台指期貨暨選擇權日報

2023/1/4

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

01月04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	14,088	-1,856	1,105	-32	-308	-48
投信	-10,237	585	138	0	48	0
自營商	6,391	233	7	1	-48	28

01月04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	236	-14	12,896	78	-876	-1,688
投信	0	0	-100	0	159	0
自營商	-256	21	5,322	-4,762	17,182	14,861

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
富邦金	3.59	台積電	-29.12
中租-KY	3.34	鴻海	-4.45
富邦媒	2.73	聯發科	-4.11
旭隼	2.53	長榮	-2.72
中信金	1.28	南電	-2.07
中華電	1.24	萬海	-1.89
南亞科	1.09	中鋼	-1.77
上海商銀	1.09	聯電	-1.40
大立光	1.07	日月光投控	-1.26
和泰車	1.05	台達電	-1.25
前十名合計	19.03	後十名合計	-50.04

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	44.5%	40.7%
電子期前十大市場佔比	68.2%	68.5%
金融期前十大市場佔比	68.1%	60.7%
非金電期前十大市場佔比	99.4%	94.7%

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

台指期貨暨選擇權日報

2023/1/4

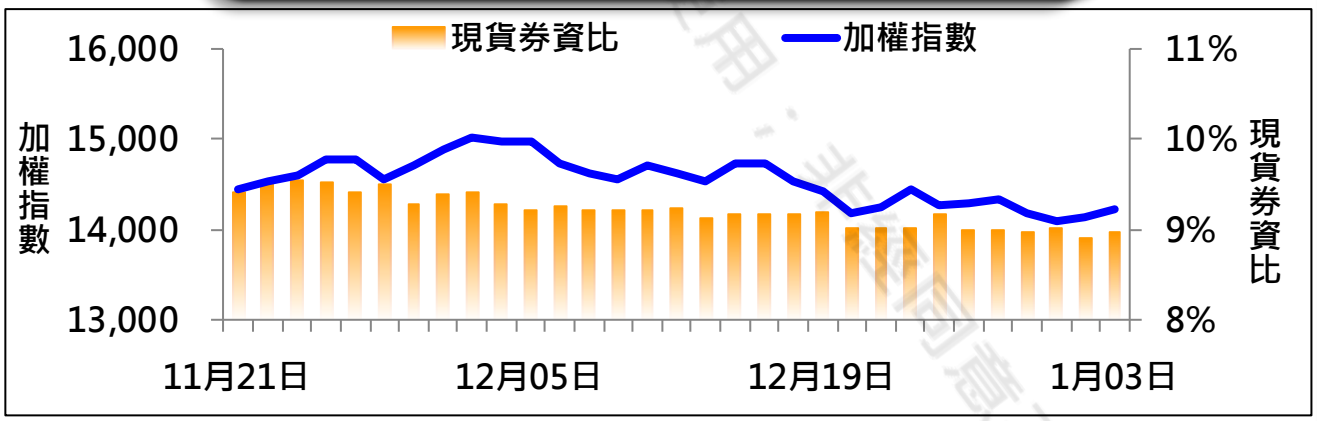
華南期貨 HUA NAN FUTURES

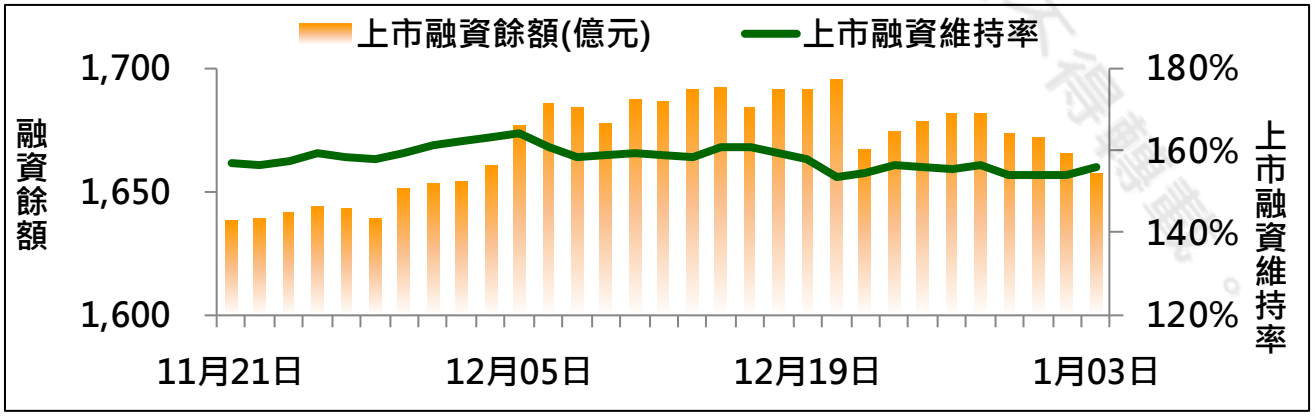
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
12月28日	-130.6	14,158	-541	-48.4	6,265	875
12月29日	-122.5	14,182	24	-3.0	6,411	146
12月30日	-1.4	19,221	5,039	8.3	5,780	-631
01月03日	-1.2	15,944	-3,277	9.2	6,158	378
01月04日	-56.0	14,088	-1,856	5.8	6,391	233

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
12月28日	9,684	659	9,025	5,741	11,918	-6,177
12月29日	11,995	-143	12,138	7,986	14,066	-6,080
12月30日	12,725	-194	12,919	14,425	6,193	8,232
01月03日	12,818	812	12,006	10,084	2,321	7,763
01月04日	12,896	-876	13,772	5,322	17,182	-11,860

現貨券資比 & 上市融資維持率



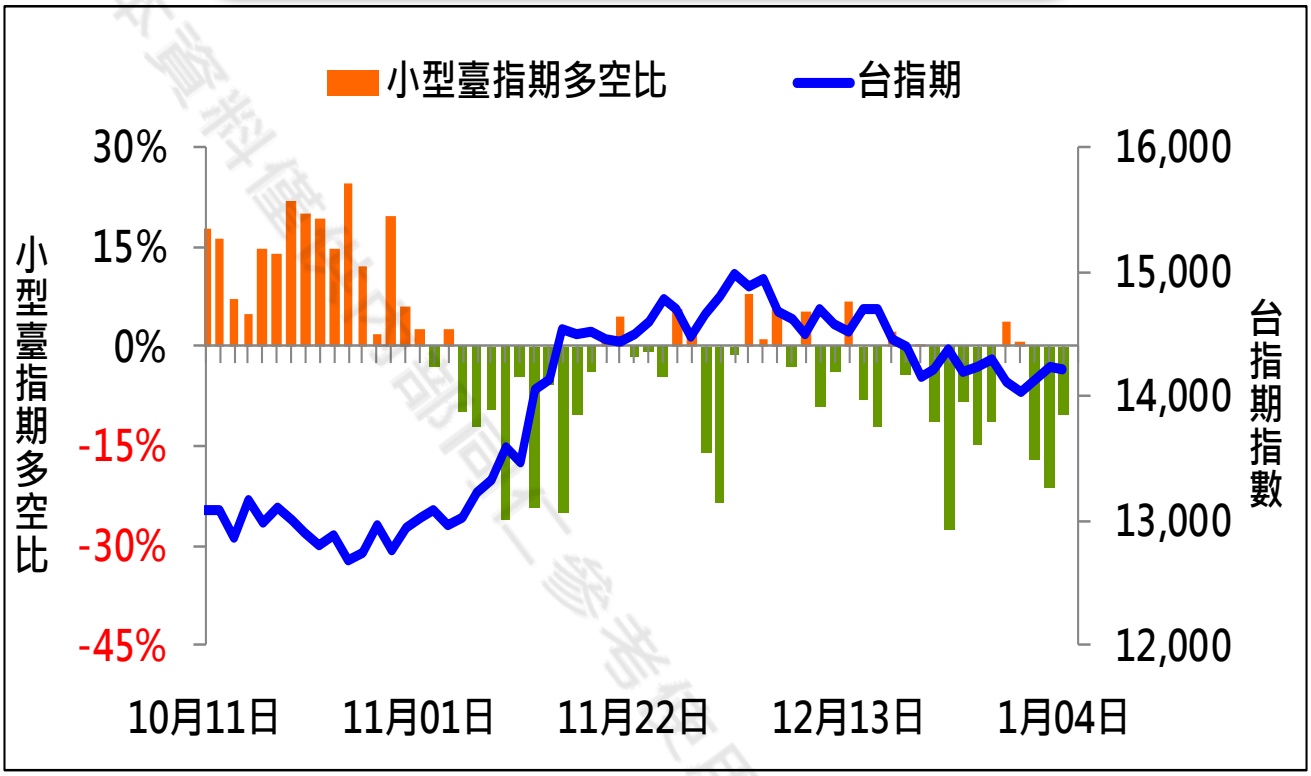


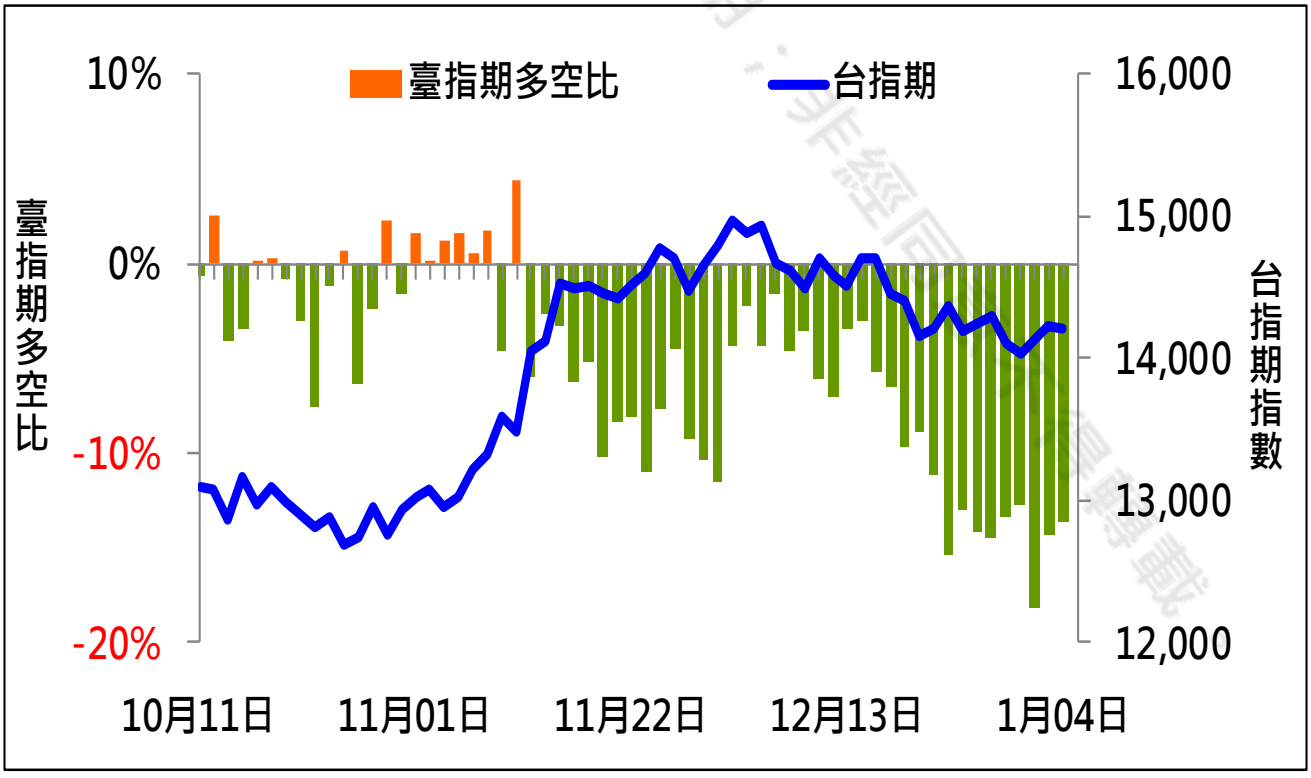
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

散戶多空比





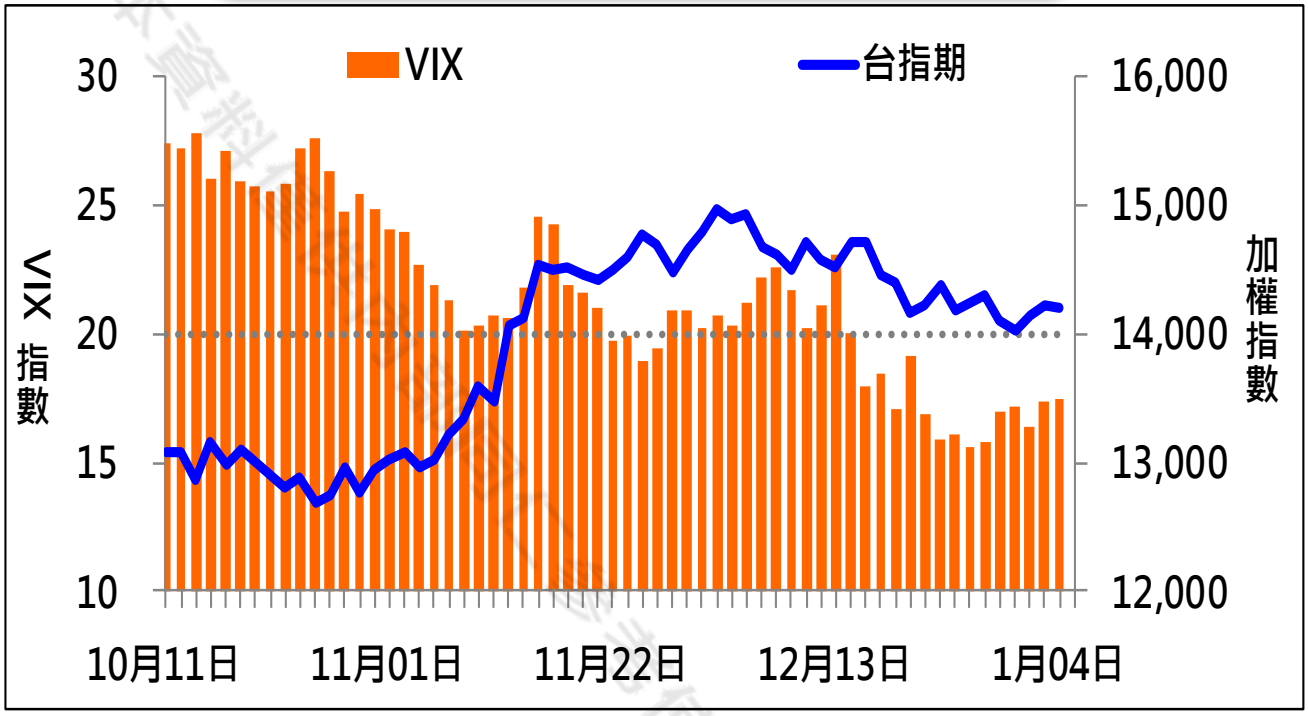
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

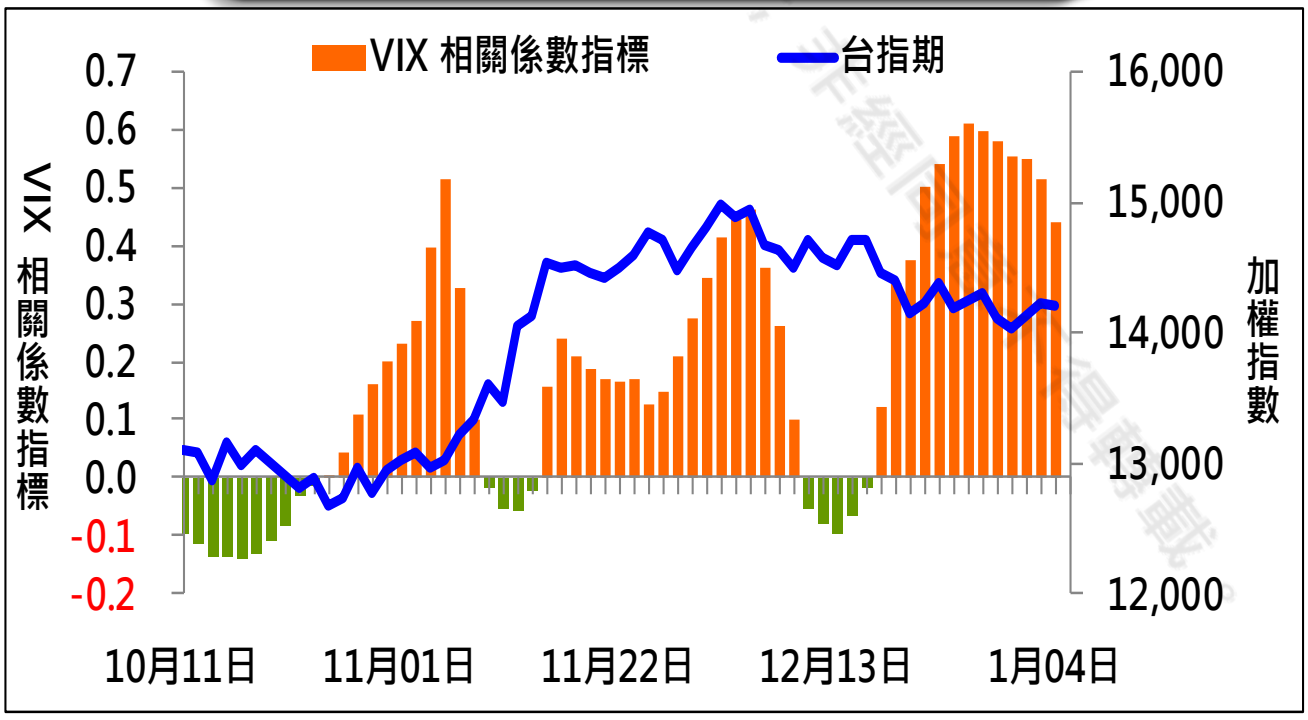
2023/1/4

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

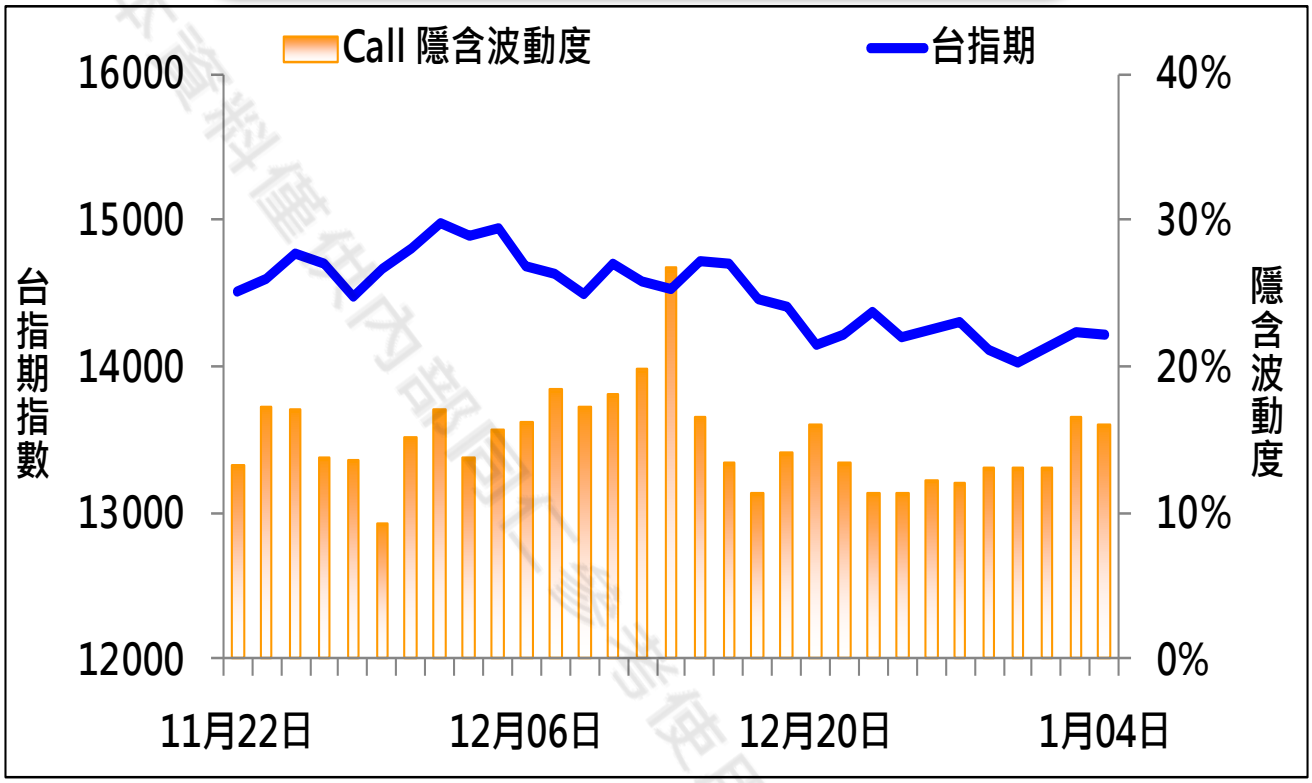


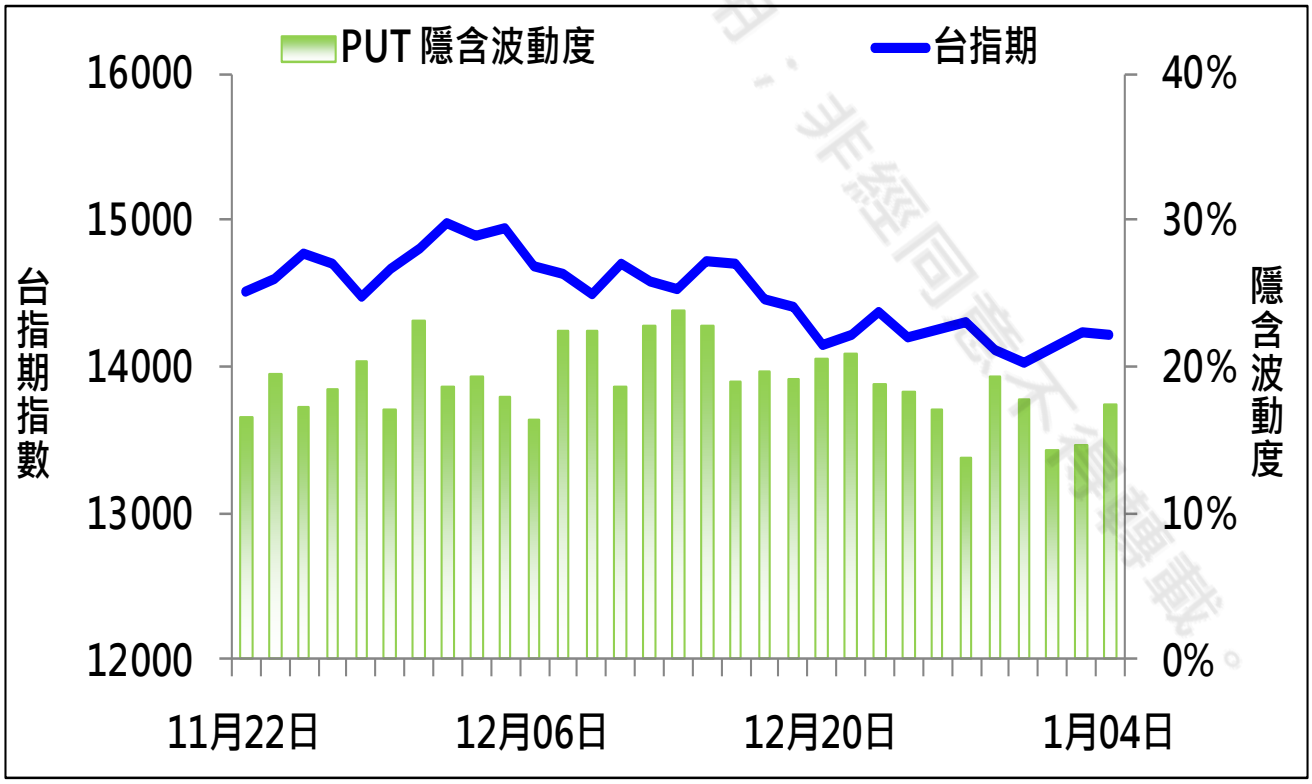
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

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

台指期貨暨選擇權日報

2023/1/4

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2023/1/4　　結算日：2023/1/11

OI 增減	Call	202301W2 履約價	Put	OI 增減	
0	5	13,500	2,720	700	
1	1	13,600	1,691	672	
2	32	13,700	2,843	489	
0	8	13,750	1,332	393	
11	18	13,800	3,562	2,200	※
1	26	13,850	2,001	1,541	
-10	74	13,900	2,329	1,024	
20	39	13,950	2,555	2,123	
85	222	14,000	1,972	1,225	
1	187	14,050	1,266	700	
-13	431	14,100	2,061	1,283	
177	576	14,150	677	428	
819	2,149	14,200	1,565	1,063	
1,039	2,326	14,250	670	425	
1,436	2,736	14,300	583	418	
812	1,557	14,350	170	119	
1,008	1,985	14,400	501	368	
742	1,626	14,450	90	47	
1,847	3,532	14,500	78	46	
1,272	1,926	14,550	40	37	
2,115	3,841	14,600	25	16	
1,705	2,780	14,650	2	1	
※ 2,343	2,921	14,700	11	6	
1,495	2,017	14,800	5	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
21,027	36,692	0.9279	34,045	18,380	
昨日 P/C	1.0000	今日增減變化		-0.0721	

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

台指期貨暨選擇權日報

2023/1/4

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2023/1/4　　結算日：2023/1/18

OI 增減	Call	202301 月履約價	Put	OI 增減	
0	491	12,900	4,929	178	
0	89	13,000	3,690	177	
0	10	13,200	2,603	237	
0	66	13,400	3,940	434	※
0	144	13,500	6,810	164	
0	135	13,600	4,166	24	
-8	341	13,800	3,327	-277	
0	0	13,950	78	78	
-76	1,348	14,000	3,475	358	
46	46	14,050	173	173	
15	2,322	14,100	1,961	78	
49	49	14,150	81	81	
-63	1,517	14,200	1,345	12	
32	32	14,250	29	29	
273	1,852	14,300	1,107	20	
115	115	14,350	21	21	
-174	2,723	14,400	1,196	-5	
168	168	14,450	23	23	
44	3,795	14,500	536	-4	
145	145	14,550	0	0	
41	2,870	14,600	449	8	
268	5,385	14,800	226	-7	
28	11,942	15,000	135	-1	
324	8,157	15,100	82	-9	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
1,394	77,815	0.8950	69,645	1,788
昨日 P/C	0.8879	今日增減變化		0.0071

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

台指期貨暨選擇權日報

2023/1/4

華南期貨 HUA NAN FUTURES

次月選擇權OI變化

日期：2023/1/4　　結算日：2023/2/15

OI 增減	Call	202302 月履約價	Put	OI 增減	
0	1	12,800	784	-23	
0	2	12,900	175	40	
0	2	13,000	851	36	
0	2	13,100	335	148	
0	0	13,200	593	389	
0	4	13,300	331	34	
0	0	13,400	212	75	※
0	5	13,500	384	90	
0	1	13,600	161	17	
1	2	13,700	168	88	
1	13	13,800	170	2	
0	11	13,900	149	28	
-1	90	14,000	260	6	
25	62	14,100	124	2	
9	101	14,200	278	11	
19	146	14,300	47	1	
57	279	14,400	28	2	
80	524	14,500	90	36	
85	629	14,600	26	-2	
18	782	14,700	14	0	
55	983	14,800	8	-1	
-6	809	14,900	15	-1	
33	1,258	15,000	69	4	
9	421	15,100	23	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
812	12,396	0.5541	6,869	1,159	
昨日 P/C	0.4929	今日增減變化		0.0612	

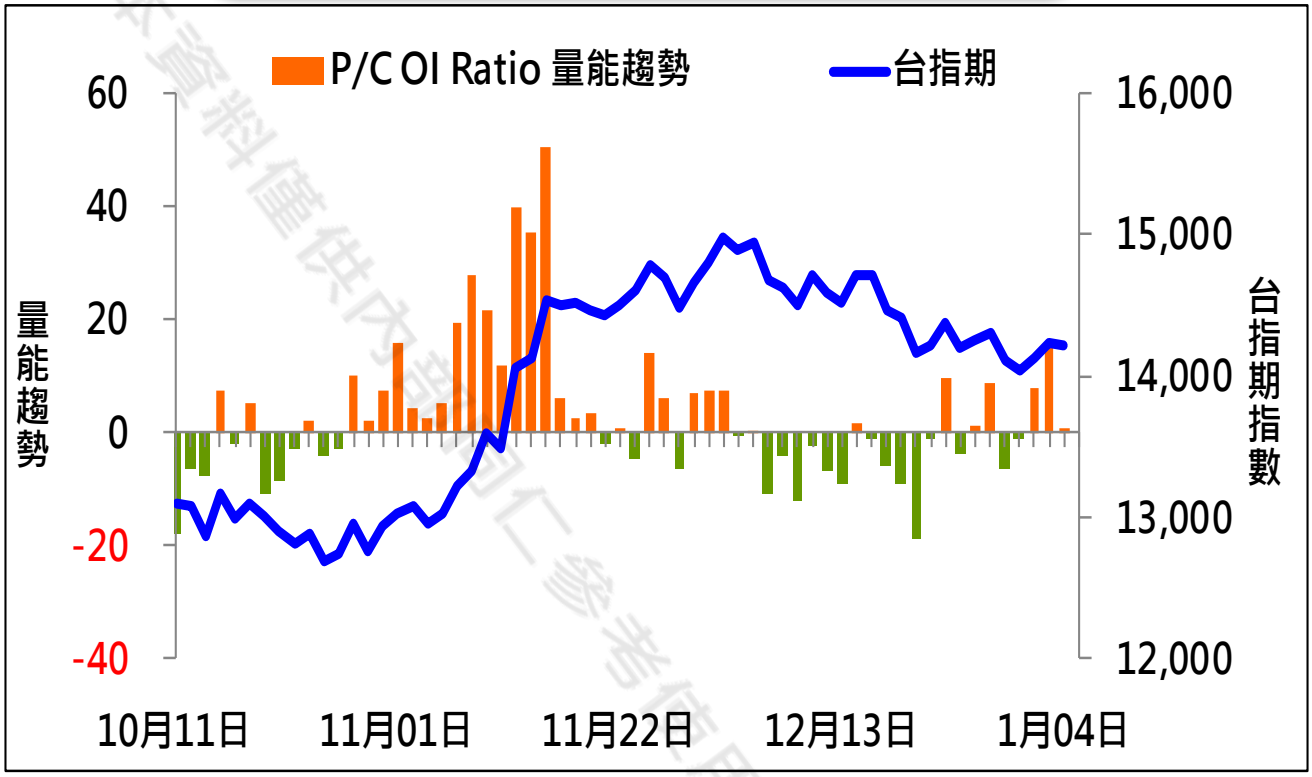
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

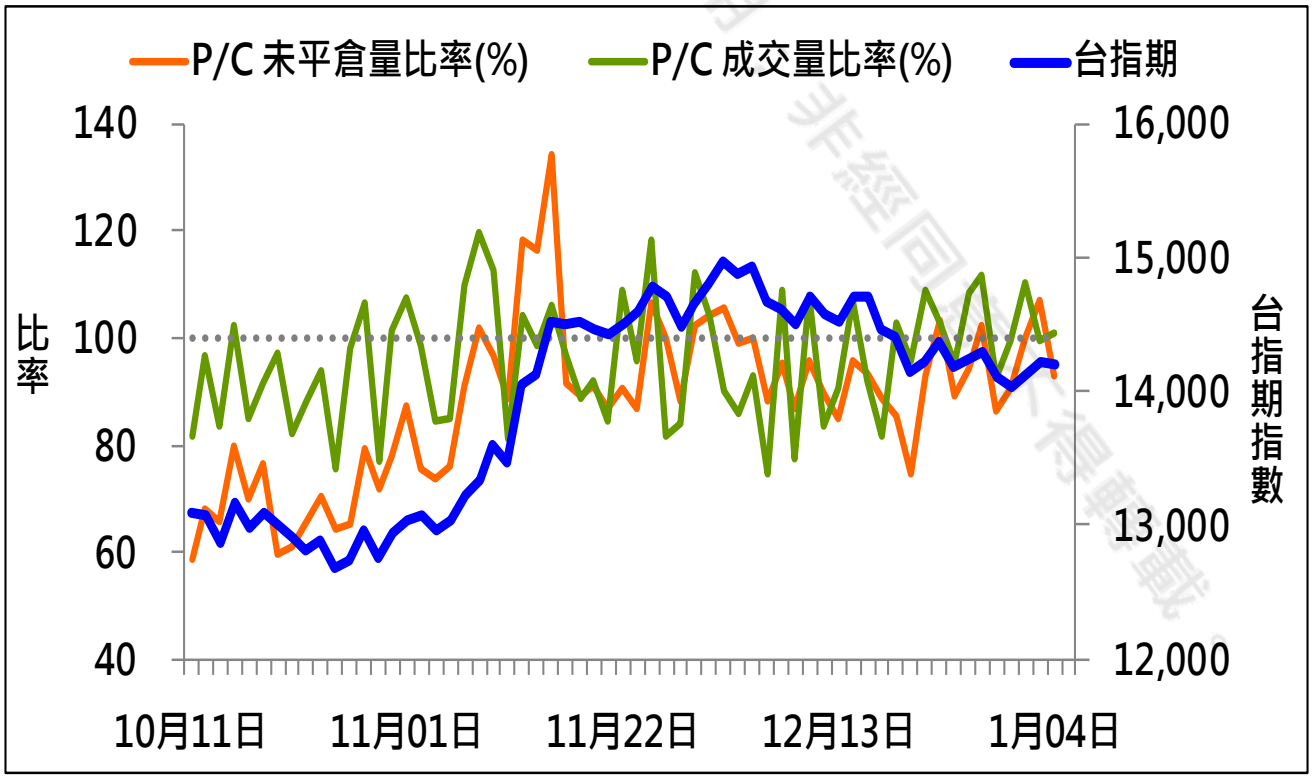
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖

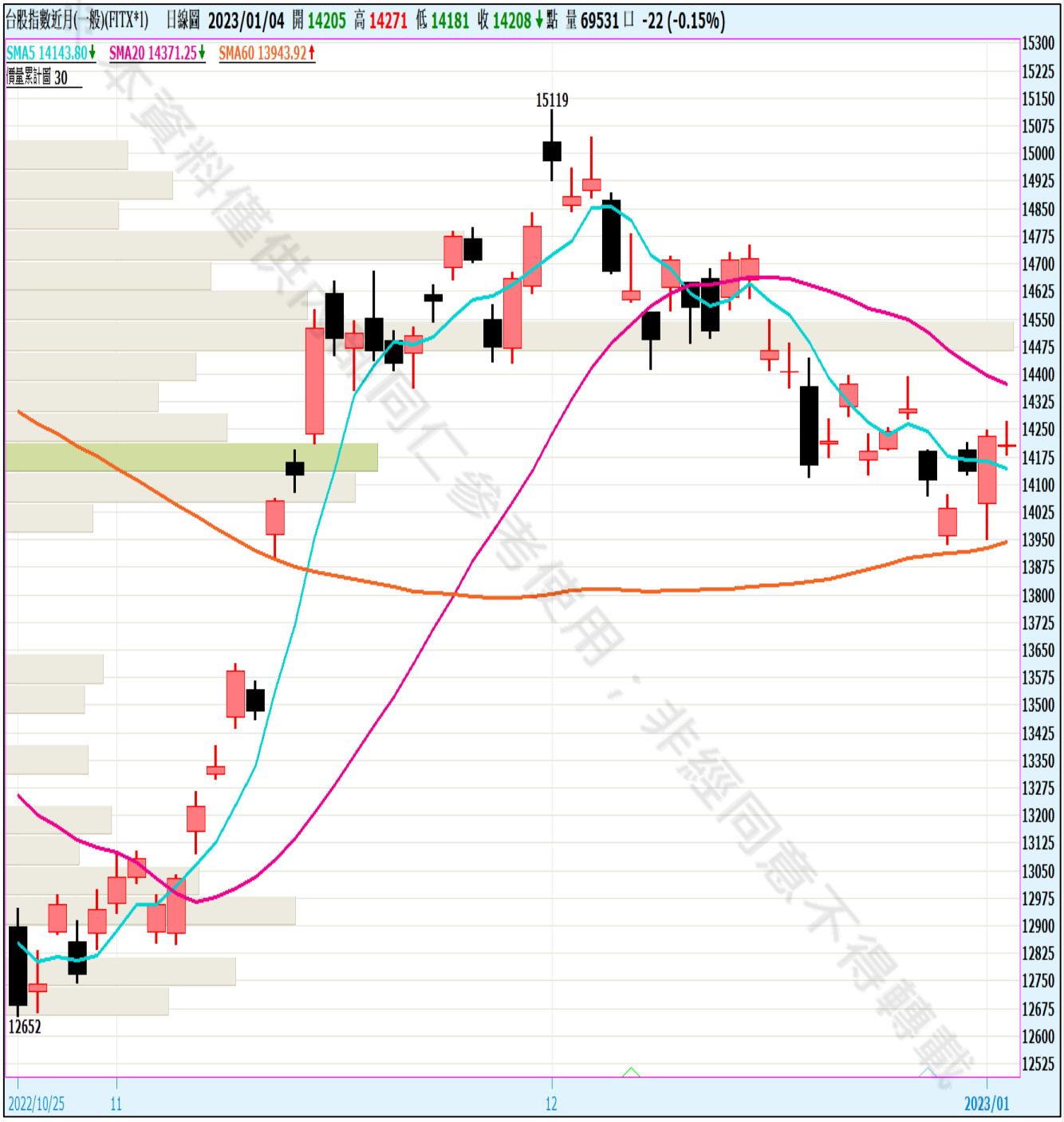




期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

盤後重點觀察



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