台指期貨暨選擇權日報

2023/6/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

06月29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	2,192	-5,710	-466	-37	-275	74
投信	566	1,280	342	48	14	0
自營商	-10,591	1,182	-104	-53	-269	-86

06月29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	6	17,069	1,344	21,183	2,359
投信	0	0	200	50	37	0
自營商	-32	-24	2,750	1,447	9,405	5,696

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
緯穎	6.45	鴻海	-8.89
緯創	4.56	台積電	-8.31
廣達	3.10	聯電	-2.41
南亞科	2.68	日月光投控	-2.10
兆豐金	2.68	長榮	-1.70
和泰車	2.45	長榮航	-1.37
創意	2.15	研華	-1.37
台達電	2.08	國泰金	-1.30
世芯-KY	1.73	神基	-1.20
華邦電	1.66	統一超	-1.17
前十名合計	29.54	後十名合計	-29.81

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	49.0%	55.1%
電子期前十大市場佔比	54.4%	59.3%
金融期前十大市場佔比	74.1%	81.4%
非金電期前十大市場佔比	91.7%	90.8%

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

2023/6/29

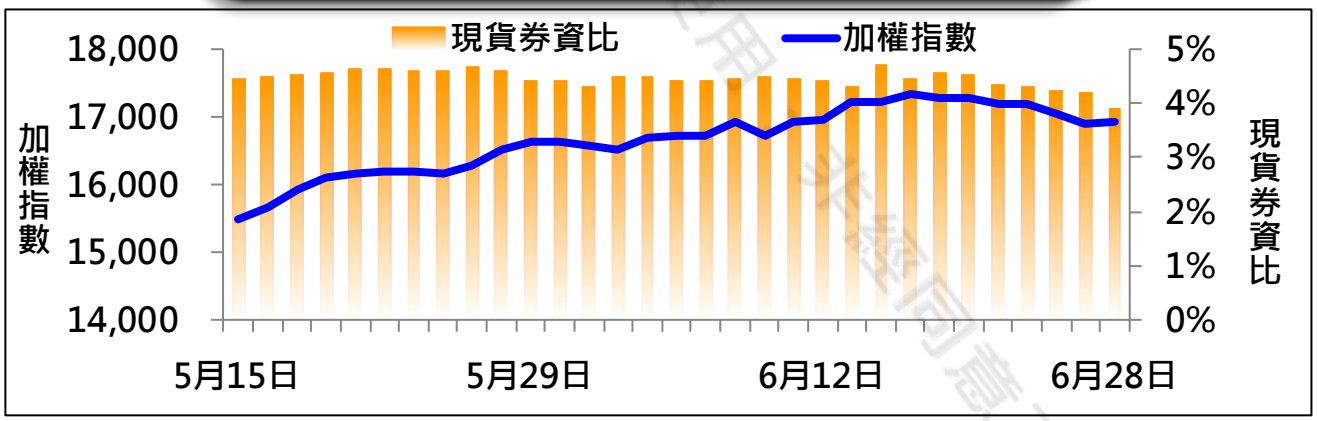
華南期貨 HUA NAN FUTURES

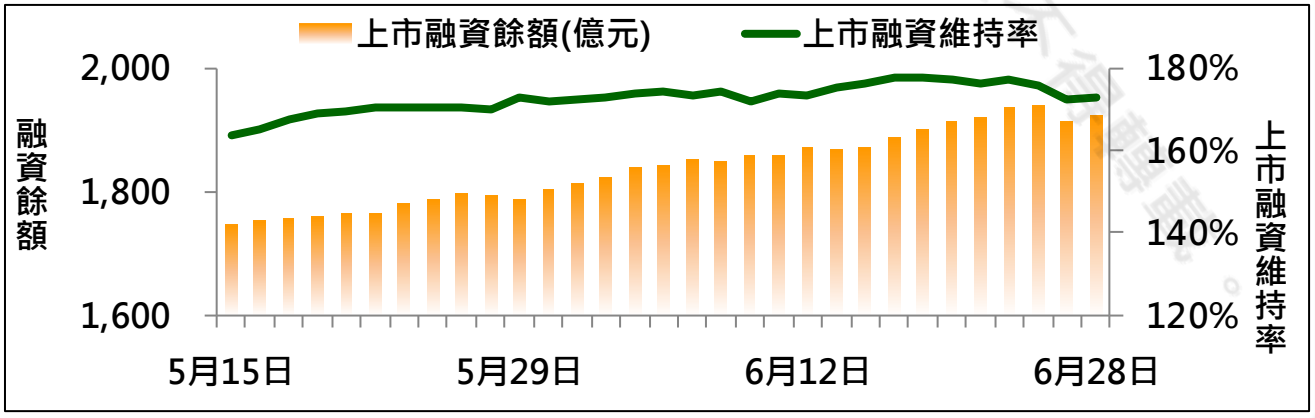
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
06月21日	-20.4	14,406	-666	27.5	-11,360	-1,856
06月26日	-251.6	12,695	-1,711	39.1	-12,091	-731
06月27日	-117.5	10,179	-2,516	2.9	-12,185	-94
06月28日	-97.4	7,902	-2,277	37.6	-11,773	412
06月29日	-53.4	2,192	-5,710	116.0	-10,591	1,182

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21日	14,211	7,610	6,601	-469	-2,505	2,036
06月26日	14,197	11,591	2,606	8,639	4,591	4,048
06月27日	15,347	17,032	-1,685	131	-116	247
06月28日	15,725	18,824	-3,099	1,303	3,709	-2,406
06月29日	17,069	21,183	-4,114	2,750	9,405	-6,655

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

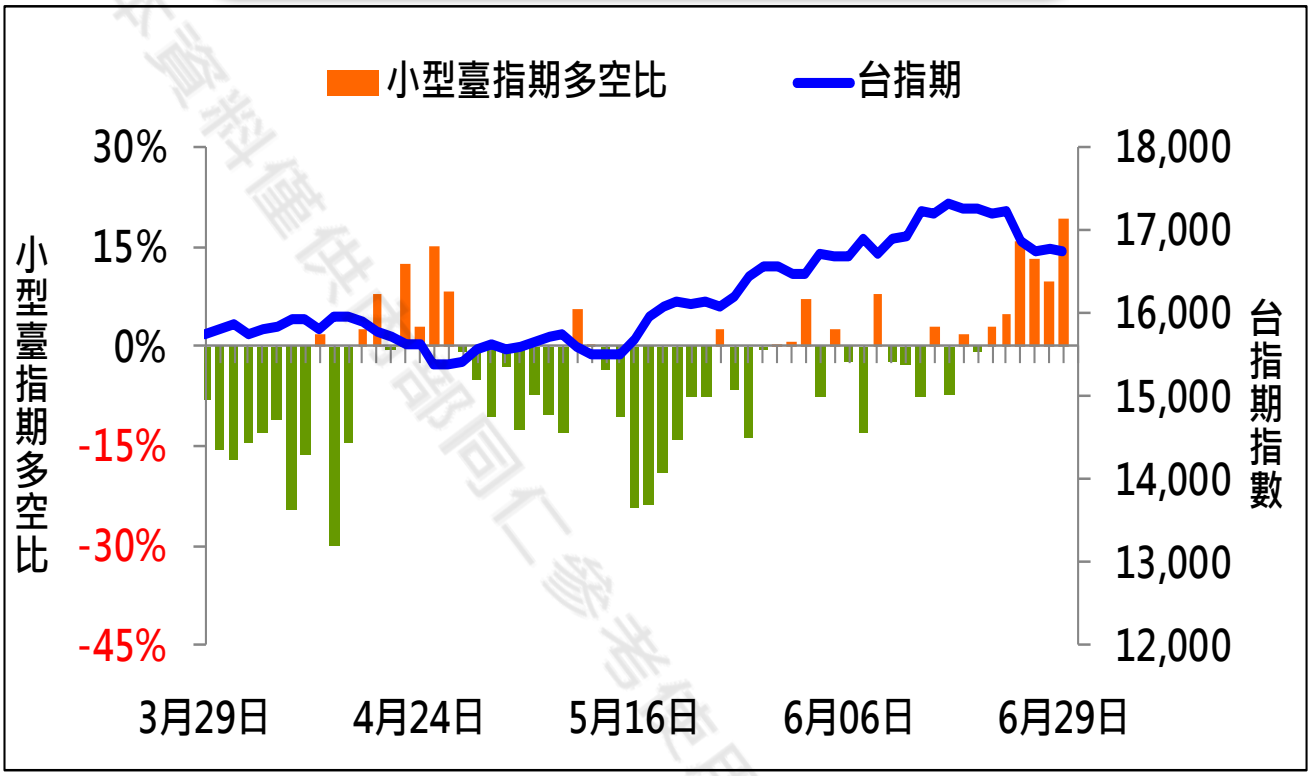
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

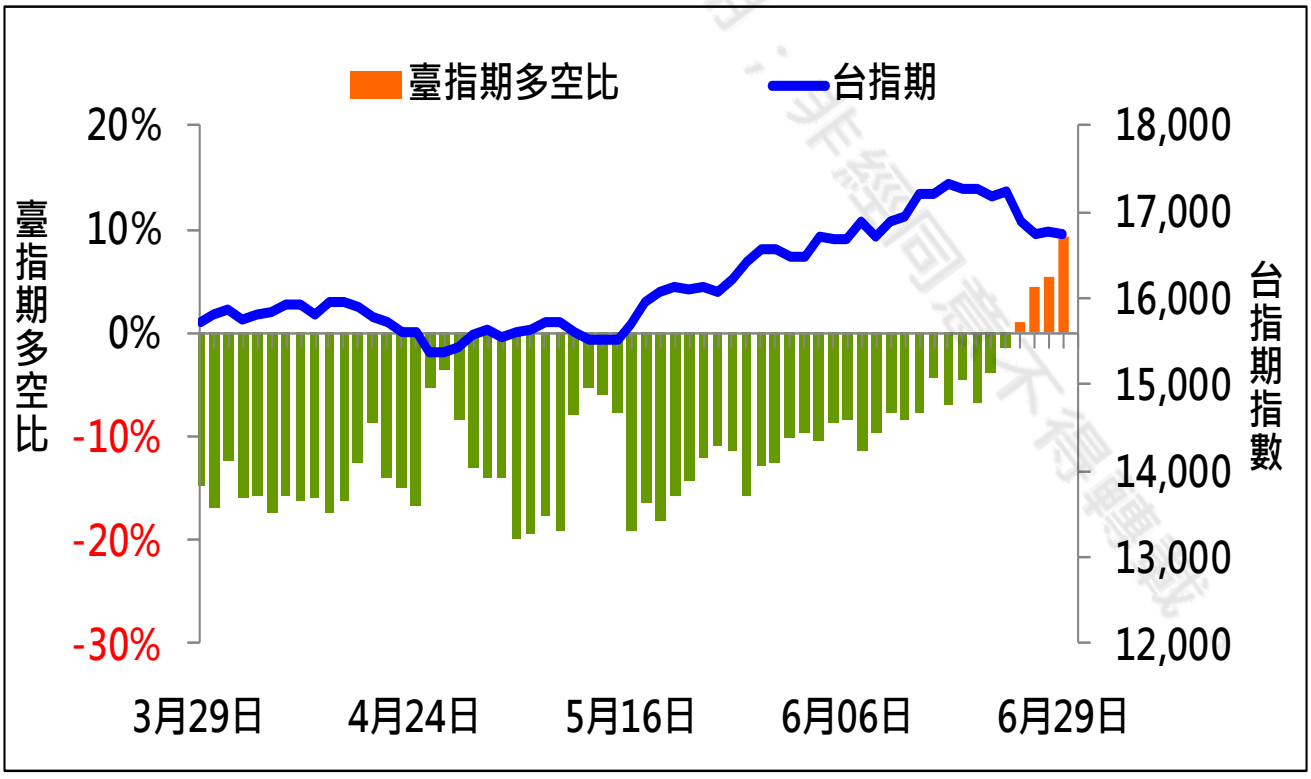
台指期貨暨選擇權日報

2023/6/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

散戶多空比





※本資料僅供部同仁參考使用，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

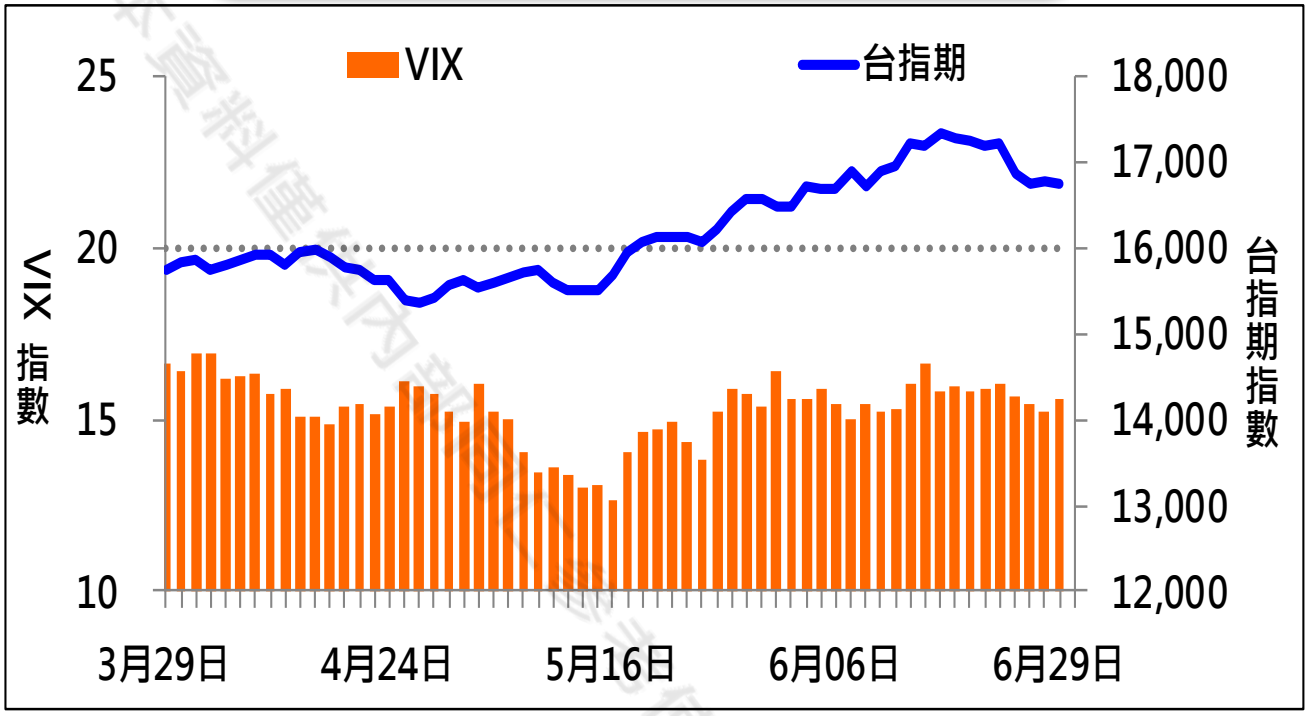
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

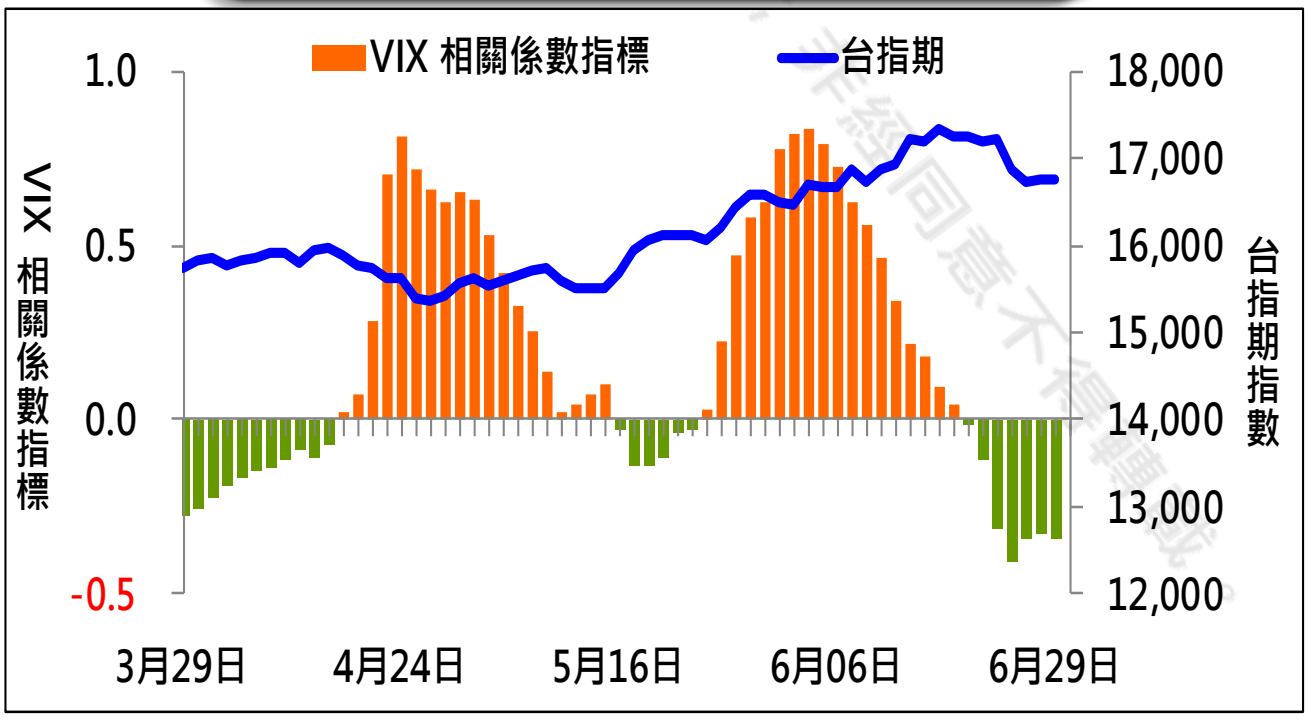
2023/6/29

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

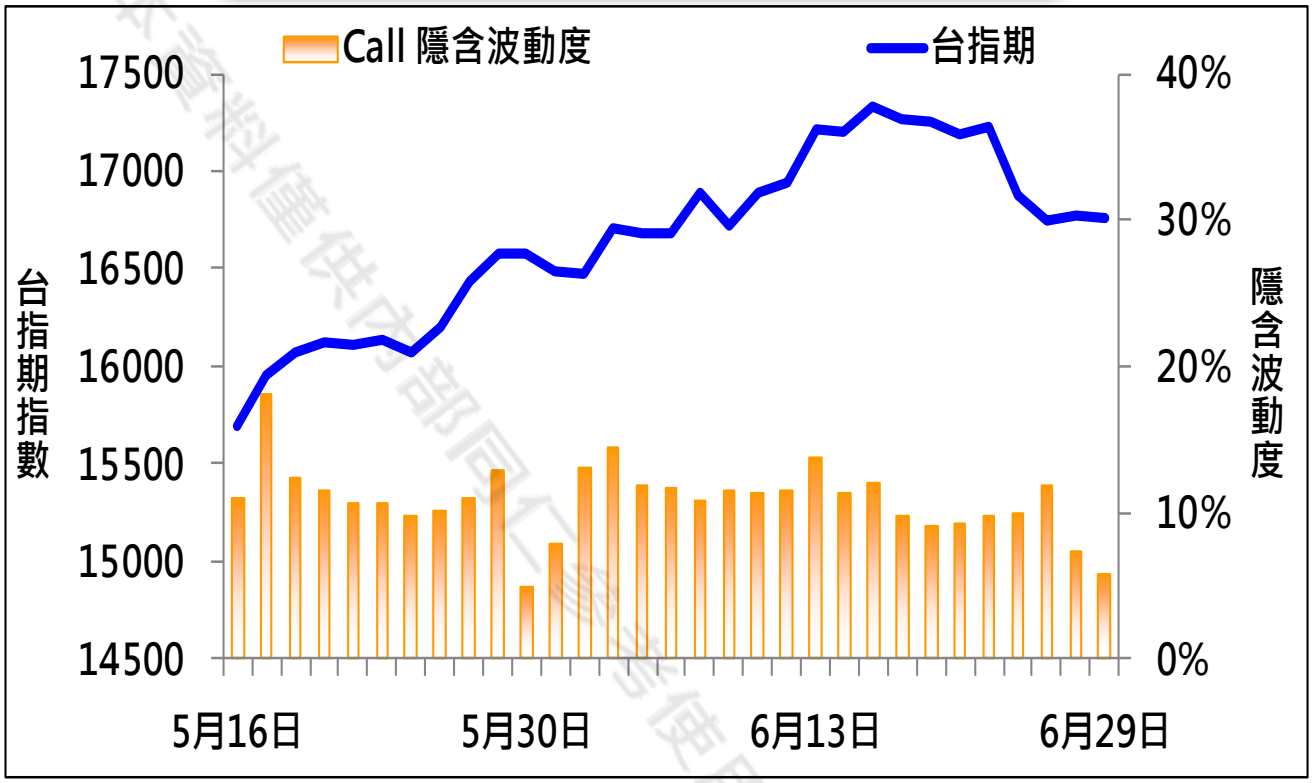
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

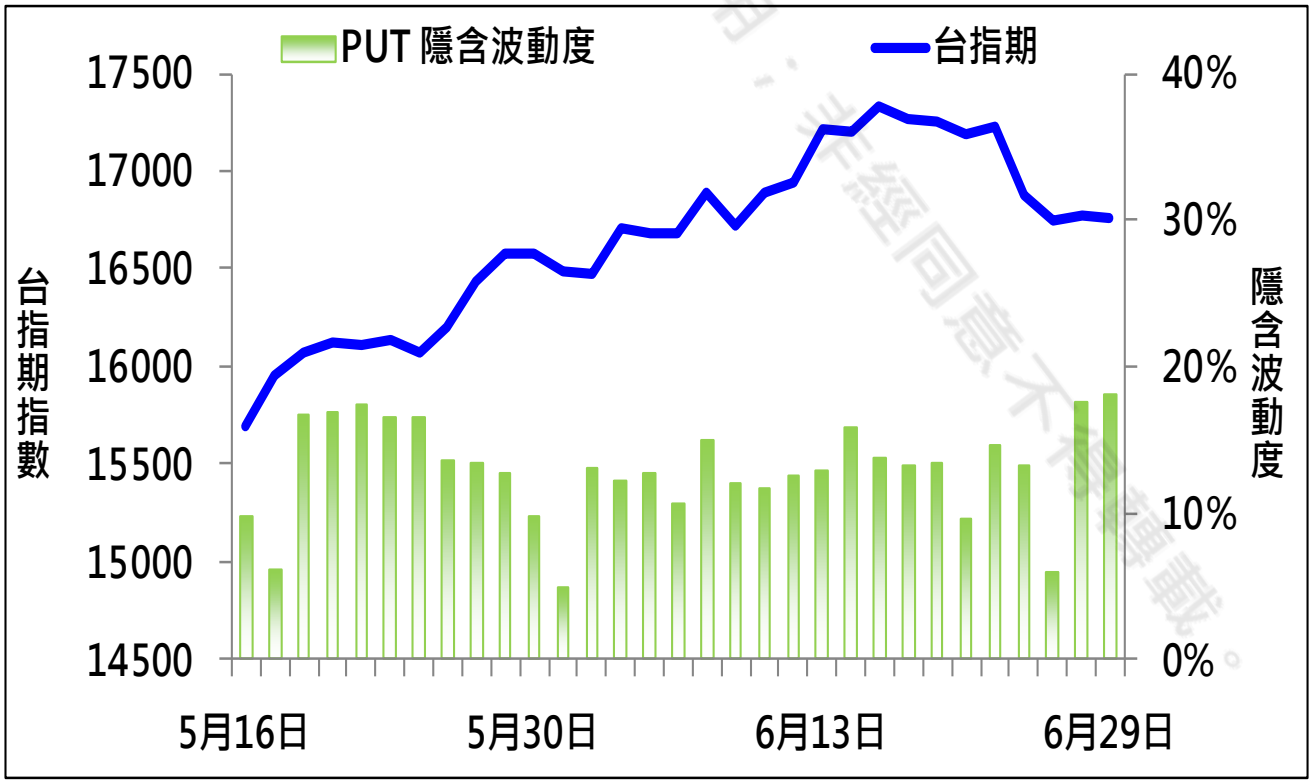
台指期貨暨選擇權日報

2023/6/29

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

2023/6/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2023/6/29　　結算日：2023/7/5

	OI 增減	Call	202307W1 履約價	Put	OI 增減	
	0	0	16,100	2,583	1,202	
	0	1	16,200	4,481	2,512	
	2	2	16,300	4,055	1,928	
	8	32	16,400	10,830	3,678	
	1	1	16,450	4,266	3,351	
	9	32	16,500	8,032	4,689	
	10	46	16,550	3,704	2,367	
	249	429	16,600	8,696	5,939	※
	334	379	16,650	6,695	5,086	
	283	638	16,700	4,095	2,620	
	945	1,325	16,750	3,376	1,546	
	3,957	6,045	16,800	4,973	2,195	
	1,814	2,952	16,850	2,886	1,805	
	3,045	4,592	16,900	6,773	5,155	
	3,229	4,934	16,950	1,721	1,178	
	4,586	7,205	17,000	1,285	956	
	2,555	4,987	17,050	419	294	
※	6,586	9,495	17,100	539	436	
	1,819	4,688	17,150	103	52	
	3,040	5,608	17,200	77	28	
	1,498	3,203	17,250	20	2	
	1,630	3,025	17,300	10	-6	
	1,289	2,395	17,350	1	0	
	186	1,753	17,450	0	0	
	增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
	40,797	70,921	1.2049	85,455	49,850	
	昨日 P/C	1.1819	今日增減變化		0.0230	

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

2023/6/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2023/6/29　　結算日：2023/7/12

	OI 增減	Call	202307W2 履約價	Put	OI 增減	
	0	0	15,800	49	-59	
	0	0	15,900	125	39	
	0	0	16,000	538	491	
	0	0	16,100	180	106	
	1	1	16,200	1,044	988	※
	1	1	16,300	490	315	
	4	5	16,400	531	423	
	1	1	16,450	145	140	
	2	2	16,500	282	200	
	2	2	16,550	202	188	
	11	15	16,600	193	152	
	7	19	16,650	157	116	
	75	95	16,700	172	102	
	8	32	16,750	200	151	
	90	117	16,800	97	54	
	49	72	16,850	46	31	
	153	186	16,900	37	22	
	77	85	16,950	28	17	
	514	543	17,000	26	24	
	74	87	17,050	3	3	
	99	202	17,100	4	3	
	41	112	17,150	0	0	
	363	418	17,200	4	4	
	152	200	17,250	0	0	
	336	379	17,300	0	0	
※	700	765	17,350	0	0	
	173	261	17,400	0	0	
	96	346	18,100	0	0	
	13	253	18,200	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,938	5,211	0.8971	4,675	3,588
昨日 P/C	0.8539	今日增減變化		0.0433

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

2023/6/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2023/6/29　　結算日：2023/7/19

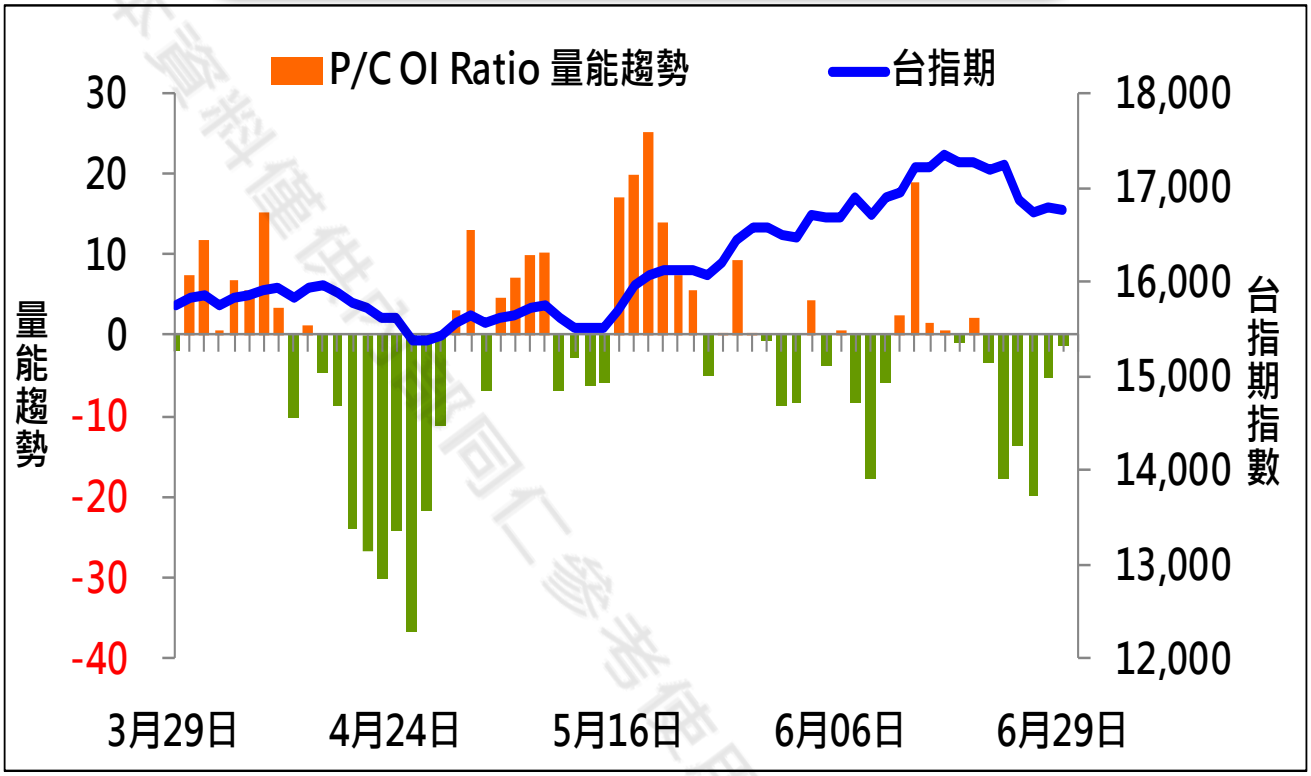
OI 增減	Call	202307 月 履約價	Put	OI 增減	
0	66	15,200	1,275	-5	
0	21	15,300	522	8	
-1	25	15,400	1,357	-22	
4	61	15,500	4,853	9	
4	59	15,600	1,363	441	
-1	84	15,700	2,473	233	
-1	76	15,800	3,029	99	
0	72	15,900	2,065	734	
2	163	16,000	5,272	145	
0	105	16,100	3,278	-13	
-2	124	16,200	4,423	181	
-2	644	16,300	4,335	1,854	※
24	244	16,400	3,257	185	
8	595	16,500	3,221	548	
49	850	16,600	4,412	144	
2,011	3,133	16,700	3,406	267	
223	2,234	16,800	1,764	100	
40	2,288	16,900	1,604	258	
186	3,480	17,000	1,422	136	
560	3,867	17,100	810	22	
135	5,110	17,200	442	13	
358	5,527	17,300	380	-26	
※ 2,731	6,460	17,400	147	-6	
405	6,107	17,500	69	19	
829	4,834	17,600	6	-1	
252	3,612	17,700	3	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
7,672	66,308	0.9577	63,505	5,251	
昨日 P/C	0.9935	今日增減變化		-0.0358	

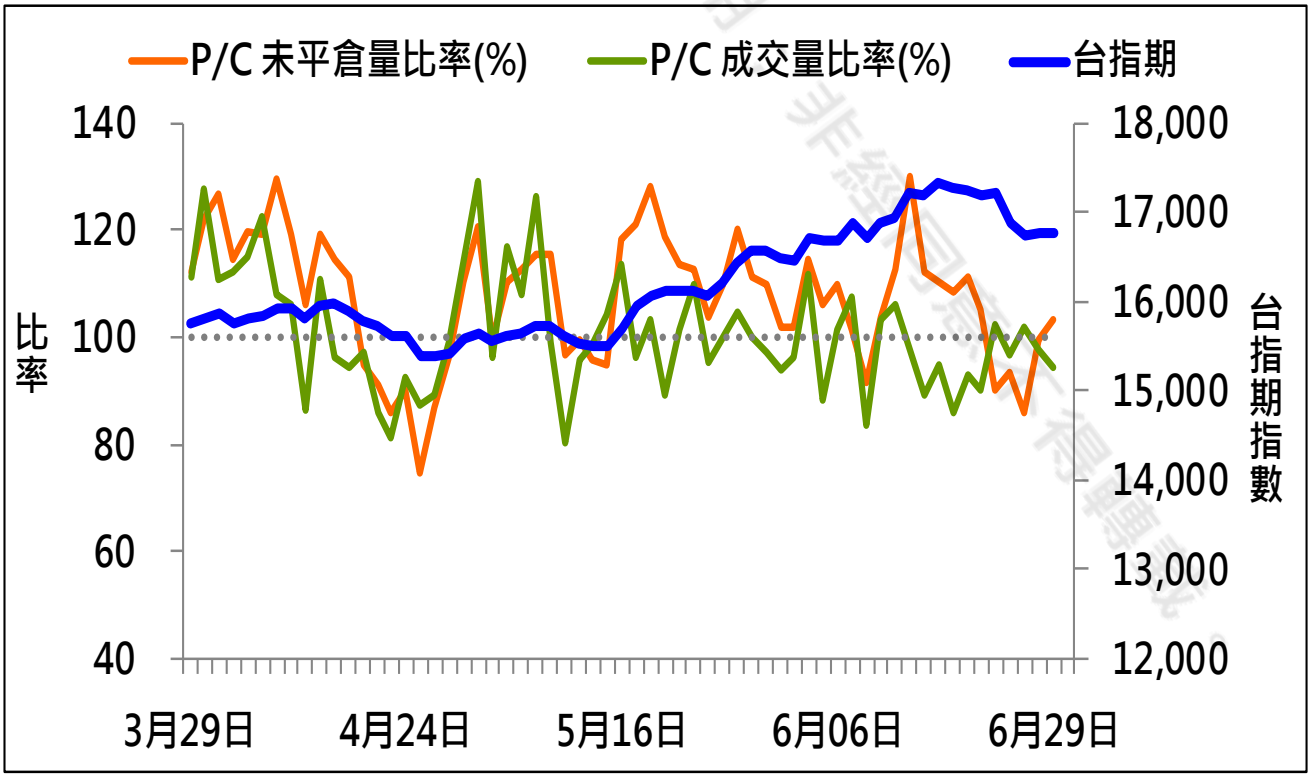
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

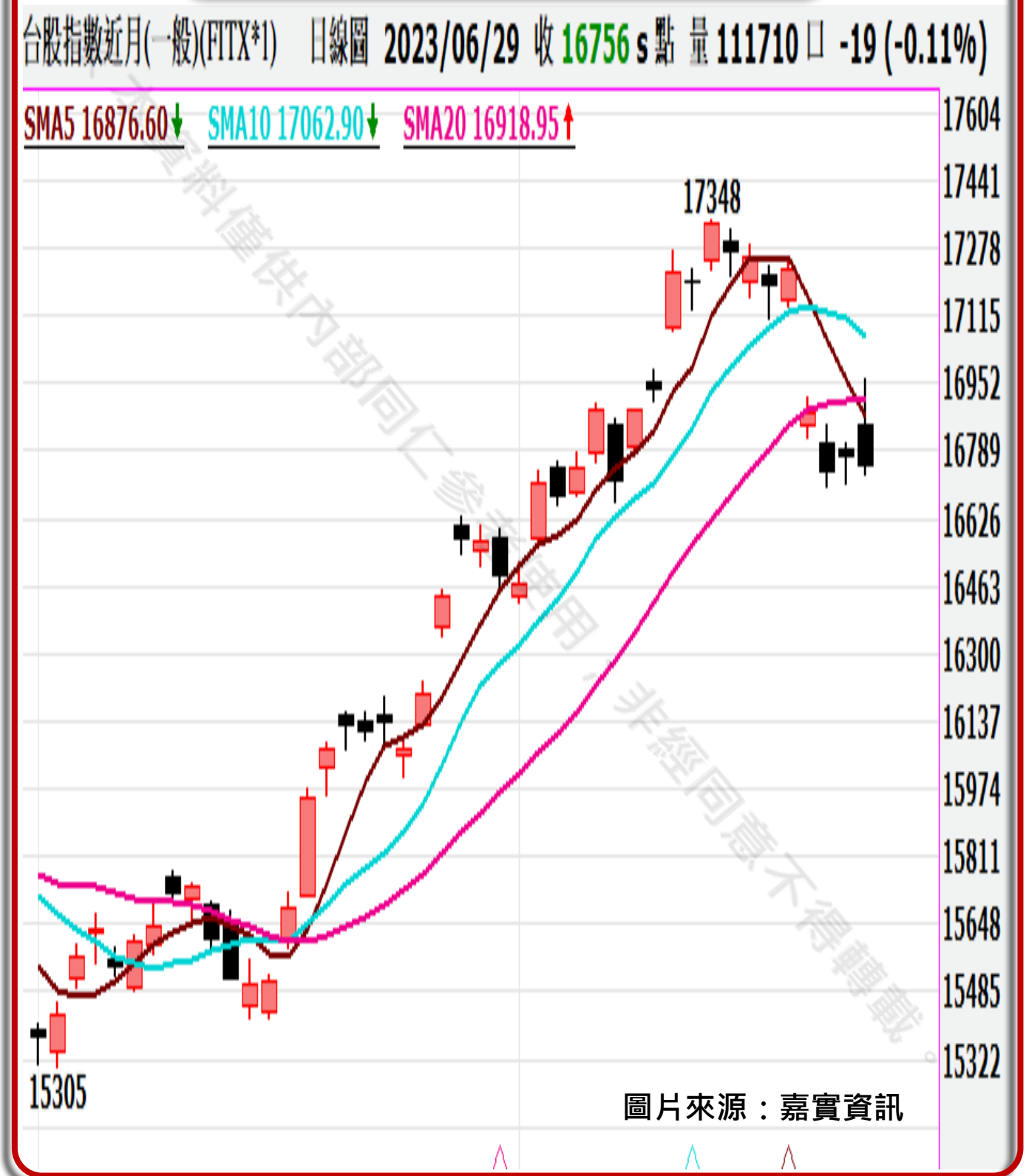




期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

盤後重點觀察



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