台指期貨暨選擇權日報

2023/2/15

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

02月15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	8,311	-4,068	585	136	-864	269
投信	-8,036	-775	142	0	75	0
自營商	6,552	1,899	85	13	224	-6

02月15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	-26	9,592	-1,723	1,642	-10,492
投信	0	0	100	0	-13	-402
自營商	-31	-17	-5,045	-33,684	-3,043	-10,253

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
欣興	2.84	台積電	-166.38
鴻海	2.22	聯發科	-11.29
華新	1.56	台塑化	-3.36
南電	1.14	國泰金	-3.07
士電	1.12	研華	-2.86
億豐	1.08	富邦金	-2.69
台泥	0.71	中信金	-2.25
國巨	0.68	台塑	-2.04
創意	0.64	南亞	-2.04
大立光	0.64	聯電	-2.00
前十名合計	12.63	後十名合計	-197.98

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	53.8%	44.0%
電子期前十大市場佔比	64.9%	77.7%
金融期前十大市場佔比	70.7%	84.0%
非金電期前十大市場佔比	100.0%	97.0%

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

2023/2/15

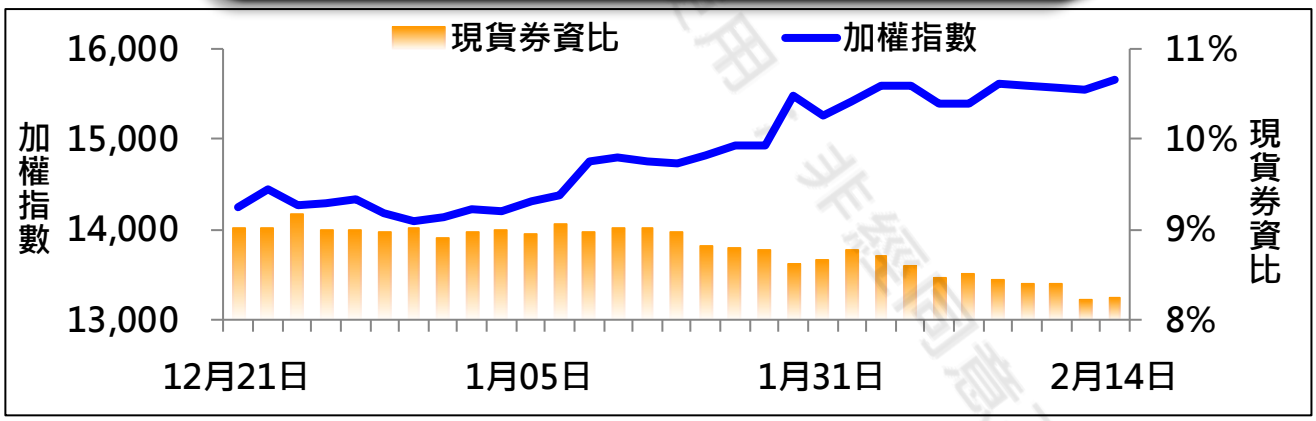
華南期貨 HUA NAN FUTURES

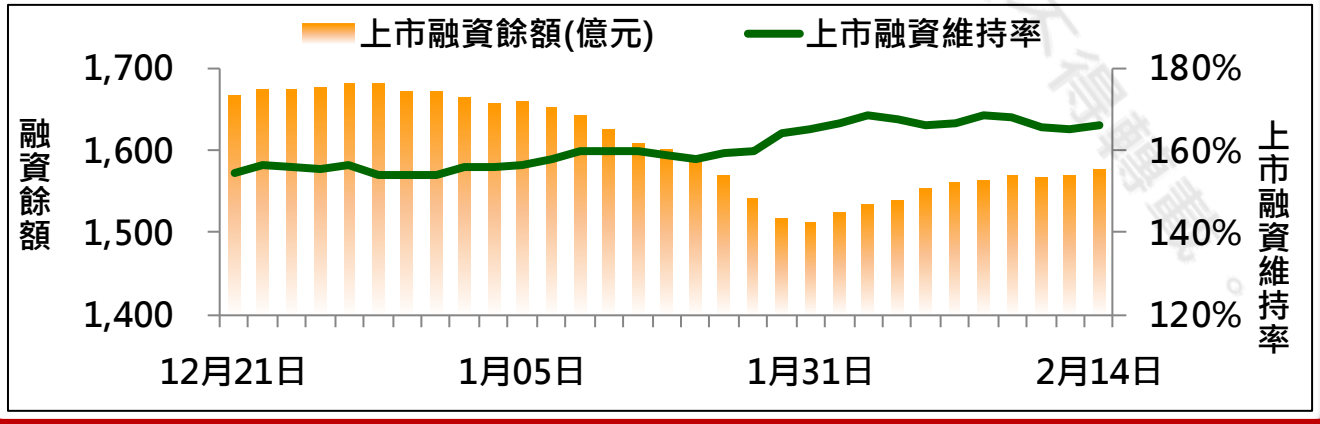
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
02月09日	-5.5	10,750	-1,016	-10.5	6,407	707
02月10日	-1.6	11,682	932	-40.0	6,032	-375
02月13日	-54.7	12,264	582	-26.8	6,741	709
02月14日	87.3	12,379	115	-8.3	4,653	-2,088
02月15日	-81.6	8,311	-4,068	-16.7	6,552	1,899

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
02月09日	15,928	10,255	5,673	399	4,733	-4,334
02月10日	13,219	11,829	1,390	12,601	4,673	7,928
02月13日	11,572	9,761	1,811	18,122	16,768	1,354
02月14日	11,315	12,134	-819	28,639	7,210	21,429
02月15日	9,592	1,642	7,950	-5,045	-3,043	-2,002

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

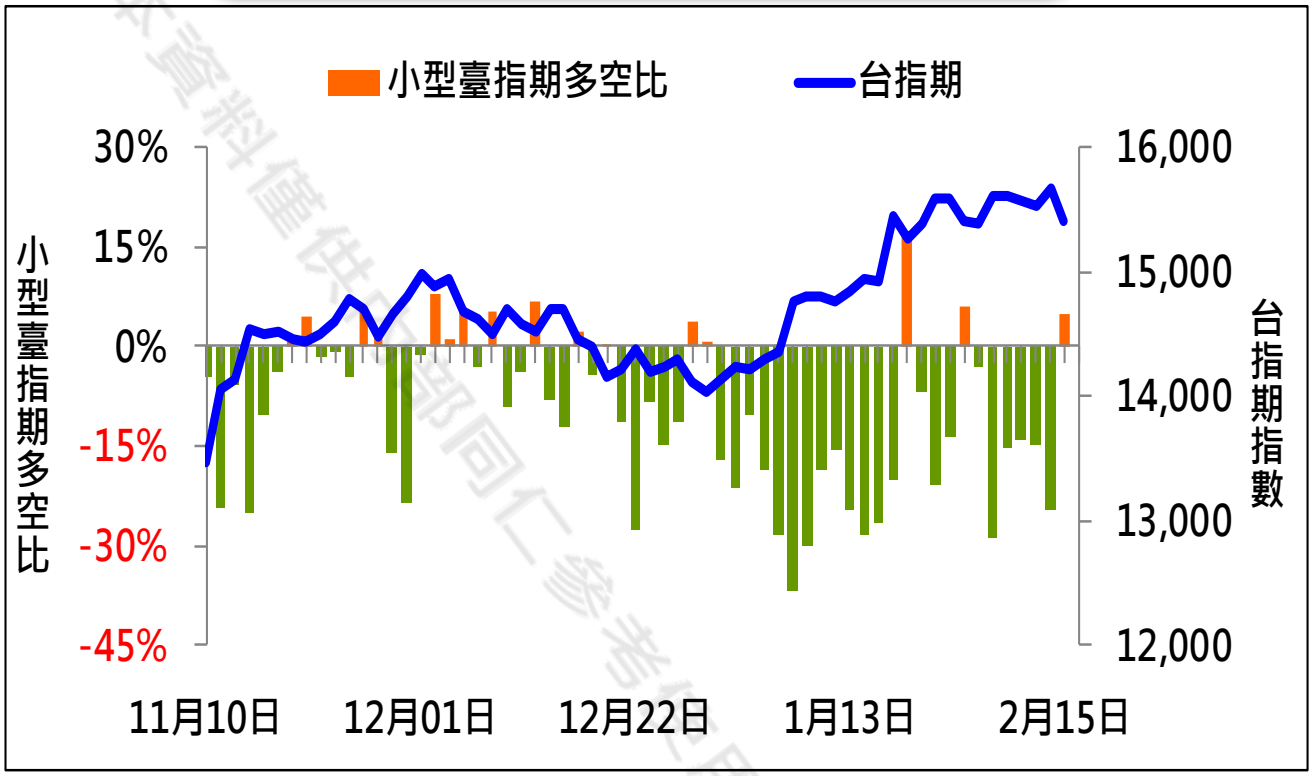
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

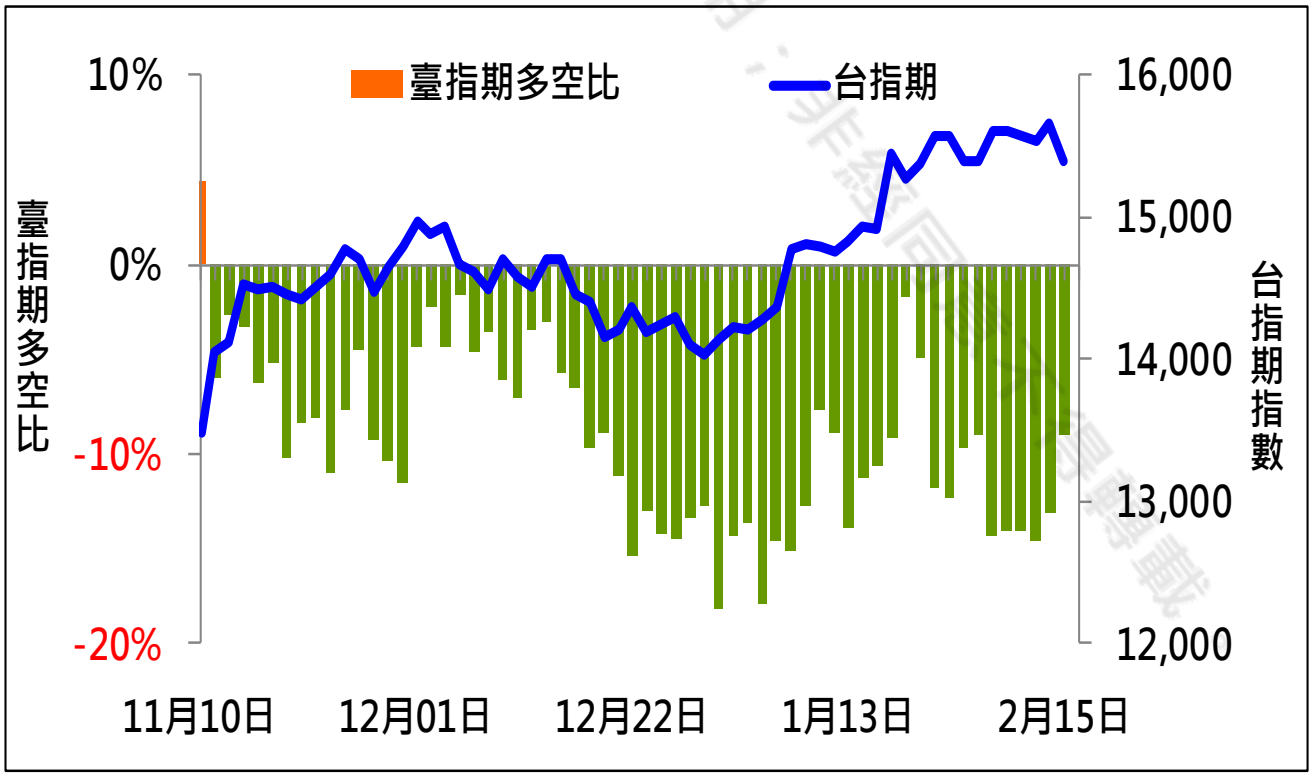
台指期貨暨選擇權日報

2023/2/15

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

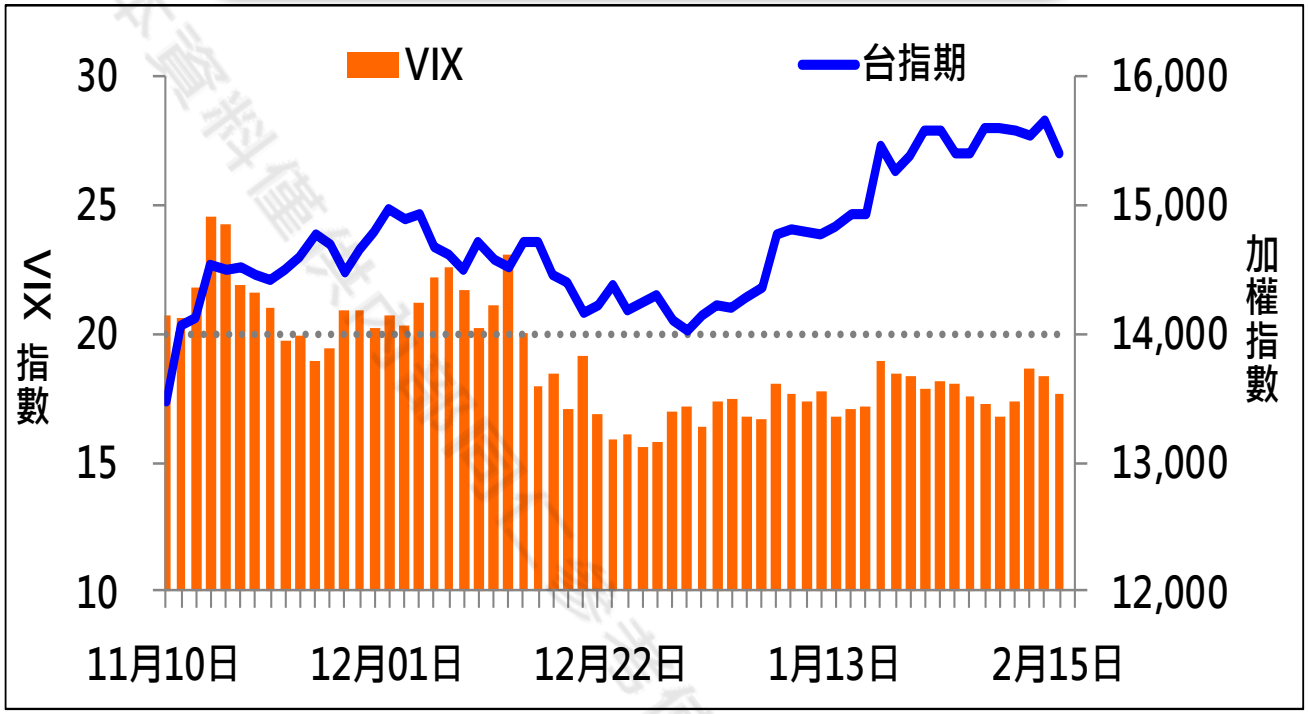
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

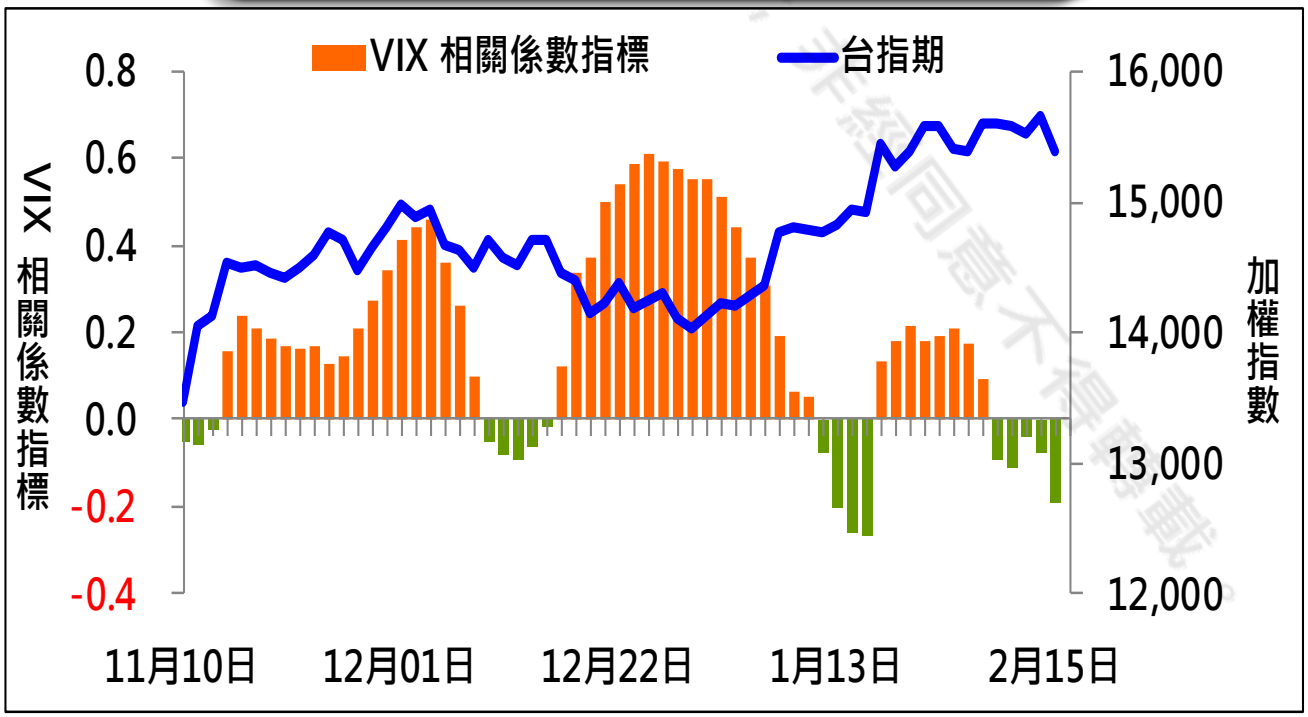
2023/2/15

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

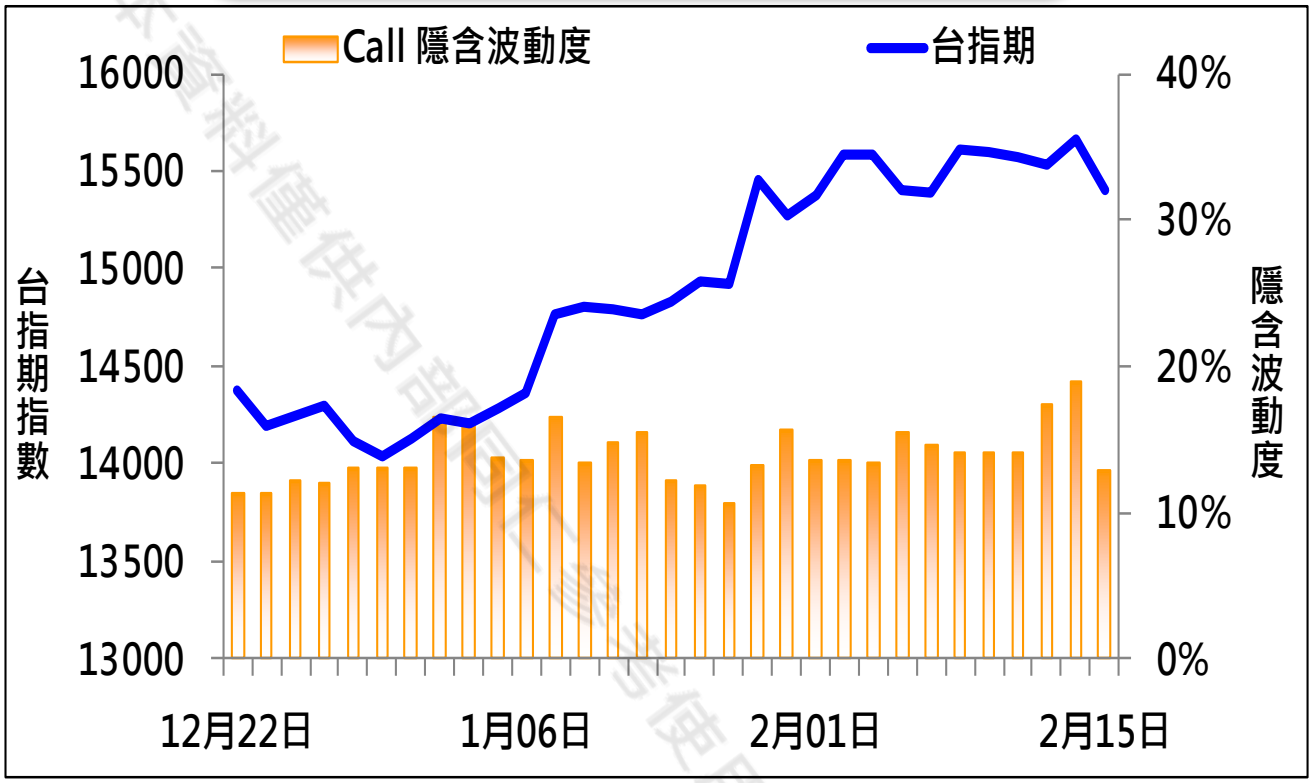


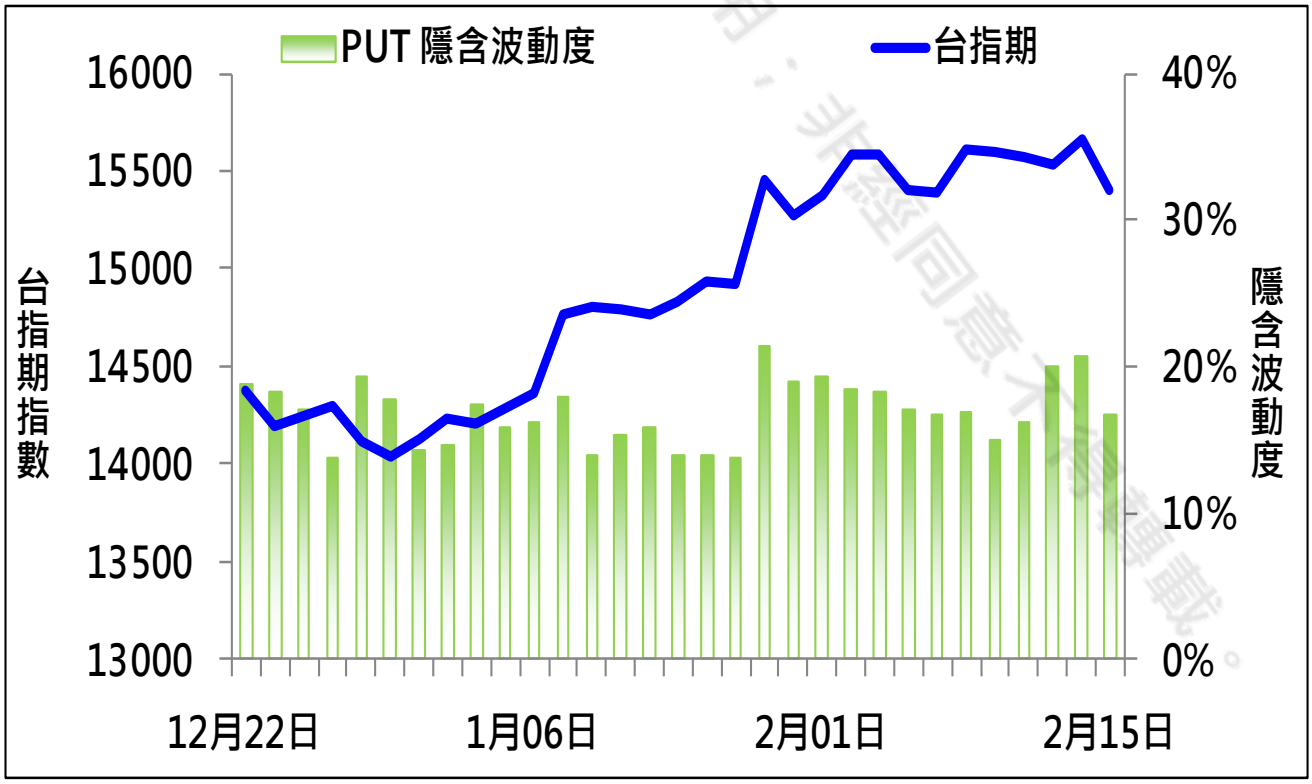
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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

2023/2/15

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2023/2/15　　結算日：2023/2/22

	OI 增減	Call	202302W4 履約價	Put	OI 增減	
	6	28	15,000	2,619	1,771	
	7	7	15,050	1,416	909	
	27	41	15,100	2,021	1,248	
	4	9	15,150	1,910	1,318	
	115	159	15,200	3,418	2,413	※
	121	134	15,250	1,800	1,035	
	225	276	15,300	1,625	695	
	126	198	15,350	1,479	532	
	765	899	15,400	3,261	1,418	
	782	926	15,450	1,141	141	
	1,645	1,902	15,500	1,887	275	
	788	1,475	15,550	1,068	44	
	1,364	3,201	15,600	603	-120	
	2,830	4,060	15,650	384	68	
	3,086	4,062	15,700	284	69	
	2,647	3,612	15,750	349	84	
※	3,582	4,616	15,800	275	141	
	2,036	3,123	15,850	37	6	
	3,532	4,614	15,900	41	-22	
	1,241	2,409	15,950	34	-5	
	1,954	4,613	16,000	111	59	
	714	1,140	16,050	70	50	
	216	1,602	16,100	3	2	
	2,026	3,221	16,200	44	2	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
31,936	54,178	0.7452	40,373	18,194
昨日 P/C	0.8600	今日增減變化		-0.1148

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

2023/2/15

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2023/2/15　　結算日：2023/3/1

OI 增減	Call	202303W1 履約價	Put	OI 增減	
0	0	14,000	378	378	※
0	0	14,100	7	7	
0	0	14,200	250	250	
3	3	15,000	125	125	
2	2	15,100	58	58	
5	5	15,200	82	82	
1	1	15,250	57	57	
24	24	15,300	36	36	
10	10	15,350	4	4	
39	39	15,400	53	53	
75	75	15,450	2	2	
49	49	15,500	37	37	
44	44	15,550	1	1	
71	71	15,600	4	4	
※ 372	372	15,650	3	3	
40	40	15,700	4	4	
77	77	15,750	1	1	
115	115	15,800	3	3	
112	112	15,850	0	0	
83	83	15,900	0	0	
82	82	15,950	0	0	
51	51	16,000	0	0	
25	25	16,050	0	0	
251	251	16,800	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
1,835	1,835	0.9875	1,812	1,812
昨日 P/C	0.0000	今日增減變化		0.9875

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

2023/2/15

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2023/2/15　　結算日：2023/3/15

	OI 增減	Call	202303 月 履約價	Put	OI 增減
	0	1	10,000	9,941	2,229
	2	85	14,500	1,932	272
	-2	246	14,600	2,096	492
	-8	89	14,700	2,593	899
	10	217	14,800	2,478	285
	2	87	14,900	1,635	437
	42	427	15,000	4,251	874
	4	155	15,100	2,357	420
	20	401	15,200	3,926	960
	197	326	15,300	1,589	580
	295	1,298	15,400	1,816	-231
	304	925	15,500	911	-116
	223	2,285	15,600	708	82
	378	1,429	15,700	236	-33
	423	1,590	15,800	126	12
※	1,317	5,448	16,000	94	-11
	0	1,220	18,000	526	521
	0	0	18,100	0	0
	0	497	18,200	0	0
	28	2,788	18,400	0	0
	20	1,650	18,600	1	0
	12	1,989	18,800	0	0
	0	1,936	19,000	1	0
	60	7,658	19,200	0	0

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
8,776	64,635	1.1049	71,412	10,718
昨日 P/C	1.0866	今日增減變化		0.0183

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

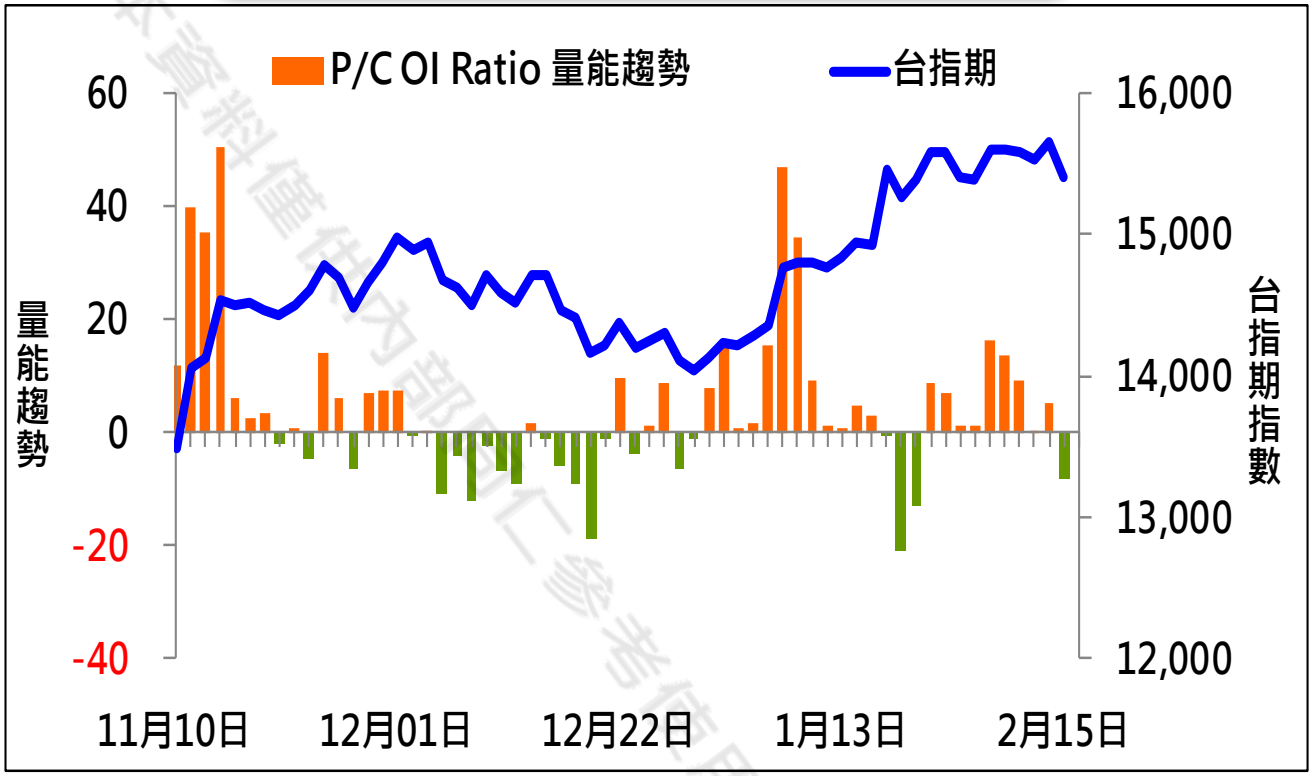
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

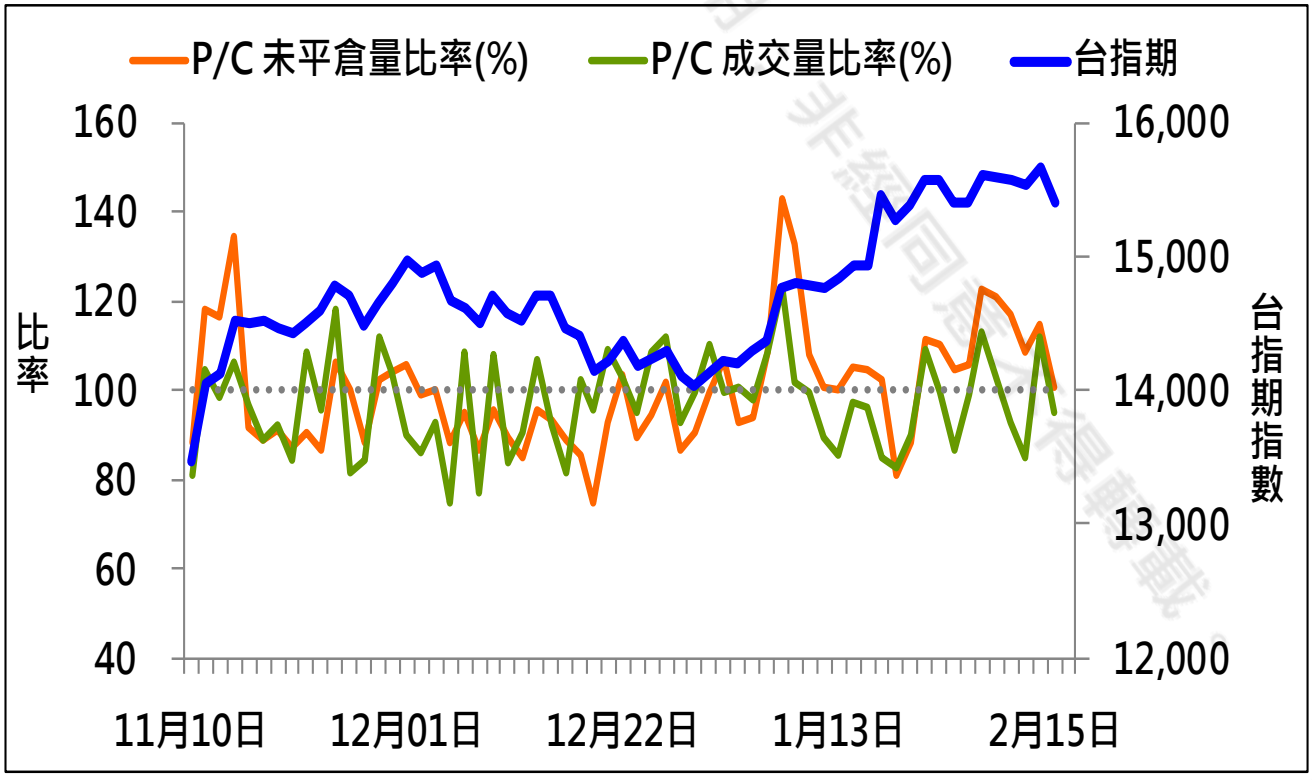
台指期貨暨選擇權日報

2023/2/15

華南期貨 HUA NAN FUTURES

成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖



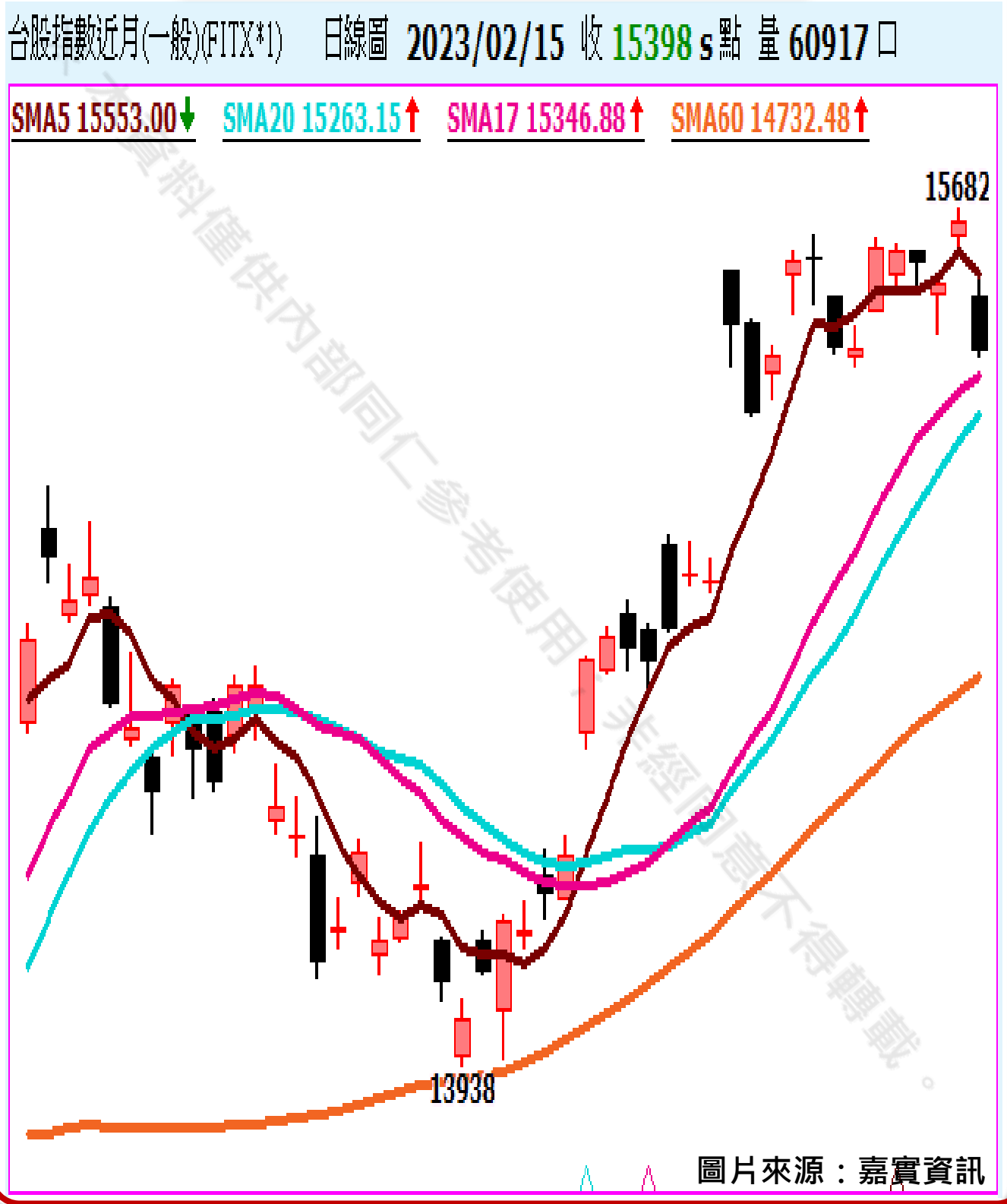


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

盤後重點觀察



資料僅供內部同仁參考使用，非經同意不得轉載。

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