台指期貨暨選擇權日報

2023/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

07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	1,035	-1,159	-432	-69	106	65
投信	552	-329	332	-92	17	0
自營商	-4,587	577	-174	127	-654	-130

07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	44	2	19,570	1,064	11,947	268
投信	0	0	-100	0	298	0
自營商	-53	1	11,379	4,078	7,292	-3,750

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
華泰	23.94	鴻海	-6.10
廣達	20.41	緯穎	-4.62
光寶科	15.08	智原	-3.08
華碩	10.46	和泰車	-2.89
台達電	9.15	中信金	-2.21
日月光投控	6.74	國泰金	-1.78
旺宏	6.28	亞德客-KY	-1.76
台汽電	4.61	中鋼	-1.74
技嘉	4.34	元大金	-1.65
台光電	4.25	永豐餘	-1.46
前十名合計	105.26	後十名合計	-27.29

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	47.8%	52.1%
電子期前十大市場佔比	56.4%	51.6%
金融期前十大市場佔比	64.2%	82.4%
非金電期前十大市場佔比	99.3%	83.7%

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

2023/7/28

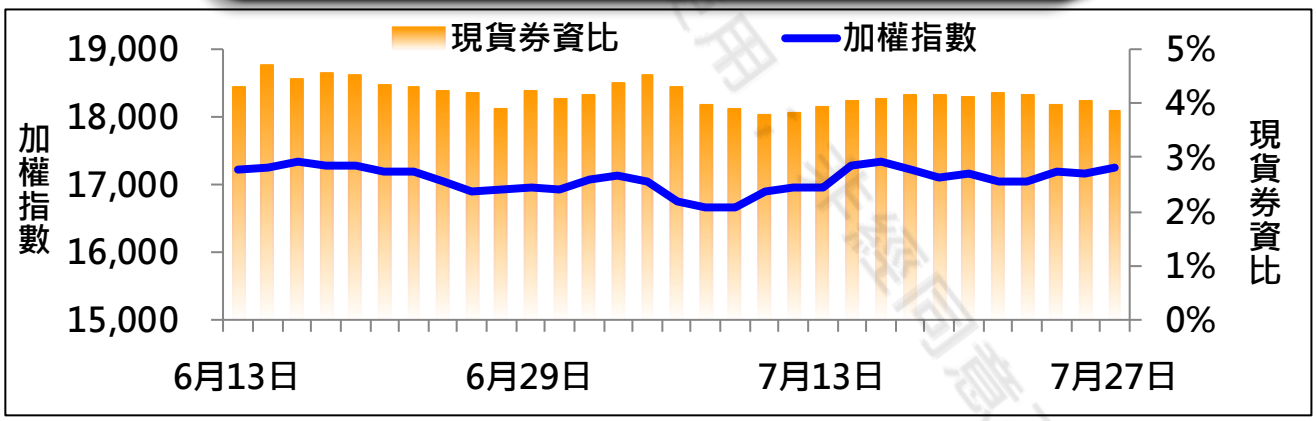
華南期貨 HUA NAN FUTURES

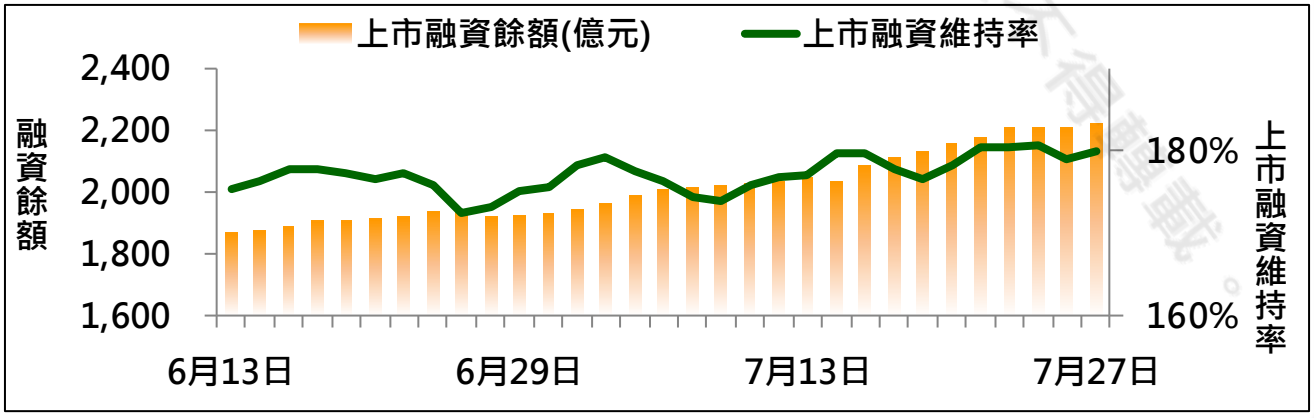
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
07月24日	-195.1	4,280	3,745	48.9	-7,490	-277
07月25日	117.2	4,933	653	7.5	-6,871	619
07月26日	13.7	1,619	-3,314	-20.7	-6,312	559
07月27日	103.3	2,194	575	9.0	-5,164	1,148
07月28日	15.6	1,035	-1,159	42.8	-4,587	577

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
07月24日	17,439	9,412	8,027	12,495	10,522	1,973
07月25日	19,519	10,868	8,651	15,307	2,232	13,075
07月26日	18,645	10,604	8,041	2,723	7,840	-5,117
07月27日	18,506	11,679	6,827	7,301	11,042	-3,741
07月28日	19,570	11,947	7,623	11,379	7,292	4,087

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

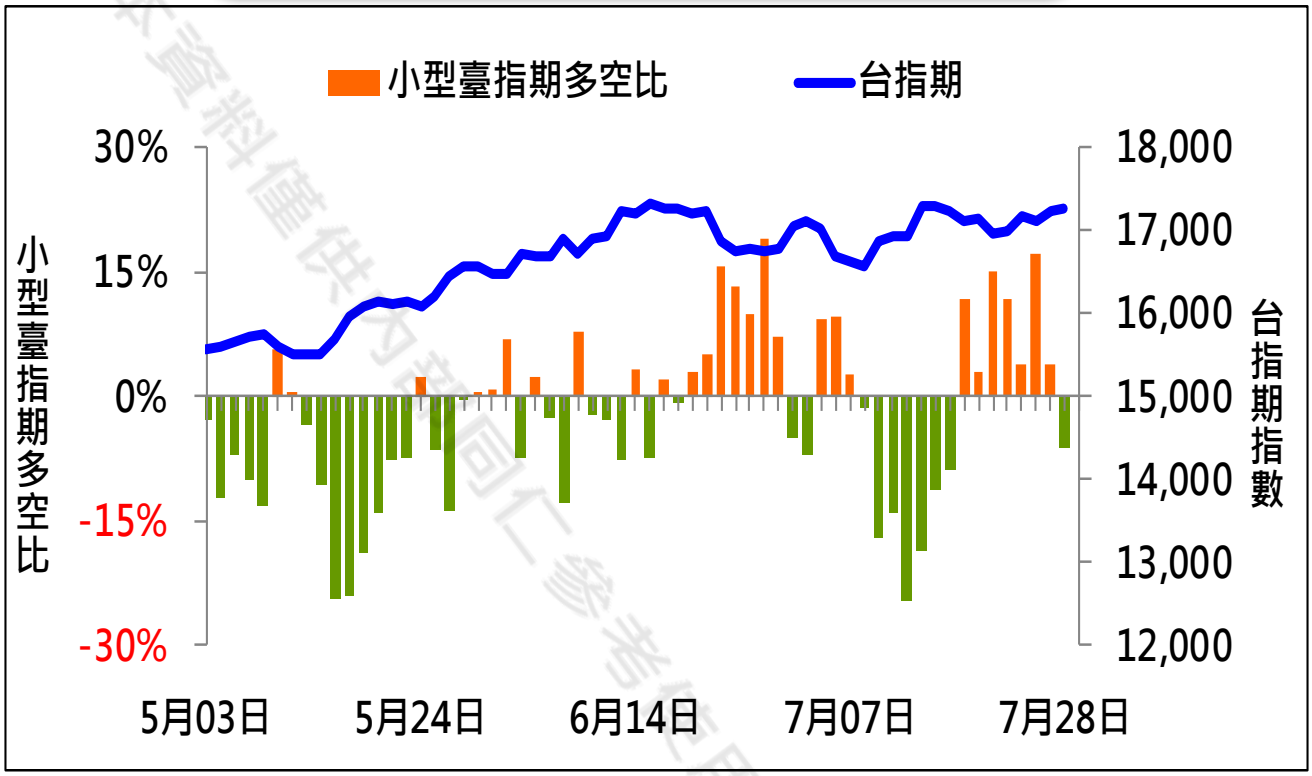
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

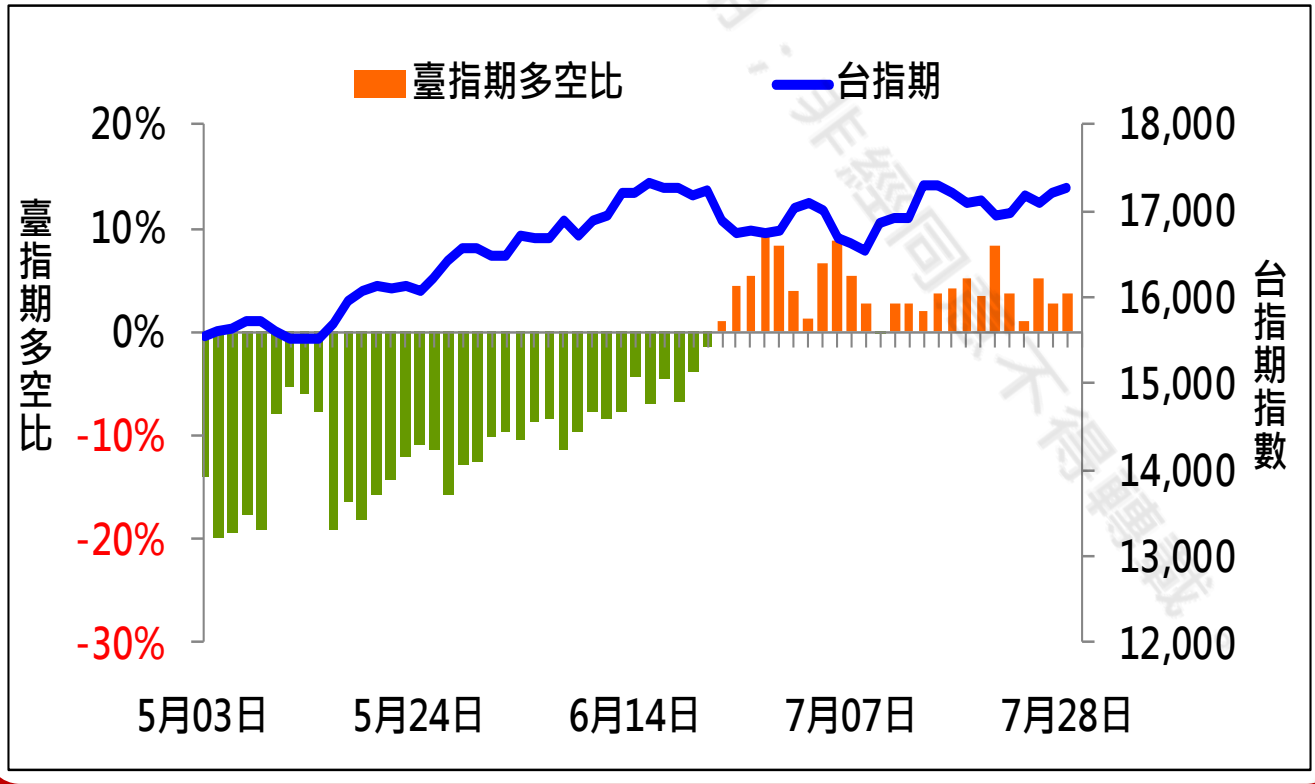
台指期貨暨選擇權日報

2023/7/28

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

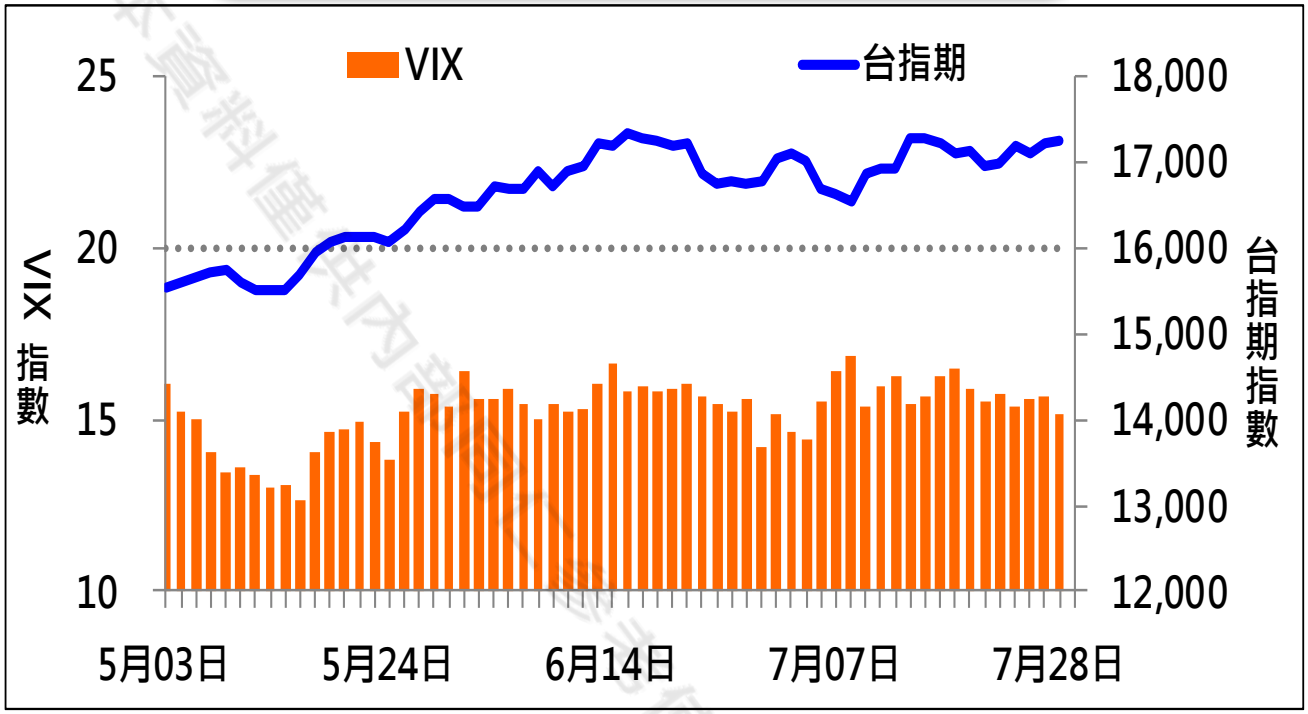
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

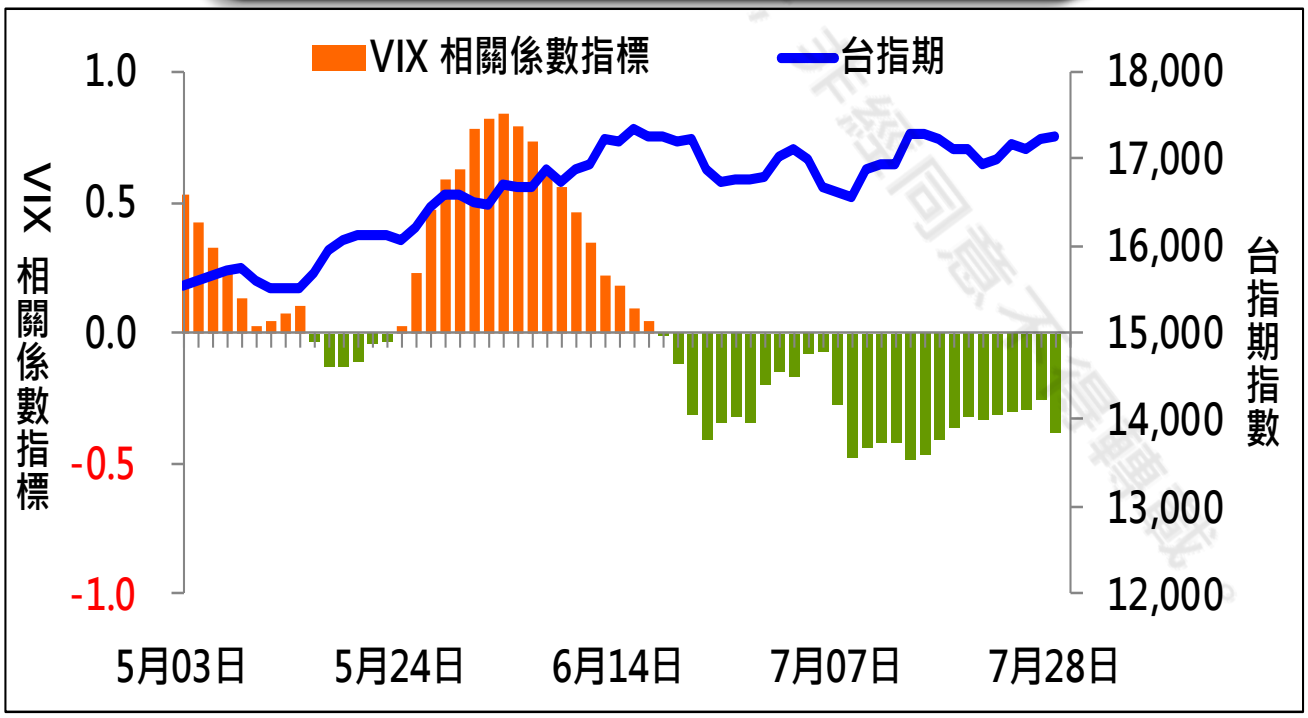
2023/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



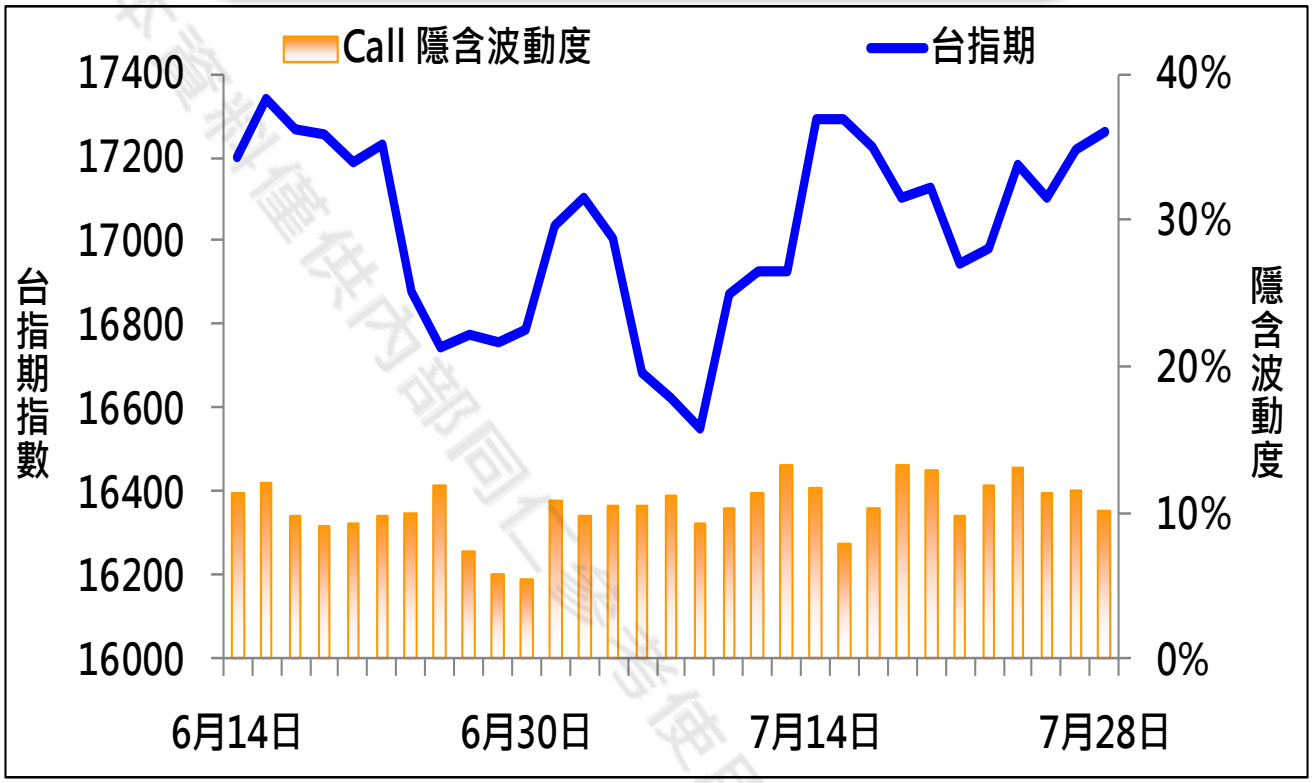
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

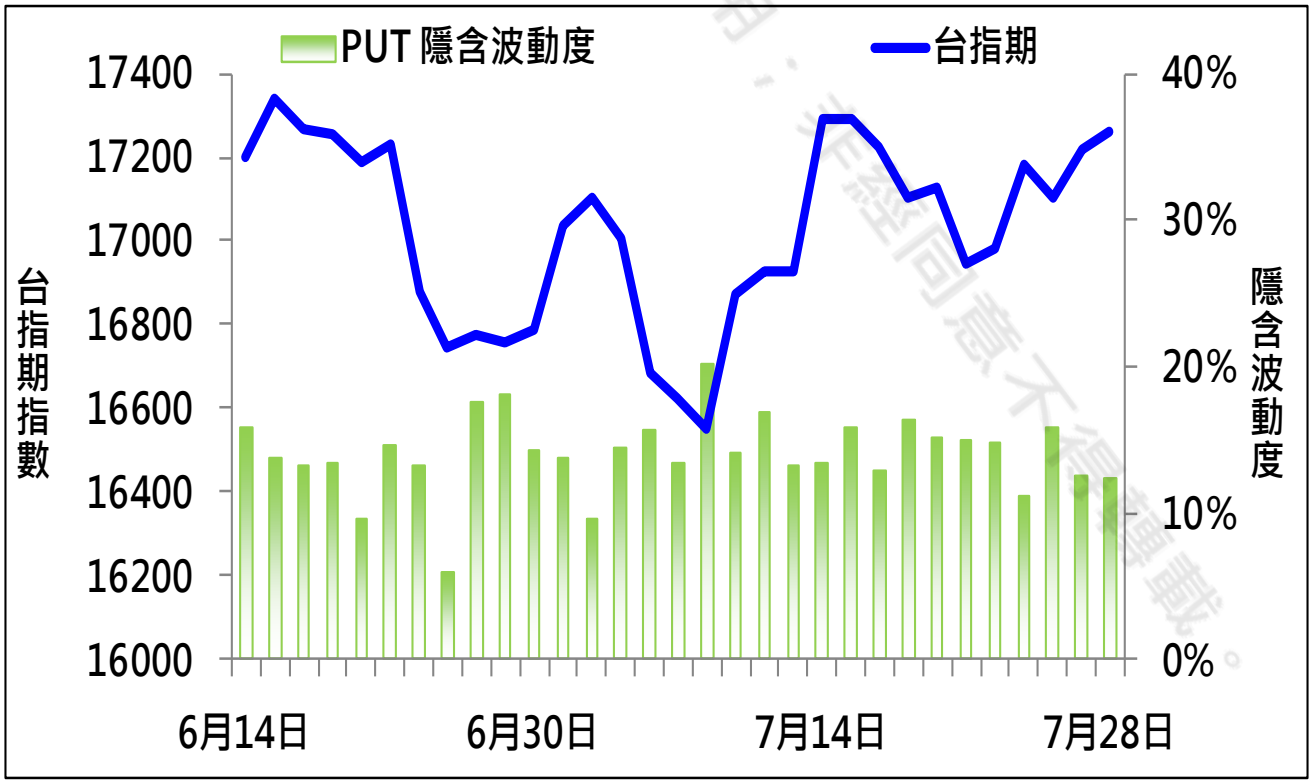
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

2023/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2023/7/28　　結算日：2023/8/2

OI 增減	Call	202308W1 履約價	Put	OI 增減	
-1	11	16,650	3,885	650	
0	33	16,700	4,463	451	
2	18	16,750	3,893	739	
-9	63	16,800	8,554	1,481	
0	21	16,850	6,056	841	
-60	249	16,900	6,919	1,425	
-46	333	16,950	6,922	1,215	
-125	861	17,000	11,520	4,489	※
133	1,020	17,050	5,918	2,260	
13	1,220	17,100	7,123	2,763	
-235	1,643	17,150	4,538	1,741	
164	3,094	17,200	5,494	2,655	
435	2,898	17,250	2,759	727	
3,476	7,139	17,300	3,444	1,685	
1,970	5,036	17,350	2,121	1,736	
3,168	10,522	17,400	778	414	
※ 3,802	9,028	17,450	369	264	
1,887	8,685	17,500	227	122	
1,677	7,684	17,550	23	17	
2,056	7,217	17,600	100	34	
1,340	4,763	17,650	2	0	
1,897	5,999	17,700	19	3	
1,086	1,086	17,750	0	0	
957	3,896	17,800	25	1	
246	3,041	17,900	2	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
24,084	86,900	1.2657	109,990	28,948
昨日 P/C	1.2901	今日增減變化		-0.0244

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

2023/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2023/7/28　　結算日：2023/8/9

OI 增減	Call	202308W2 履約價	Put	OI 增減	
0	0	16,400	1,063	47	
0	2	16,500	474	151	
0	5	16,600	423	65	
0	0	16,700	748	290	※
1	2	16,800	470	149	
4	6	16,900	442	206	
0	21	16,950	250	76	
8	20	17,000	350	149	
4	29	17,050	104	35	
-18	84	17,100	169	99	
-1	103	17,150	92	58	
67	220	17,200	258	100	
108	237	17,250	117	77	
185	319	17,300	71	15	
180	280	17,350	10	10	
183	315	17,400	97	65	
13	156	17,450	24	23	
73	280	17,500	25	9	
57	263	17,550	28	23	
46	309	17,600	5	0	
88	289	17,650	0	0	
339	608	17,700	8	8	
233	233	17,750	20	20	
※ 598	720	17,800	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
2,464	5,373	1.1887	6,387	2,100
昨日 P/C	1.4737	今日增減變化		-0.2850

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

2023/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2023/7/28　　結算日：2023/8/16

OI 增減	Call	202308 月 履約價	Put	OI 增減	
0	1	15,600	1,135	46	
0	10	15,800	1,026	-6	
0	27	15,900	1,089	52	
0	163	16,000	5,500	-36	
0	14	16,100	2,077	-19	
0	40	16,200	2,540	357	
0	62	16,300	4,318	29	
-1	35	16,400	3,033	-228	
-2	216	16,500	5,454	640	※
5	472	16,600	3,526	-373	
-13	333	16,700	3,973	434	
-27	3,730	16,800	3,451	288	
16	740	16,900	3,284	262	
-89	4,580	17,000	3,924	154	
393	3,530	17,100	3,446	307	
27	2,609	17,200	2,050	-69	
※ 663	5,397	17,300	2,010	-206	
-24	3,847	17,400	1,115	482	
-266	5,415	17,500	408	55	
27	5,103	17,600	222	72	
-18	5,241	17,700	58	25	
220	3,925	17,800	31	23	
196	3,717	17,900	13	-2	
-26	3,011	18,000	9	0	

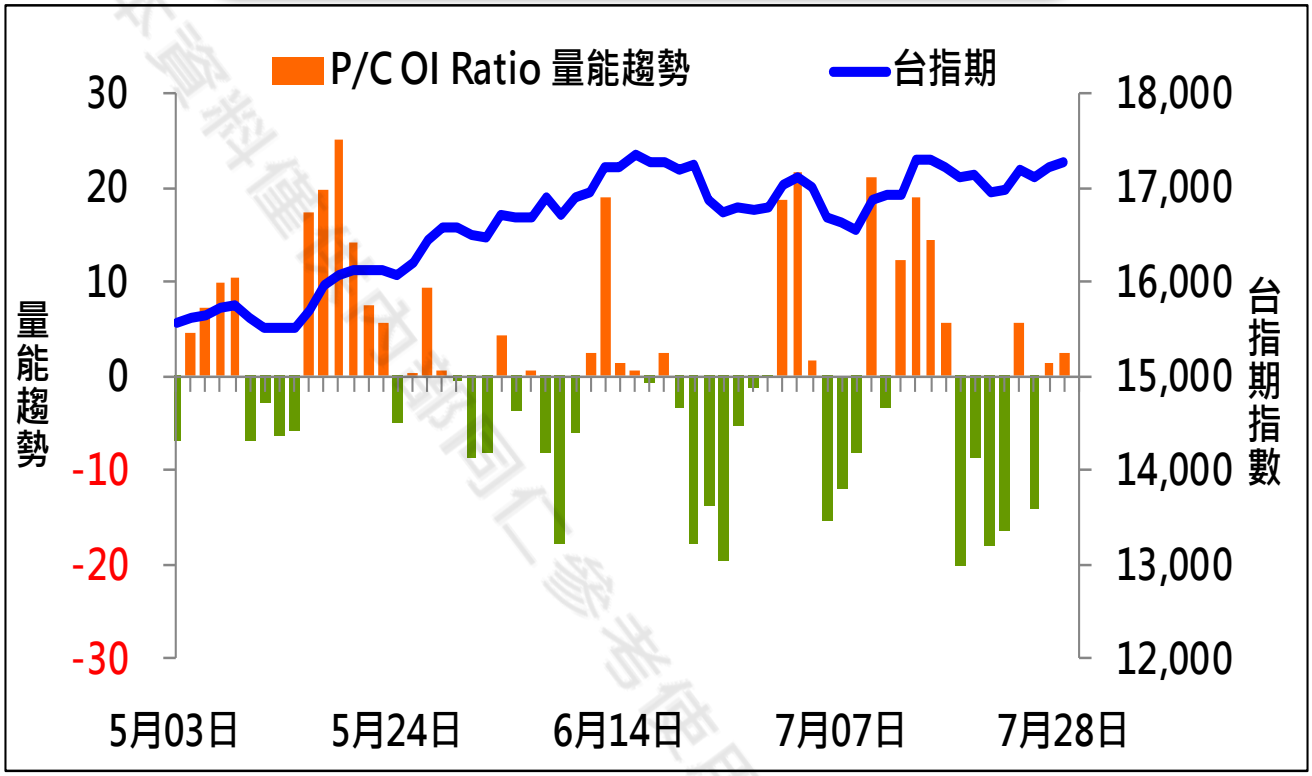
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
1,335	64,510	1.0158	65,527	2,139
昨日 P/C	1.0034	今日增減變化		0.0124

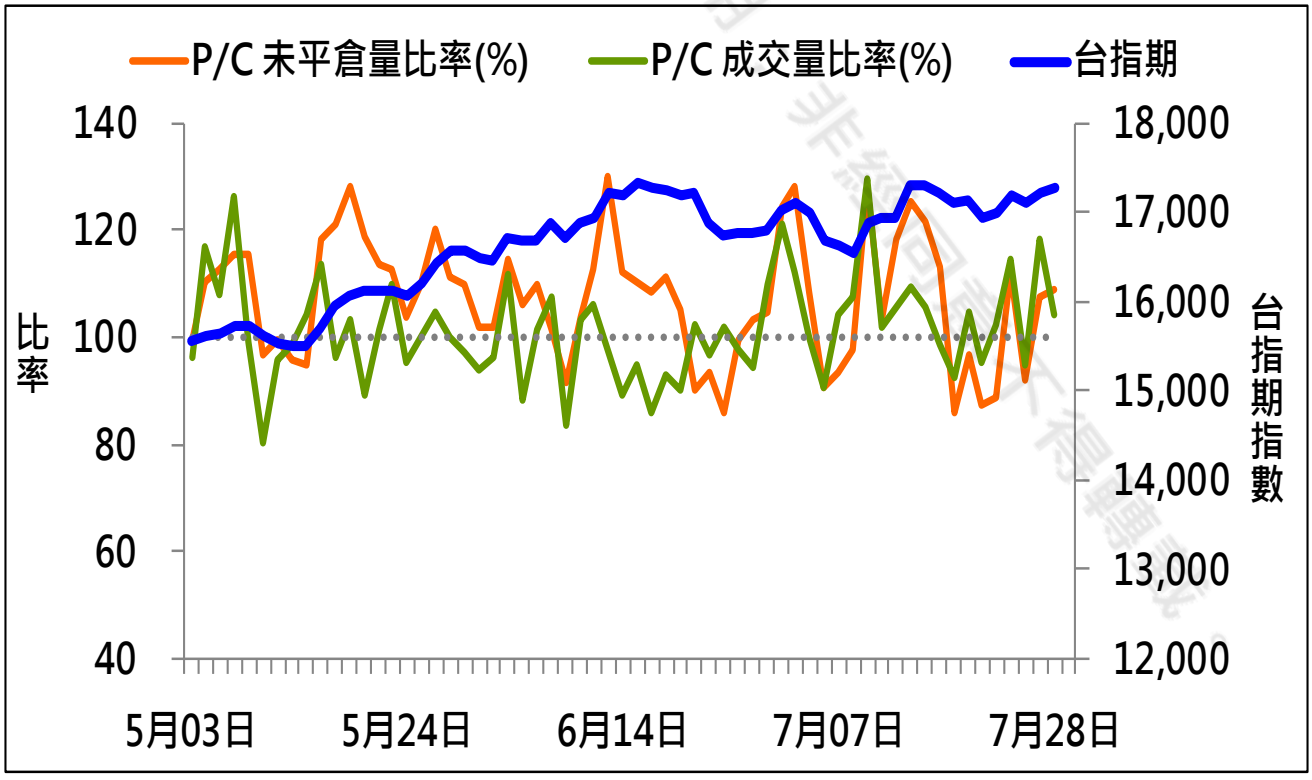
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

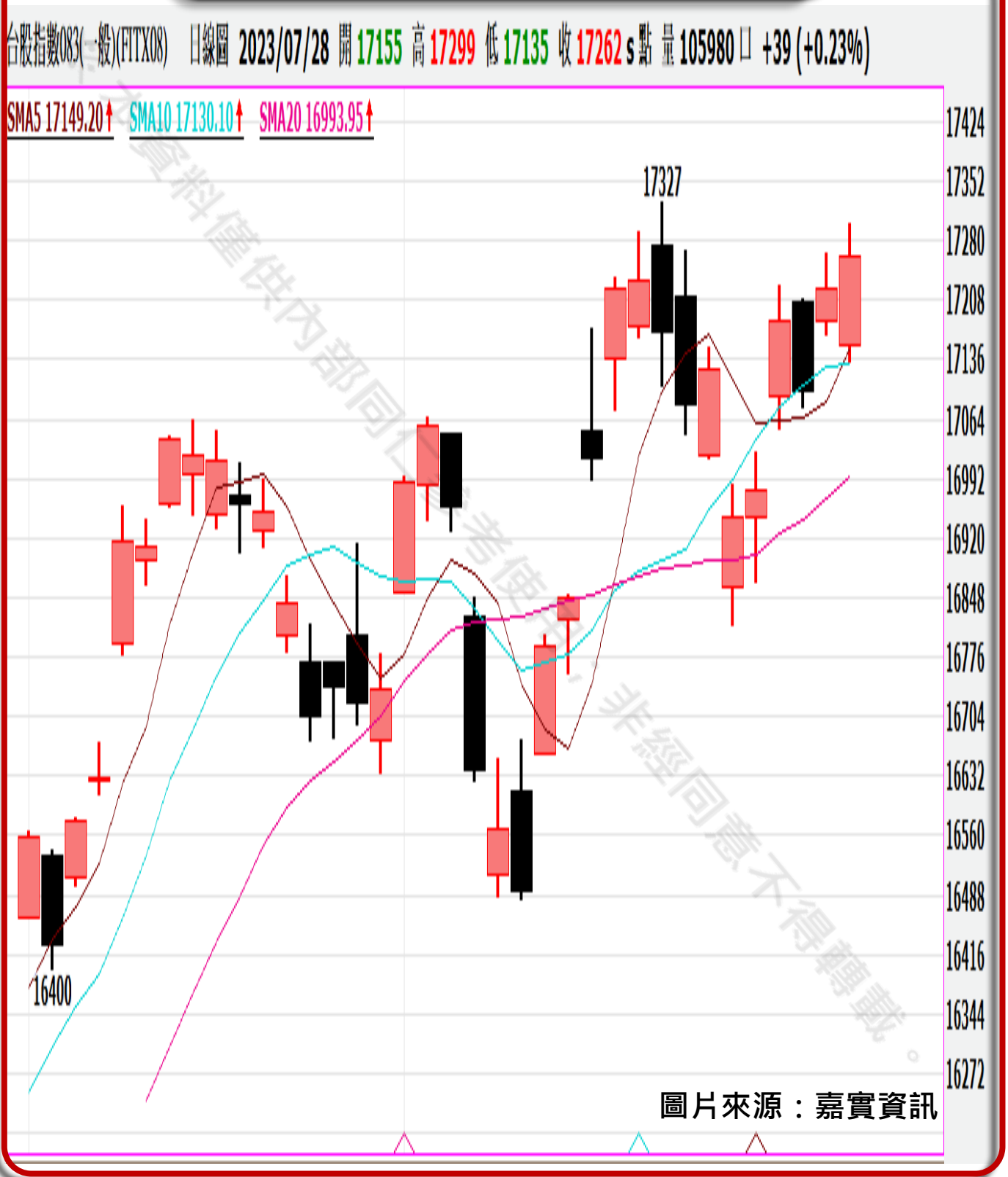




期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



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