台指期貨暨選擇權日報

2023/8/31

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

08月31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	-8,451	-1,757	-543	4	100	-32
投信	953	-676	224	0	24	-3
自營商	-1,753	1,302	-292	-52	-629	-9

08月31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	69	2	25,319	2,944	17,592	5,611
投信	0	0	200	0	180	0
自營商	-71	-2	-12,872	-12,632	2,241	5,692

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
華泰	13.27	旺宏	-12.04
廣達	8.54	緯穎	-10.82
緯創	6.41	富邦金	-5.57
統懋	4.59	統一	-5.28
台光電	3.24	和泰車	-4.59
鴻海	3.06	南亞	-4.56
英業達	2.85	日月光投控	-3.87
華新	2.06	技嘉	-3.65
儒鴻	1.58	國泰金	-3.58
金像電	1.52	中華電	-3.43
前十名合計	47.12	後十名合計	-57.38

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	38.8%	46.3%
電子期前十大市場佔比	56.1%	60.5%
金融期前十大市場佔比	62.0%	74.7%
非金電期前十大市場佔比	96.4%	96.4%

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 (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

2023/8/31

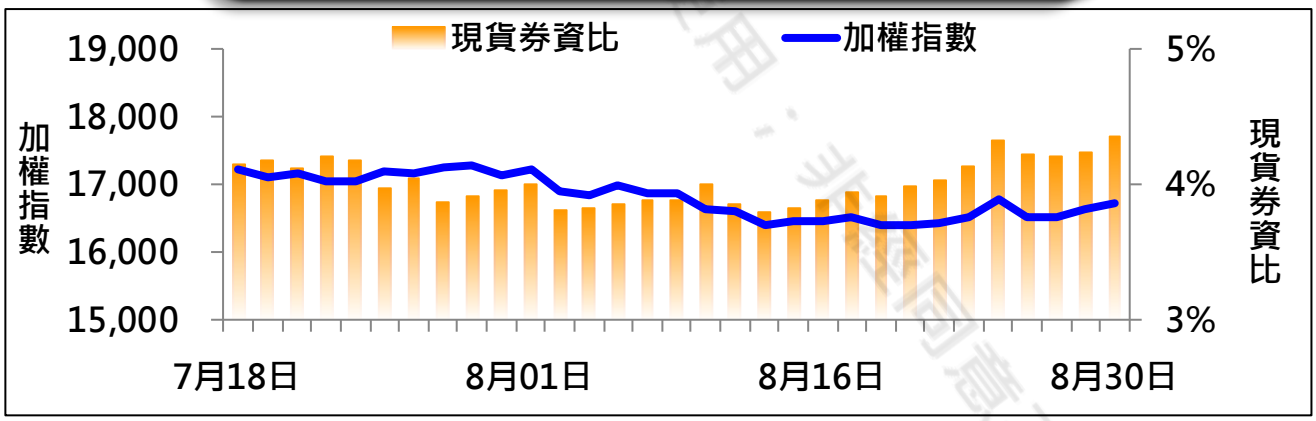
華南期貨 HUA NAN FUTURES

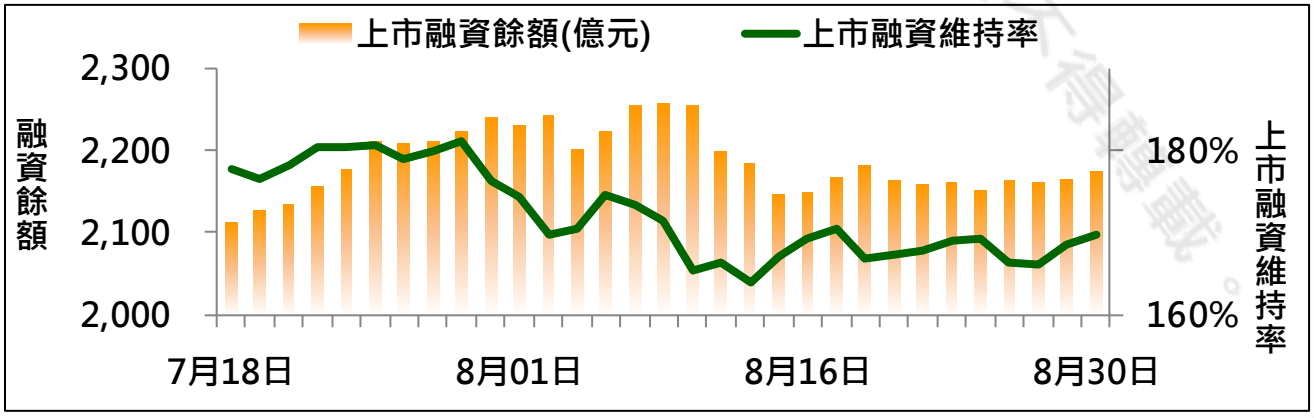
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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25日	-337.2	-11,836	-10,198	-85.6	-3,322	1,122
08月28日	-37.1	-8,290	3,546	-50.0	-3,863	-541
08月29日	39.5	-4,856	3,434	-1.1	-3,669	194
08月30日	71.3	-6,694	-1,838	24.0	-3,055	614
08月31日	-56.3	-8,451	-1,757	-0.1	-1,753	1,302

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25日	19,917	17,458	2,459	-10,835	12,578	-23,413
08月28日	22,173	16,065	6,108	-3,076	3,996	-7,072
08月29日	22,783	17,068	5,715	-339	1,735	-2,074
08月30日	22,375	11,981	10,394	-240	-3,451	3,211
08月31日	25,319	17,592	7,727	-12,872	2,241	-15,113

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

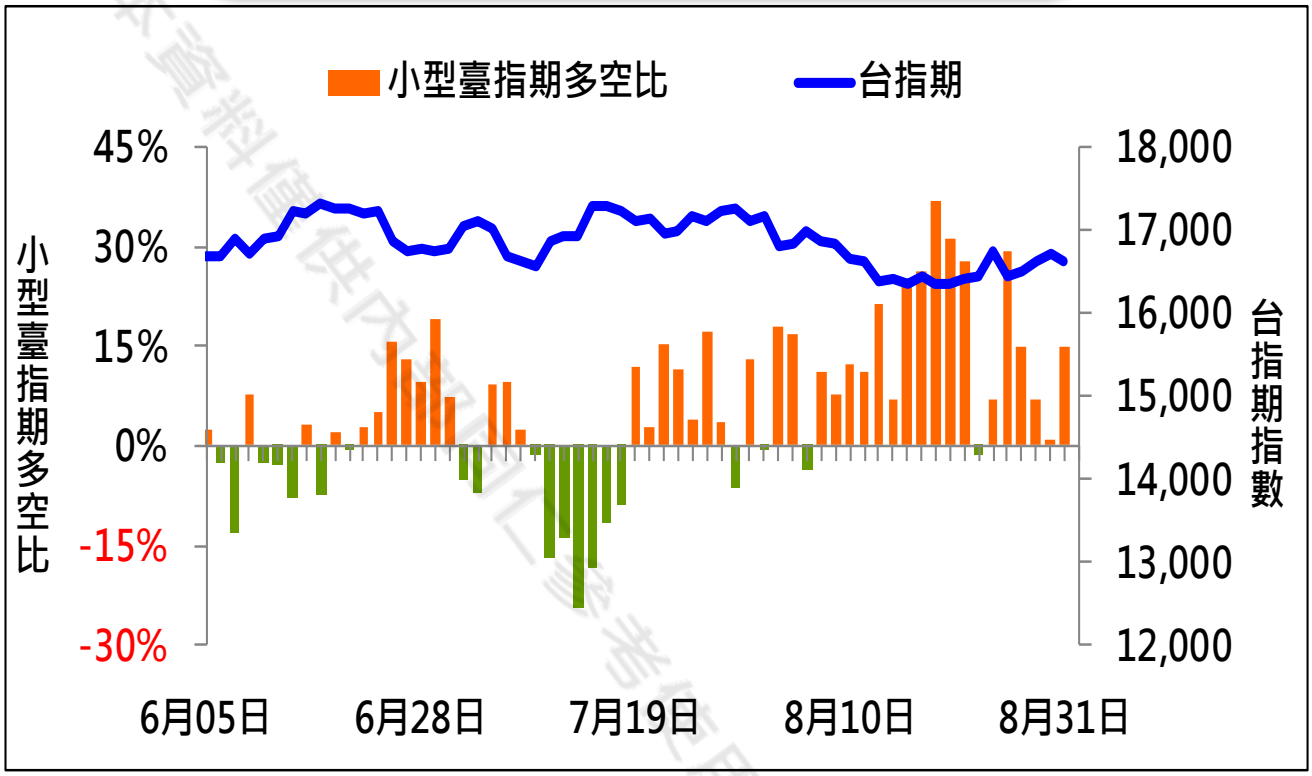
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

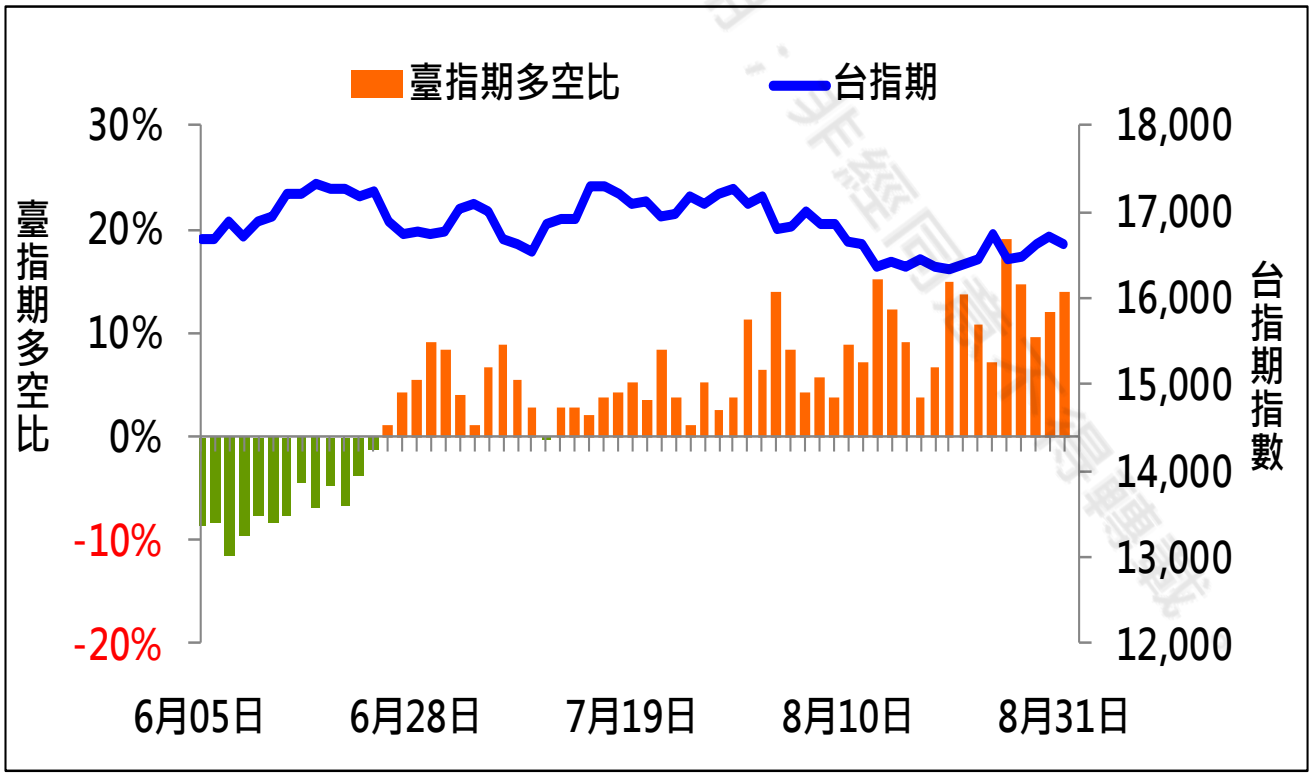
台指期貨暨選擇權日報

2023/8/31

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

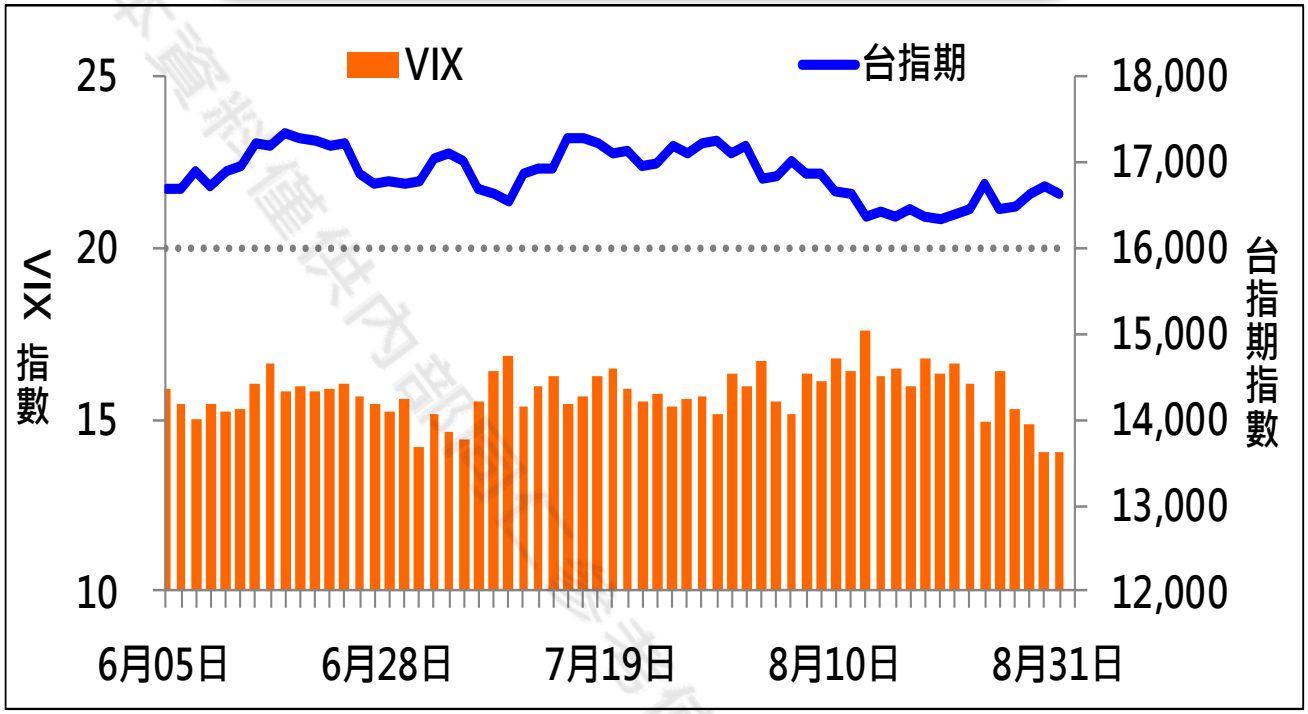
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

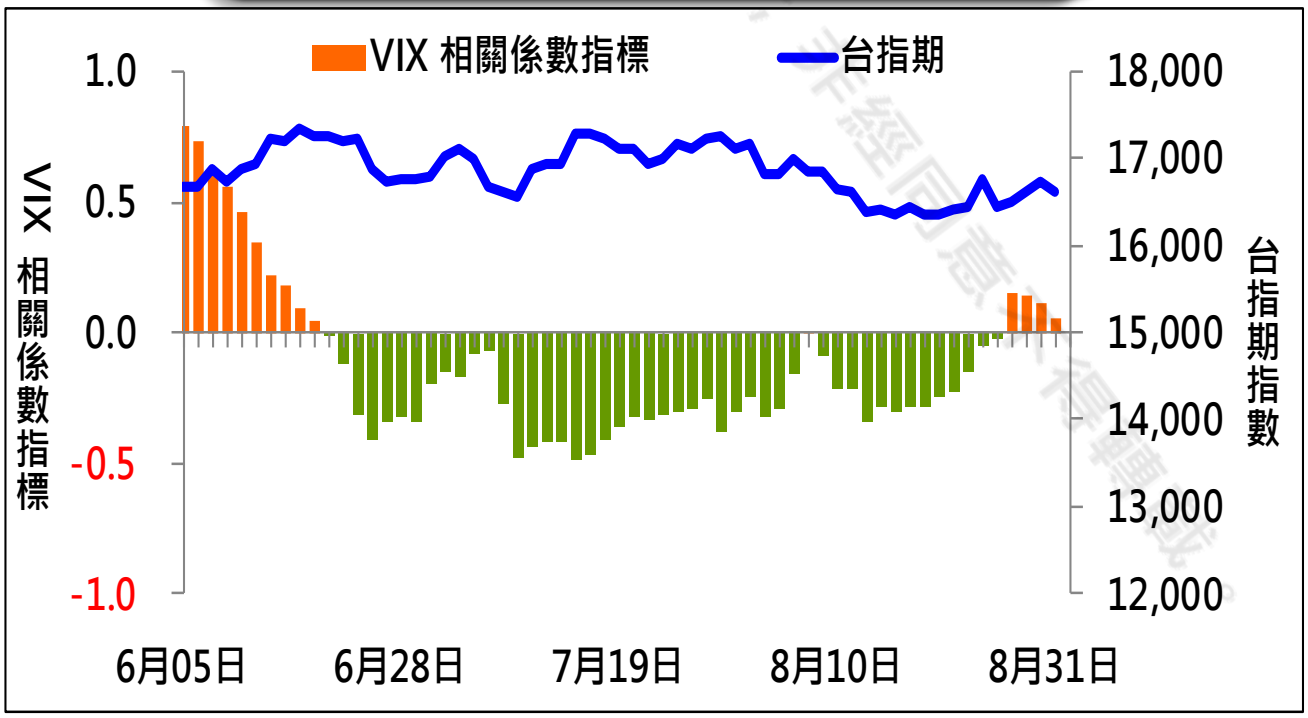
2023/8/31

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

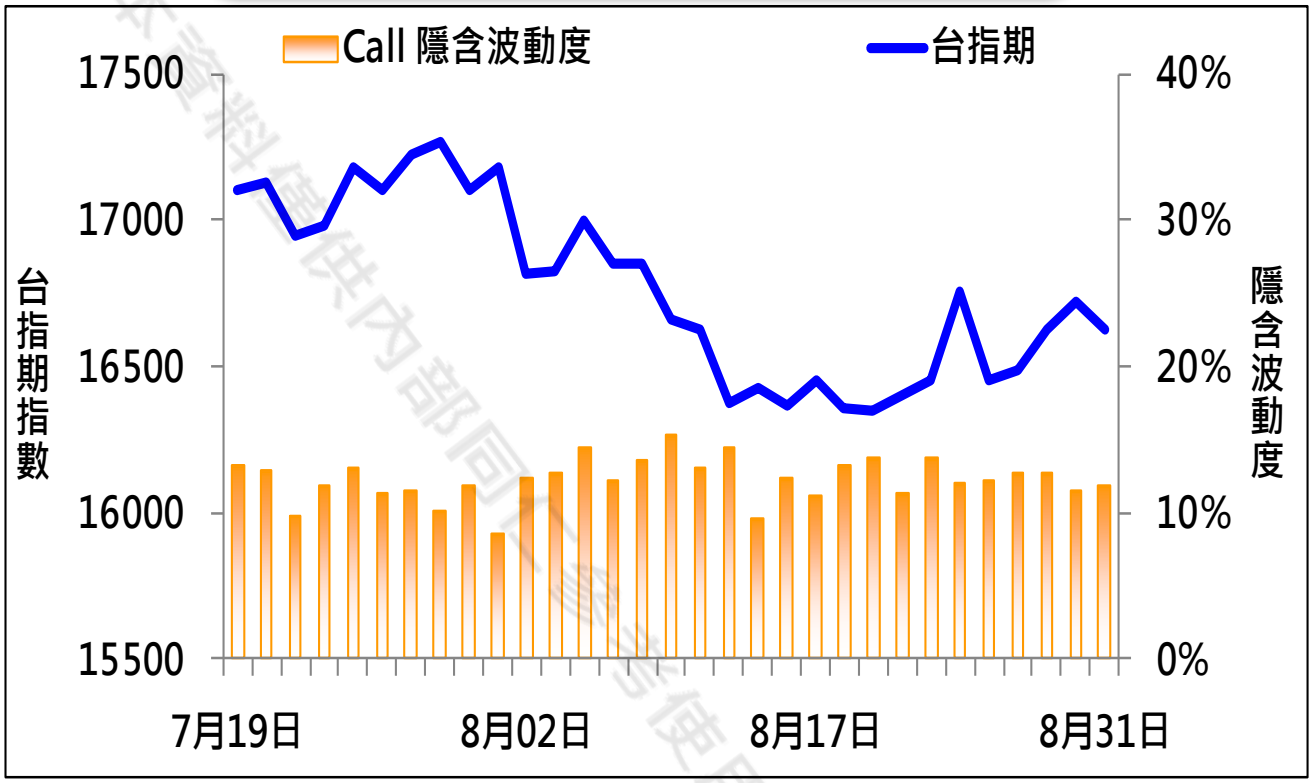


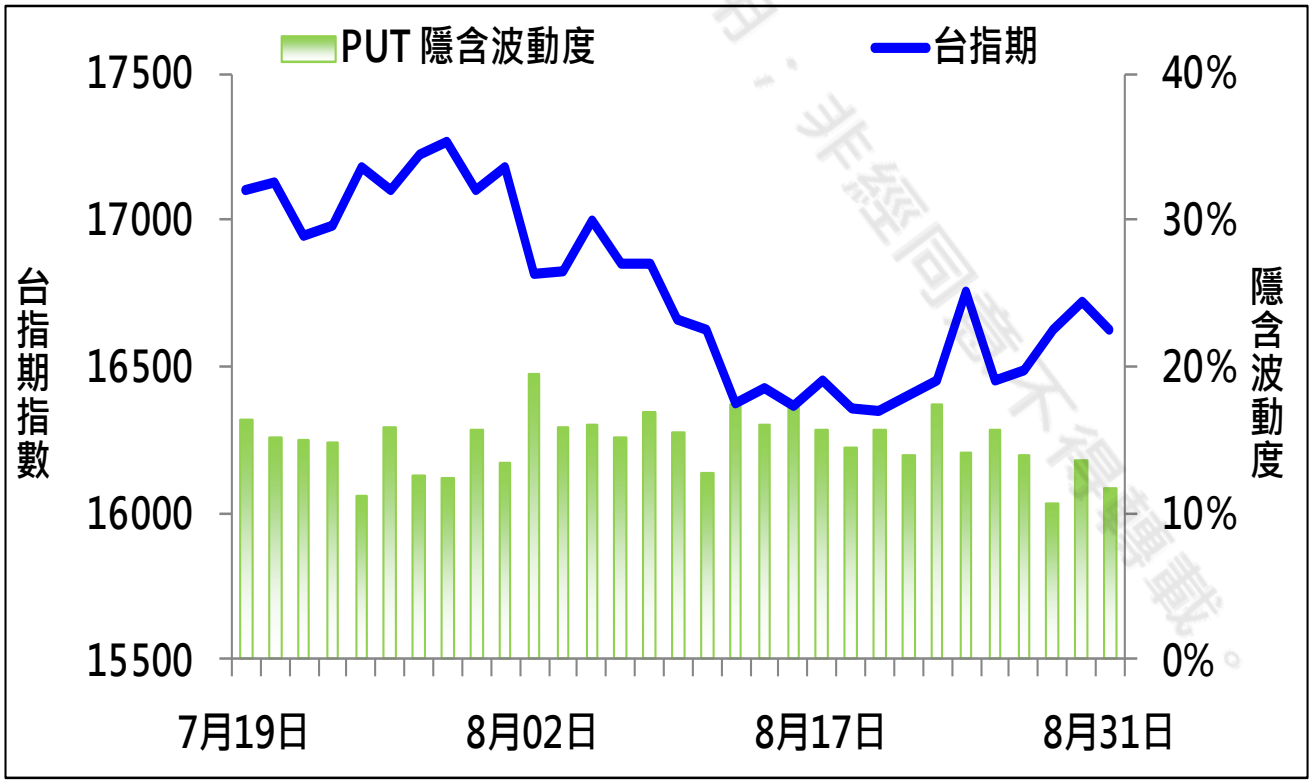
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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

2023/8/31

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

資料日期：2023/8/31　　結算日：2023/9/6

OI 增減	Call	202309W1 履約價	Put	OI 增減	
0	0	16,150	1,541	572	
-9	10	16,200	2,131	204	
2	22	16,250	3,839	1,976	
7	28	16,300	5,123	2,448	
0	16	16,350	4,350	2,861	※
14	101	16,400	5,590	2,853	
28	198	16,450	3,947	2,358	
255	486	16,500	5,548	2,086	
479	755	16,550	4,403	2,490	
703	1,446	16,600	5,723	2,132	
1,833	2,459	16,650	2,401	1,117	
3,320	4,216	16,700	2,695	880	
2,686	3,818	16,750	1,473	650	
4,005	5,704	16,800	731	231	
2,960	5,025	16,850	394	274	
※ 5,269	8,295	16,900	325	160	
2,286	4,142	16,950	148	85	
4,926	8,485	17,000	123	20	
1,531	4,804	17,050	10	1	
744	4,042	17,100	72	31	
189	1,443	17,150	9	1	
987	3,530	17,200	7	1	
1,061	1,864	17,250	0	0	
505	1,700	17,300	6	-1	
33,695	65,433	總計	71,175	27,652	
P/C	1.0878	||	增減	-0.2836	

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

2023/8/31

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

資料日期：2023/8/31　　結算日：2023/9/20

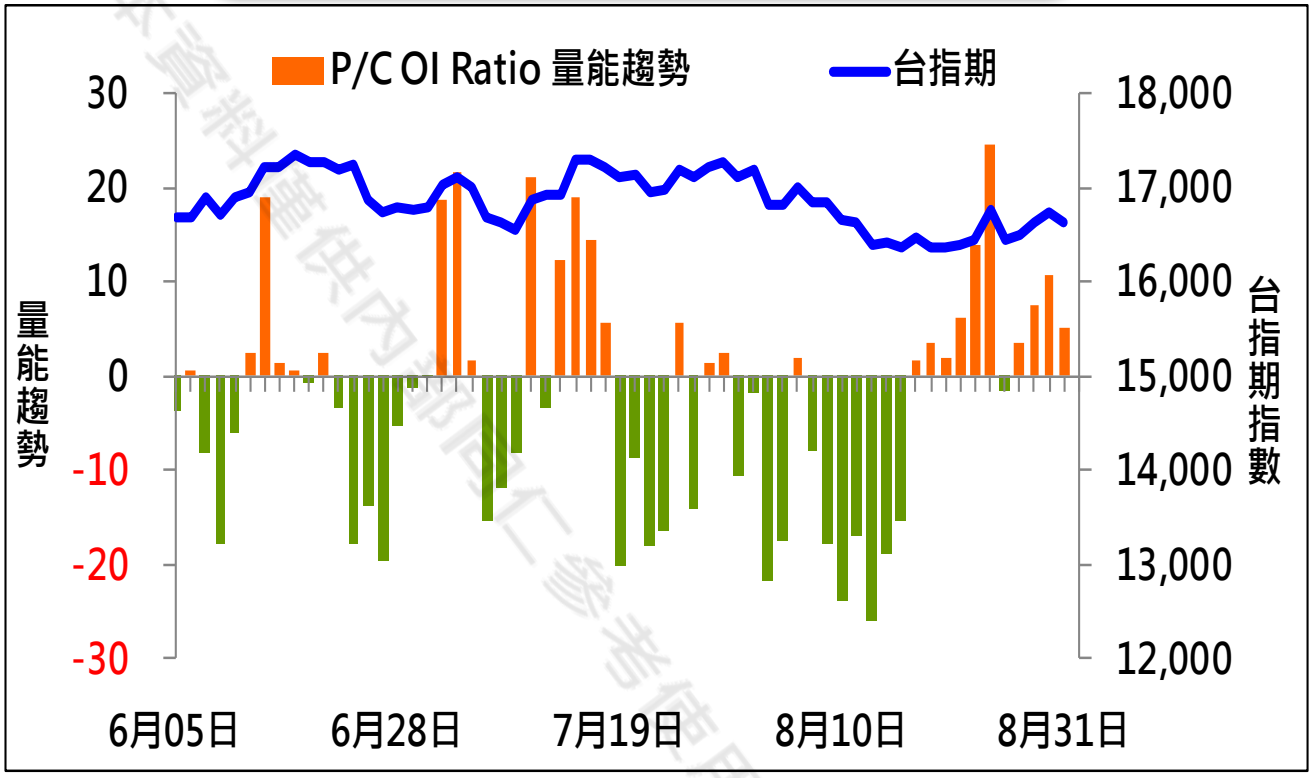
OI 增減	Call	202309 月 履約價	Put	OI 增減	
0	69	15,600	6,167	-39	
0	41	15,700	2,469	49	
0	98	15,800	3,406	-359	
0	26	15,900	3,138	-24	
1	140	16,000	9,384	-757	
1	157	16,100	4,872	1,269	※
-30	931	16,200	8,664	244	
331	1,803	16,300	6,827	7	
2	1,594	16,400	2,519	42	
81	1,833	16,500	2,865	230	
135	5,562	16,600	3,551	-113	
※ 832	2,934	16,700	1,205	20	
436	5,896	16,800	2,236	-404	
264	4,653	16,900	958	47	
420	9,425	17,000	962	25	
-137	5,465	17,100	127	-2	
655	7,764	17,200	170	-1	
813	7,021	17,300	80	-2	
-284	4,437	17,400	137	-26	
472	4,568	17,500	111	-1	
60	3,745	17,600	70	0	
-54	2,808	17,700	56	0	
3,402	93,415	總計	87,777	-174	
P/C	0.9396	||	增減	-0.0374	

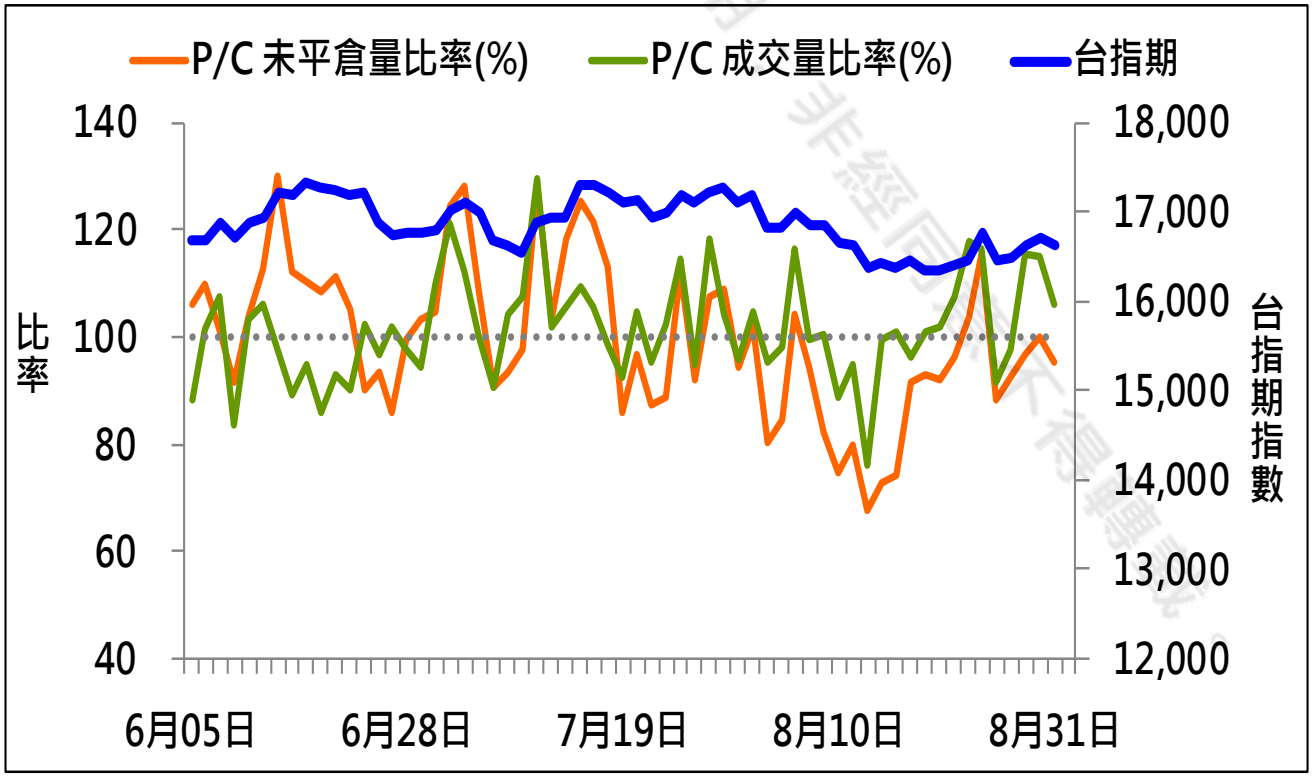
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

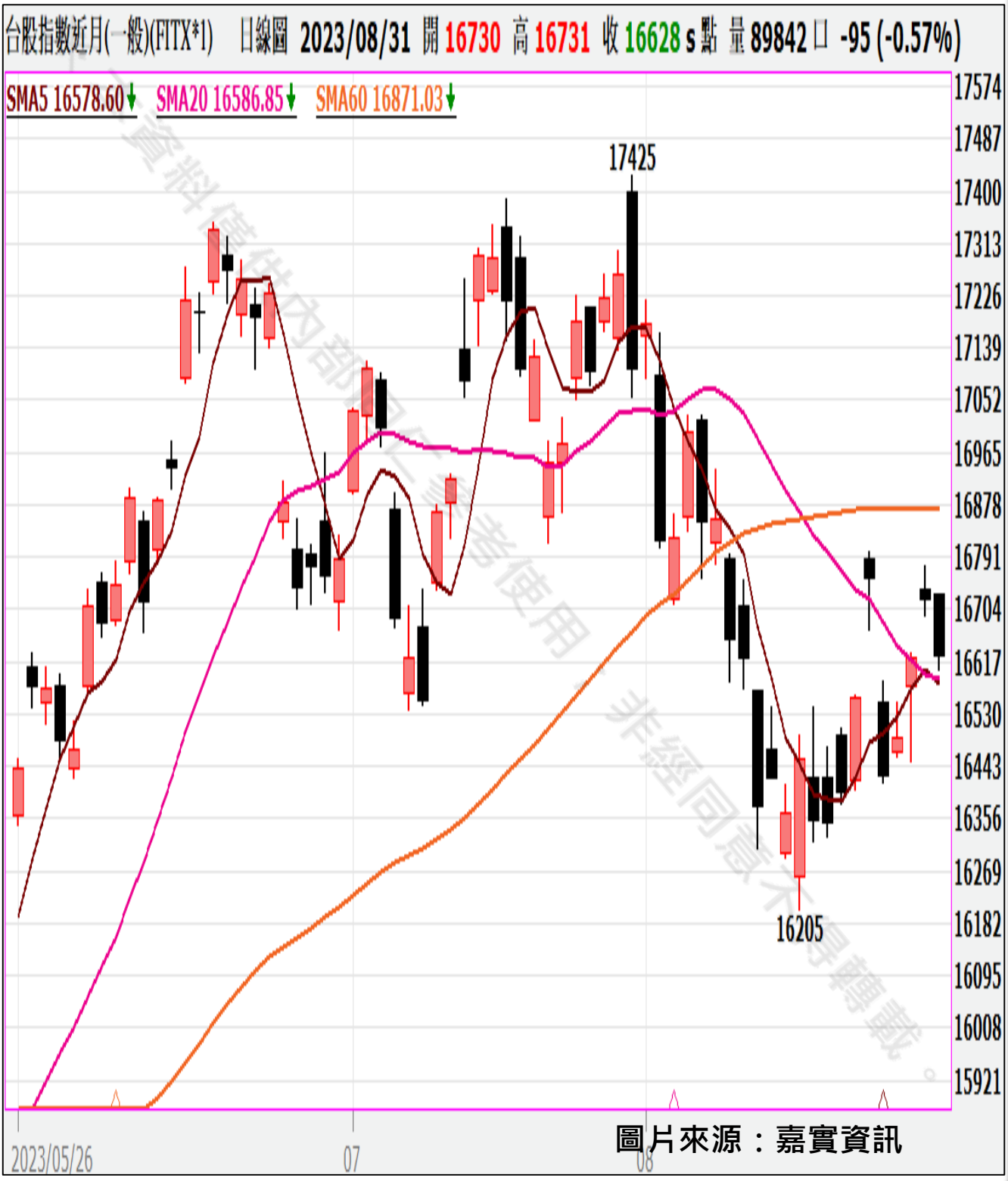
成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖





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。

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 (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