台指期貨暨選擇權日報

2023/12/6

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

12月06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	-6,349	-443	-187	-35	-261	-12
投信	7,664	-885	160	0	8	0
自營商	-1,571	27	-32	12	-109	15

12月06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	-16	0	30,679	414	26,037	-548
投信	0	0	50	0	19	0
自營商	49	12	-1,516	-4,470	36,872	-3,046

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
廣達	5.56	大立光	-2.56
技嘉	3.05	矽力*-KY	-1.72
緯穎	2.52	富邦金	-1.40
兆豐金	2.47	統一	-1.27
中信金	2.25	聯電	-1.20
創意	2.14	南亞科	-1.19
緯創	1.85	群創	-1.16
金像電	1.81	台化	-1.12
聯詠	1.56	大同	-1.08
和泰車	1.42	聯發科	-1.02
前十名合計	24.63	後十名合計	-13.73

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	48.0%	49.6%
電子期前十大市場佔比	57.4%	59.8%
金融期前十大市場佔比	52.7%	76.7%
非金電期前十大市場佔比	96.5%	92.5%

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

2023/12/6

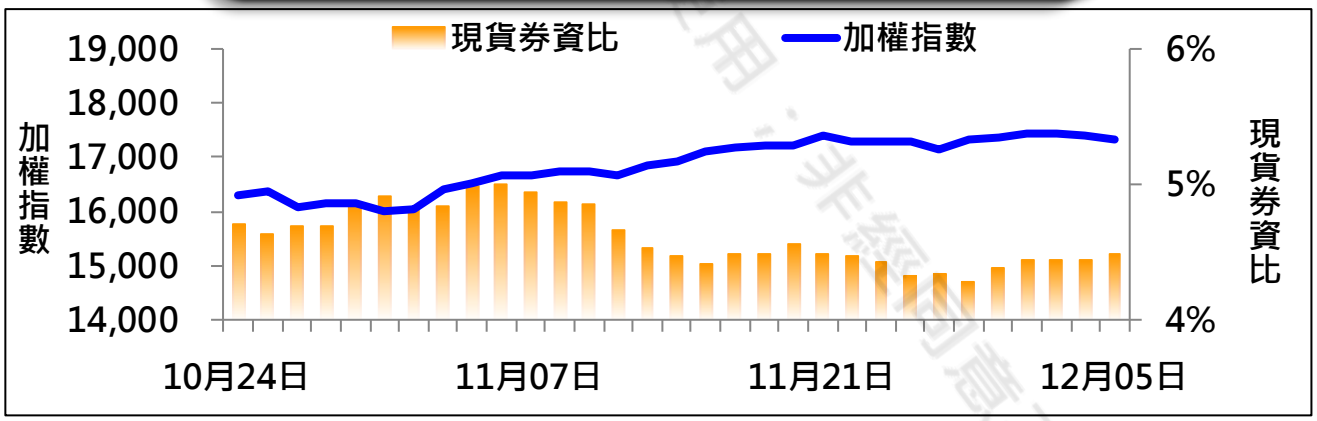
華南期貨 HUA NAN FUTURES

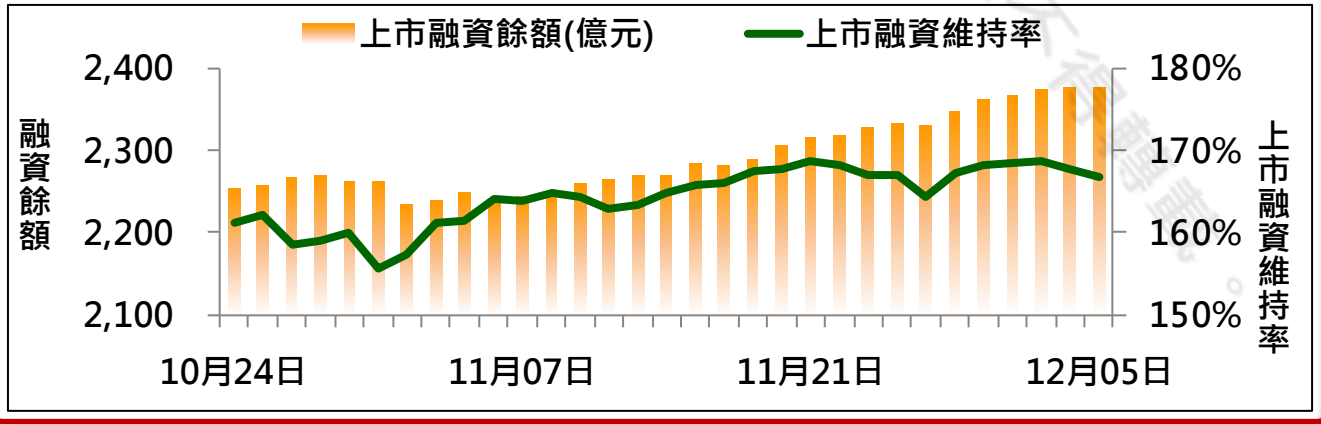
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
11月30日	80.2	-3,608	870	-26.5	-2,569	-759
12月01日	12.4	-832	2,776	-35.9	-2,825	-256
12月04日	-52.9	-4,353	-3,521	-33.9	-1,674	1,151
12月05日	-104.5	-5,906	-1,553	-60.5	-1,598	76
12月06日	2.3	-6,349	-443	-10.2	-1,571	27

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
11月30日	30,886	27,811	3,075	6,729	26,192	-19,463
12月01日	31,169	28,030	3,139	14,671	21,990	-7,319
12月04日	29,018	26,865	2,153	10,583	24,807	-14,224
12月05日	30,265	26,585	3,680	2,954	39,918	-36,964
12月06日	30,679	26,037	4,642	-1,516	36,872	-38,388

現貨券資比 & 上市融資維持率



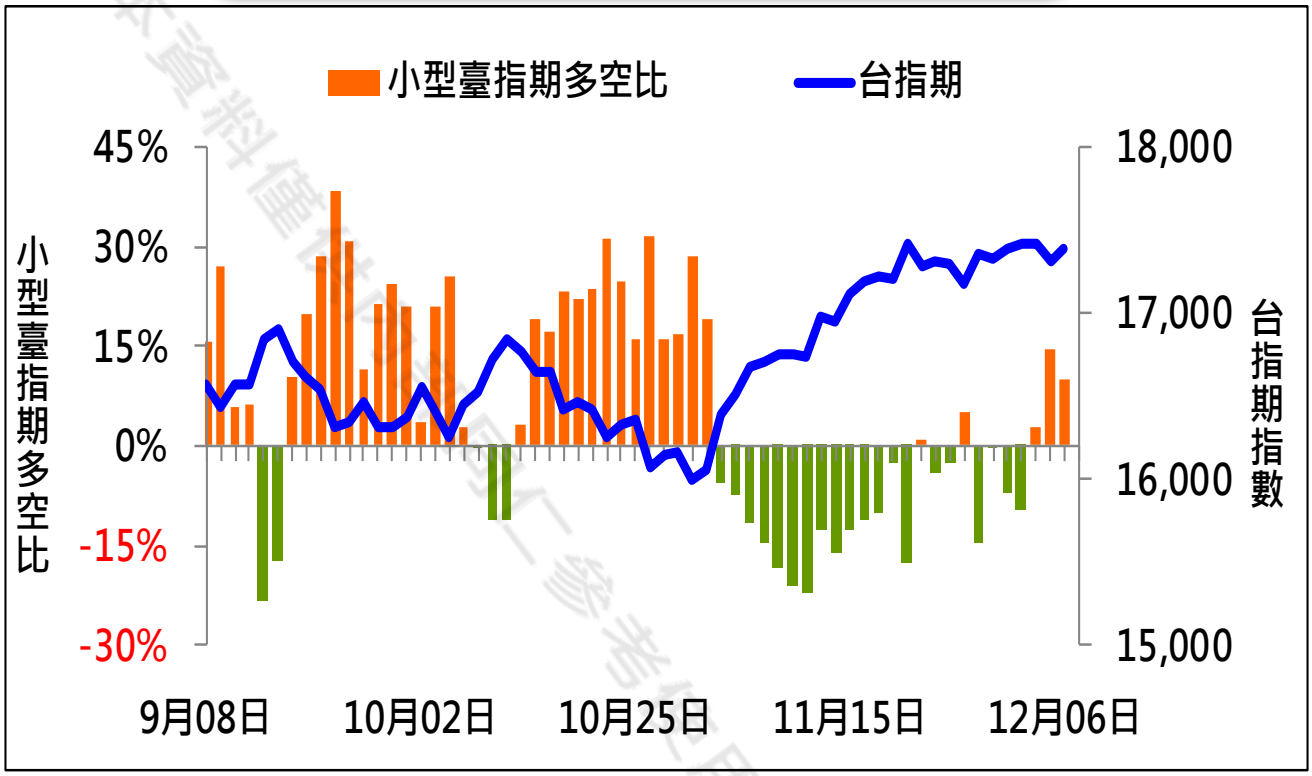


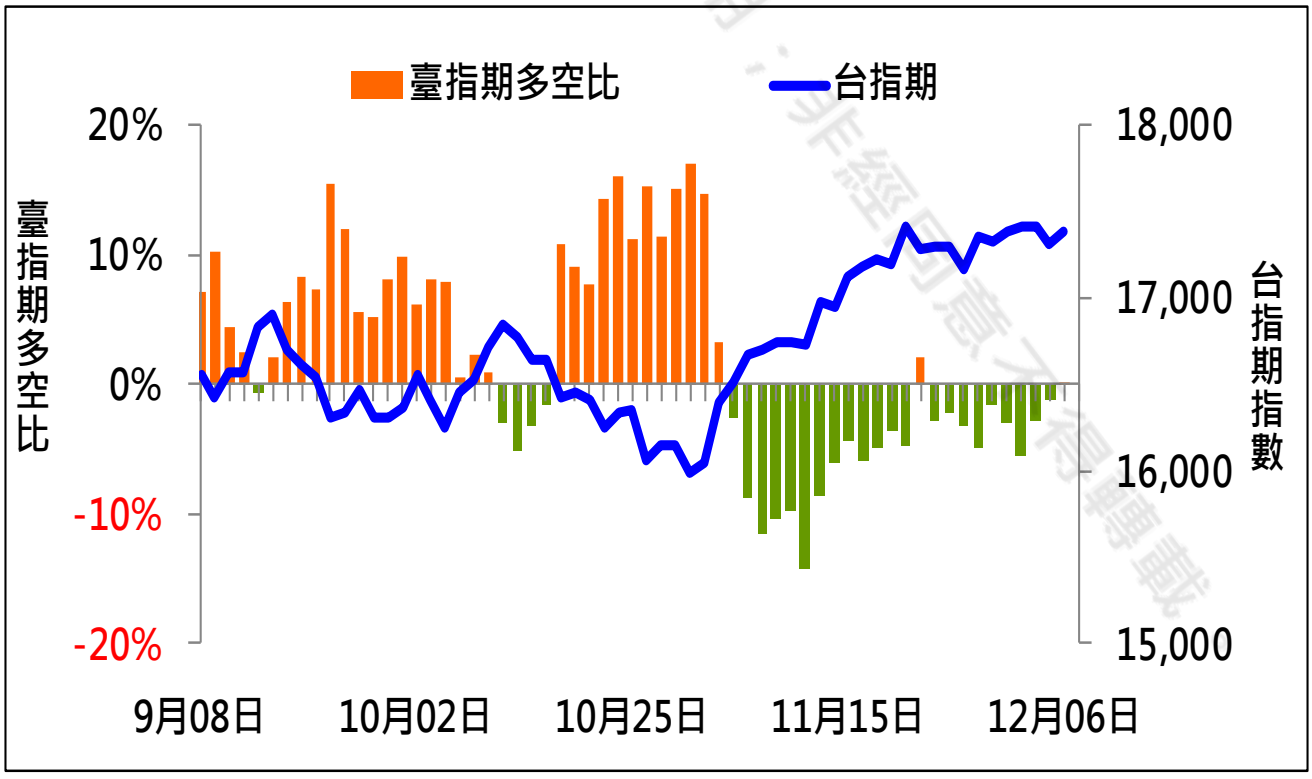
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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

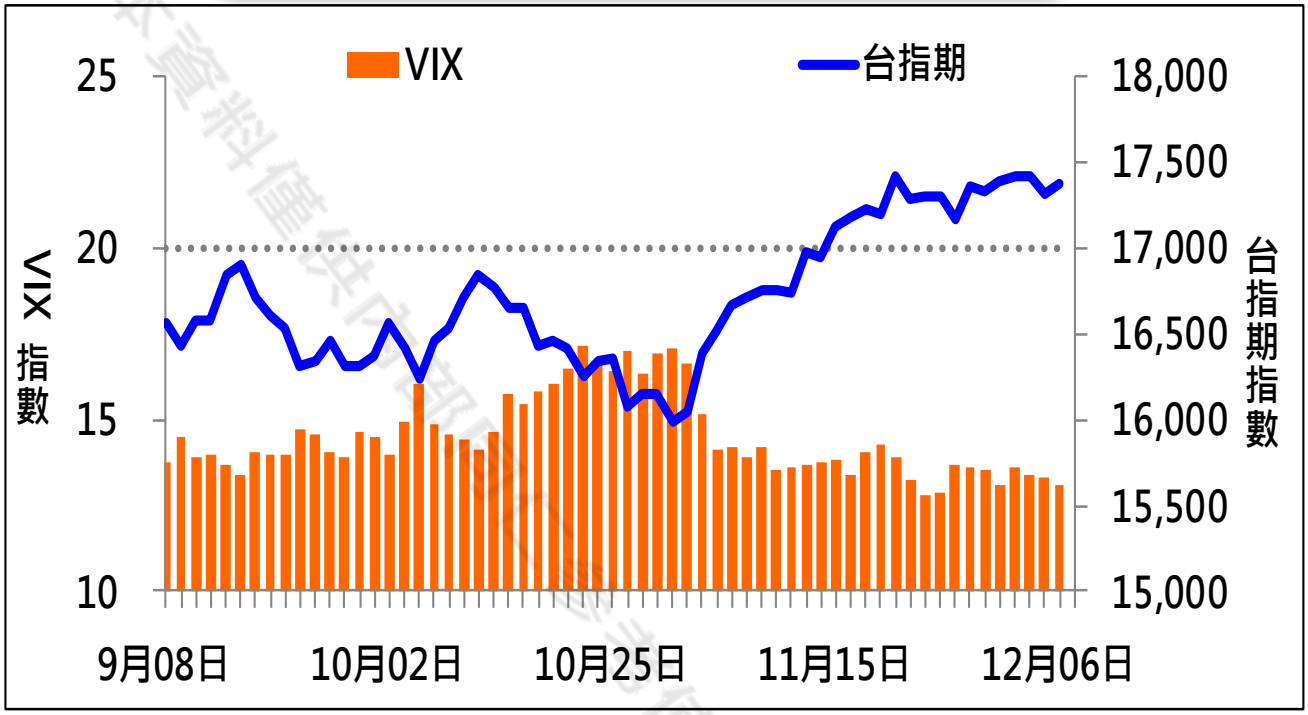
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

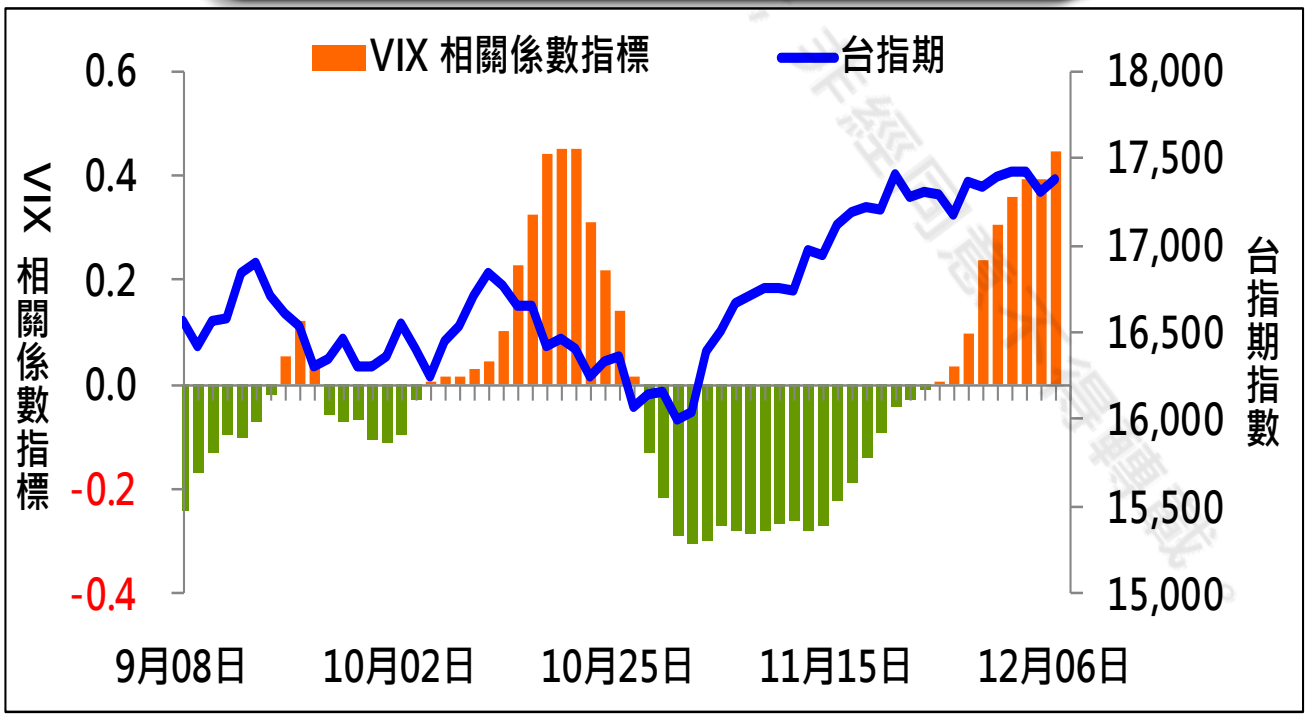
2023/12/6

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



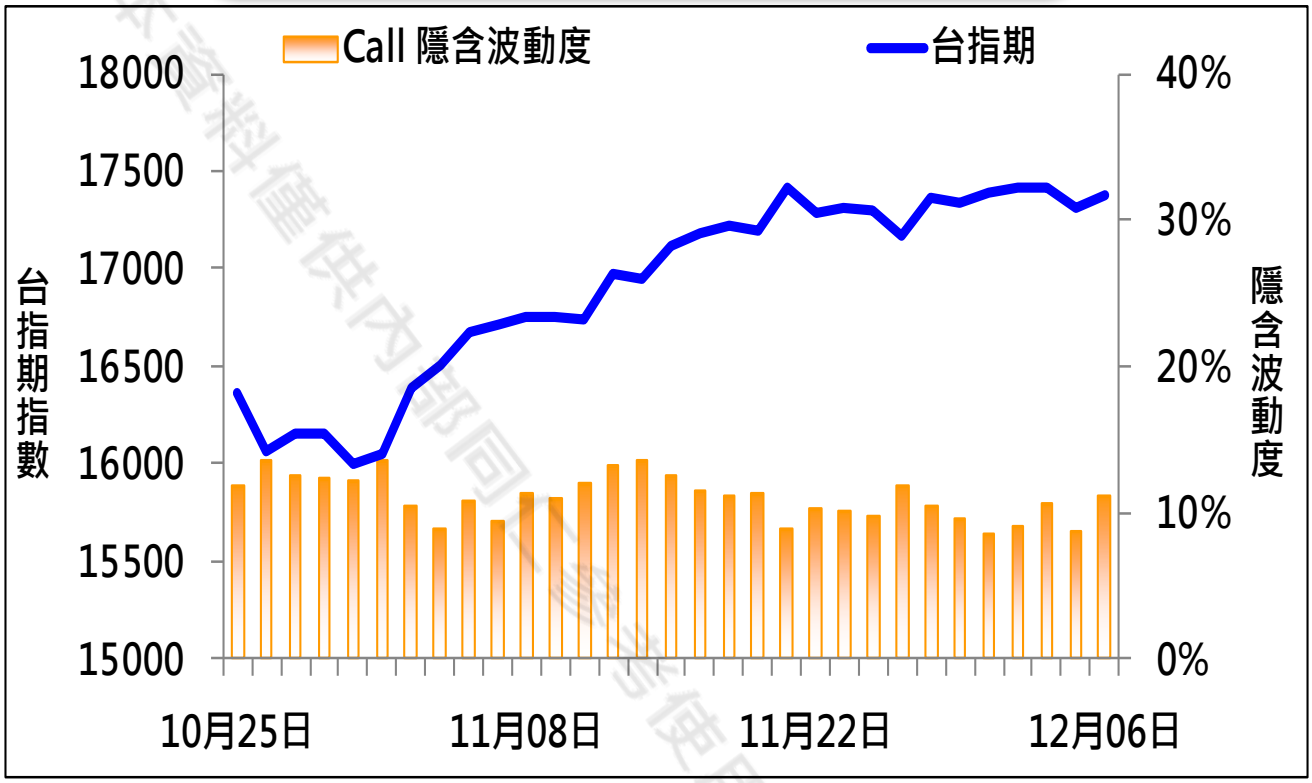
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

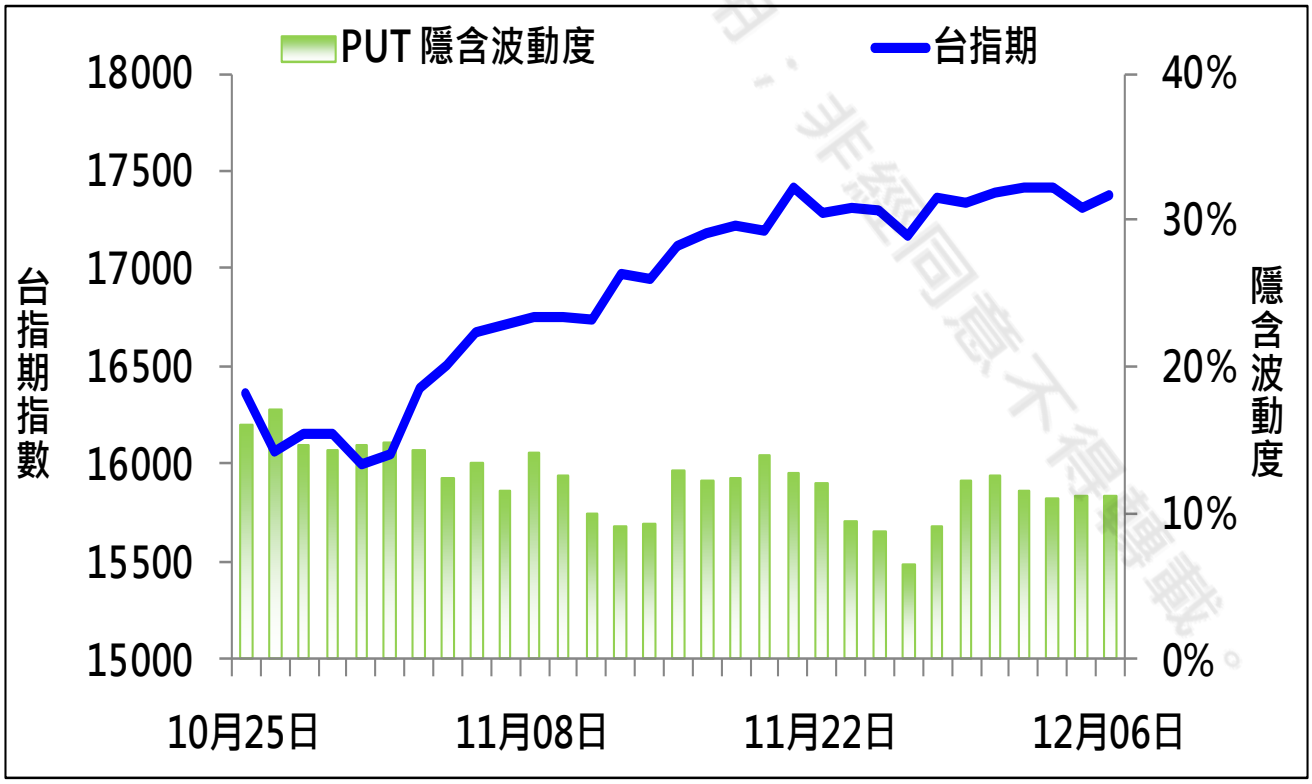
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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





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 (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

2023/12/6

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

資料日期：2023/12/6　　結算日：2023/12/13

OI 增減	Call	202312W2 履約價	Put	OI 增減	
7	14	16,800	1,727	623	
0	1	16,850	1,094	569	
0	18	16,900	2,237	1,466	
4	9	16,950	2,650	1,580	
22	43	17,000	4,776	2,331	※
-2	5	17,050	2,799	1,817	
40	81	17,100	3,012	1,957	
8	49	17,150	2,753	2,127	
116	452	17,200	2,953	1,735	
155	290	17,250	1,896	1,354	
222	878	17,300	2,480	1,793	
14	953	17,350	1,195	941	
673	1,692	17,400	1,142	862	
1,868	2,344	17,450	429	314	
1,987	3,204	17,500	612	212	
2,605	3,447	17,550	212	117	
2,034	3,897	17,600	156	62	
※ 3,652	5,844	17,650	24	9	
2,946	6,371	17,700	76	31	
1,108	2,412	17,750	8	6	
1,641	3,196	17,800	9	7	
-183	964	17,850	1	0	
758	1,243	17,900	3	-1	
23,331	43,760	總計	36,145	21,733	
P/C	0.8260	||	增減	0.1205	

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

2023/12/6

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

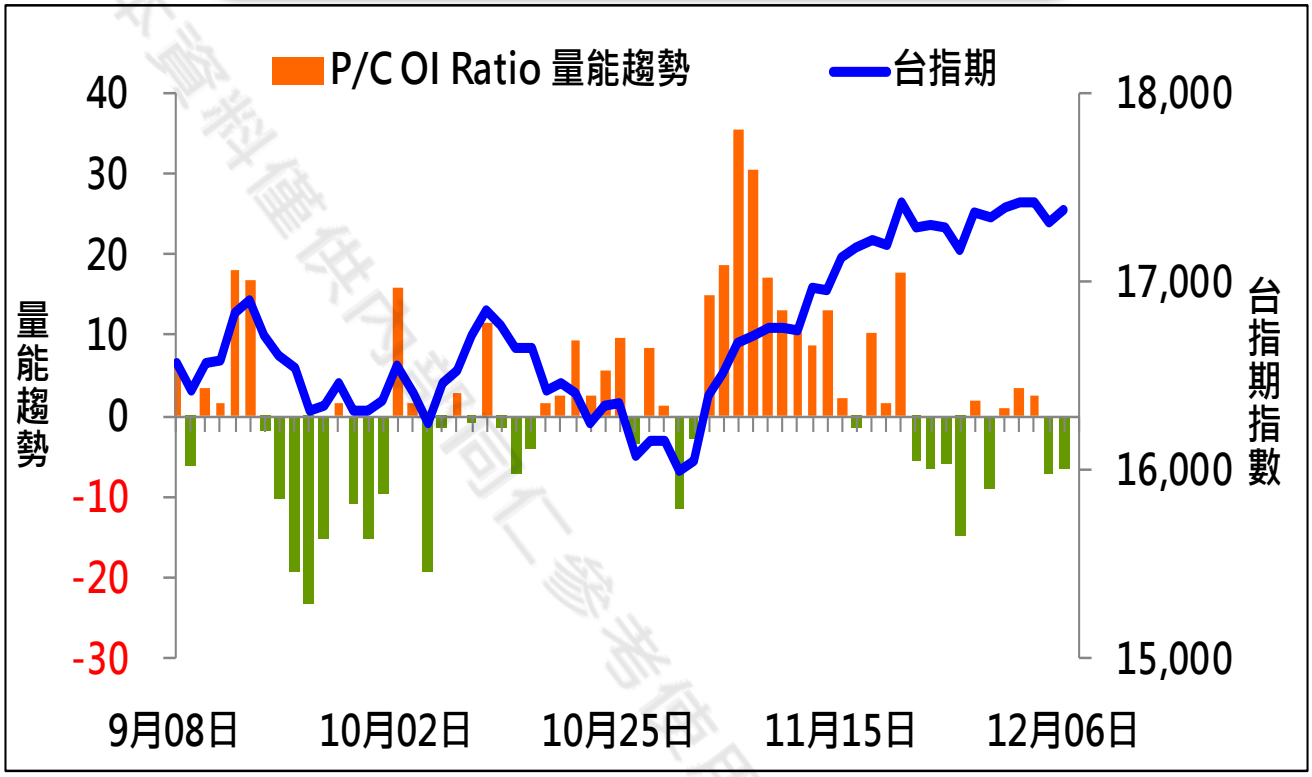
	OI 增減	Call	202312 月	Put	OI 增減	
	-1	314	16,500	8,001	-442	
	2	516	16,600	4,330	-12	
	-442	1,039	16,700	7,435	-87	
	-3	3,290	16,800	7,828	1,965	※
	0	0	16,850	424	424	
	-129	1,774	16,900	7,756	-45	
	0	0	16,950	210	210	
	-36	2,772	17,000	7,594	182	
	3	3	17,050	406	406	
	26	3,954	17,100	7,152	-287	
	0	0	17,150	347	347	
	-752	4,012	17,200	5,058	486	
	42	42	17,250	252	252	
	-85	6,612	17,300	4,111	-694	
	80	80	17,350	247	247	
	100	5,930	17,400	2,319	-521	
	115	115	17,450	113	113	
	-417	9,436	17,500	905	60	
	251	251	17,550	65	65	
	-1,692	7,644	17,600	709	-46	
	239	239	17,650	6	6	
	613	8,394	17,700	464	17	
※	1,257	1,257	17,750	0	0	
	111	10,881	17,800	398	17	
	-348	9,253	17,900	226	-24	
	-306	13,600	18,000	58	8	
	150	3,389	18,100	54	-9	
	-2,062	118,783	總計	138,570	1,207	
	P/C	1.1666	||	增減	0.0299	

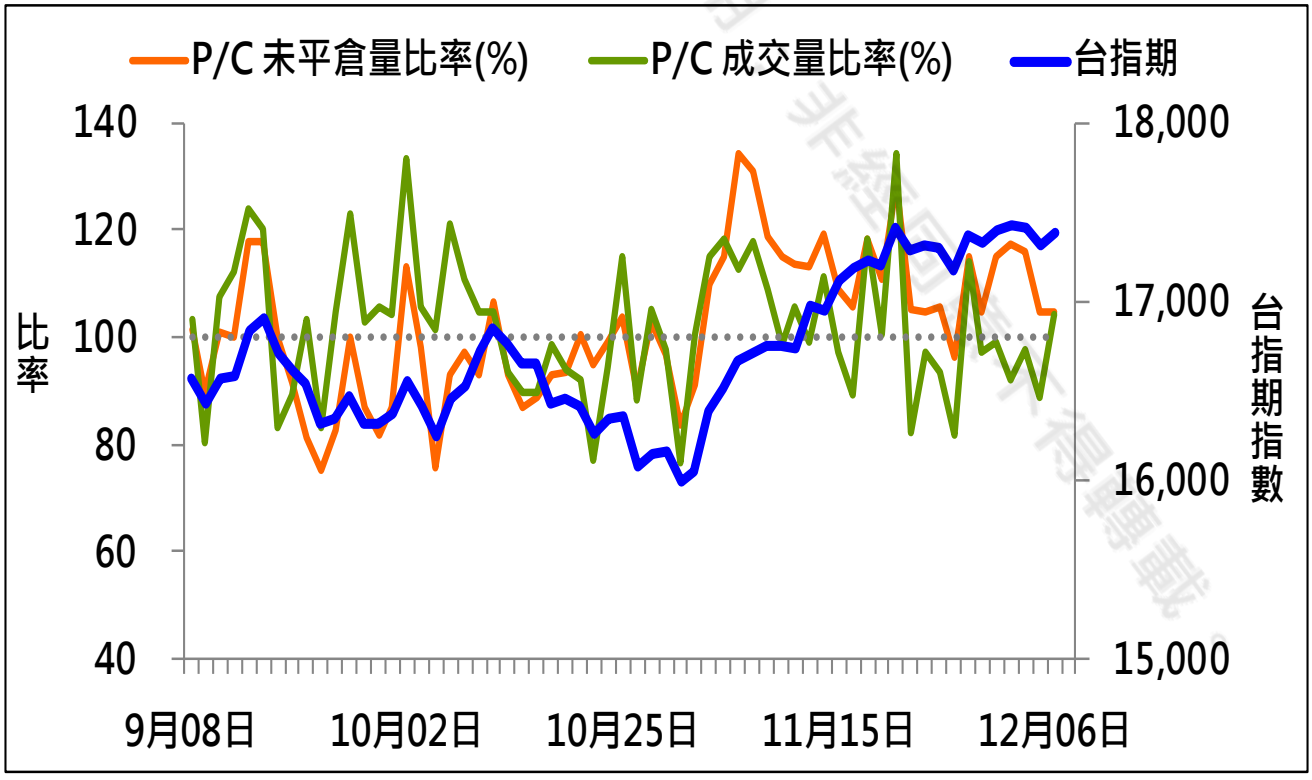
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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