# 台指期貨暨選擇權日報

2023/3/30

華南期貨 HUA NAN FUTURES

## 法人籌碼動態

| 03月30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 | 9,630 | 1,991 | 351 | -17 | -532 | 45 |
| 投信 | -5,246 | -616 | 142 | 1 | 64 | 0 |
| 自營商 | 8,255 | 258 | 352 | -3 | -36 | -77 |

| 03月30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 | 65 | 12 | 13,800 | 827 | -2,259 | 1,592 |
| 投信 | 0 | 0 | 100 | 0 | 81 | 0 |
| 自營商 | -67 | -21 | 16,172 | 4,855 | 30,427 | 4,519 |

| 個股貢獻點數前十名 | | 個股貢獻點數後十名 | |
|---|---|---|---|
| 台積電 | 41.49 | 中租-KY | -1.66 |
| 鴻海 | 4.44 | 國泰金 | -1.30 |
| 欣興 | 3.41 | 國票金 | -0.83 |
| 南亞科 | 2.88 | 台化 | -0.75 |
| 聯發科 | 2.56 | 研華 | -0.75 |
| 緯穎 | 2.52 | 永豐金 | -0.73 |
| 聯電 | 2.40 | 和泰車 | -0.70 |
| 旭隼 | 2.11 | 世芯-KY | -0.69 |
| 緯創 | 1.90 | 合庫金 | -0.67 |
| 南電 | 1.86 | 富邦媒 | -0.63 |
| 前十名合計 | 65.57 | 後十名合計 | -8.70 |

| 單位：口 | 多 | 空 |
|---|---|---|
| 台指期前十大市場佔比 | 46.9% | 37.4% |
| 電子期前十大市場佔比 | 47.5% | 66.7% |
| 金融期前十大市場佔比 | 53.1% | 60.6% |
| 非金電期前十大市場佔比 | 100.0% | 82.1% |

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

2023/3/30

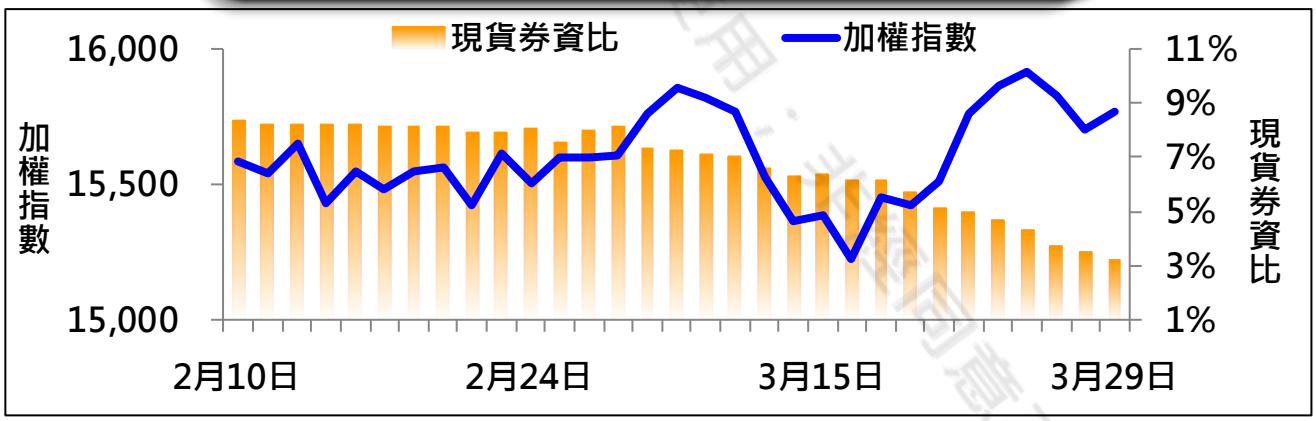
華南期貨 HUA NAN FUTURES

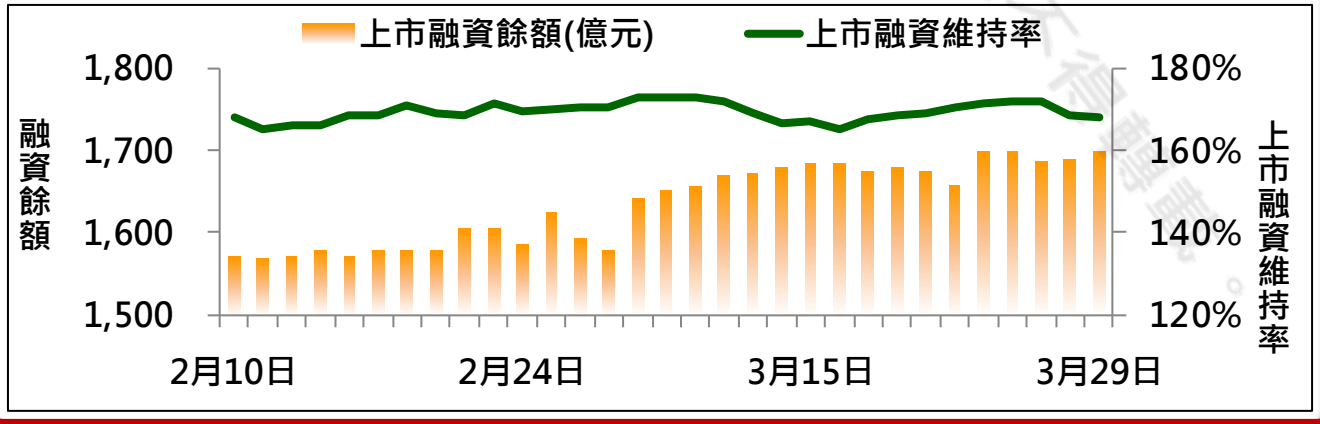
## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

| 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) |
| 03月24日 | 113.0 | 12,728 | -4,756 | 17.2 | 7,833 | -385 |
| 03月27日 | -8.7 | 4,357 | -8,371 | -12.5 | 8,593 | 760 |
| 03月28日 | -20.7 | 4,737 | 380 | -21.1 | 8,089 | -504 |
| 03月29日 | 91.8 | 7,639 | 2,902 | -5.5 | 7,997 | -92 |
| 03月30日 | 105.6 | 9,630 | 1,991 | 27.9 | 8,255 | 258 |

| 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 |
| 03月24日 | 13,952 | -1,438 | 15,390 | 10,322 | 6,678 | 3,644 |
| 03月27日 | 13,086 | 510 | 12,576 | 4,795 | 17,158 | -12,363 |
| 03月28日 | 13,581 | -398 | 13,979 | 1,874 | 19,321 | -17,447 |
| 03月29日 | 12,973 | -3,851 | 16,824 | 11,317 | 25,908 | -14,591 |
| 03月30日 | 13,800 | -2,259 | 16,059 | 16,172 | 30,427 | -14,255 |

## 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

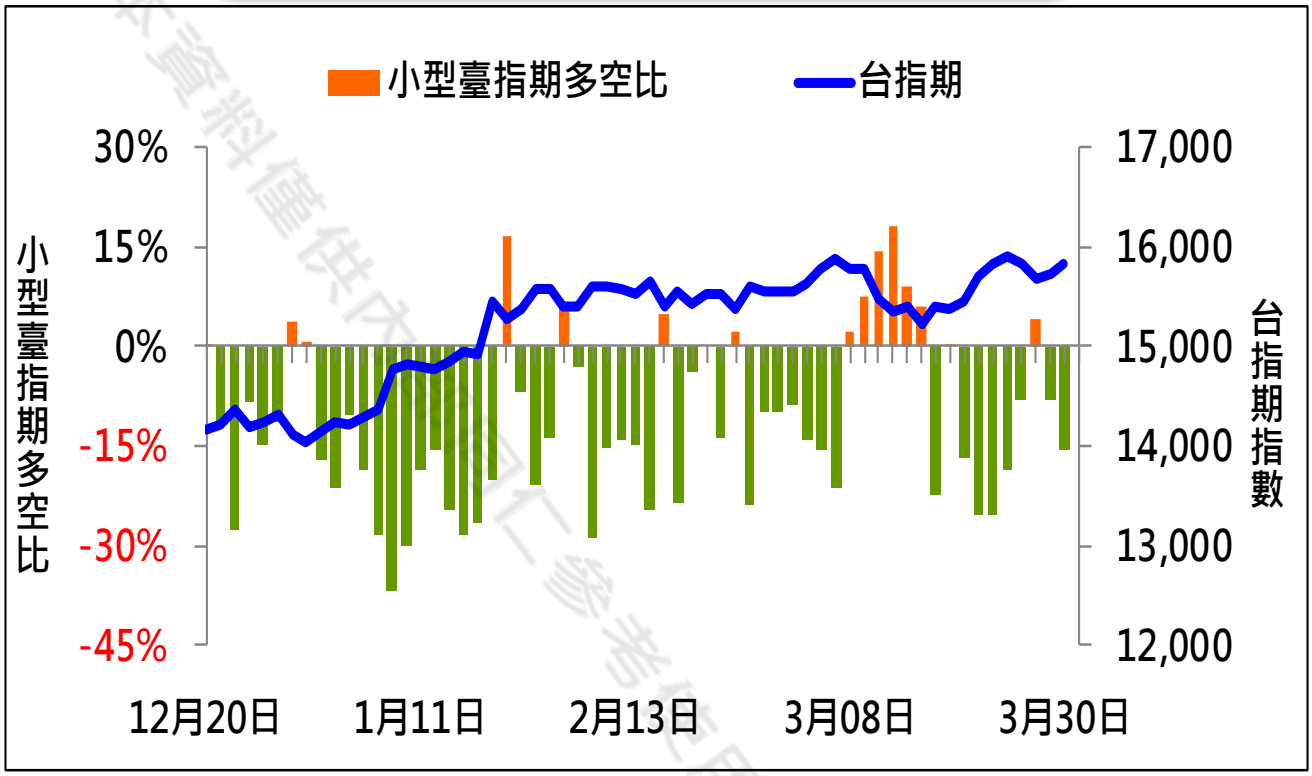
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

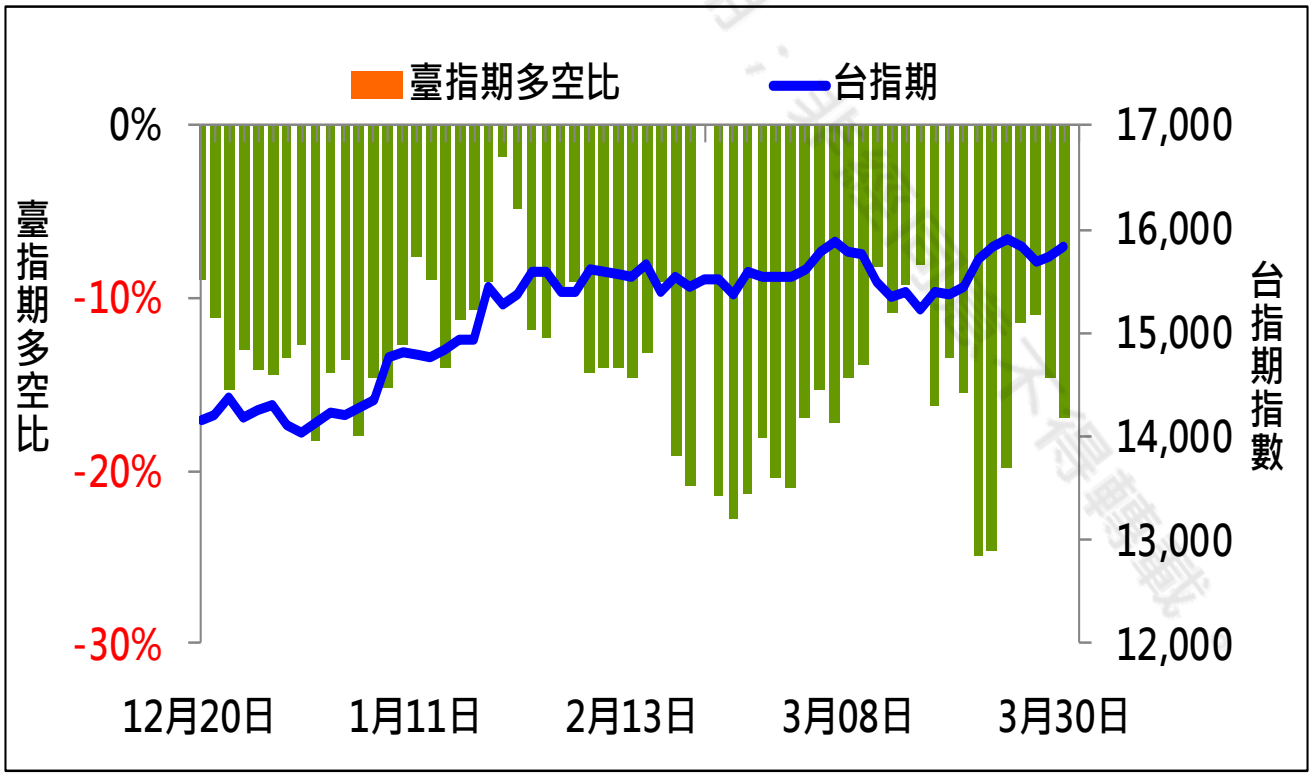
# 台指期貨暨選擇權日報

2023/3/30

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

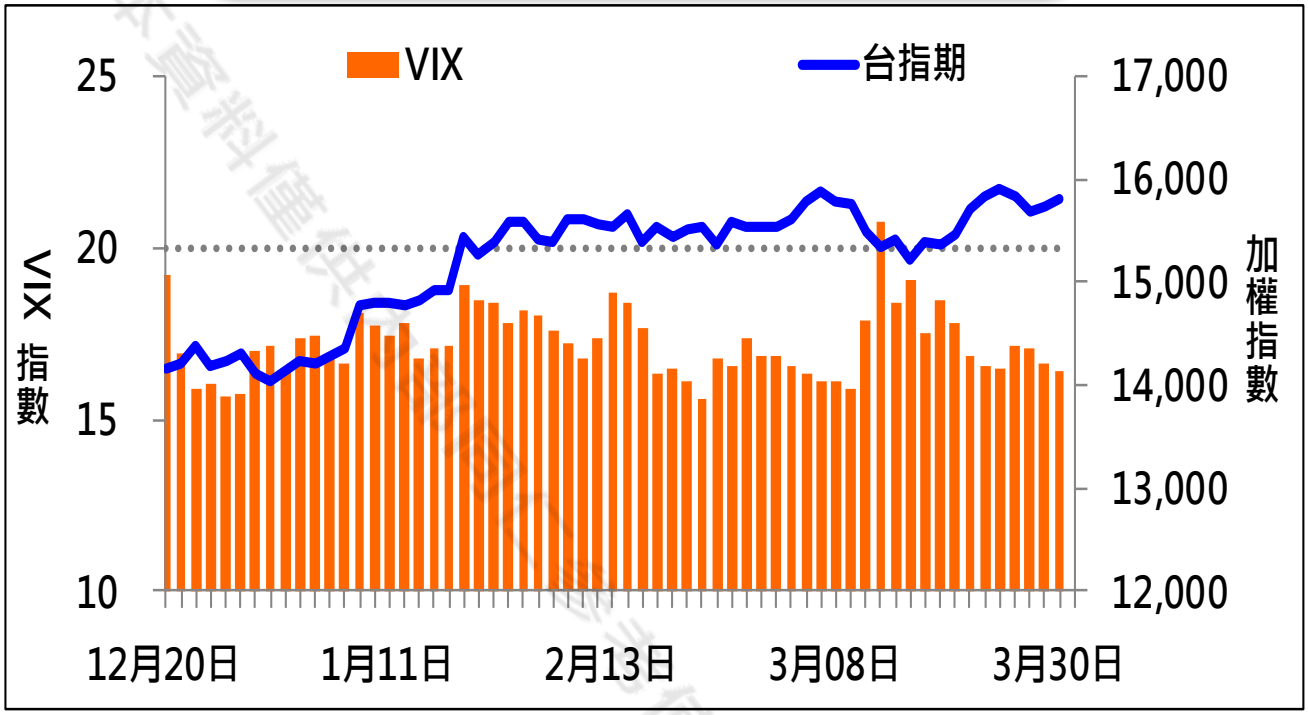

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

# 台指期貨暨選擇權日報

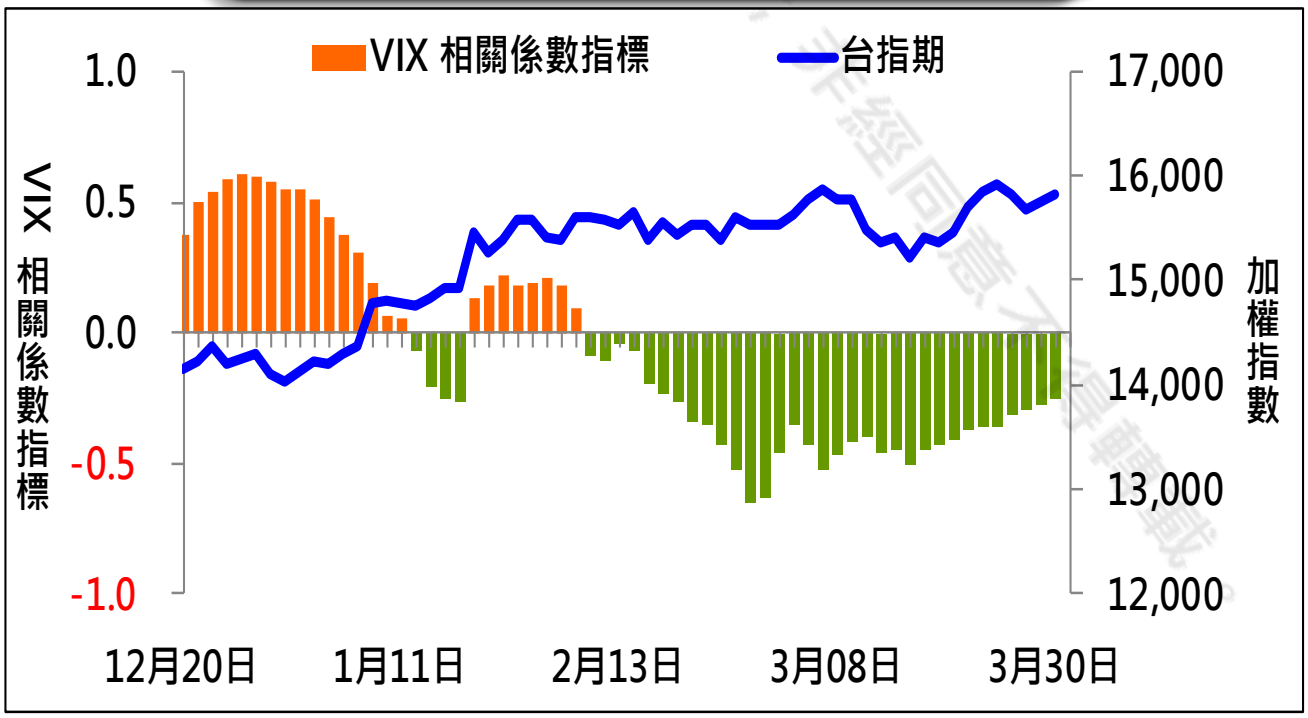
2023/3/30

華南期貨 HUA NAN FUTURES

## VIX




## VIX 與 TWSE 相關係數指標

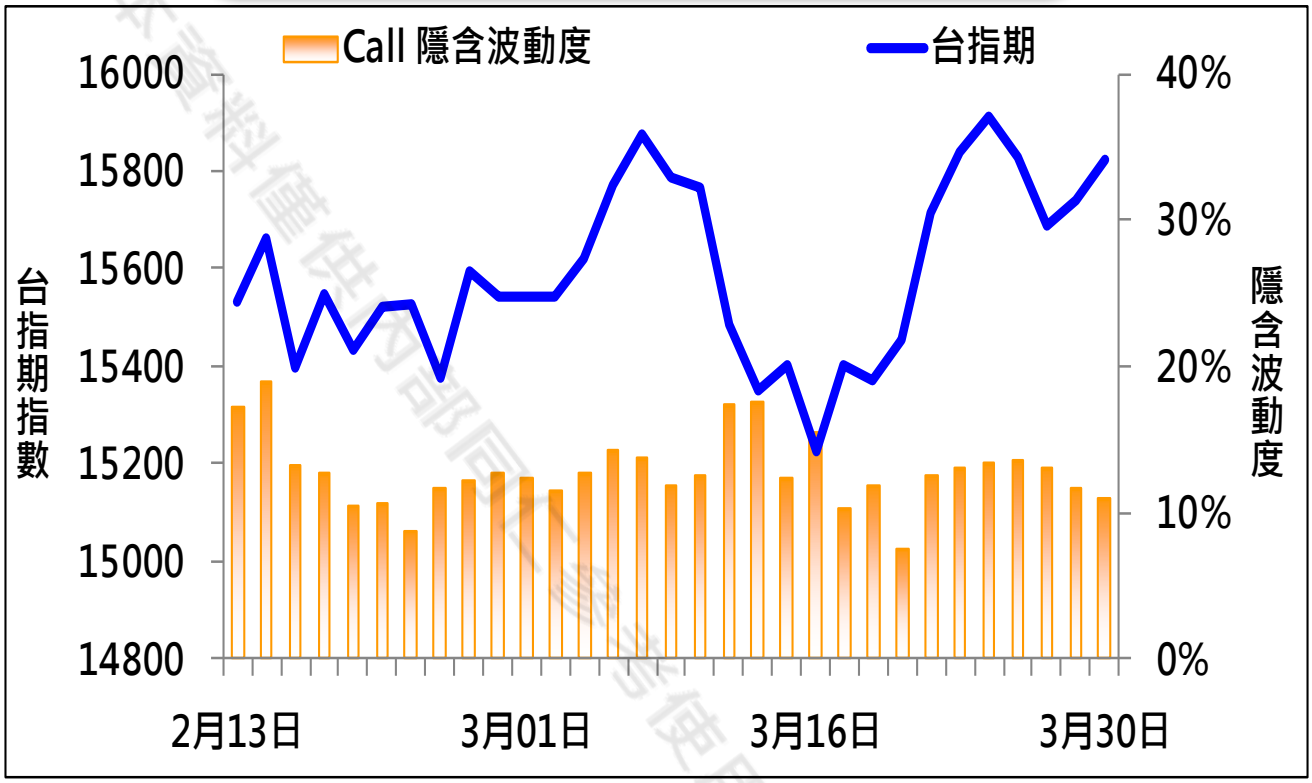


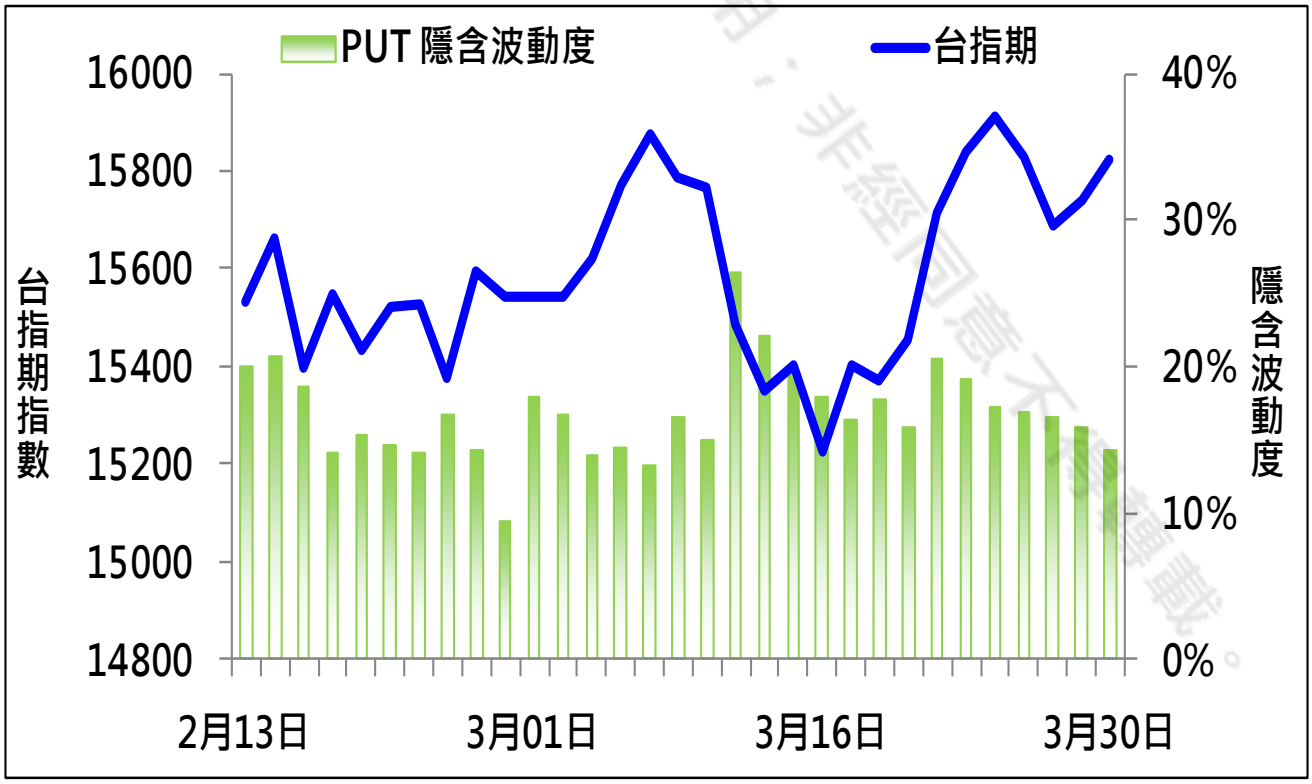

期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2023/3/30

華南期貨 HUA NAN FUTURES

## 週選擇權OI變化

日期：2023/3/30　　結算日：2023/4/5

| OI 增減 | Call | 202304W1 履約價 | Put | OI 增減 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 0 | 9 | 15,250 | 2,787 | 1,916 | |
| 0 | 28 | 15,300 | 4,376 | 1,975 | |
| 0 | 22 | 15,350 | 2,139 | 1,174 | |
| -3 | 26 | 15,400 | 5,242 | 3,336 | |
| 35 | 59 | 15,450 | 3,607 | 1,173 | |
| -7 | 105 | 15,500 | 6,990 | 5,235 | ※ |
| 83 | 123 | 15,550 | 3,092 | 2,231 | |
| -34 | 324 | 15,600 | 5,159 | 2,481 | |
| 24 | 258 | 15,650 | 2,808 | 1,992 | |
| 153 | 1,012 | 15,700 | 3,706 | 2,596 | |
| 217 | 976 | 15,750 | 2,579 | 1,523 | |
| 563 | 2,223 | 15,800 | 2,371 | 1,573 | |
| 1,399 | 2,416 | 15,850 | 910 | 715 | |
| 1,326 | 3,273 | 15,900 | 513 | 306 | |
| 1,733 | 3,455 | 15,950 | 183 | 129 | |
| 1,512 | 4,541 | 16,000 | 333 | 257 | |
| 1,223 | 3,075 | 16,050 | 49 | 13 | |
| 2,268 | 4,865 | 16,100 | 87 | 60 | |
| 2,524 | 4,285 | 16,150 | 11 | 9 | |
| ※ 2,562 | 4,736 | 16,200 | 32 | 15 | |
| 958 | 2,198 | 16,250 | 1 | 1 | |
| 1,254 | 2,335 | 16,300 | 27 | 3 | |

| 增減總計 | OI 總計 | P/C | OI 總計 | 增減總計 |
|---|---|---|---|---|
| 20,452 | 47,643 | 1.5537 | 74,023 | 36,968 |
| 昨日 P/C | 1.3628 | 今日增減變化 | | 0.1909 |

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

2023/3/30

華南期貨 HUA NAN FUTURES

## 雙週選擇權OI變化

日期：2023/3/30　　結算日：2023/4/12

| OI 增減 | Call | 202304W2 履約價 | Put | OI 增減 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 0 | 0 | 14,400 | 469 | 465 | ※ |
| 0 | 0 | 14,500 | 51 | 42 | |
| 0 | 0 | 14,600 | 51 | 31 | |
| 0 | 0 | 14,700 | 84 | 53 | |
| 0 | 0 | 14,800 | 112 | 72 | |
| 0 | 0 | 14,900 | 152 | 44 | |
| 1 | 1 | 15,000 | 390 | 259 | |
| 0 | 0 | 15,100 | 252 | 86 | |
| 3 | 5 | 15,200 | 492 | 350 | |
| 0 | 0 | 15,250 | 328 | 270 | |
| 1 | 1 | 15,300 | 360 | 253 | |
| 1 | 1 | 15,350 | 220 | 141 | |
| 0 | 9 | 15,400 | 169 | 95 | |
| -1 | 0 | 15,450 | 151 | 80 | |
| 2 | 8 | 15,500 | 316 | 160 | |
| 2 | 5 | 15,550 | 136 | 42 | |
| 5 | 6 | 15,600 | 194 | 106 | |
| 19 | 24 | 15,650 | 112 | 81 | |
| 13 | 30 | 15,700 | 353 | 198 | |
| 6 | 30 | 15,750 | 104 | 69 | |
| 70 | 191 | 15,800 | 177 | 157 | |
| 21 | 56 | 15,850 | 136 | 136 | |
| 73 | 102 | 15,900 | 24 | 21 | |
| 21 | 74 | 15,950 | 41 | 41 | |
| 268 | 333 | 16,000 | 57 | 56 | |
| 102 | 190 | 16,050 | 1 | 0 | |
| 239 | 879 | 16,100 | 4 | 3 | |
| 267 | 364 | 16,150 | 0 | 0 | |
| ※ 704 | 827 | 16,200 | 5 | 0 | |
| 199 | 468 | 16,300 | 4 | 4 | |
| 188 | 198 | 16,400 | 0 | 0 | |
| 316 | 334 | 16,500 | 0 | 0 | |
| 337 | 341 | 16,600 | 0 | 0 | |

| 增減總計 | OI 總計 | P/C | OI 總計 | 增減總計 |
|---|---|---|---|---|
| 3,230 | 4,857 | 1.0469 | 5,085 | 3,415 |
| 昨日 P/C | 1.0264 | 今日增減變化 | | 0.0205 |

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

2023/3/30

華南期貨 HUA NAN FUTURES

## 近月選擇權OI變化

日期：2023/3/30　　結算日：2023/4/19

| OI 增減 | Call | 202304 月 履約價 | Put | OI 增減 |
|---|---|---|---|---|
| 0 | 63 | 14,700 | 4,056 | -32 |
| 0 | 87 | 14,800 | 7,548 | -43 |
| -1 | 91 | 14,900 | 3,855 | -106 |
| -3 | 151 | 15,000 | 8,232 | 467 |
| 0 | 329 | 15,100 | 3,462 | 306 |
| 6 | 1,690 | 15,200 | 4,688 | -170 |
| -17 | 1,936 | 15,300 | 4,556 | 188 |
| 5 | 1,756 | 15,400 | 5,038 | 90 |
| -183 | 3,418 | 15,500 | 9,532 | -58 |
| -101 | 2,806 | 15,600 | 2,021 | -11 |
| -91 | 2,881 | 15,700 | 1,980 | 122 |
| 99 | 3,604 | 15,800 | 1,306 | 241 |
| 89 | 3,558 | 15,900 | 743 | 176 |
| -363 | 6,290 | 16,000 | 594 | 85 |
| -93 | 7,179 | 16,100 | 234 | 34 |
| 122 | 8,541 | 16,200 | 266 | 46 |
| 147 | 6,877 | 16,300 | 162 | 38 |
| 194 | 6,435 | 16,400 | 58 | 2 |
| 263 | 5,357 | 16,500 | 16 | 2 |

| 增減總計 | OI 總計 | P/C | OI 總計 | 增減總計 |
|---|---|---|---|---|
| 314 | 82,486 | 1.0739 | 88,580 | 1,766 |

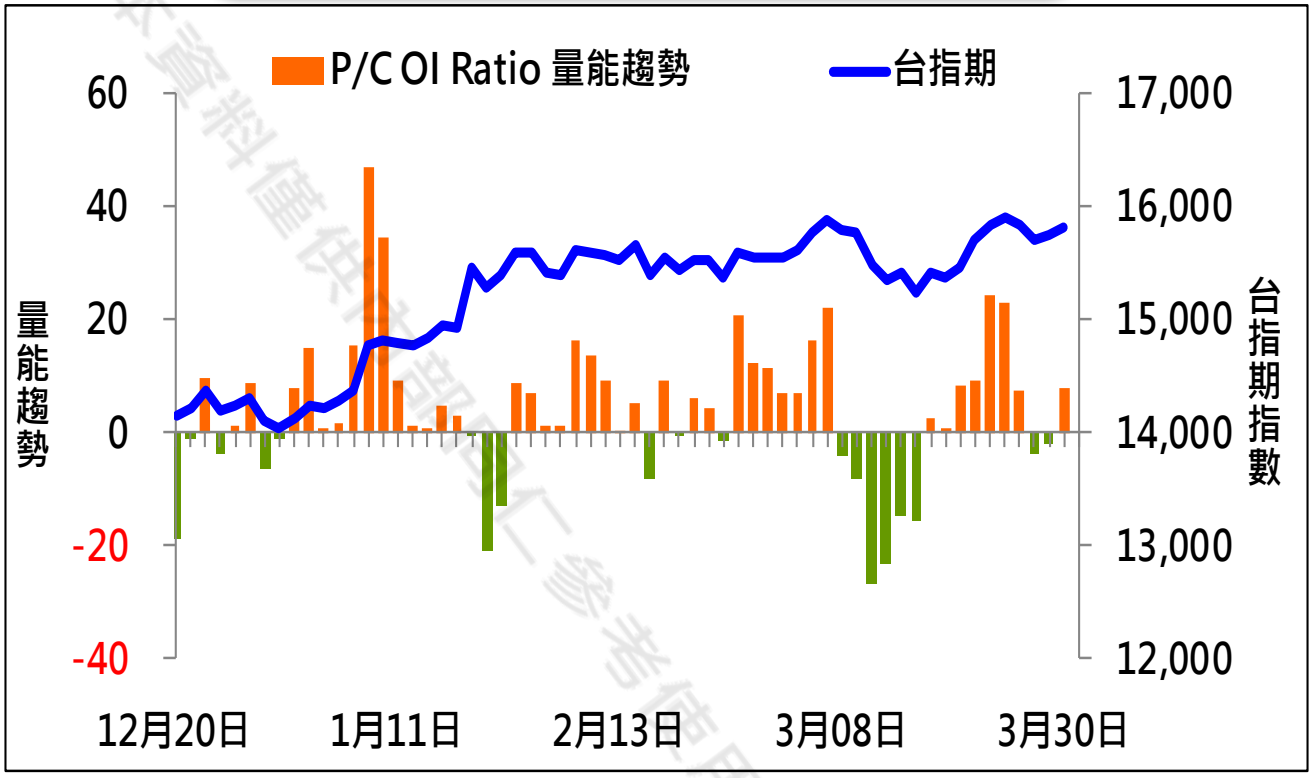
| 昨日 P/C | 1.0565 | 今日增減變化 | 0.0174 |
|---|---|---|---|

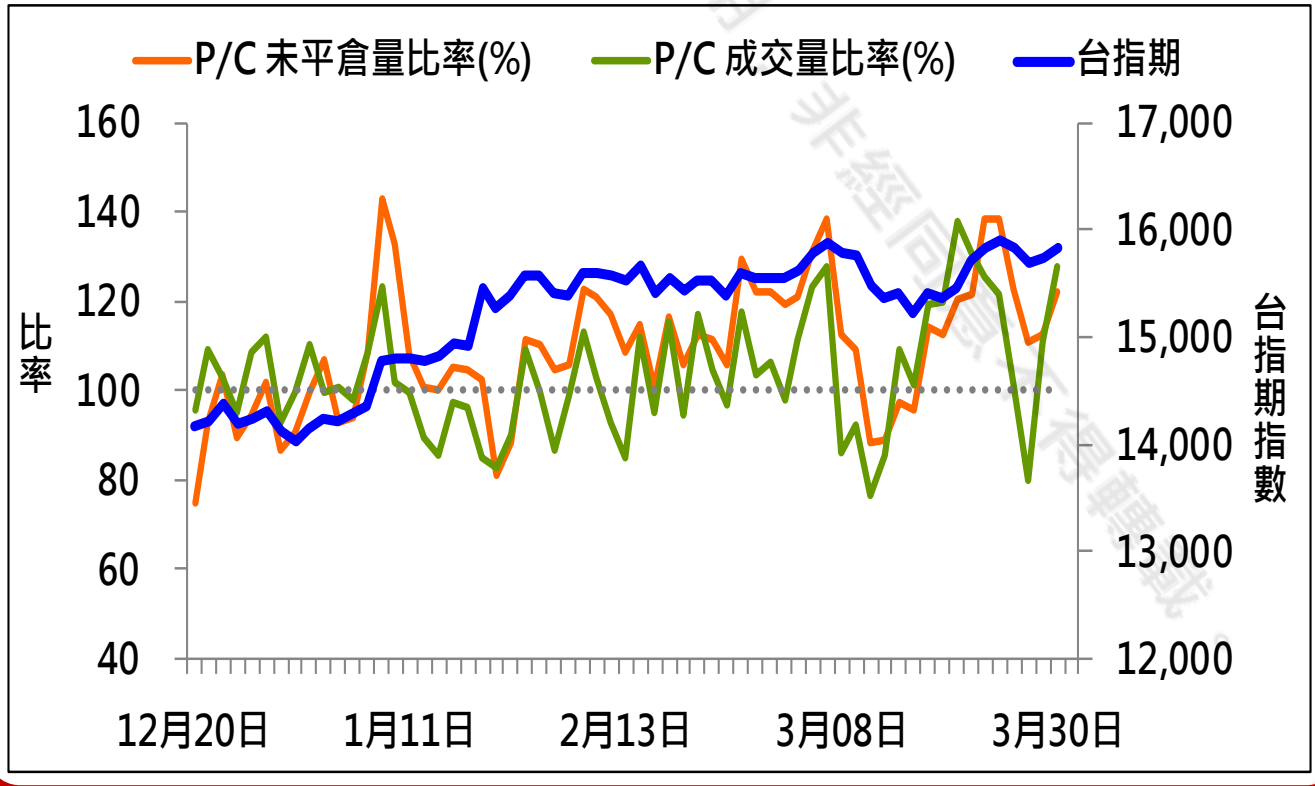
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

## 成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖

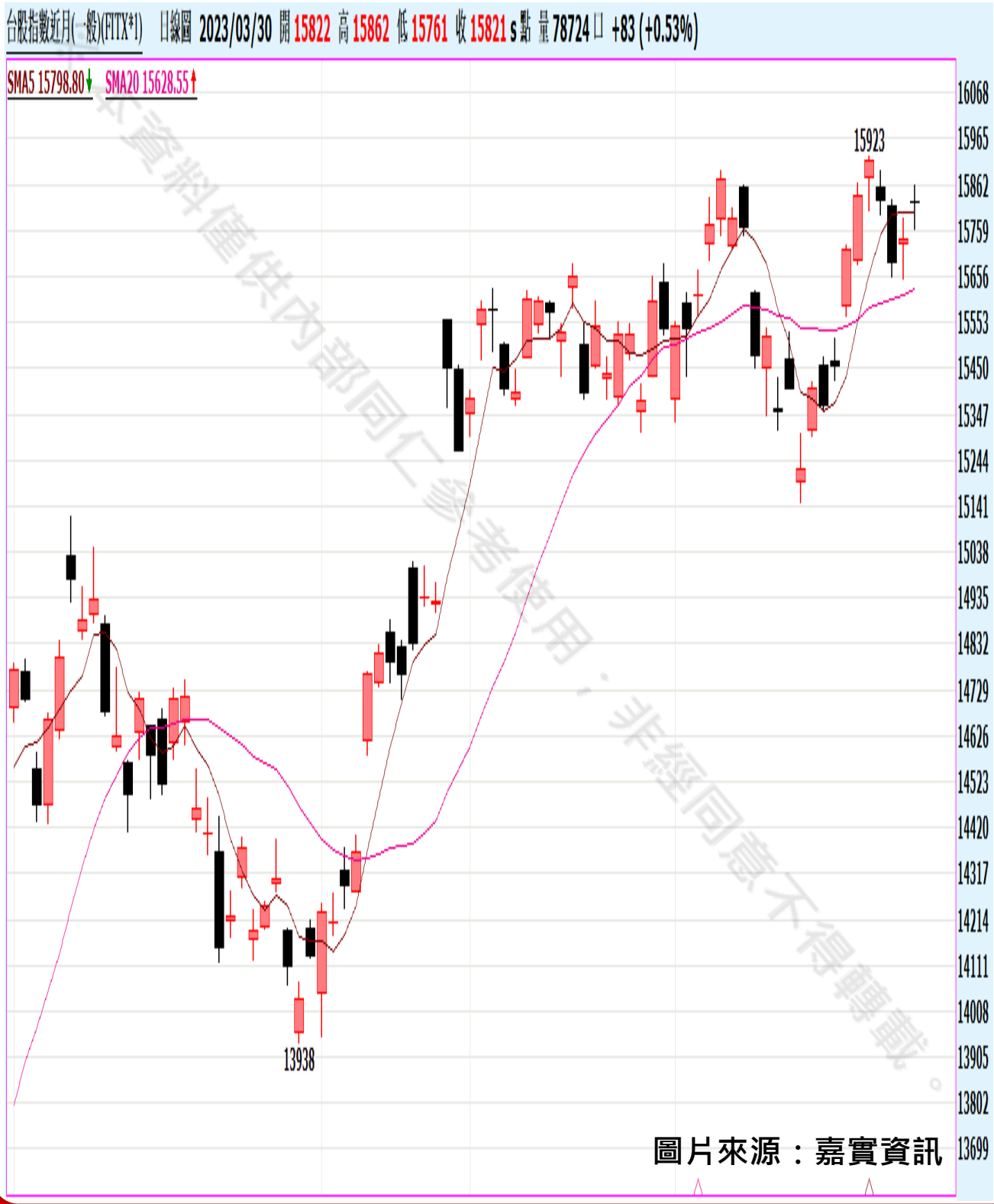



期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

## 盤後重點觀察




本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