台指期貨暨選擇權日報

2023/10/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

10月19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	-5,306	2,860	-168	-73	52	-92
投信	1,606	229	165	-3	16	0
自營商	-2,379	-765	-172	61	-226	20

10月19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	2	3	16,767	1,965	24,440	2,897
投信	0	0	0	0	-132	0
自營商	-7	0	16,183	11,558	5,485	-558

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台積電	50.05	鴻海	-8.92
聯發科	8.75	南亞	-4.85
世芯-KY	3.72	亞德客-KY	-3.22
聯電	3.42	台化	-3.02
智邦	2.16	國泰金	-2.61
材料-KY	1.49	兆豐金	-2.24
京元電子	1.34	中信金	-1.94
健策	1.29	台塑化	-1.84
瑞昱	1.24	元大金	-1.81
佳世達	1.17	富邦金	-1.80
前十名合計	74.63	後十名合計	-32.24

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	43.2%	51.4%
電子期前十大市場佔比	42.1%	56.7%
金融期前十大市場佔比	72.3%	79.7%
非金電期前十大市場佔比	100.0%	92.9%

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

2023/10/20

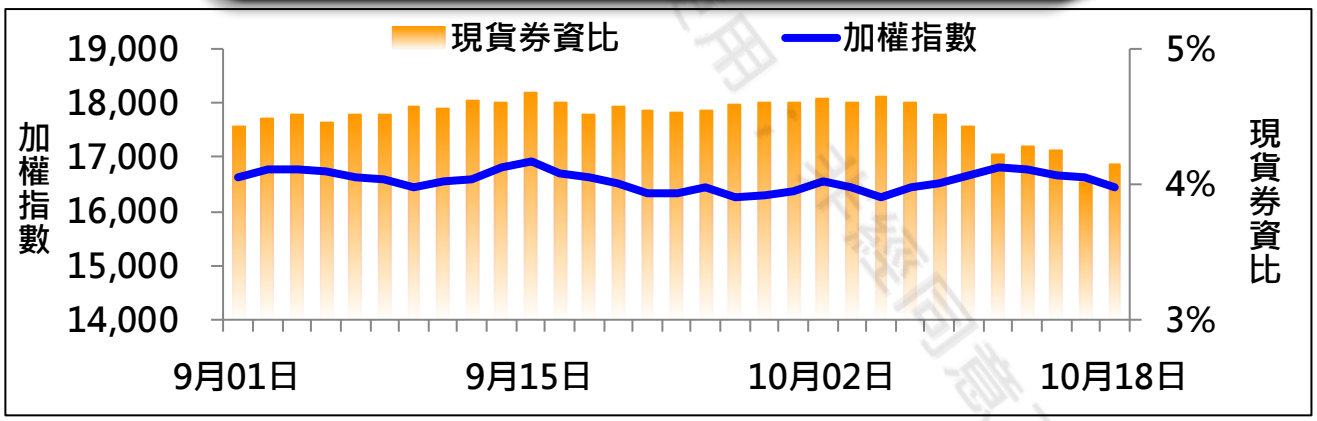
華南期貨 HUA NAN FUTURES

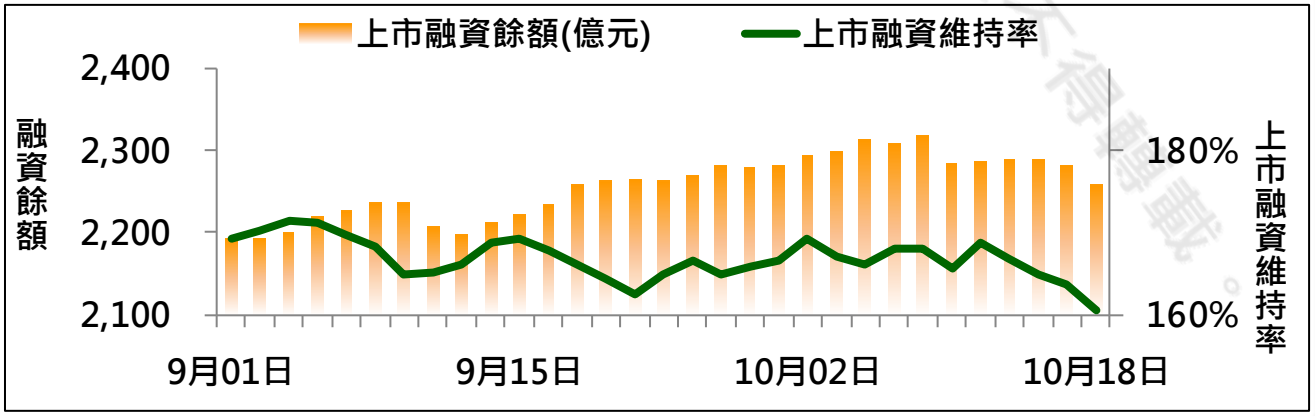
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
10月13日	-61.0	-468	409	-19.0	648	1,314
10月16日	-156.6	-1,420	-952	-39.0	523	-125
10月17日	-43.8	-1,226	194	-25.7	-975	-1,498
10月18日	-83.5	-8,166	-6,940	-77.4	-1,614	-639
10月19日	-128.0	-5,306	2,860	-4.9	-2,379	-765

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
10月13日	25,910	32,146	-6,236	2,949	1,794	1,155
10月16日	29,965	41,574	-11,609	-8,123	7,679	-15,802
10月17日	31,513	42,296	-10,783	14,076	-5,200	19,276
10月18日	14,802	21,543	-6,741	4,625	6,043	-1,418
10月19日	16,767	24,440	-7,673	16,183	5,485	10,698

現貨券資比 & 上市融資維持率





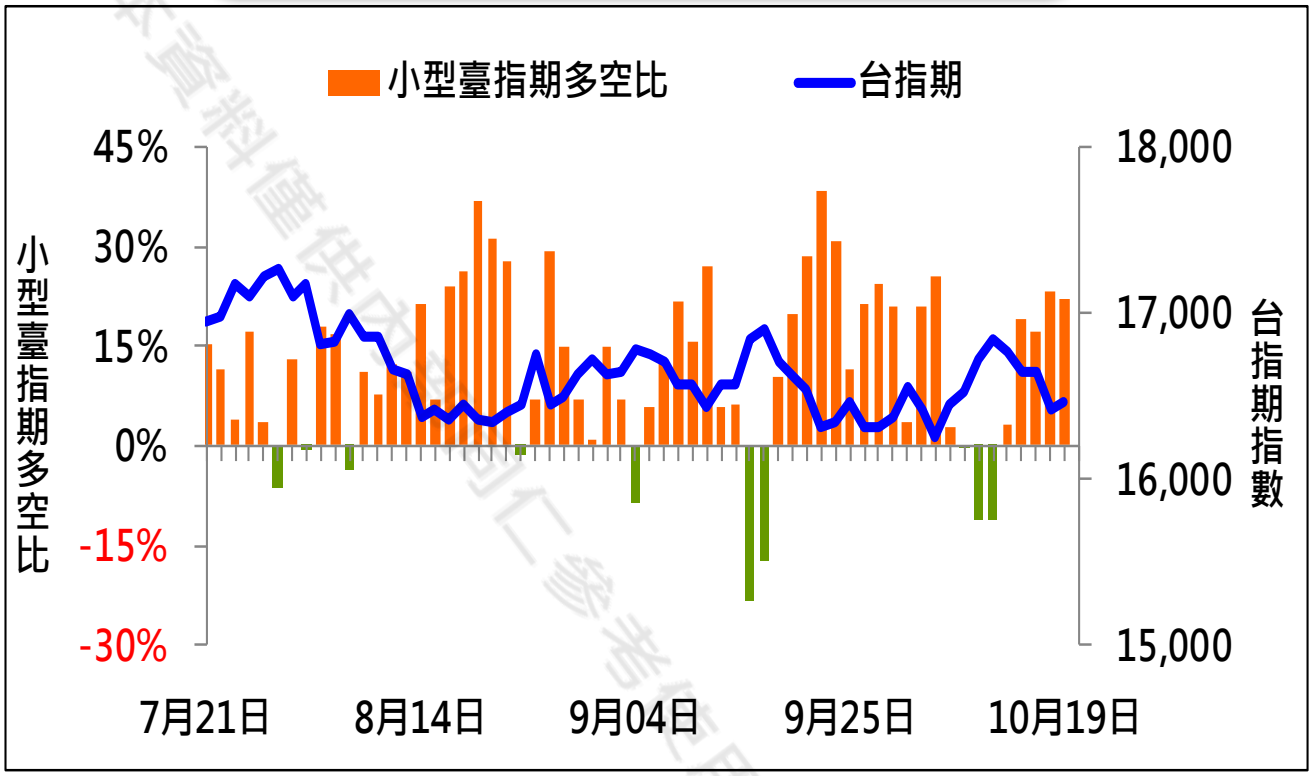
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

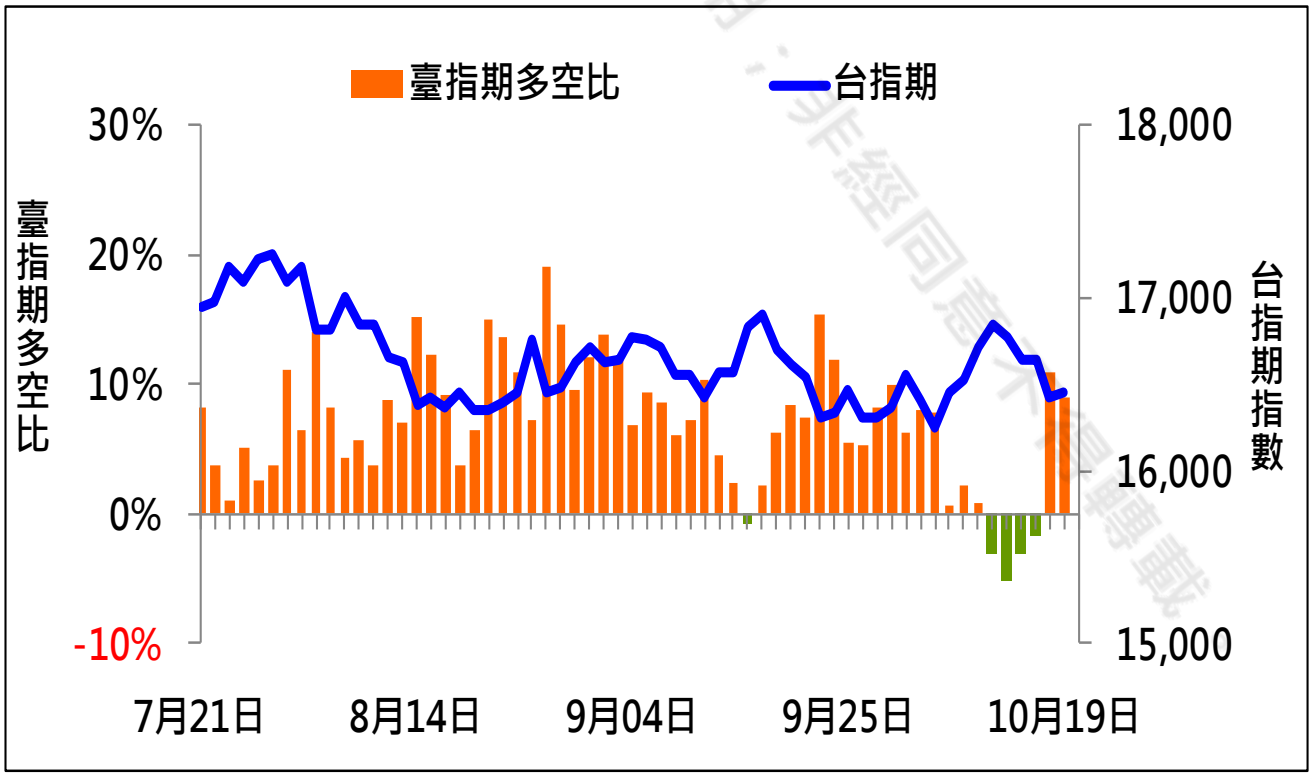
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

散戶多空比





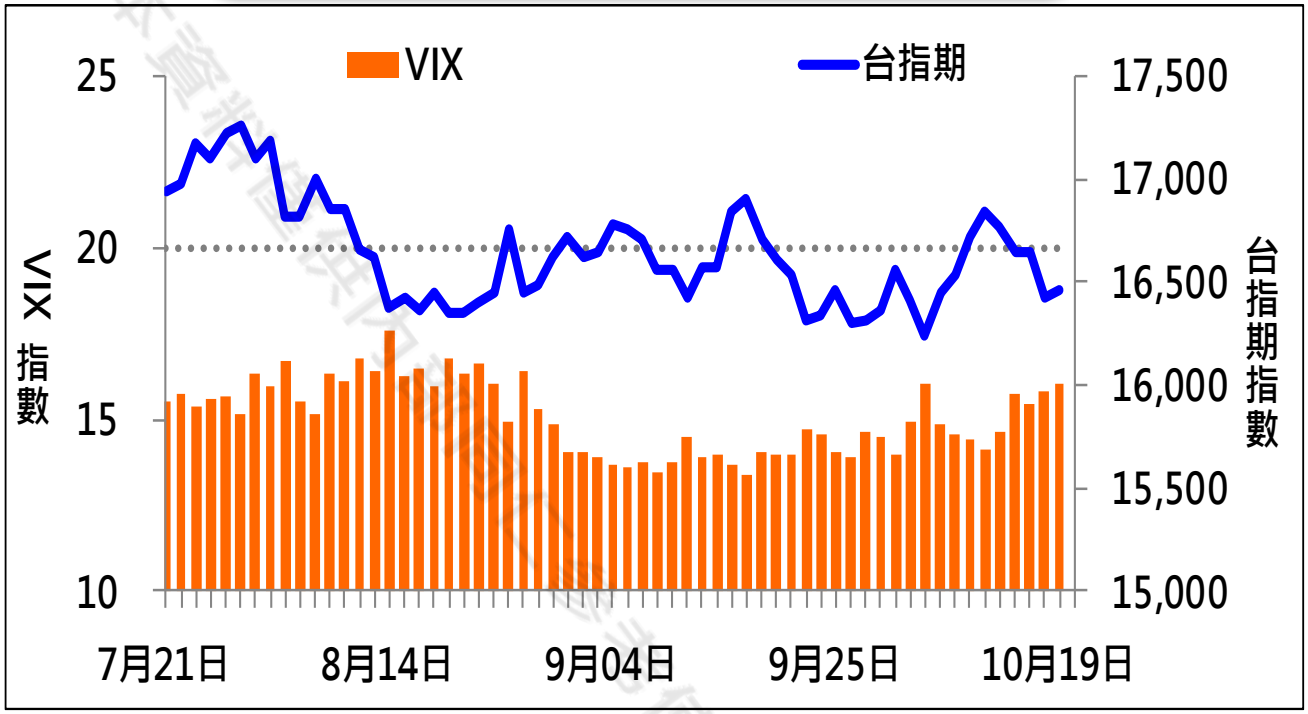
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

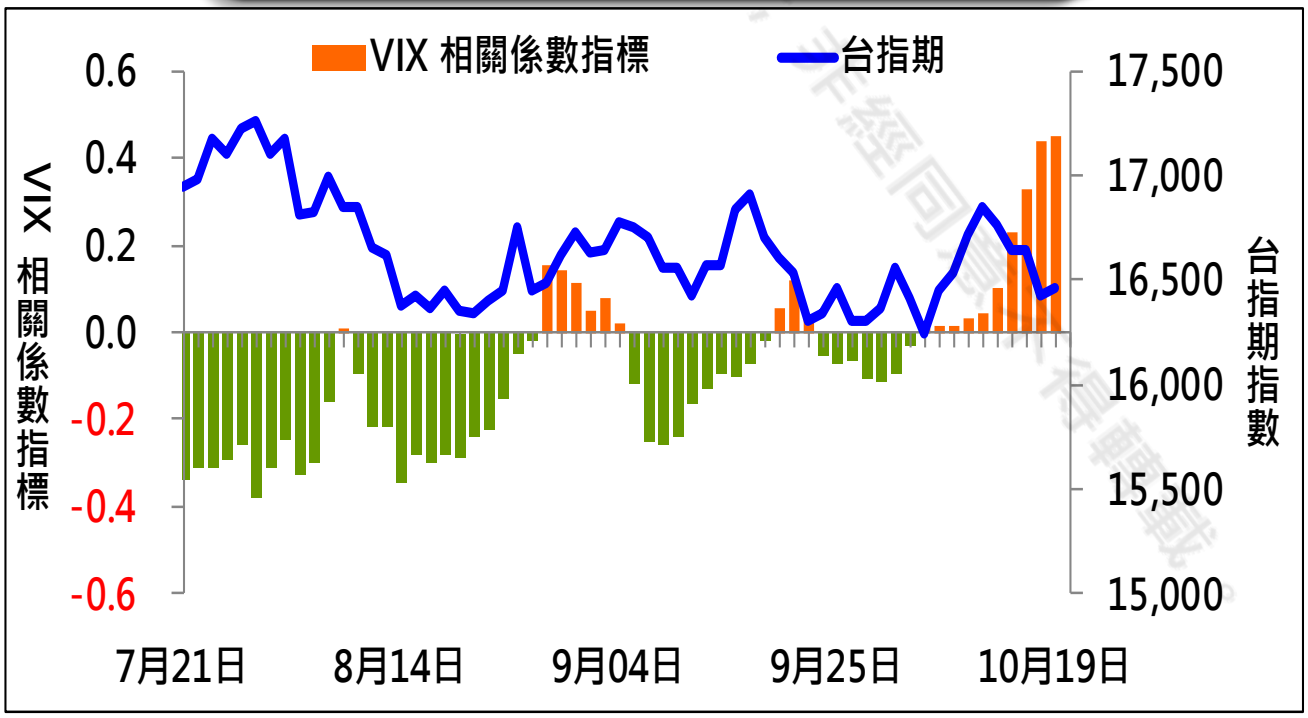
2023/10/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

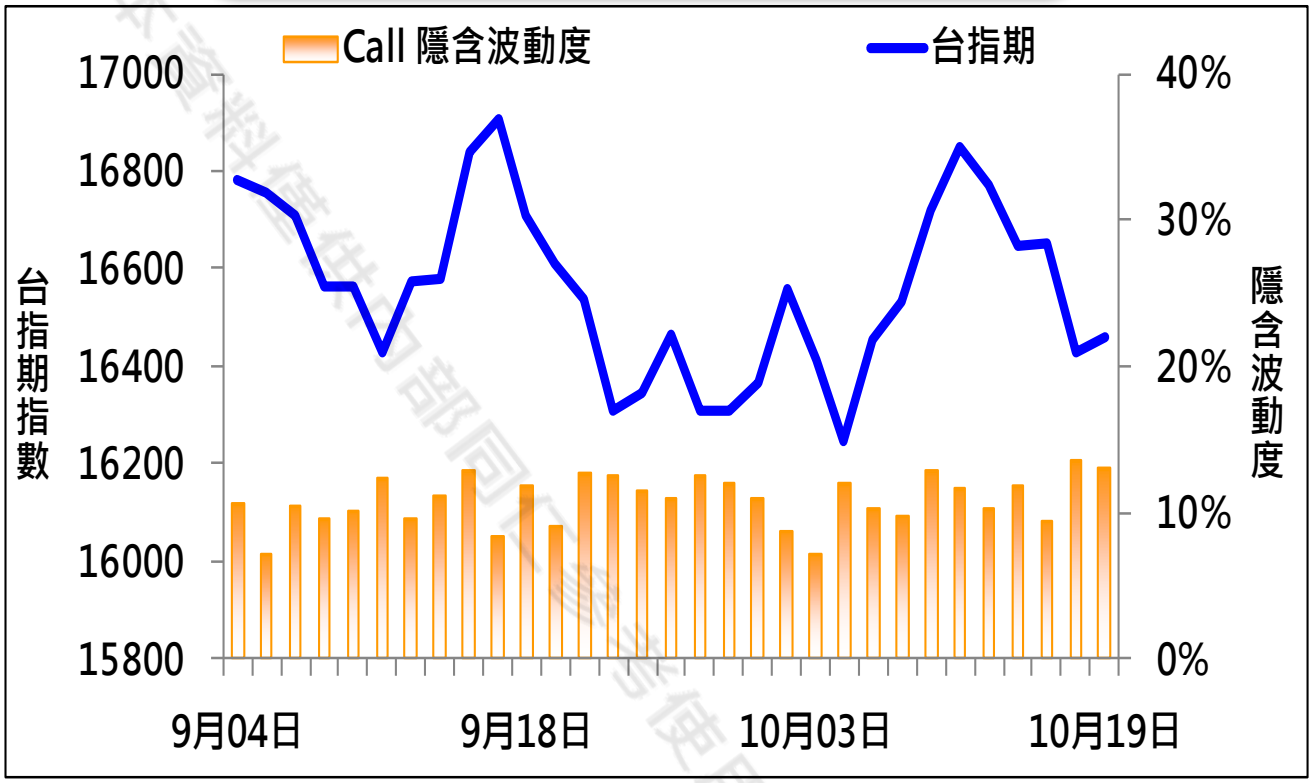


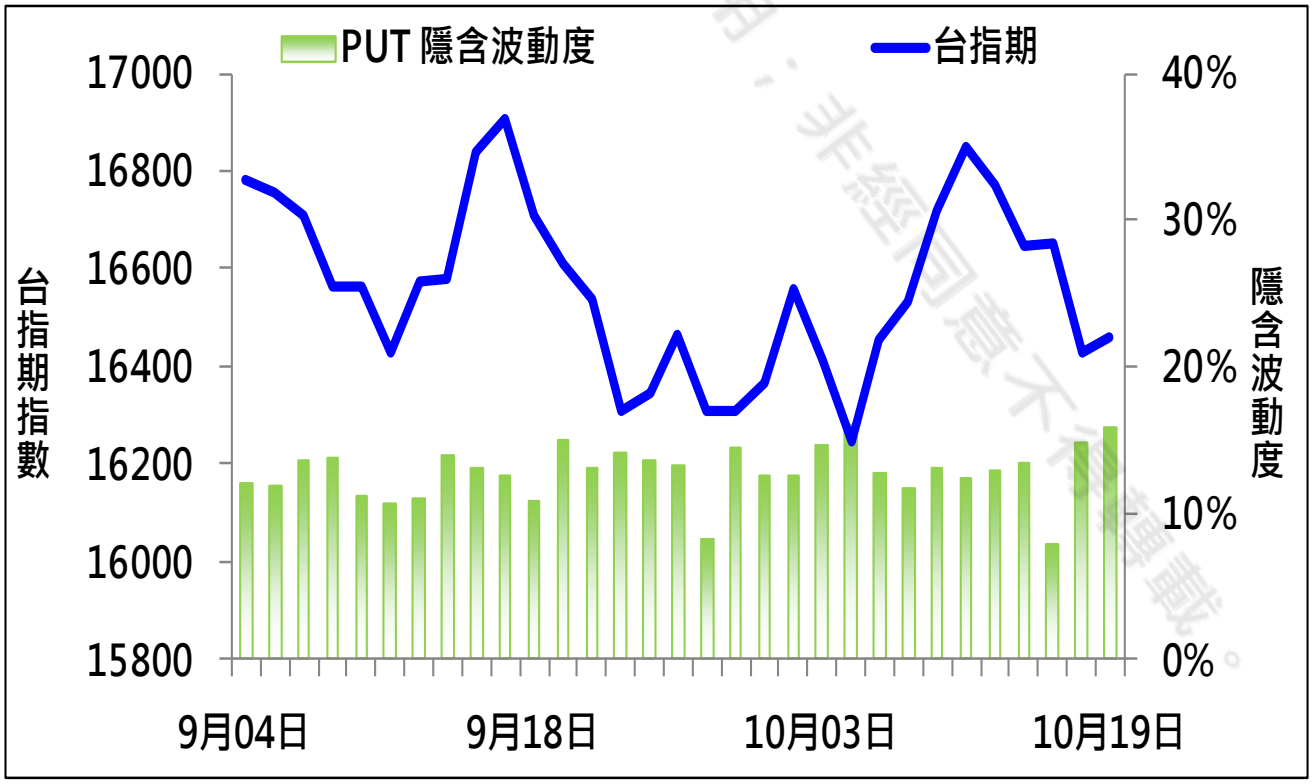
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2023/10/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

資料日期：2023/10/19　　結算日：2023/10/25

OI 增減	Call	202310W4 履約價	Put	OI 增減
4	6	16,050	2,980	2,096
95	111	16,100	5,283	3,557
24	34	16,150	3,597	2,089
86	111	16,200	7,435	3,839
165	225	16,250	5,050	2,359
217	347	16,300	4,830	1,660
380	490	16,350	3,284	1,303
2,112	2,452	16,400	3,807	1,690
1,062	1,987	16,450	2,851	899
1,779	3,668	16,500	2,412	-878
2,223	3,831	16,550	2,192	-1,411
※ 5,531	8,580	16,600	2,836	-604
2,360	4,981	16,650	996	249
3,559	8,166	16,700	910	275
3,095	6,953	16,750	374	91
5,133	8,638	16,800	322	43
3,919	6,459	16,850	100	16
2,251	6,835	16,900	88	12
365	3,870	16,950	26	-23
673	4,740	17,000	25	3
571	3,555	17,050	4	0
1,925	5,516	17,100	17	2
37,886	90,464	總計	78,491	35,409
P/C	0.8676	||	增減	0.0483

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

2023/10/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

資料日期：2023/10/19　　結算日：2023/11/15

OI 增減	Call	202311 月履約價	Put	OI 增減	
0	5	15,200	997	228	
0	7	15,300	1,192	561	
12	18	15,400	2,362	445	
0	16	15,500	5,081	1,923	※
1	14	15,600	2,306	802	
1	5	15,700	1,966	370	
5	8	15,800	4,336	640	
7	14	15,900	3,449	236	
11	54	16,000	6,599	860	
42	74	16,100	2,358	20	
24	89	16,200	3,522	-391	
43	239	16,300	2,510	-24	
189	587	16,400	4,124	-31	
464	1,246	16,500	3,153	186	
167	1,354	16,600	2,640	102	
899	3,119	16,700	1,343	54	
872	2,947	16,800	410	-55	
773	2,605	16,900	158	3	
587	6,131	17,000	107	5	
697	5,129	17,100	35	3	
1,061	5,508	17,200	39	-1	
※ 1,667	6,475	17,300	27	2	
273	3,641	17,400	10	0	
61	979	18,000	2	0	
8,486	55,922	總計	60,430	8,217	
P/C	1.0806	||	增減	-0.0201	

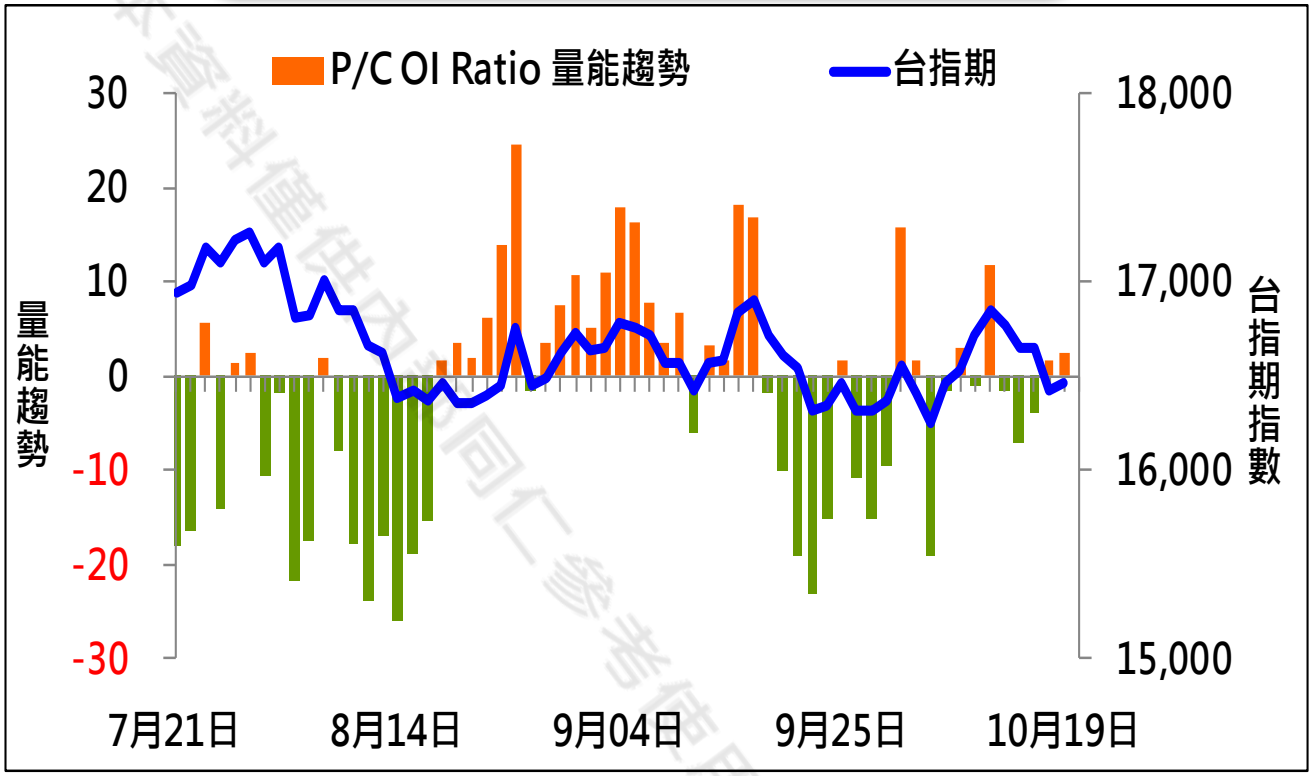
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

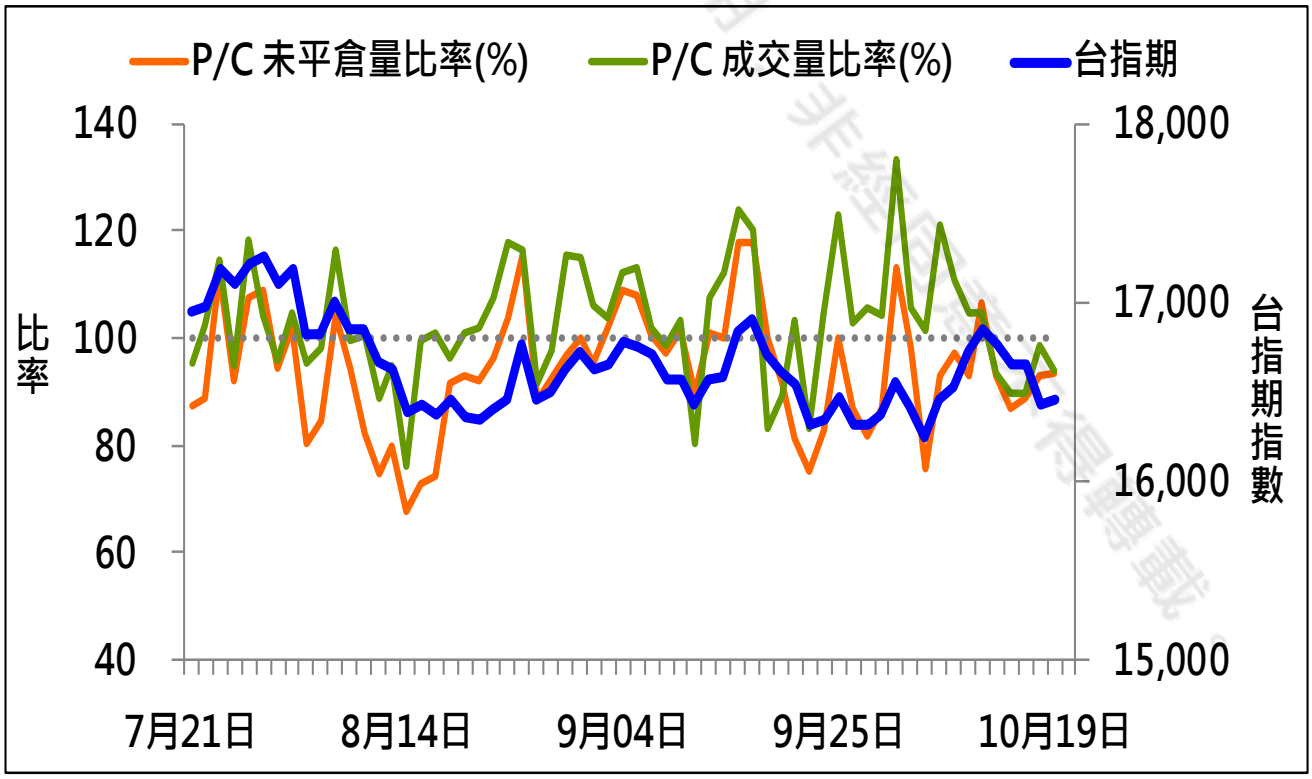
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

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

台指期貨暨選擇權日報

2023/10/20

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 (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 (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