台指期貨暨選擇權日報

2023/12/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

12月20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	-11,465	5,758	-6	129	-539	17
投信	7,994	158	172	0	8	0
自營商	-1,486	-3,445	-182	-103	-28	-17

12月20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	4	24	15,437	-17,557	22,598	-14,318
投信	0	0	0	-50	-42	-61
自營商	-17	-22	-3,786	14,510	3,894	-9,372

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
鴻海	8.86	聯發科	-4.60
廣達	8.03	中信金	-2.89
華碩	6.05	智邦	-2.87
仁寶	4.79	兆豐金	-1.80
英業達	4.53	遠傳	-1.77
宏碁	3.80	合庫金	-1.65
矽力*-KY	3.43	和泰車	-1.60
緯穎	2.52	富邦金	-1.40
台達電	2.49	瑞昱	-1.39
緯創	2.04	華南金	-1.31
前十名合計	46.54	後十名合計	-21.28

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	56.3%	59.4%
電子期前十大市場佔比	62.9%	65.7%
金融期前十大市場佔比	49.3%	83.9%
非金電期前十大市場佔比	92.9%	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

2023/12/20

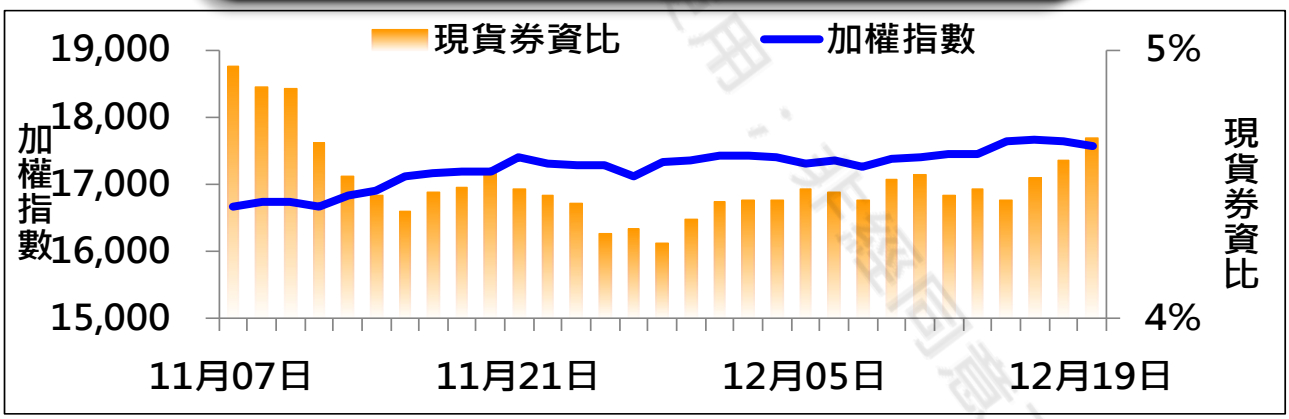
華南期貨 HUA NAN FUTURES

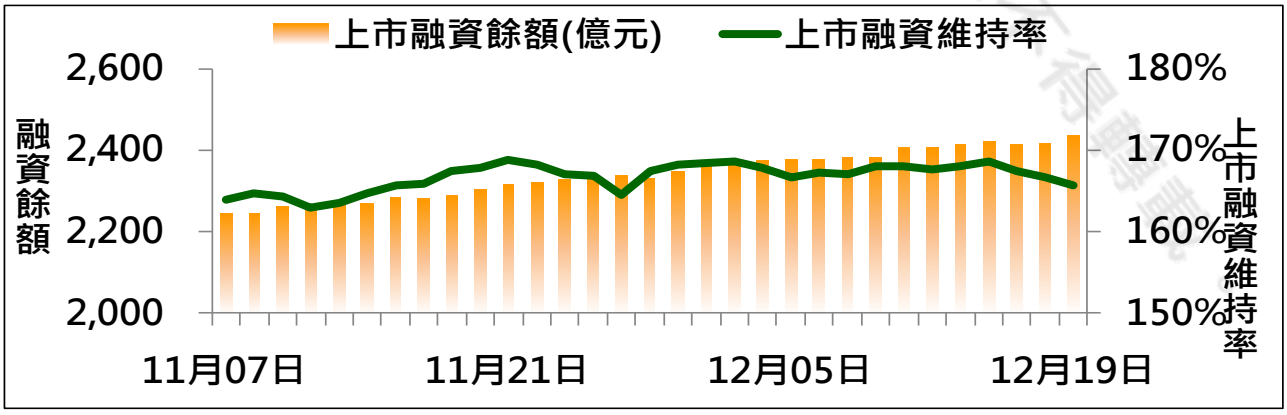
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
12月14日	338.2	-9,355	804	-39.3	-584	550
12月15日	211.7	-8,253	1,102	-48.4	-1,657	-1,073
12月18日	7.4	-12,100	-3,847	-73.9	-844	813
12月19日	1.6	-17,223	-5,123	-78.1	1,959	2,803
12月20日	246.1	-11,465	5,758	-112.7	-1,486	-3,445

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
12月14日	33,520	28,939	4,581	-9,501	21,986	-31,487
12月15日	31,746	29,638	2,108	-537	7,575	-8,112
12月18日	31,242	31,730	-488	-4,510	6,309	-10,819
12月19日	32,994	36,916	-3,922	-18,296	13,266	-31,562
12月20日	15,437	22,598	-7,161	-3,786	3,894	-7,680

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

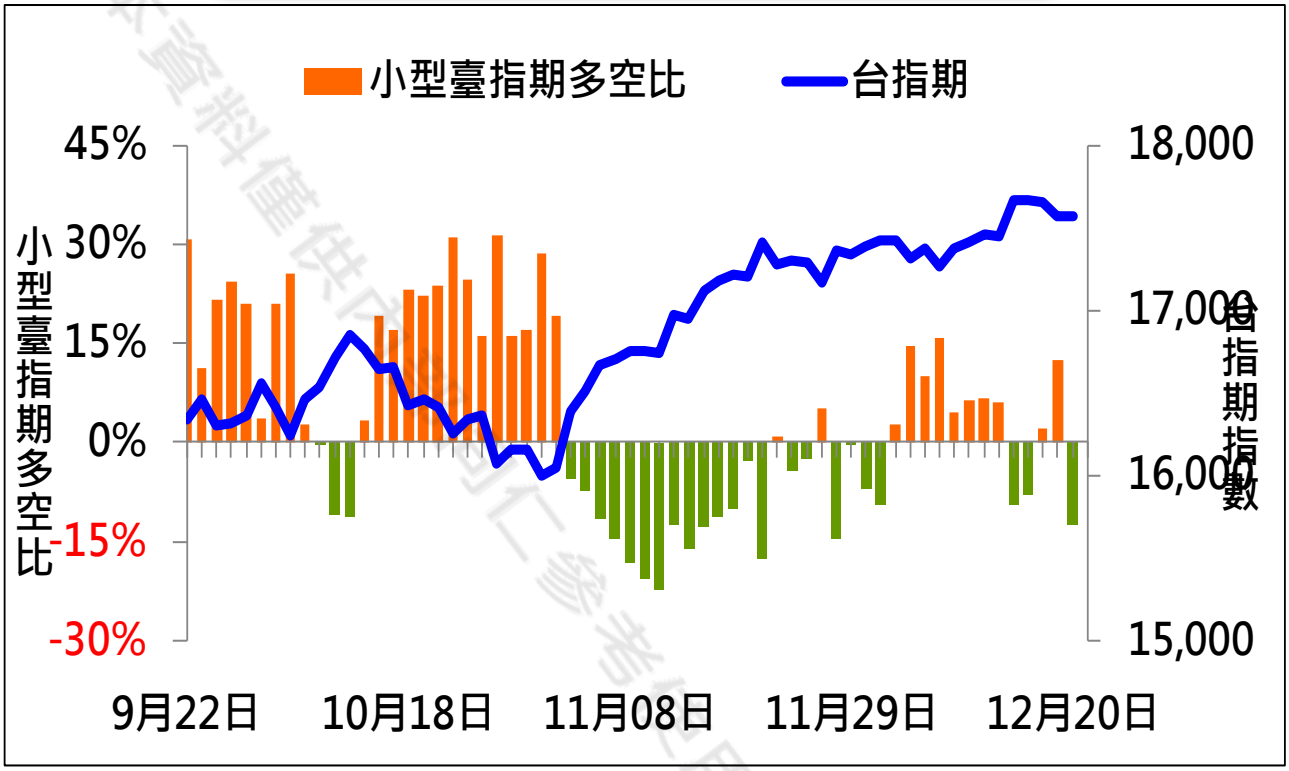
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

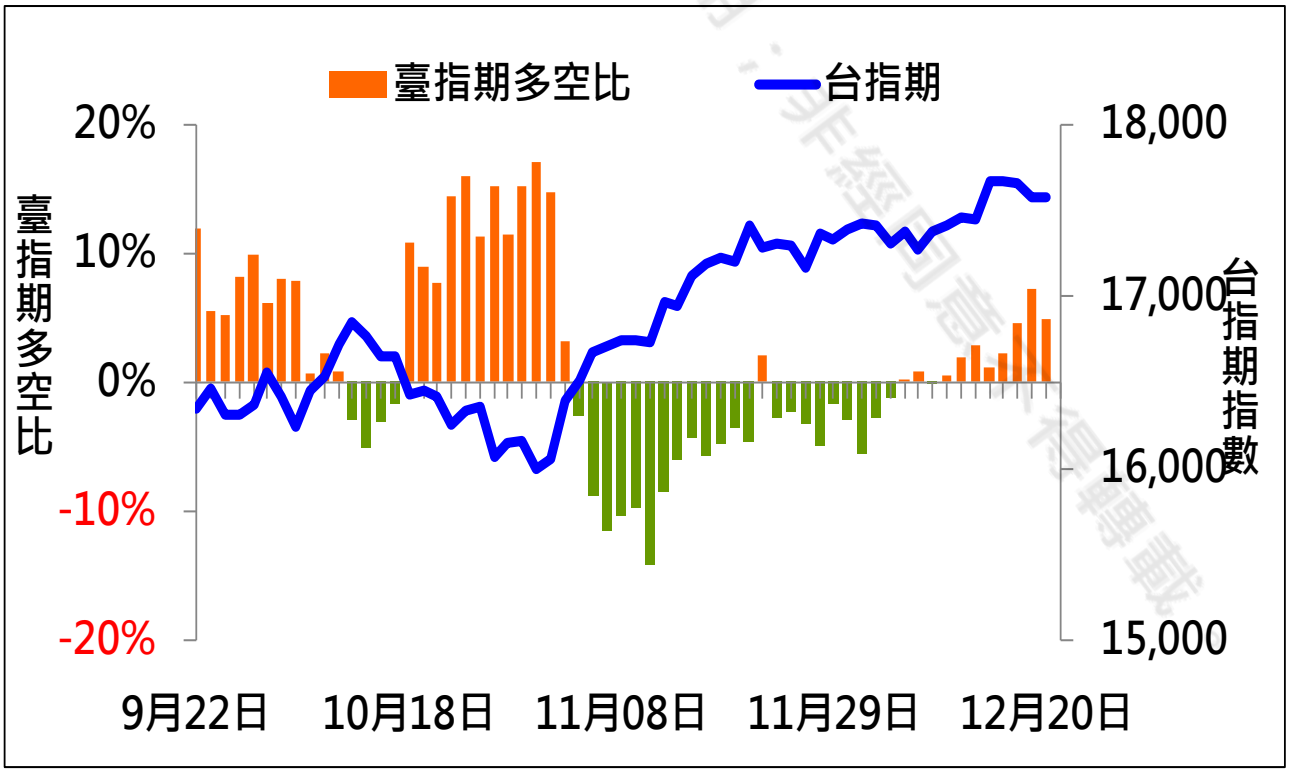
台指期貨暨選擇權日報

2023/12/20

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

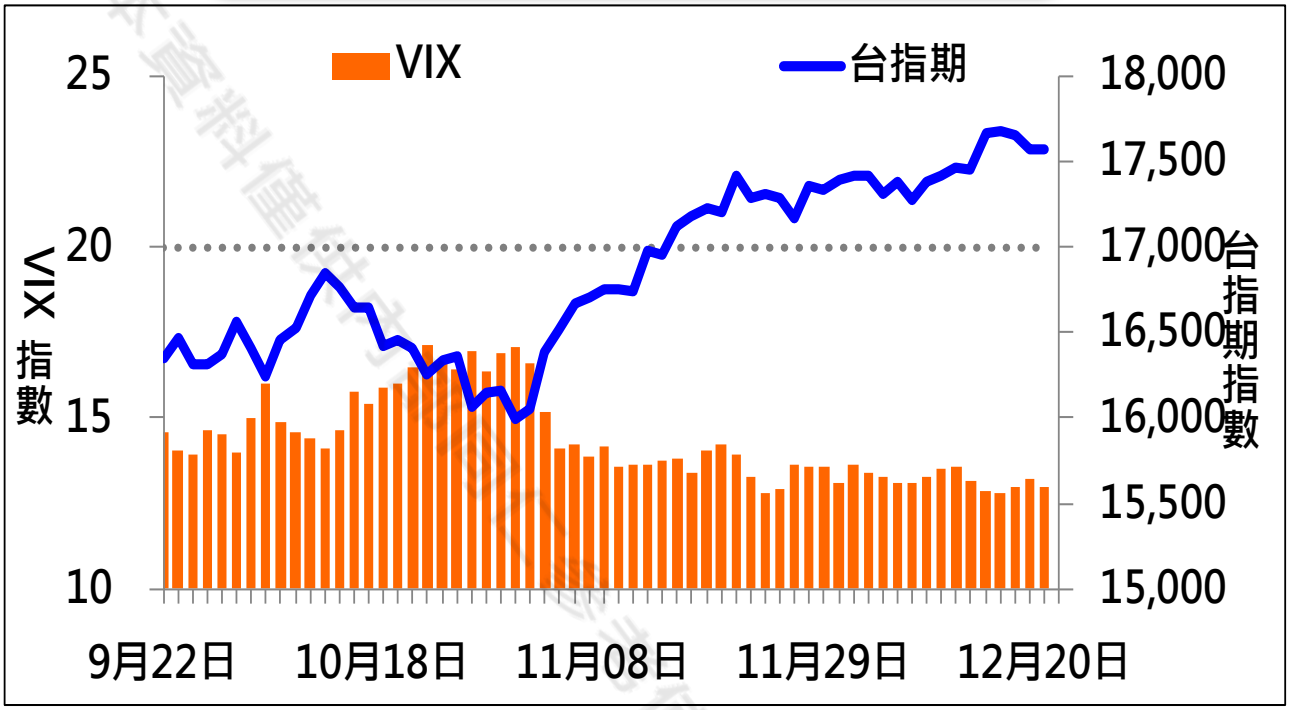
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

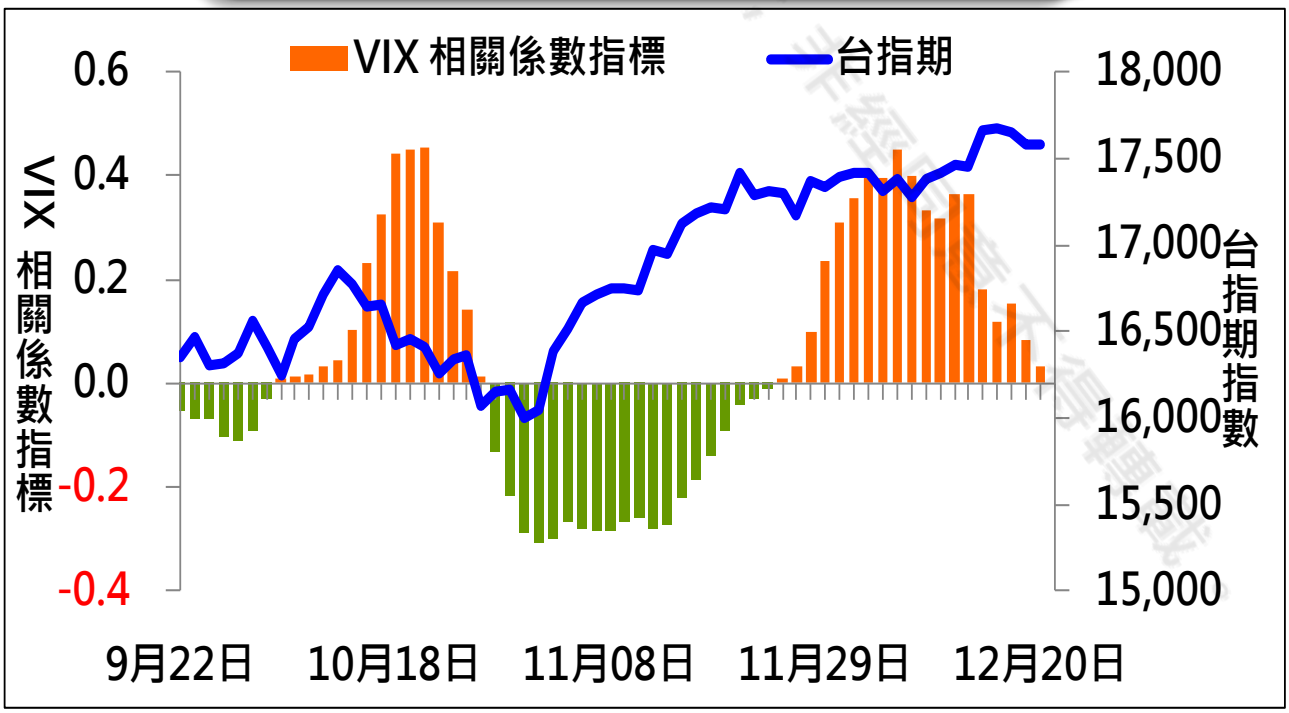
2023/12/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



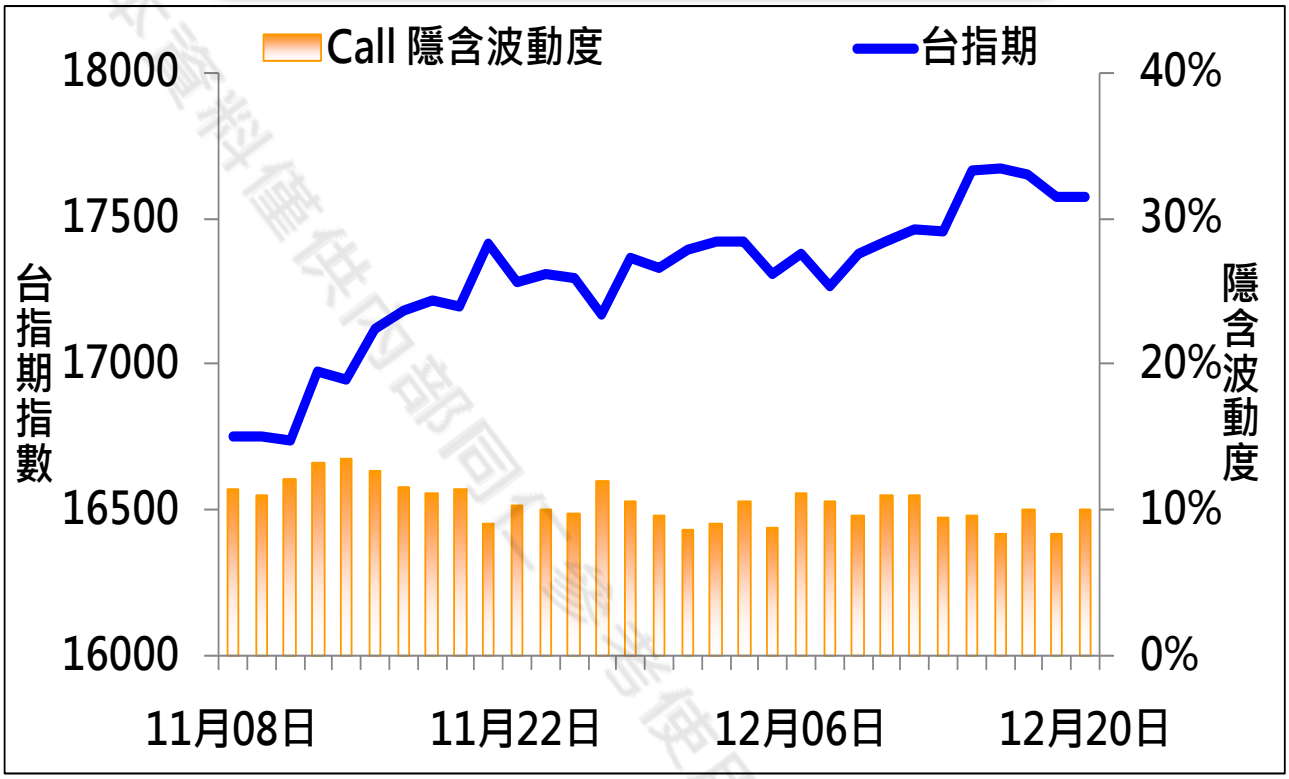
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

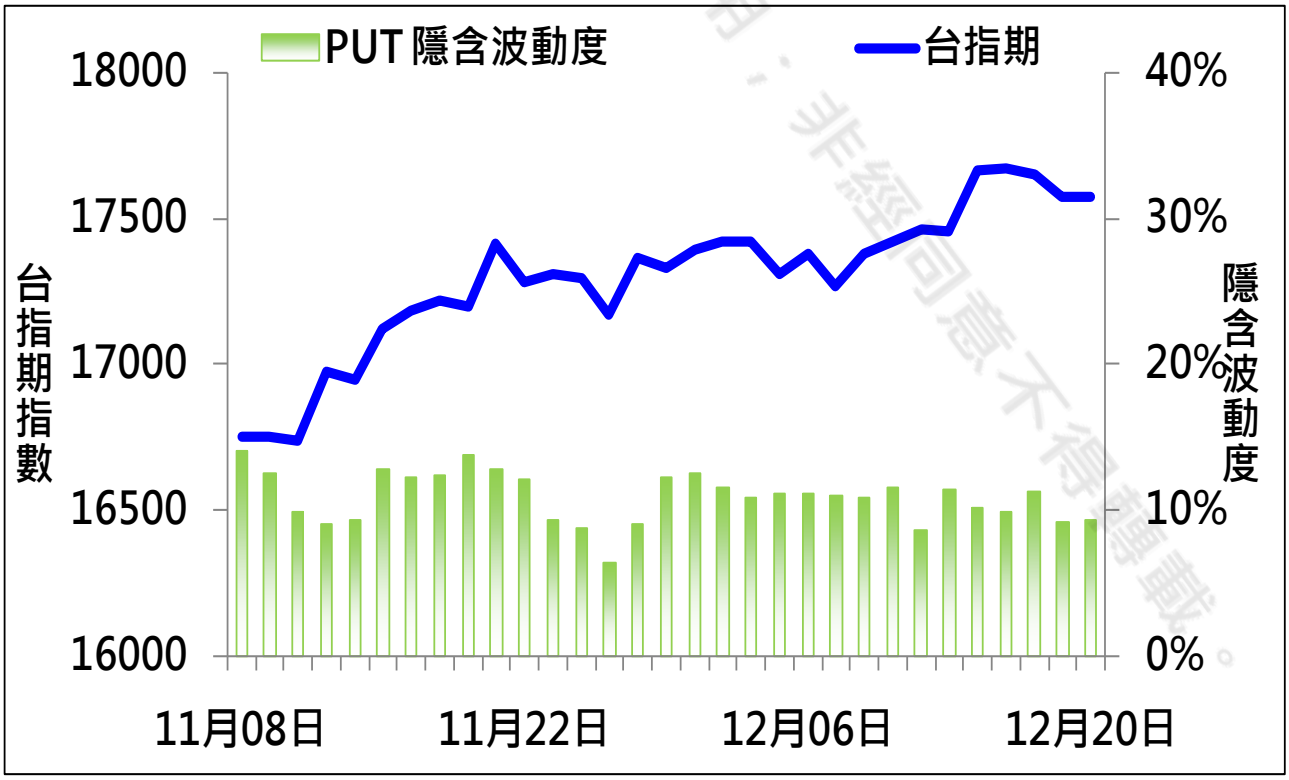
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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

2023/12/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

2023/12/20 OI 增減	2023/12/20 Call	202312W4 履約價	2023/12/27 Put	2023/12/27 OI 增減	
0	2	17,050	999	680	
10	19	17,100	1,149	490	
8	19	17,150	858	175	
-7	30	17,200	2,754	1,726	
4	16	17,250	3,925	1,004	
-4	49	17,300	6,694	4,408	※
-5	42	17,350	3,726	2,468	
-29	191	17,400	5,239	4,038	
-26	201	17,450	3,260	1,591	
10	1,553	17,500	4,302	2,468	
1,322	1,816	17,550	3,447	2,234	
708	2,056	17,600	2,553	1,992	
1,316	2,580	17,650	1,656	1,327	
1,529	3,420	17,700	1,029	663	
1,225	2,824	17,750	480	239	
1,714	4,164	17,800	545	429	
※ 1,752	3,101	17,850	276	187	
1,689	3,905	17,900	113	67	
1,196	2,815	17,950	39	5	
1,390	4,646	18,000	18	16	
1,148	1,443	18,050	0	0	
583	1,610	18,100	2	0	
743	1,007	18,150	0	-2	
16,538	40,608	總計	46,199	26,998	
P/C	1.1377	||	增減	0.3400	

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

2023/12/20

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

2023/12/20			2024/1/17		
OI 增減	Call	202401 月 履約價	Put	OI 增減	
1	2,010	16,400	3,008	-10	
0	50	16,500	2,390	75	
-4	49	16,600	3,028	-28	
1	77	16,700	3,054	453	
0	61	16,800	3,718	257	
-2	58	16,900	4,060	227	
-14	366	17,000	3,996	579	※
1	618	17,100	2,113	-54	
3	1,165	17,200	2,300	234	
-22	596	17,300	1,902	35	
-35	3,316	17,400	4,268	73	
-25	1,508	17,500	905	236	
190	3,224	17,600	719	294	
7	2,721	17,700	348	-2	
-236	5,045	17,800	198	34	
-149	3,251	17,900	160	88	
193	6,634	18,000	80	8	
261	5,059	18,100	26	8	
240	4,799	18,200	43	9	
※ 281	2,484	18,300	522	4	
103	2,301	18,400	5	0	
75	2,304	18,500	0	0	
205	1,241	18,600	2	0	
1,397	59,826	總計	55,405	3,013	
P/C	0.9261	||	增減	0.0294	

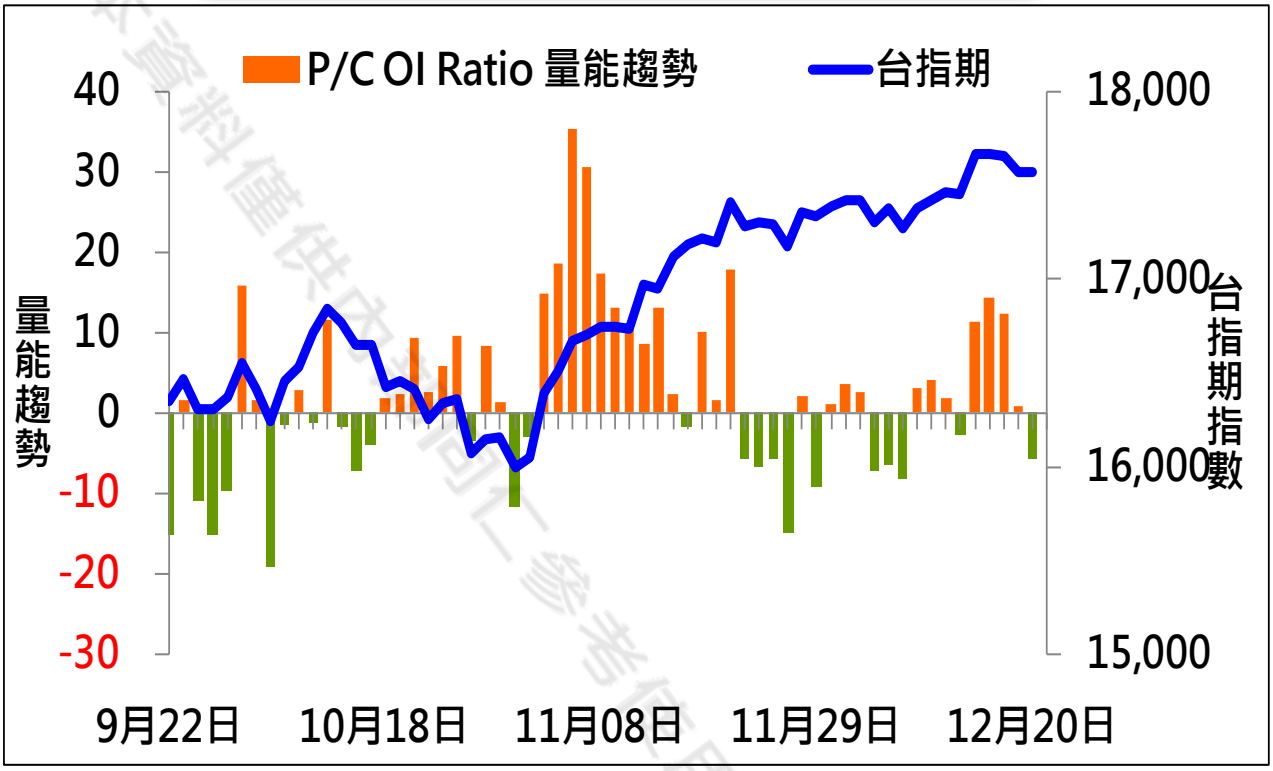
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

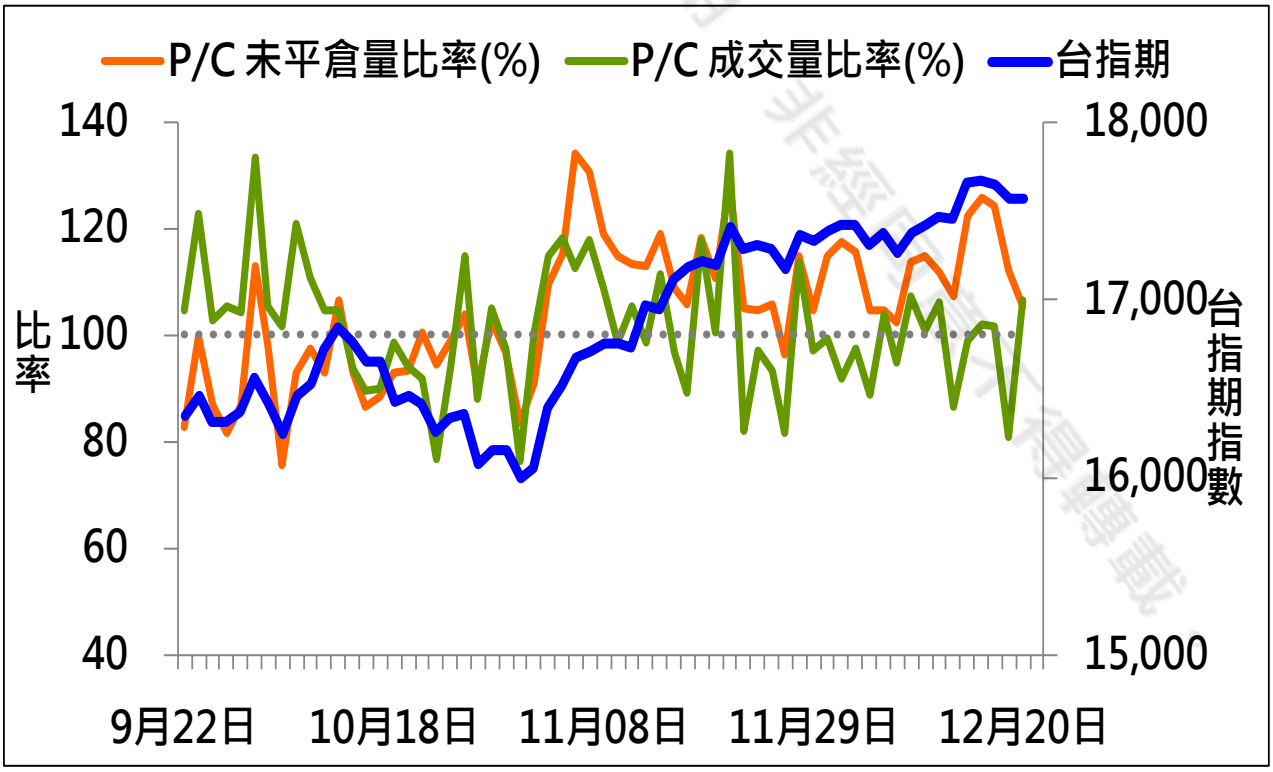
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

華南期貨 HUA NAN FUTURES

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 (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