台指期貨暨選擇權日報

2023/8/25

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

08月25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	-11,836	-10,198	-488	-34	232	-12
投信	1,444	166	223	0	27	0
自營商	-3,322	1,122	-404	-48	-639	33

08月25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	70	13	19,917	-3,381	17,458	4,543
投信	0	0	200	0	180	0
自營商	-76	-17	-10,835	-9,653	12,578	3,250

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
日月光投控	6.84	廣達	-31.94
統懋	4.22	緯創	-14.91
台汽電	1.70	台達電	-13.35
潤泰新	1.70	緯穎	-10.94
威盛	1.60	智邦	-10.52
大聯大	1.09	鴻海	-9.30
精英	0.87	光寶科	-6.86
美食-KY	0.84	欣興	-6.48
中租-KY	0.77	華泰	-5.59
瑞昱	0.76	華碩	-4.98
前十名合計	20.42	後十名合計	-114.87

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	37.2%	50.2%
電子期前十大市場佔比	55.0%	60.3%
金融期前十大市場佔比	64.0%	70.2%
非金電期前十大市場佔比	99.0%	95.7%

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 (112)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

2023/8/25

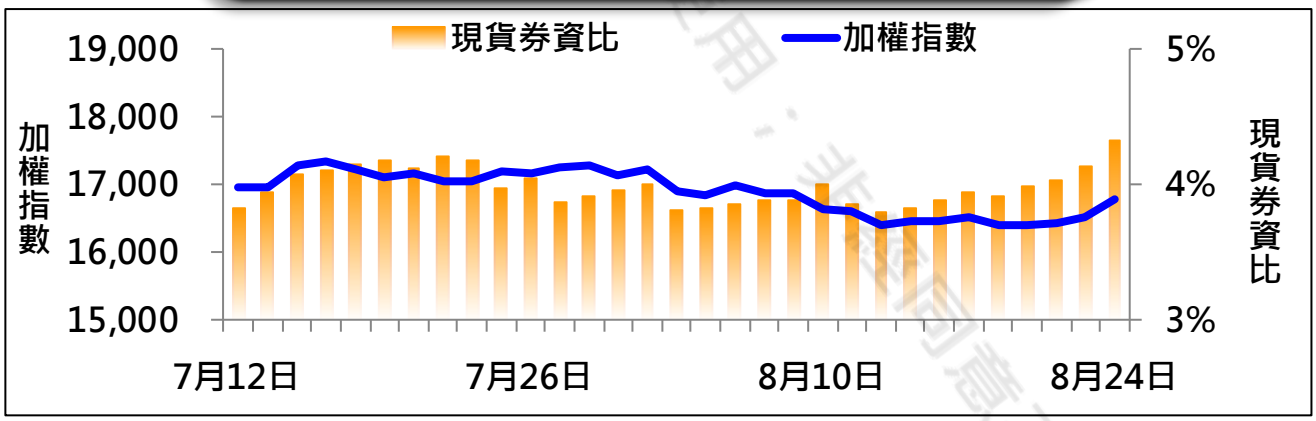
華南期貨 HUA NAN FUTURES

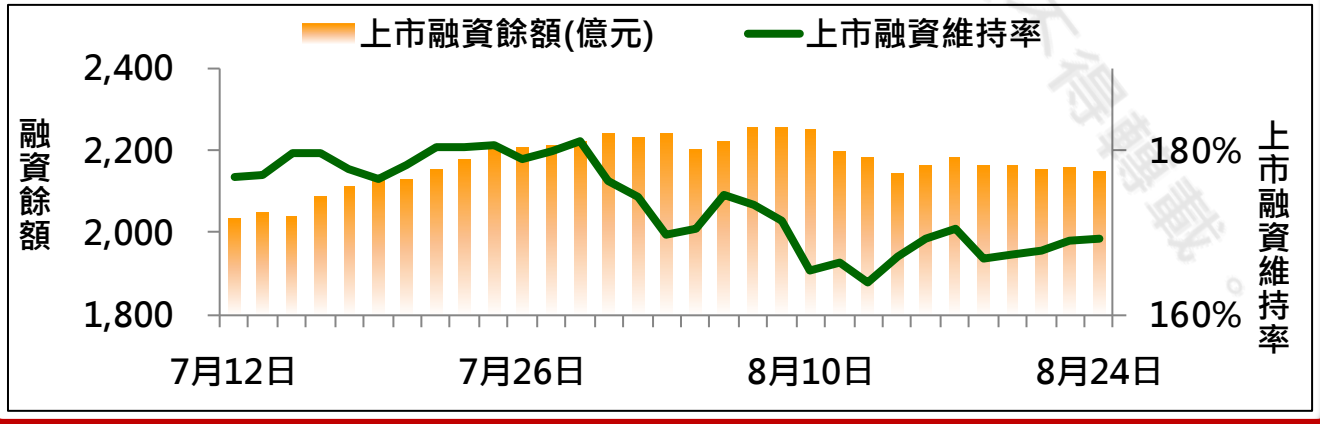
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
08月21日	-35.8	-6,087	-5,313	-11.4	-4,472	-715
08月22日	59.9	-5,076	1,011	-36.3	-4,305	167
08月23日	58.9	-3,006	2,070	6.1	-5,105	-800
08月24日	122.7	-1,638	1,368	2.2	-4,444	661
08月25日	-337.2	-11,836	-10,198	-85.6	-3,322	1,122

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
08月21日	15,495	10,535	4,960	4,990	14,201	-9,211
08月22日	16,950	11,033	5,917	7,434	10,304	-2,870
08月23日	16,807	13,538	3,269	-3,458	-804	-2,654
08月24日	23,298	12,915	10,383	-1,182	9,328	-10,510
08月25日	19,917	17,458	2,459	-10,835	12,578	-23,413

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 (112)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

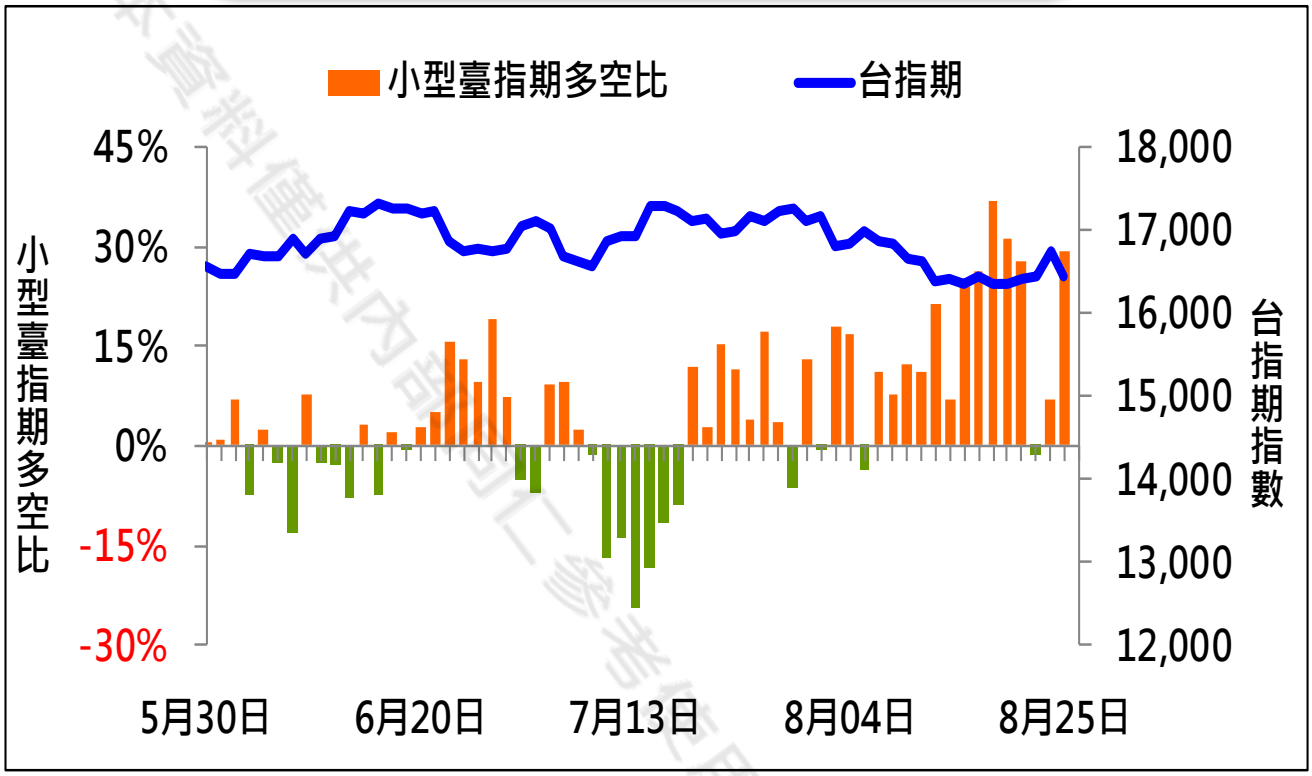
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

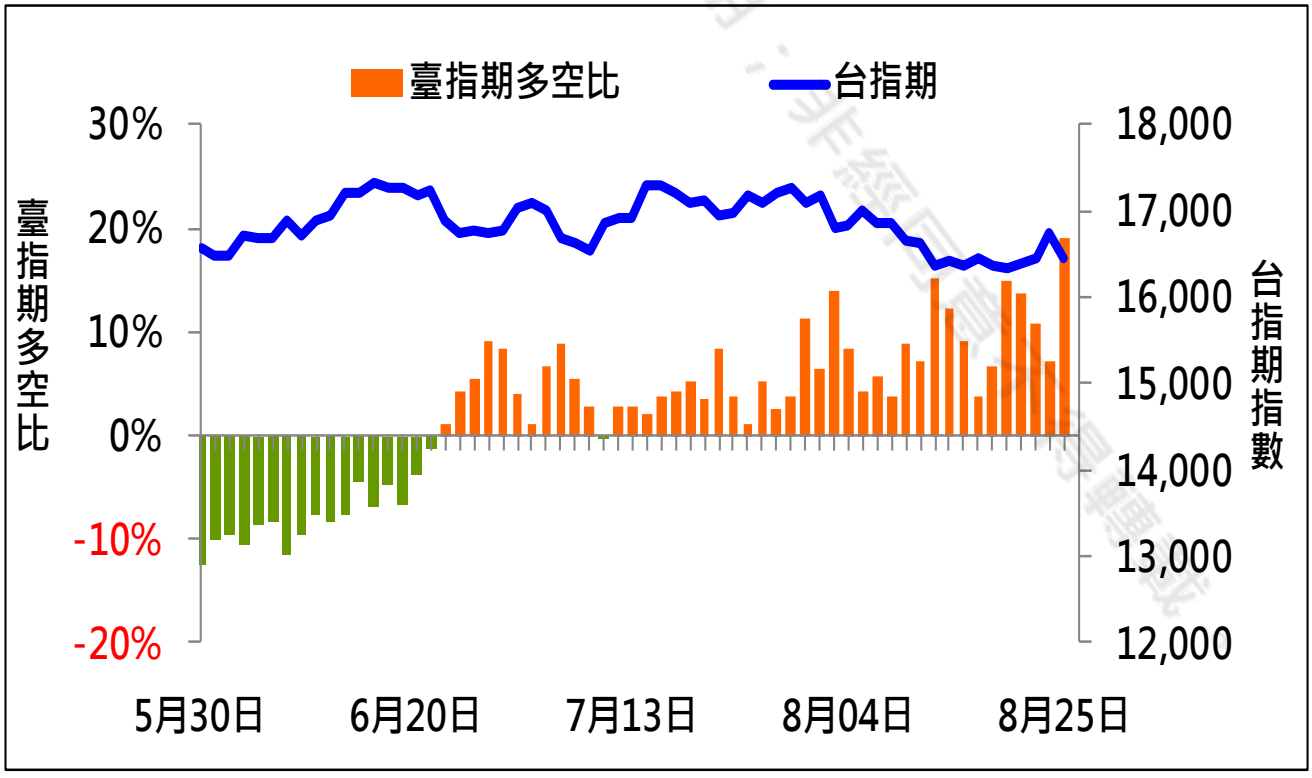
台指期貨暨選擇權日報

2023/8/25

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 (112)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

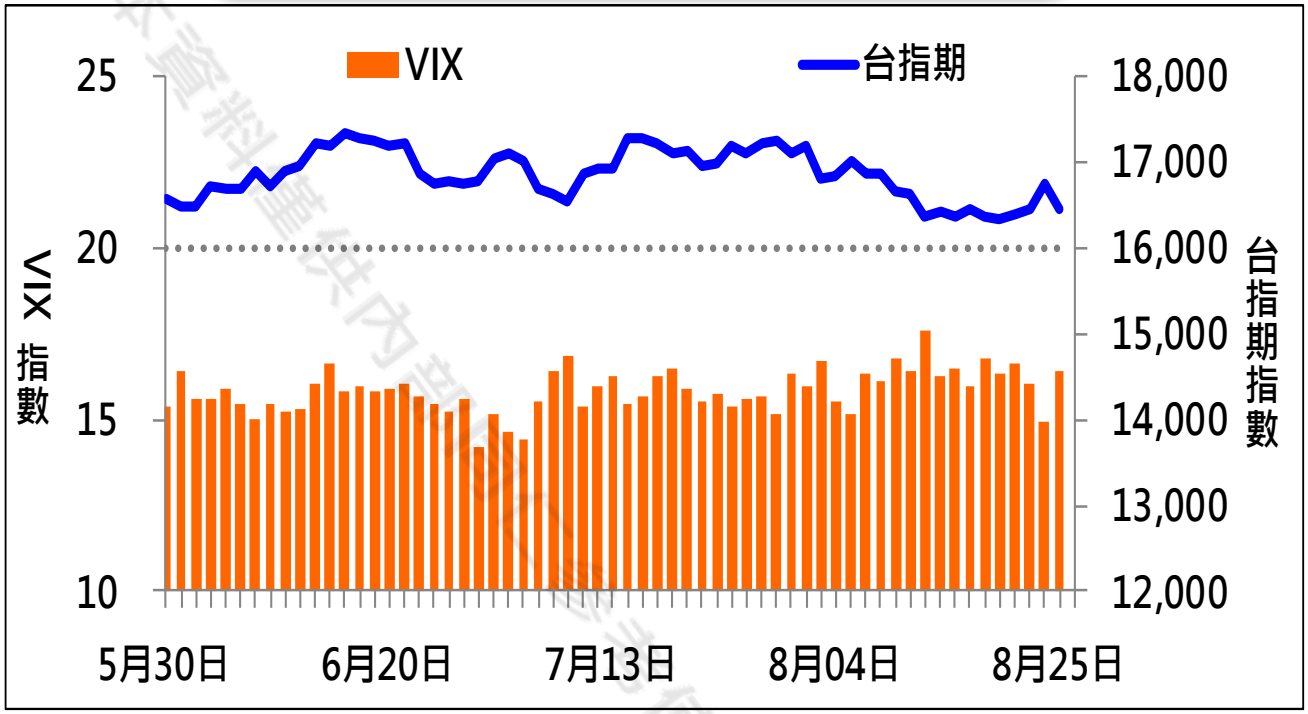
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

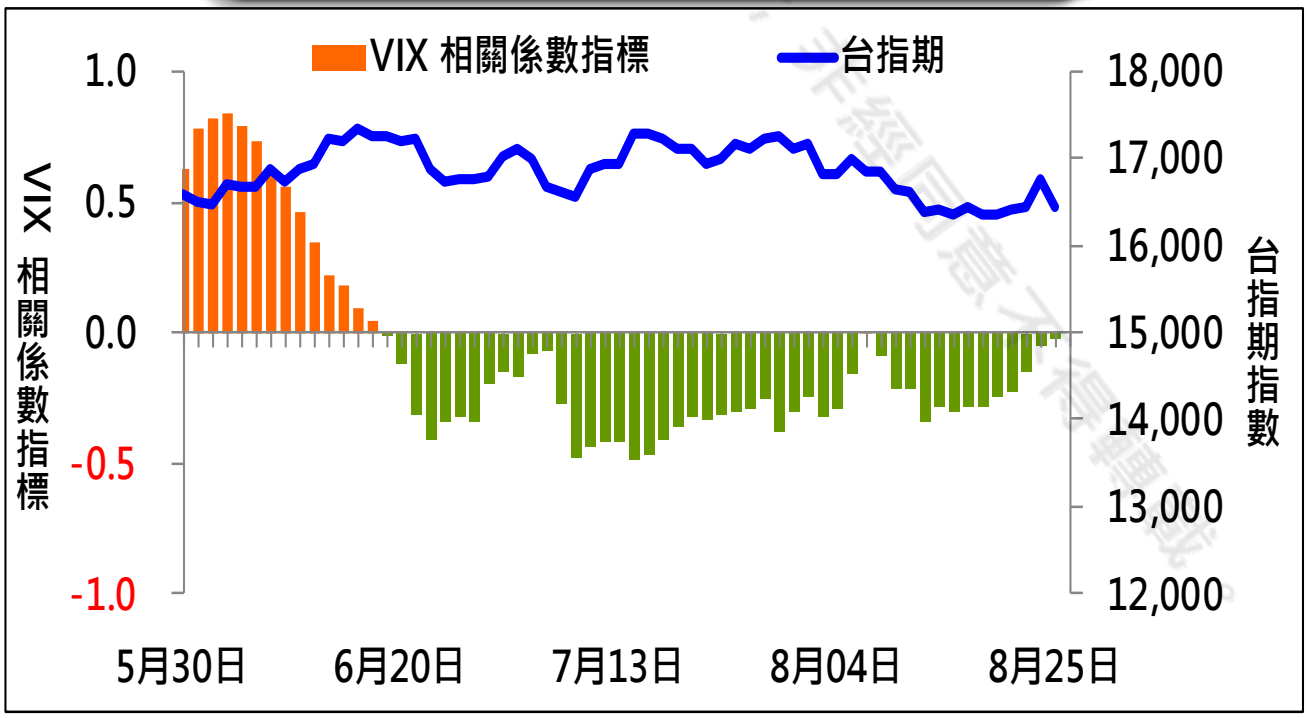
2023/8/25

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



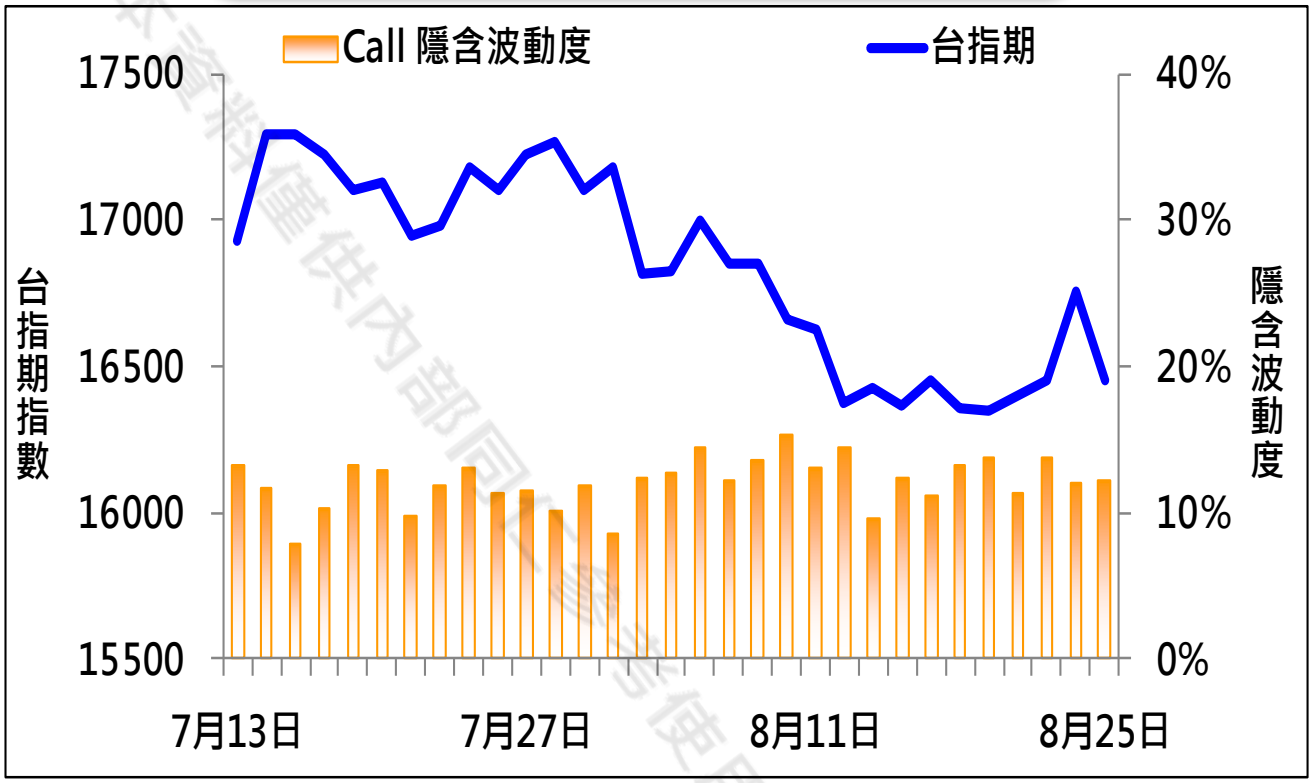
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

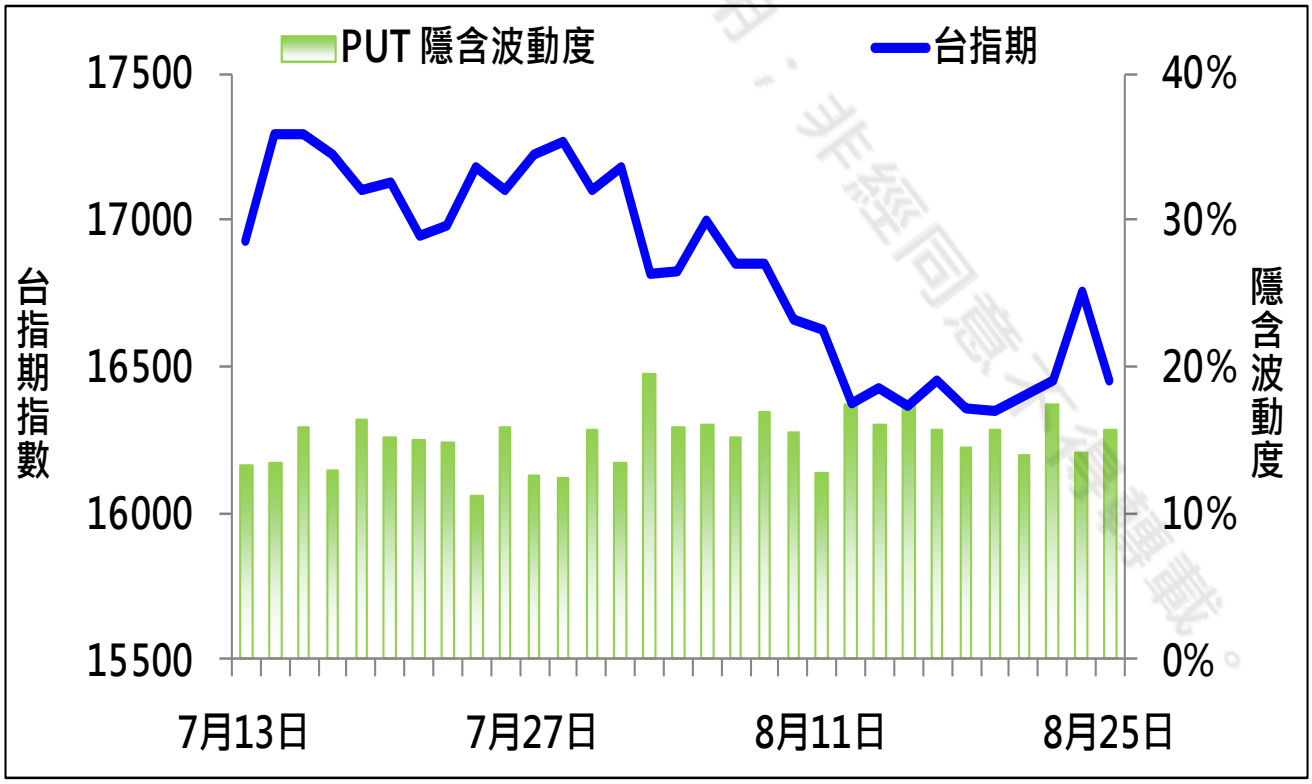
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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 (112)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

2023/8/25

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

資料日期：2023/8/25　　結算日：2023/8/30

OI 增減	Call	202308W5 履約價	Put	OI 增減	
-2	13	16,000	6,534	916	
0	2	16,050	4,666	827	
-3	40	16,100	5,266	416	
-1	32	16,150	4,903	1,785	
46	93	16,200	8,441	2,048	
7	52	16,250	5,961	1,619	
182	429	16,300	7,897	1,989	
73	377	16,350	6,446	2,812	
455	792	16,400	10,601	2,948	※
2,246	2,810	16,450	5,232	-29	
3,224	3,932	16,500	5,155	-981	
4,176	5,719	16,550	3,665	-503	
4,582	6,423	16,600	3,450	-1,204	
2,945	4,856	16,650	1,553	-877	
5,045	7,733	16,700	3,324	-468	
5,003	7,613	16,750	1,652	-221	
4,028	9,574	16,800	1,169	-859	
※ 13,958	19,020	16,850	636	-76	
3,968	9,278	16,900	384	2	
1,490	9,073	16,950	197	67	
943	9,379	17,000	145	28	
4,011	5,780	17,050	4	-4	
-1,679	7,777	17,100	14	8	
1,756	6,738	17,200	7	4	
58,177	126,925	總計	112,052	13,398	
P/C	0.8828	||	增減	-0.5522	

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 (112)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

2023/8/25

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

資料日期：2023/8/25　　結算日：2023/9/20

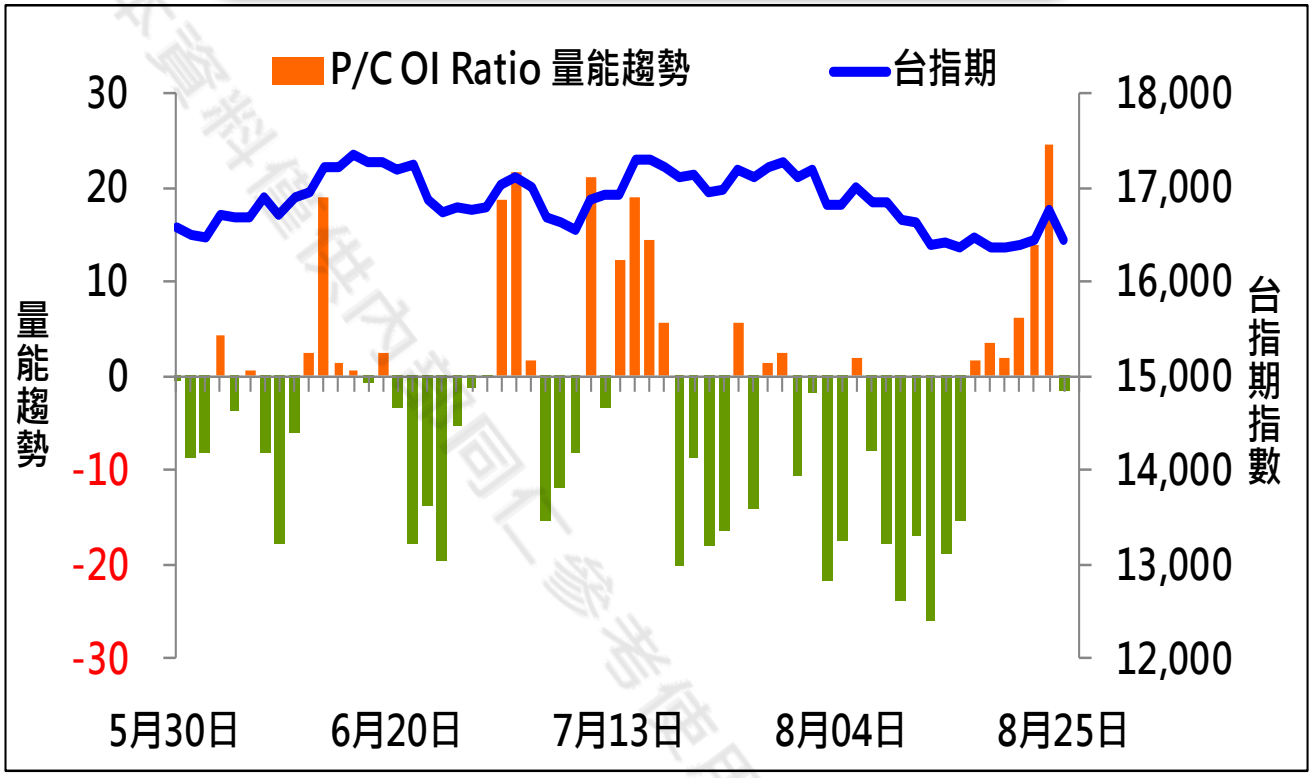
	OI 增減	Call	202309 月 履約價	Put	OI 增減	
	1	22	15,500	3,586	241	
	0	69	15,600	5,012	60	
	2	38	15,700	2,463	46	
	0	123	15,800	3,287	87	
	6	28	15,900	2,315	10	
	14	150	16,000	9,747	905	※
	3	144	16,100	3,138	438	
	60	1,111	16,200	6,650	-1,104	
	50	1,155	16,300	5,387	-67	
	-28	1,881	16,400	2,044	-283	
	1,135	2,643	16,500	2,690	287	
※	2,332	5,590	16,600	2,851	210	
	689	2,311	16,700	948	-193	
	322	4,206	16,800	2,196	46	
	492	4,130	16,900	854	6	
	1,641	9,074	17,000	916	-98	
	38	4,830	17,100	128	-5	
	454	6,472	17,200	168	-7	
	1,025	5,095	17,300	80	-5	
	40	4,058	17,400	168	0	
	212	4,139	17,500	87	0	
	343	3,622	17,600	66	-1	
	9,664	87,448	總計	80,833	1,533	
	P/C	0.9244	||	增減	-0.0951	

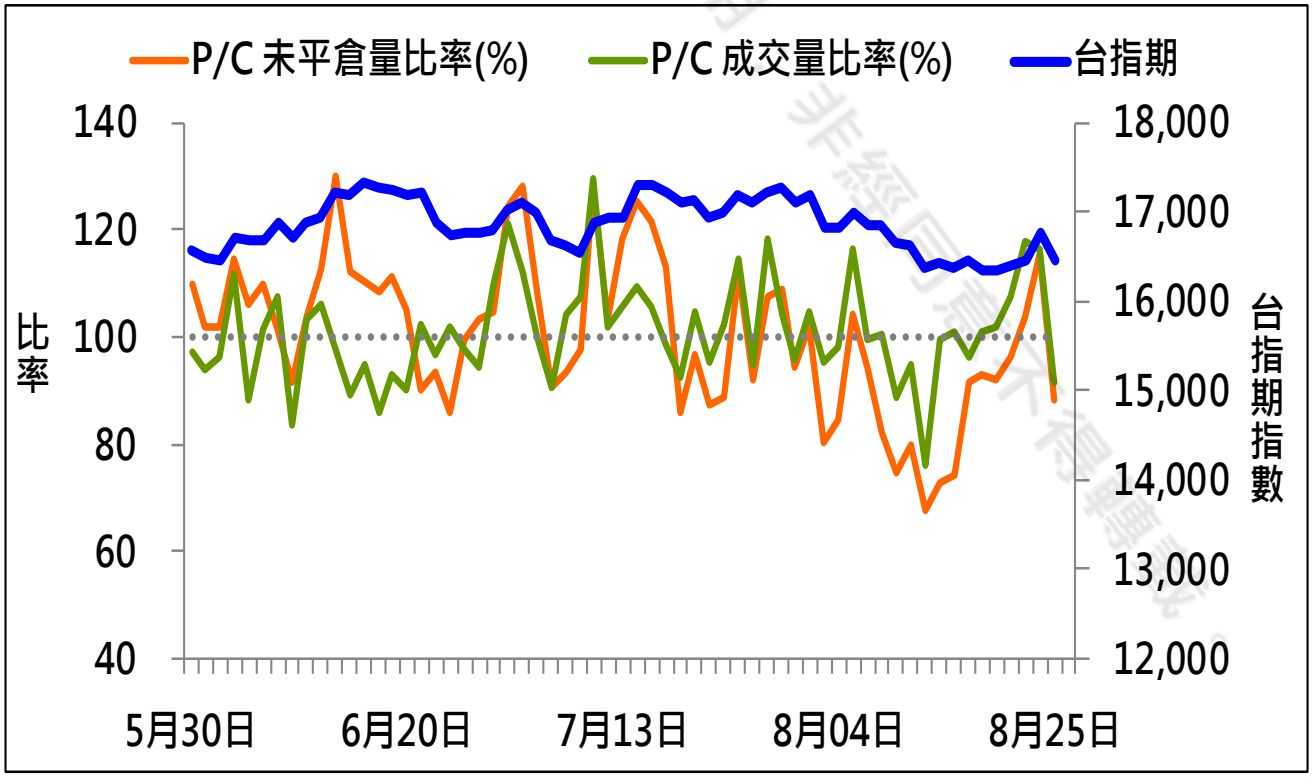
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

圖片來源：嘉實資訊

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 (112)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