台指期貨暨選擇權日報

2023/8/1

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

08月01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	326	4,112	-379	104	30	-10
投信	-117	-137	332	2	17	0
自營商	-5,328	-137	-253	22	-670	37

08月01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	48	1	18,947	567	17,556	2,509
投信	0	0	-100	0	298	0
自營商	-47	10	6,610	3,446	5,510	-5,737

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
鴻海	12.21	緯創	-8.30
國泰金	10.70	創意	-6.27
台達電	8.01	緯穎	-4.23
旺宏	6.85	智原	-3.75
富邦金	6.16	台汽電	-3.36
聯發科	4.35	材料-KY	-2.76
光寶科	3.64	華城	-2.70
華泰	3.58	威盛	-2.60
智邦	3.08	廣達	-2.55
統一	3.00	健鼎	-2.43
前十名合計	61.58	後十名合計	-38.95

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	45.3%	51.4%
電子期前十大市場佔比	52.5%	49.5%
金融期前十大市場佔比	58.8%	82.8%
非金電期前十大市場佔比	99.4%	91.4%

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

2023/8/1

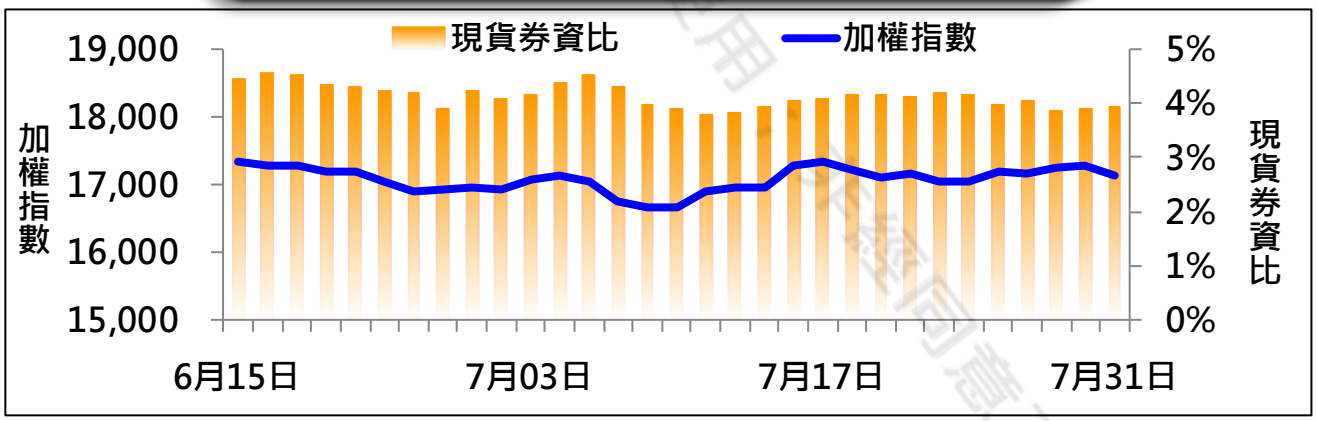
華南期貨 HUA NAN FUTURES

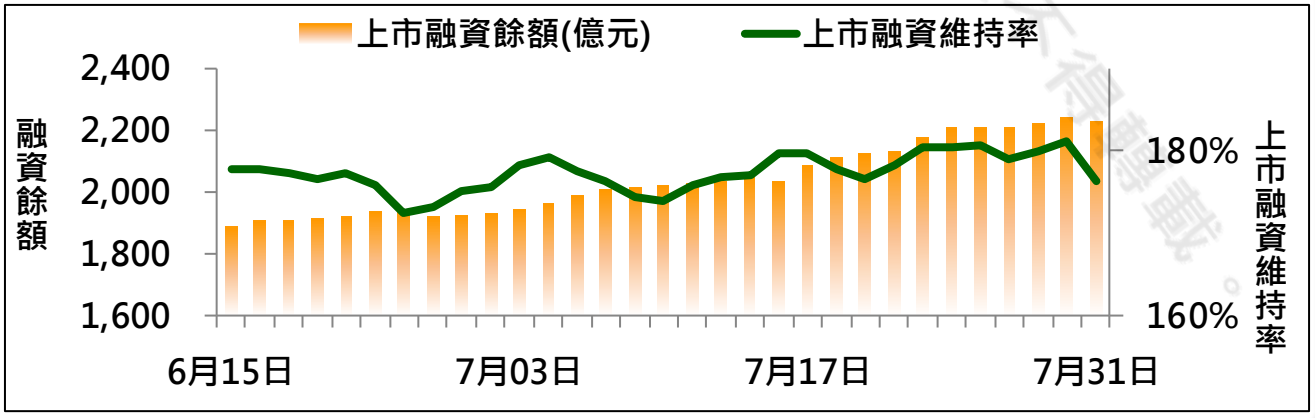
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
07月31日	-88.4	-3,786	-4,821	-27.7	-5,191	-604
08月01日	81.3	326	4,112	-4.6	-5,328	-137

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
07月31日	18,380	15,047	3,333	3,164	11,247	-8,083
08月01日	18,947	17,556	1,391	6,610	5,510	1,100

現貨券資比 & 上市融資維持率



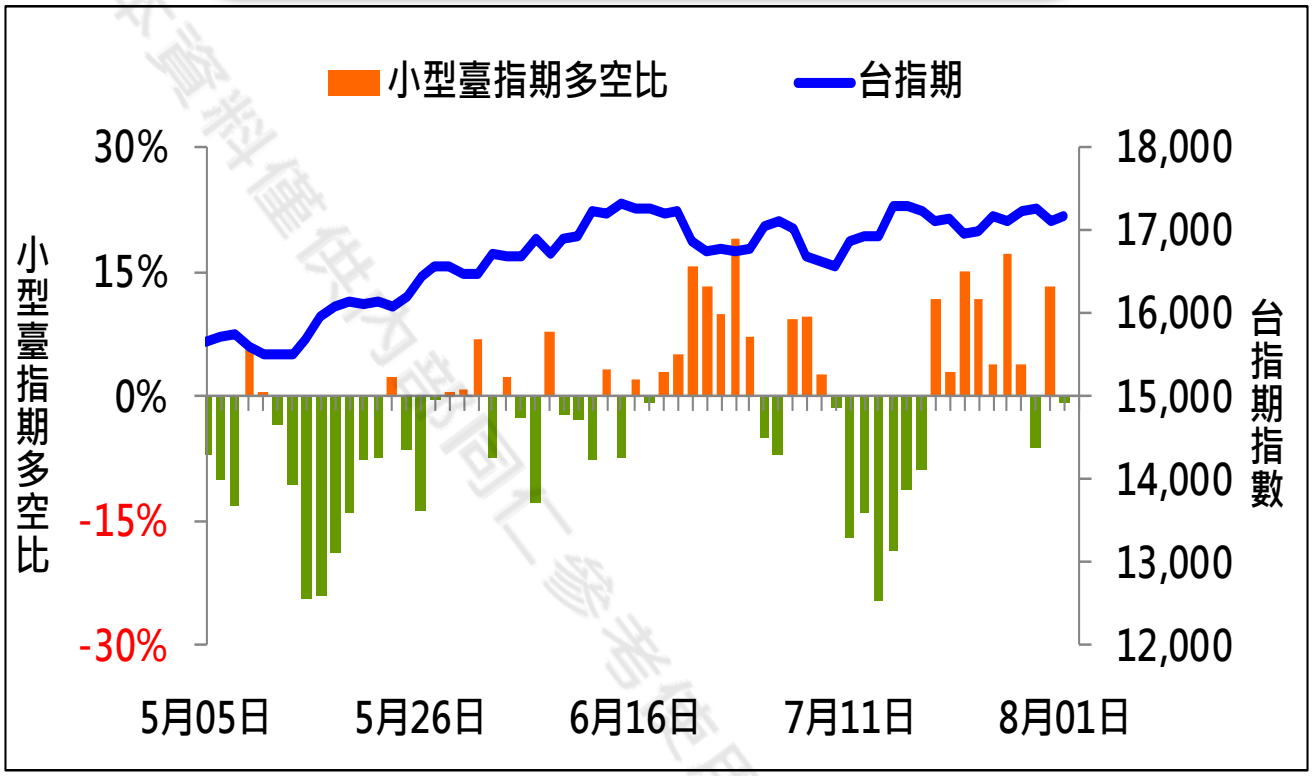


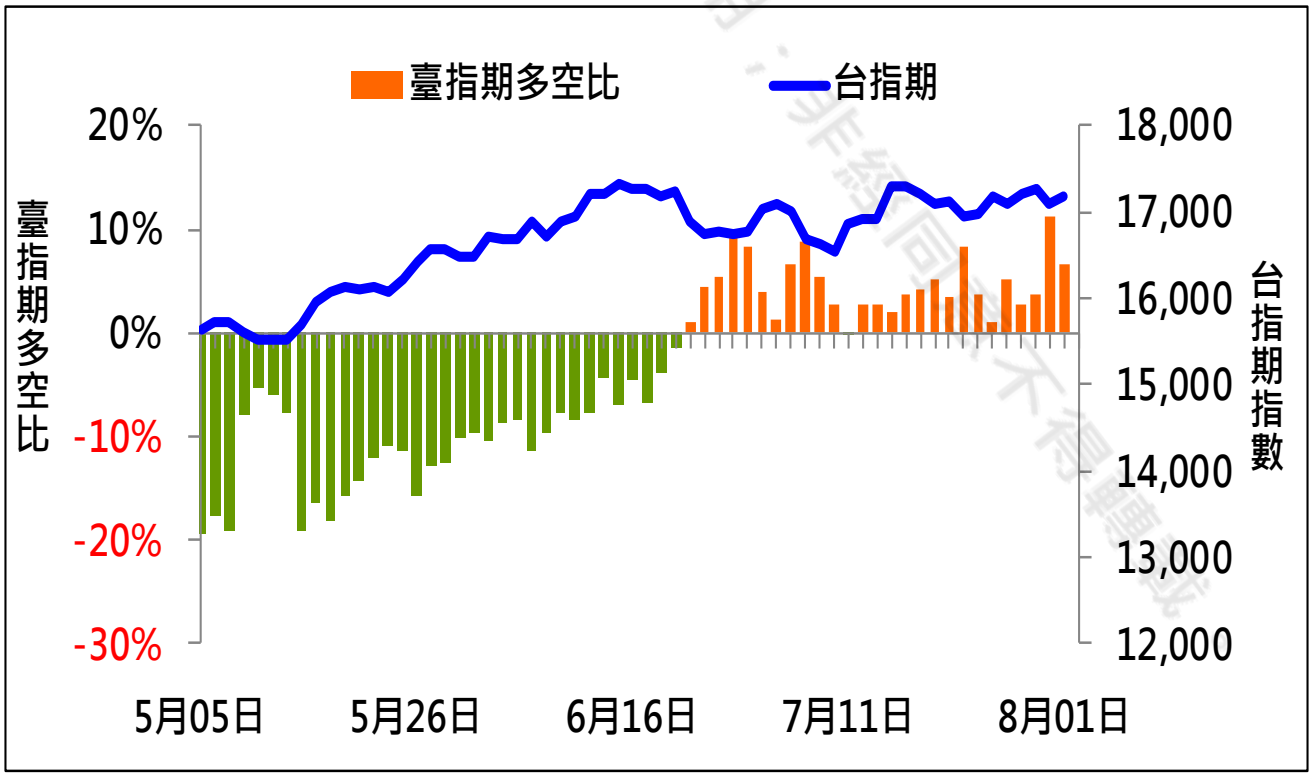
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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





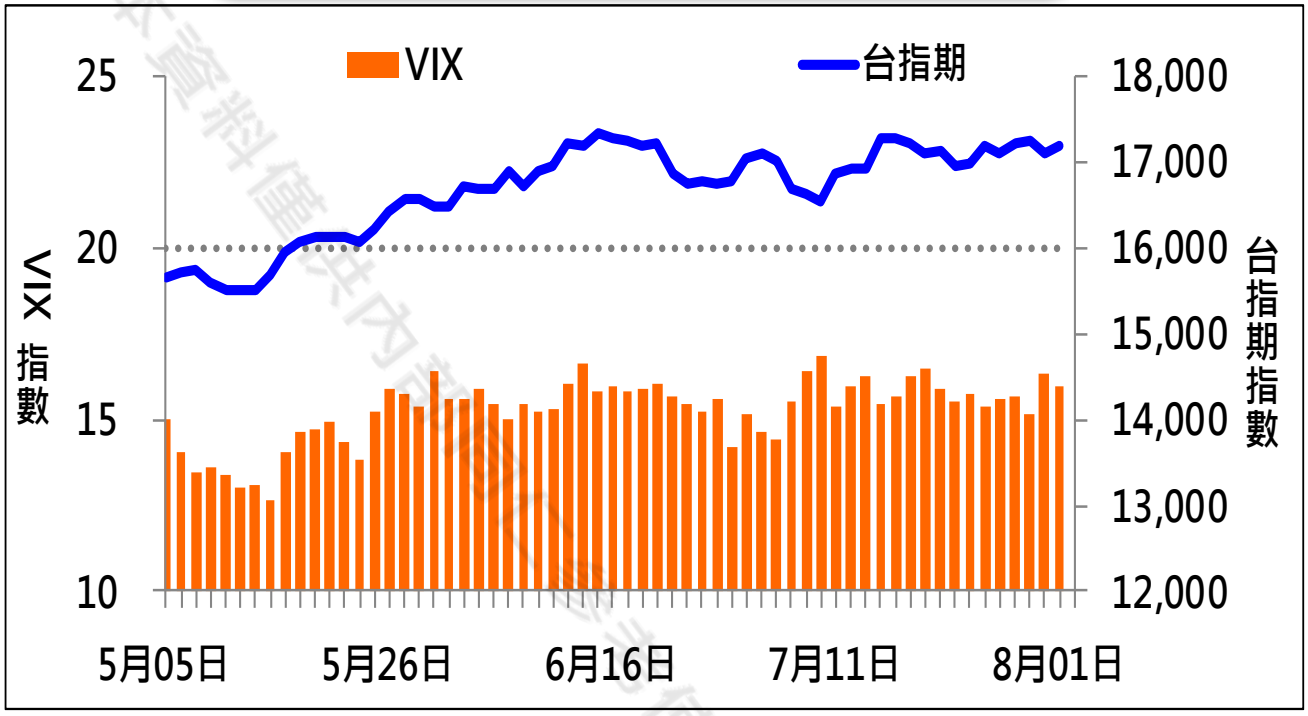
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

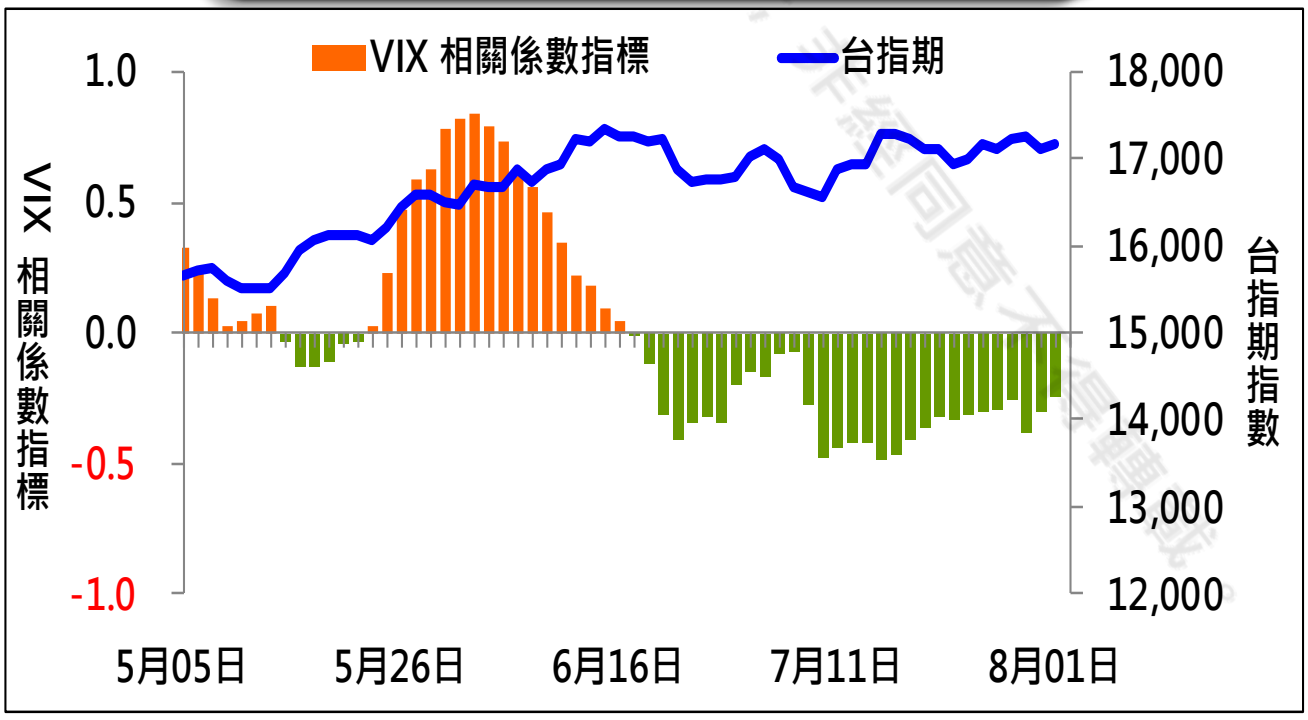
2023/8/1

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



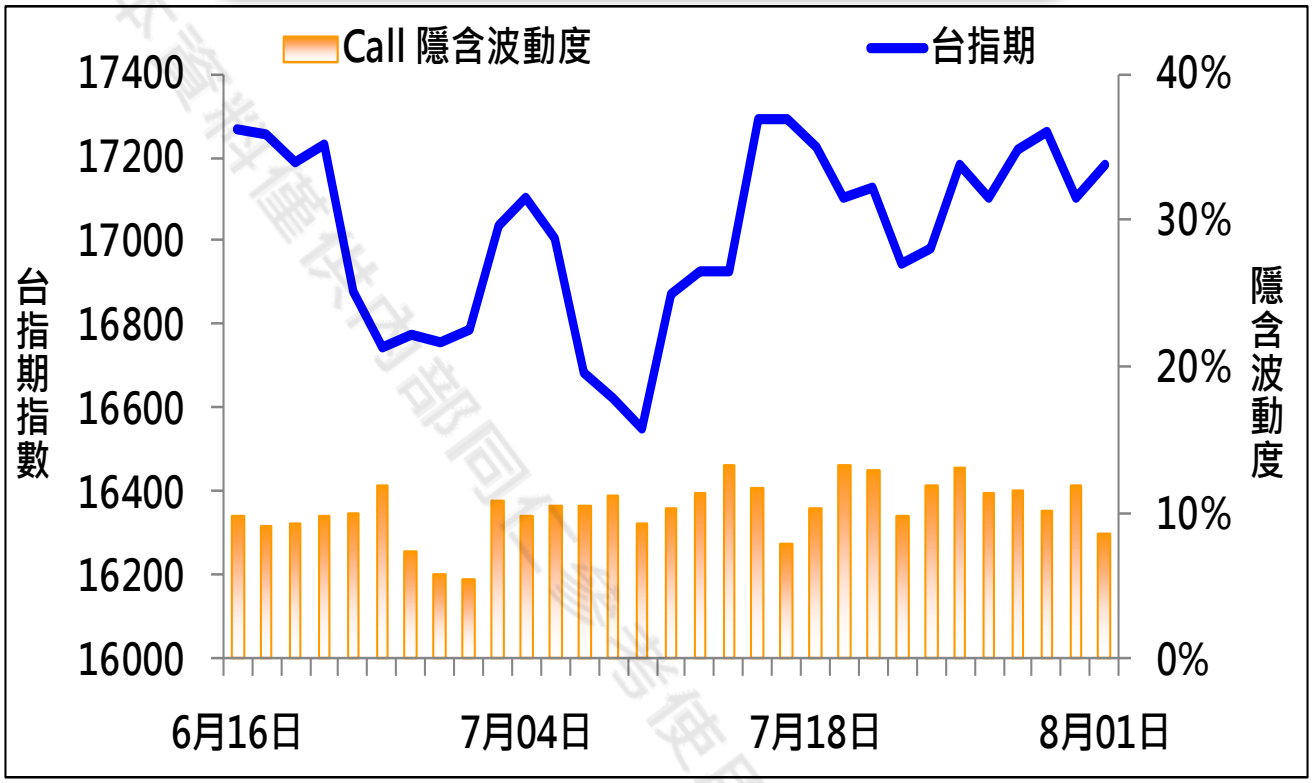
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

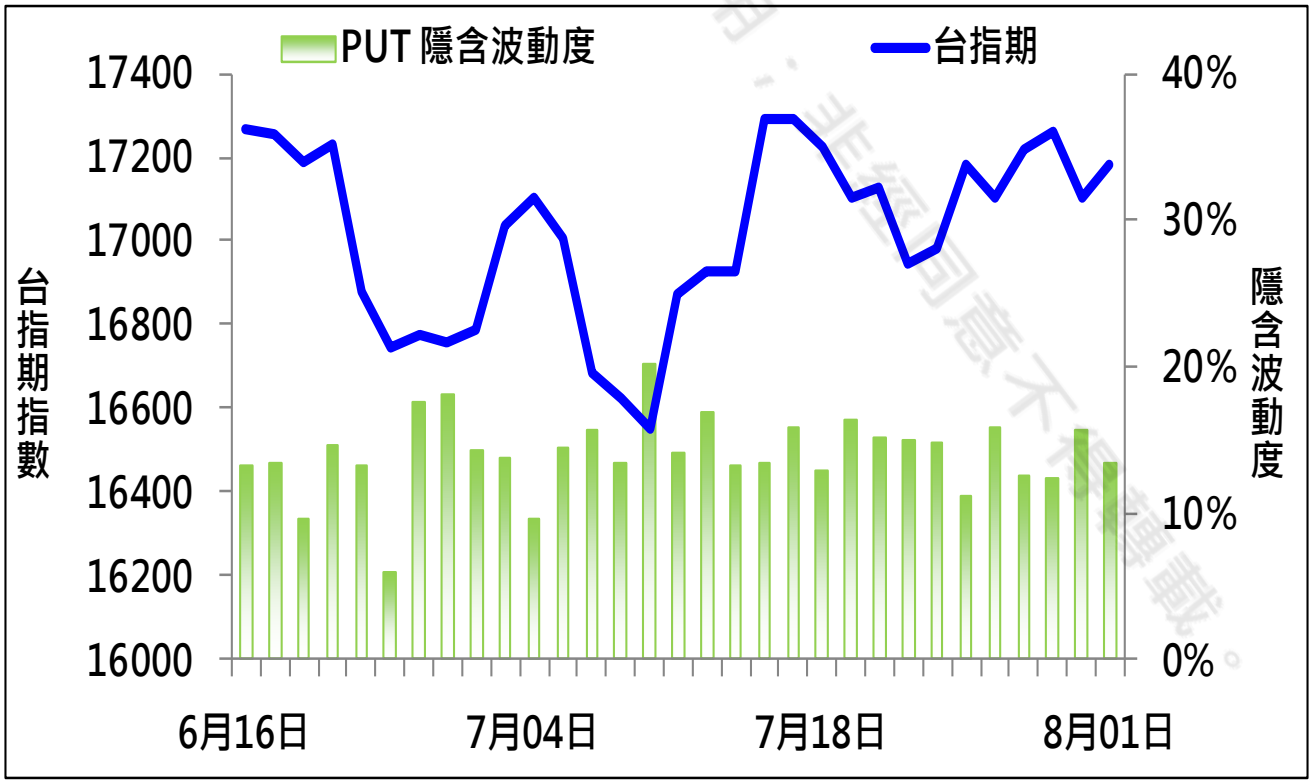
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

2023/8/1

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2023/8/1　　結算日：2023/8/2

	OI 增減	Call	202308W1 履約價	Put	OI 增減	
	0	5	16,550	2,870	324	
	0	7	16,600	3,732	13	
	0	11	16,650	3,961	88	
	-1	33	16,700	4,780	82	
	0	17	16,750	3,876	247	
	-1	144	16,800	10,550	1,826	
	3	24	16,850	5,802	83	
	-9	361	16,900	8,637	1,096	
	119	453	16,950	8,480	989	
	-43	1,086	17,000	13,960	2,567	
	208	1,693	17,050	7,973	1,745	
	400	4,899	17,100	11,158	3,882	
	1,418	5,539	17,150	8,303	2,489	
	1,572	9,577	17,200	9,697	4,024	※
	3,580	9,769	17,250	4,652	1,817	
※	5,521	15,133	17,300	2,590	-312	
	2,753	12,363	17,350	1,752	-1	
	-724	13,093	17,400	1,901	-446	
	-276	9,502	17,450	1,235	-293	
	-1,185	8,565	17,500	541	-40	
	-1,516	4,869	17,550	156	-33	
	-1,705	5,335	17,600	80	-4	
	-1,238	3,798	17,650	1	-2	
	-1,603	4,667	17,700	29	0	
	-519	1,580	17,750	0	-1	
	增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
	6,167	121,566	1.1090	134,813	19,882	
	昨日 P/C	0.9959	今日增減變化		0.1130	

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

2023/8/1

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2023/8/1　　結算日：2023/8/9

OI 增減	Call	202308W2 履約價	Put	OI 增減	
-1	5	16,600	920	171	
-1	1	16,700	1,186	341	
-2	14	16,800	2,664	1,841	※
0	2	16,850	2,057	937	
7	13	16,900	1,338	163	
16	38	16,950	695	338	
40	79	17,000	1,112	516	
-14	147	17,050	596	414	
194	367	17,100	831	451	
132	311	17,150	635	385	
15	648	17,200	528	175	
50	422	17,250	219	40	
161	651	17,300	229	82	
-55	688	17,350	85	30	
259	827	17,400	78	6	
524	891	17,450	22	0	
※ 1,198	1,843	17,500	38	7	
584	1,058	17,550	36	0	
315	1,021	17,600	26	4	
269	912	17,650	10	-10	
454	1,037	17,700	21	5	
107	976	17,750	21	0	
-243	1,745	17,800	9	0	
168	544	17,900	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,054	15,060	1.2363	18,618	7,472
昨日 P/C	1.0127	今日增減變化		0.2235

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

2023/8/1

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2023/8/1　　結算日：2023/8/16

OI 增減	Call	202308 月履約價	Put	OI 增減	
0	18	15,500	791	-26	
0	14	15,700	1,005	-7	
0	10	15,800	1,027	19	
0	27	15,900	1,273	121	
0	162	16,000	5,566	50	
0	14	16,100	1,902	-210	
-3	36	16,200	2,541	62	
0	62	16,300	4,370	72	
0	40	16,400	3,045	64	
0	206	16,500	6,024	357	
-18	448	16,600	4,352	421	
15	350	16,700	4,501	646	
516	4,148	16,800	4,573	574	
82	804	16,900	3,977	268	
-53	4,940	17,000	3,974	-324	
-479	2,909	17,100	2,312	-356	
327	2,948	17,200	3,617	873	※
-666	4,837	17,300	2,619	-11	
215	5,246	17,400	789	-70	
129	6,212	17,500	462	-32	
229	5,952	17,600	315	3	
-137	5,739	17,700	78	1	
301	5,736	17,800	48	-2	
※ 517	5,256	17,900	16	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
1,587	74,419	0.9442	70,268	2,484	
昨日 P/C	0.9307	今日增減變化		0.0135	

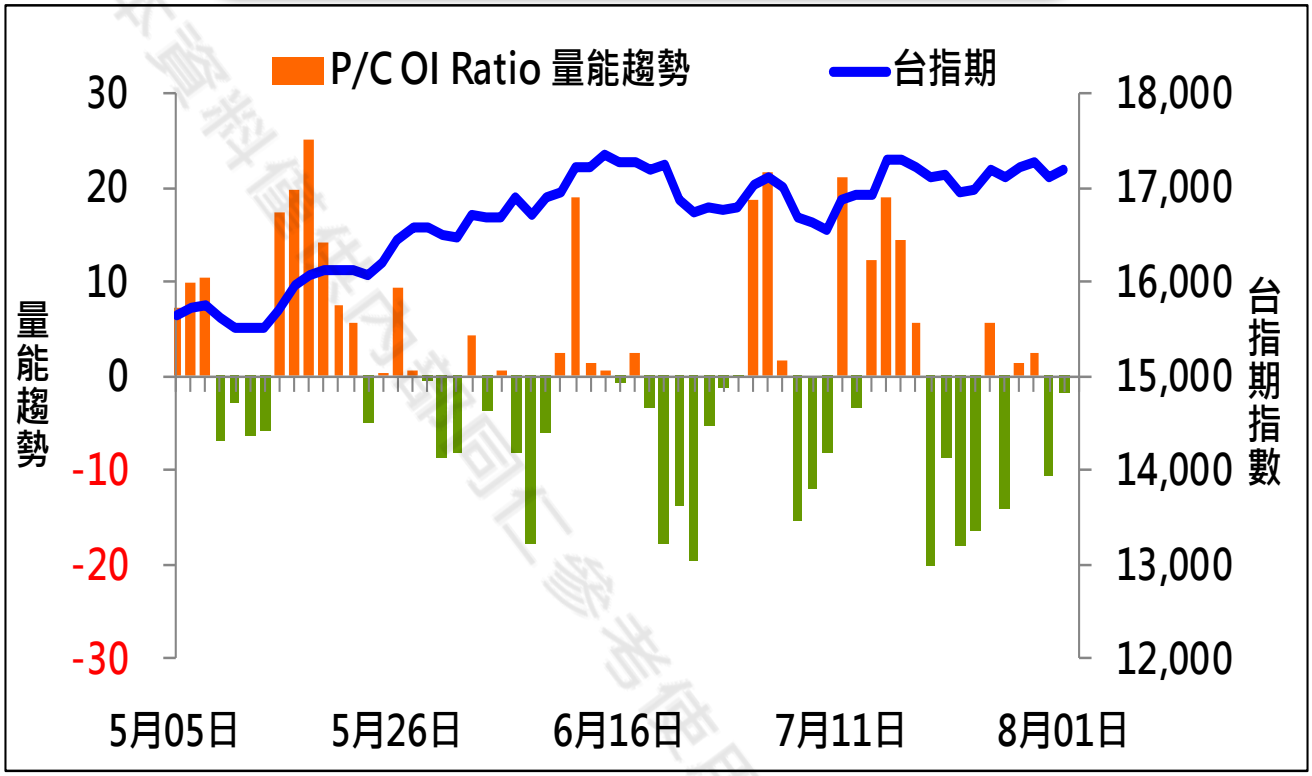
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

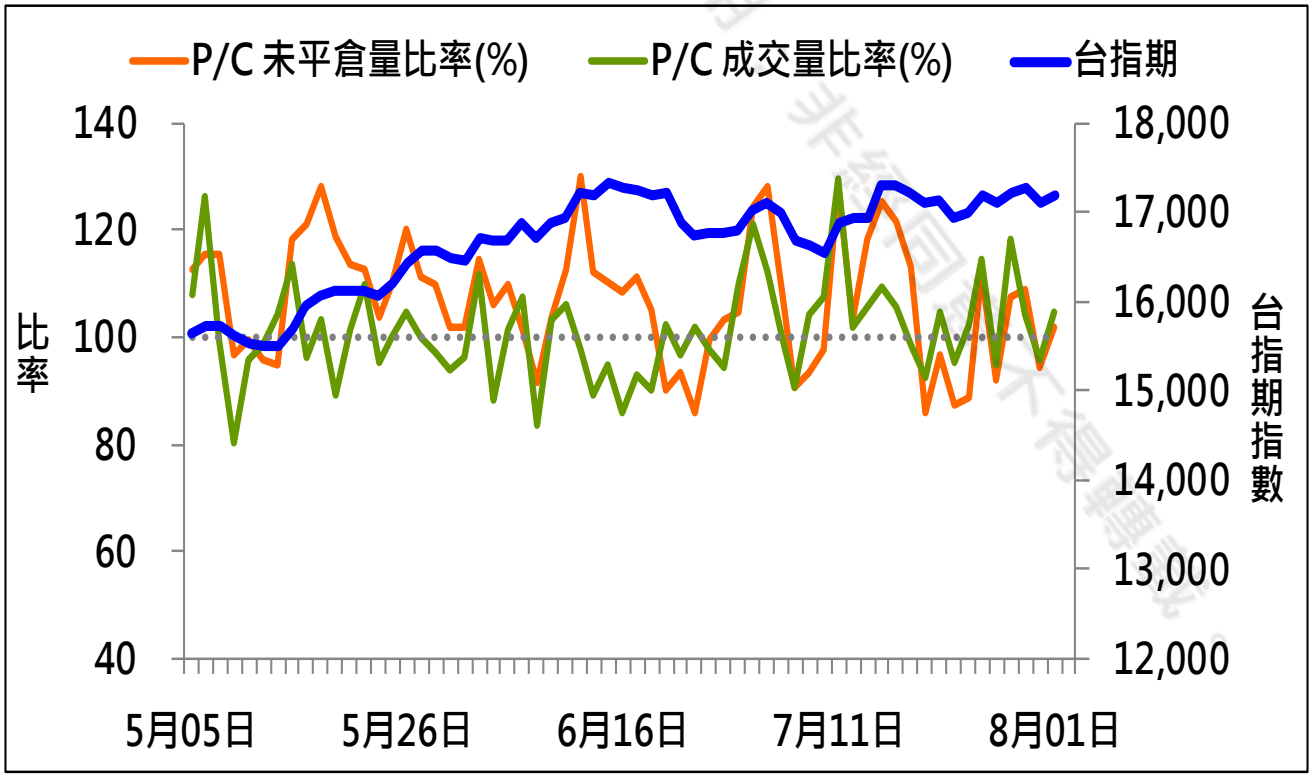
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

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