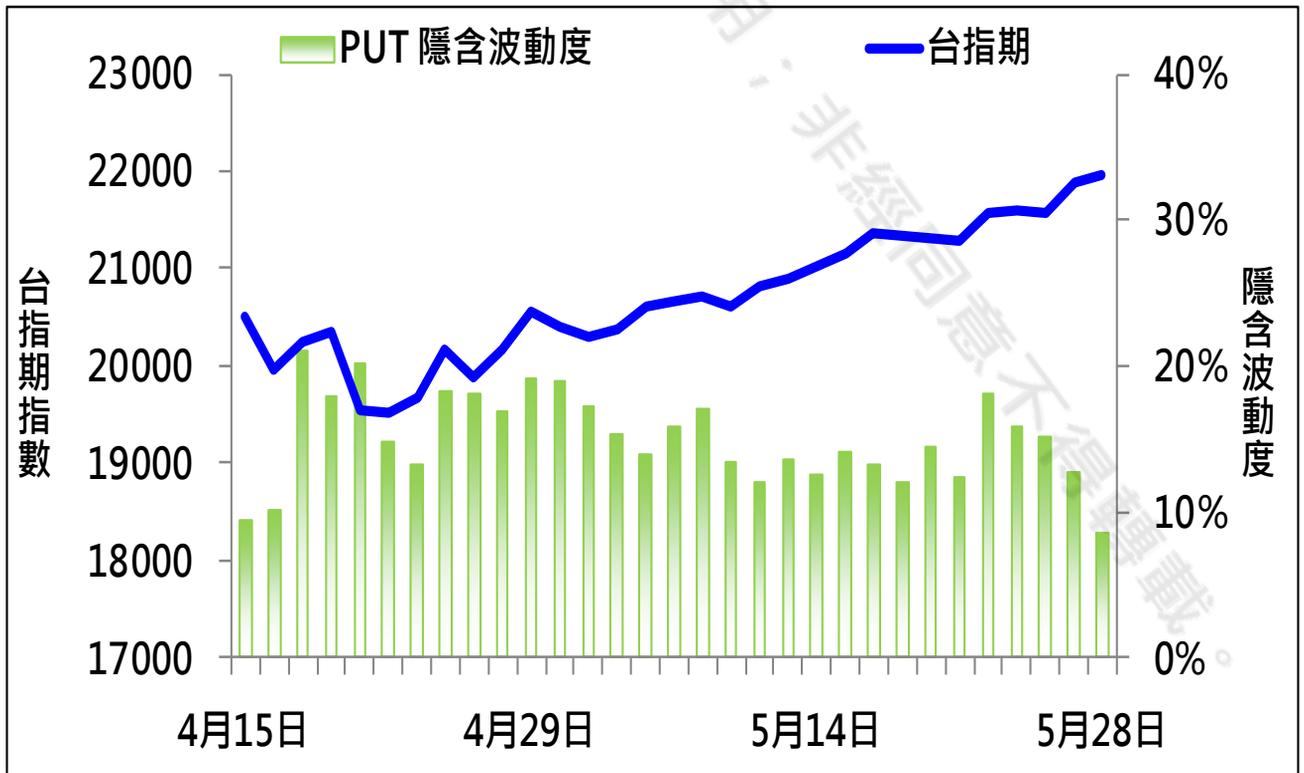
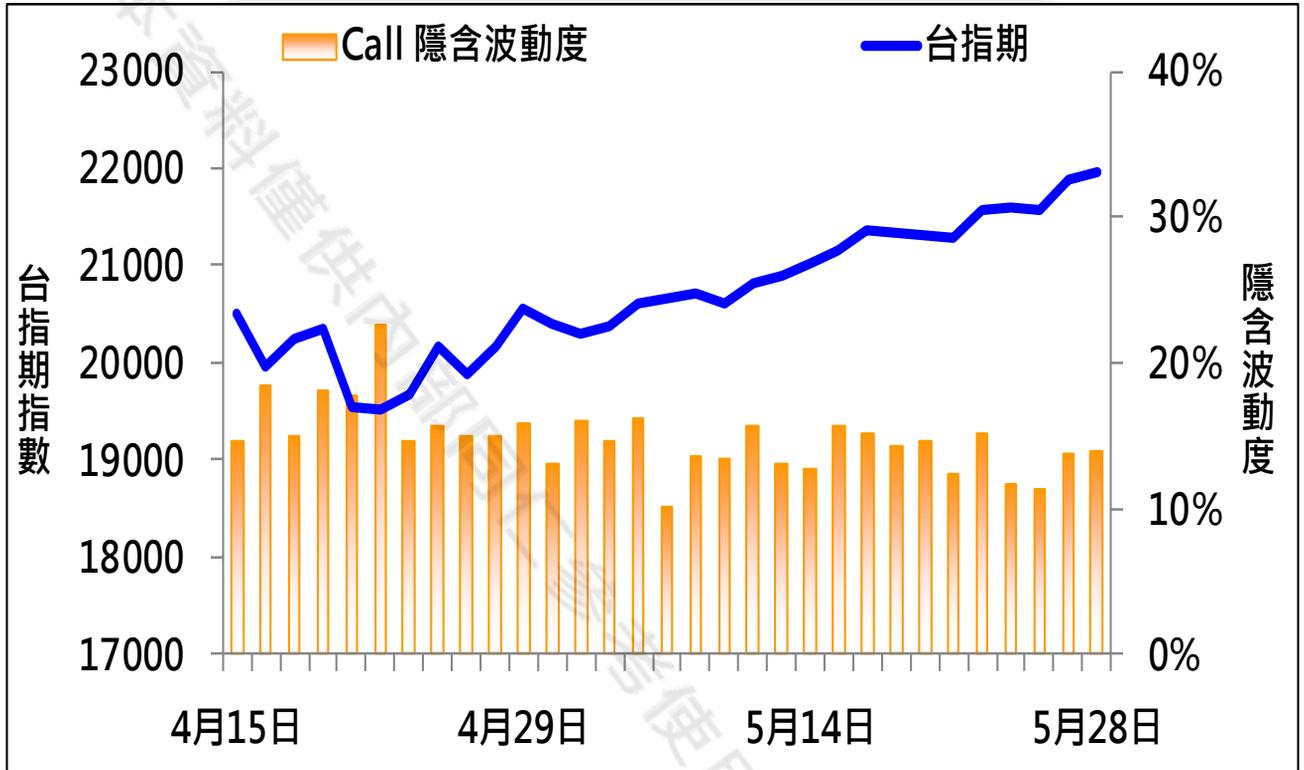


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

資料日期：2024/5/28

結算日：2024/5/29

OI 增減	Call	202405W5 履約價	Put	OI 增減
0	90	21,050	3,461	11
-3	52	21,100	5,007	-527
-1	144	21,150	3,119	-892
-27	146	21,200	5,406	-657
-23	320	21,250	3,965	-775
-33	674	21,300	7,473	-2,107
-2	450	21,350	4,144	-1,255
-143	751	21,400	6,242	-12
-50	762	21,450	3,827	-1,039
-98	1,398	21,500	7,486	706
-121	1,762	21,550	6,999	631
-303	2,374	21,600	9,571	4,023
-199	1,454	21,650	6,190	1,809
-359	2,097	21,700	8,461	2,727
-445	1,759	21,750	5,466	2,610
-1,879	4,695	21,800	8,373	3,621
-990	4,538	21,850	5,478	3,629
-961	9,089	21,900	5,597	2,943
746	4,994	21,950	2,898	2,333
1,542	14,741	22,000	3,113	2,584
1,720	5,449	22,050	581	477
2,268	8,070	22,100	521	386
2,259	4,601	22,150	141	34
1,263	6,373	22,200	57	30
399	1,264	22,250	61	1
-166	4,485	22,300	13	1
209	209	22,350	1	1
1,240	3,489	22,400	3	0
5,588	97,156	總計	155,939	17,619
P/C	1.6050		增減	0.0945

※

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 (112)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

資料日期：2024/5/28

結算日：2024/6/19

OI 增減	Call	202406月 履約價	Put	OI 增減
0	143	19,700	2,002	120
0	492	20,700	6,739	731 ※
-3	3,417	20,800	9,285	41
-11	431	20,900	2,469	412
-10	1,333	21,000	4,523	379
-17	729	21,100	1,963	65
-147	1,857	21,200	1,823	238
-11	1,751	21,300	2,751	31
-37	3,255	21,400	2,126	548
-98	3,232	21,500	1,996	551
-143	4,990	21,600	1,742	139
-29	3,084	21,700	775	117
-337	2,906	21,800	1,080	461
171	2,784	21,900	495	241
-308	3,819	22,000	566	179
140	1,976	22,100	122	65
164	3,688	22,200	614	79
-1,329	2,352	22,300	73	57
272	2,153	22,400	45	26
-802	3,060	22,500	5	2
265	1,940	22,600	5	1
※	716	22,700	0	0
629	1,560	22,800	44	2
123	768	22,900	20	20
87	1,182	23,000	5	5
<b>-413</b>	<b>64,769</b>	總計	<b>96,565</b>	<b>4,172</b>
<b>P/C</b>	<b>1.4909</b>		<b>增減</b>	<b>0.0735</b>

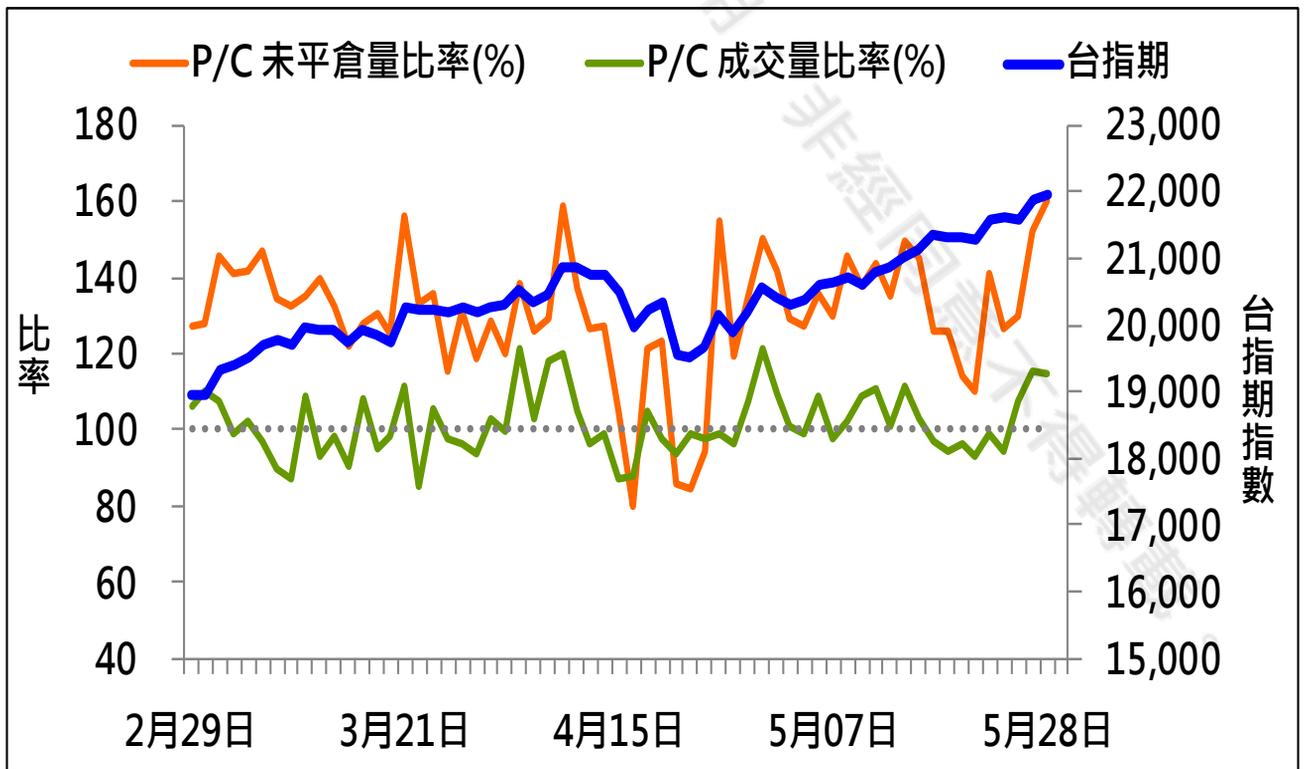
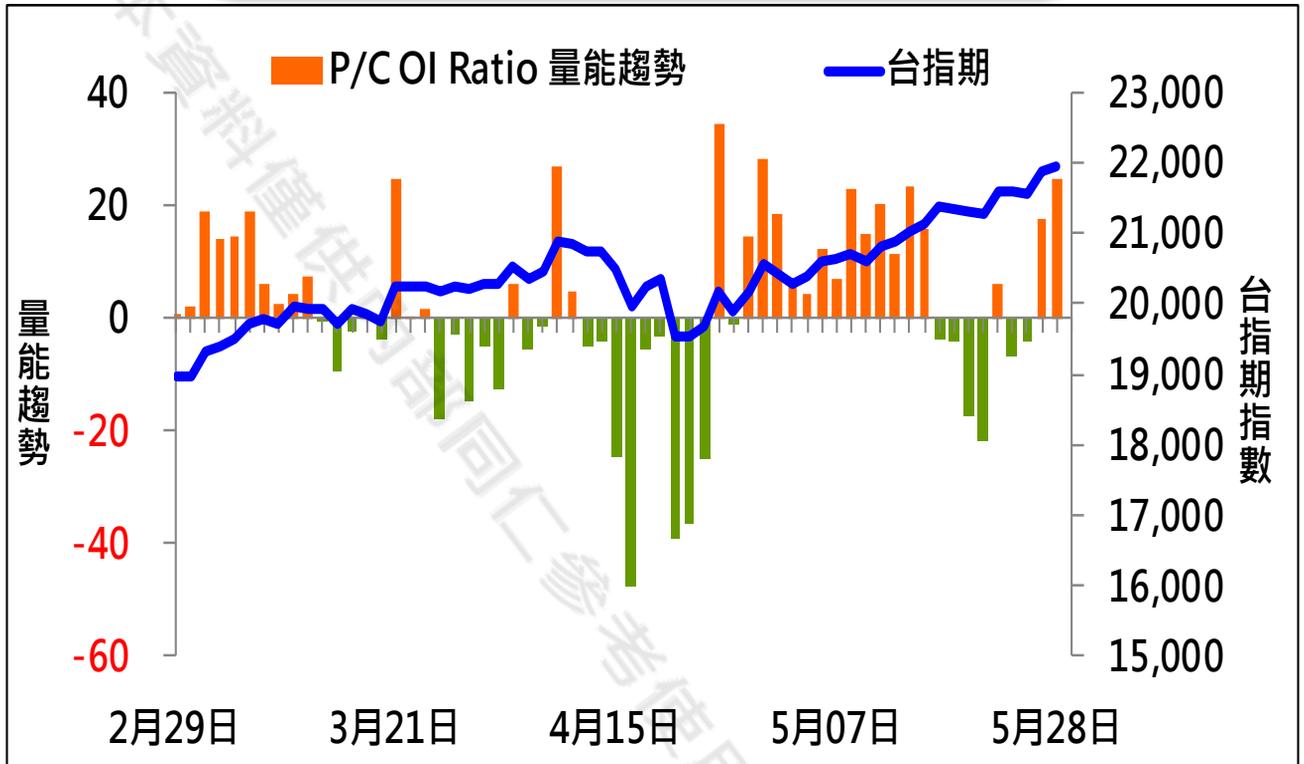
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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 2024/05/28 開 21892 高 21994 低 21845 收 21951 s 點量 71888 口 +81 (+0.37%)

SMA5 21715.00↑ SMA10 21500.60↑ SMA20 21068.85↑



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易者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，交易者須自行判斷與負責，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 (112)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 (112)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 (112)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