台指期貨暨選擇權日報

2024/2/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

02月29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	3,622	-177	191	71	-403	70
投信	5,732	389	119	0	9	0
自營商	-6,369	86	-241	-31	-130	-23

02月29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	-30	3	26,988	-15,763	37,164	-3,671
投信	0	0	0	0	-172	0
自營商	1	-5	2,292	-6,760	-17,830	-11,816

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
聯發科	12.90	台積電	-66.95
緯穎	11.85	鴻海	-2.24
台塑化	7.99	大立光	-2.15
亞德客-KY	7.10	上銀	-1.66
創意	5.19	中華電	-1.25
富邦金	5.19	台光電	-0.97
台達電	4.61	聯詠	-0.79
世芯-KY	4.22	廣達	-0.62
長榮	4.10	美時	-0.51
國泰金	3.92	神基	-0.49
前十名合計	67.08	後十名合計	-77.62

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	48.8%	43.5%
電子期前十大市場佔比	53.5%	57.8%
金融期前十大市場佔比	44.1%	83.1%
非金電期前十大市場佔比	96.4%	94.6%

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

2024/2/29

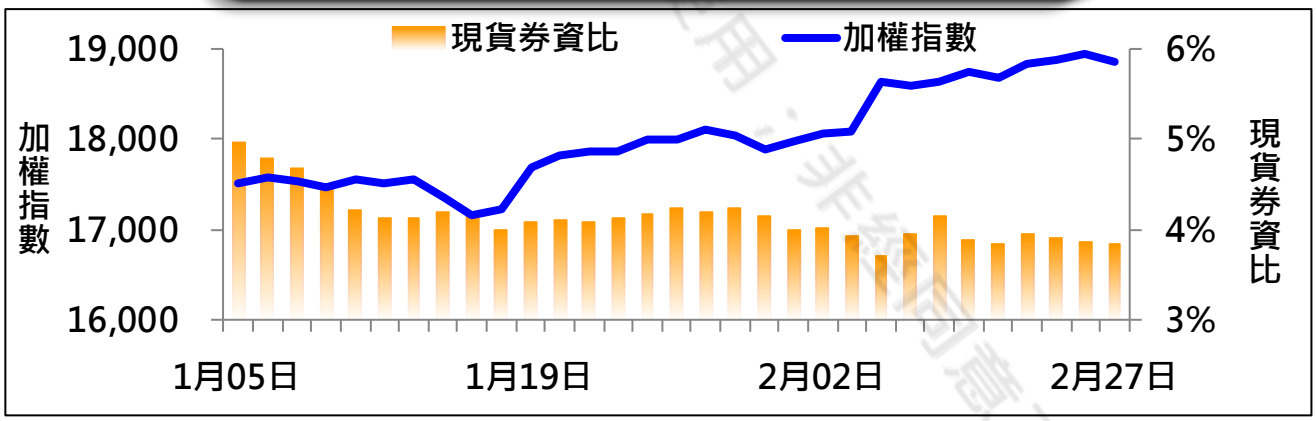
華南期貨 HUA NAN FUTURES

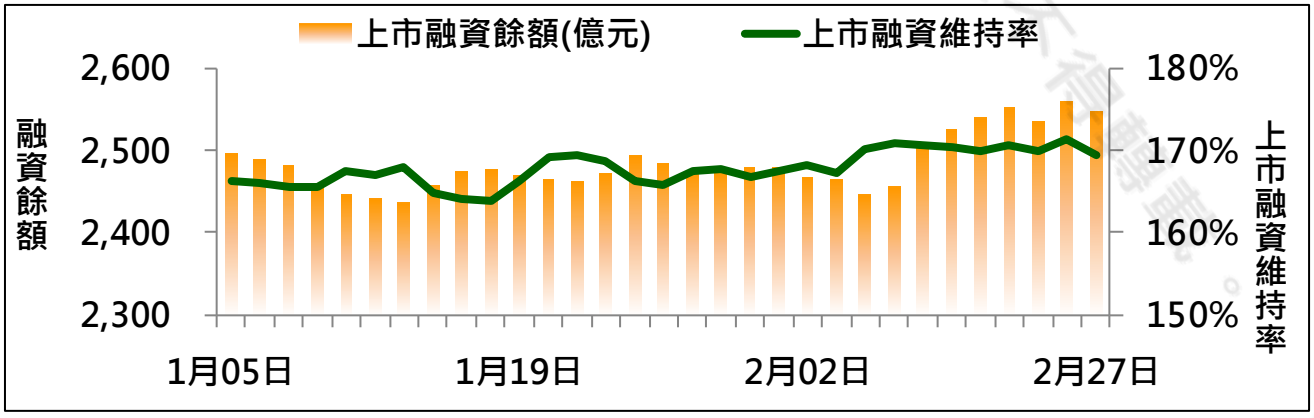
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
02月22日	164.6	3,085	664	78.7	-6,346	-323
02月23日	308.3	4,146	1,061	18.8	-5,836	510
02月26日	50.6	6,151	2,005	15.8	-6,346	-510
02月27日	-121.7	3,799	-2,352	-52.3	-6,455	-109
02月29日	31.4	3,622	-177	55.9	-6,369	86

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
02月22日	28,885	34,801	-5,916	13,488	-5,372	18,860
02月23日	36,533	36,642	-109	15,960	-4,250	20,210
02月26日	38,677	39,343	-666	16,684	-11,509	28,193
02月27日	42,751	40,835	1,916	9,052	-6,014	15,066
02月29日	26,988	37,164	-10,176	2,292	-17,830	20,122

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

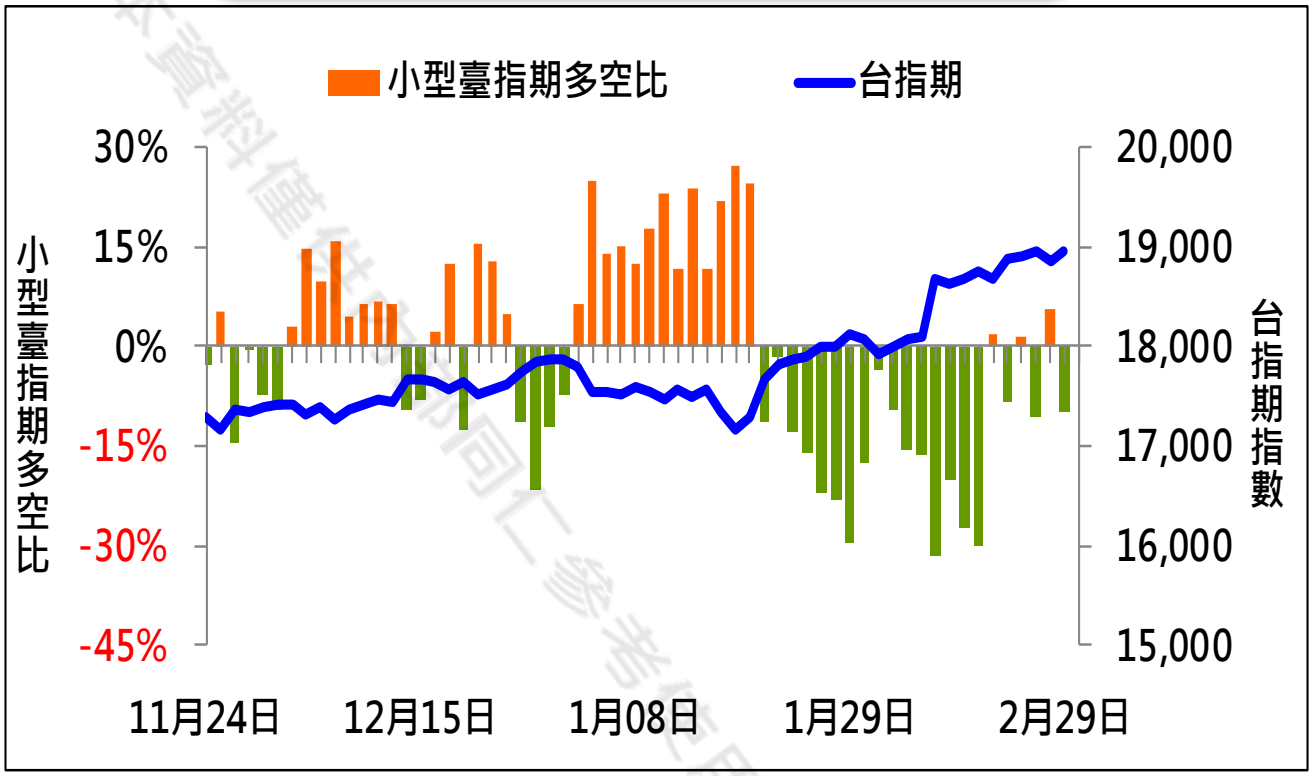
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

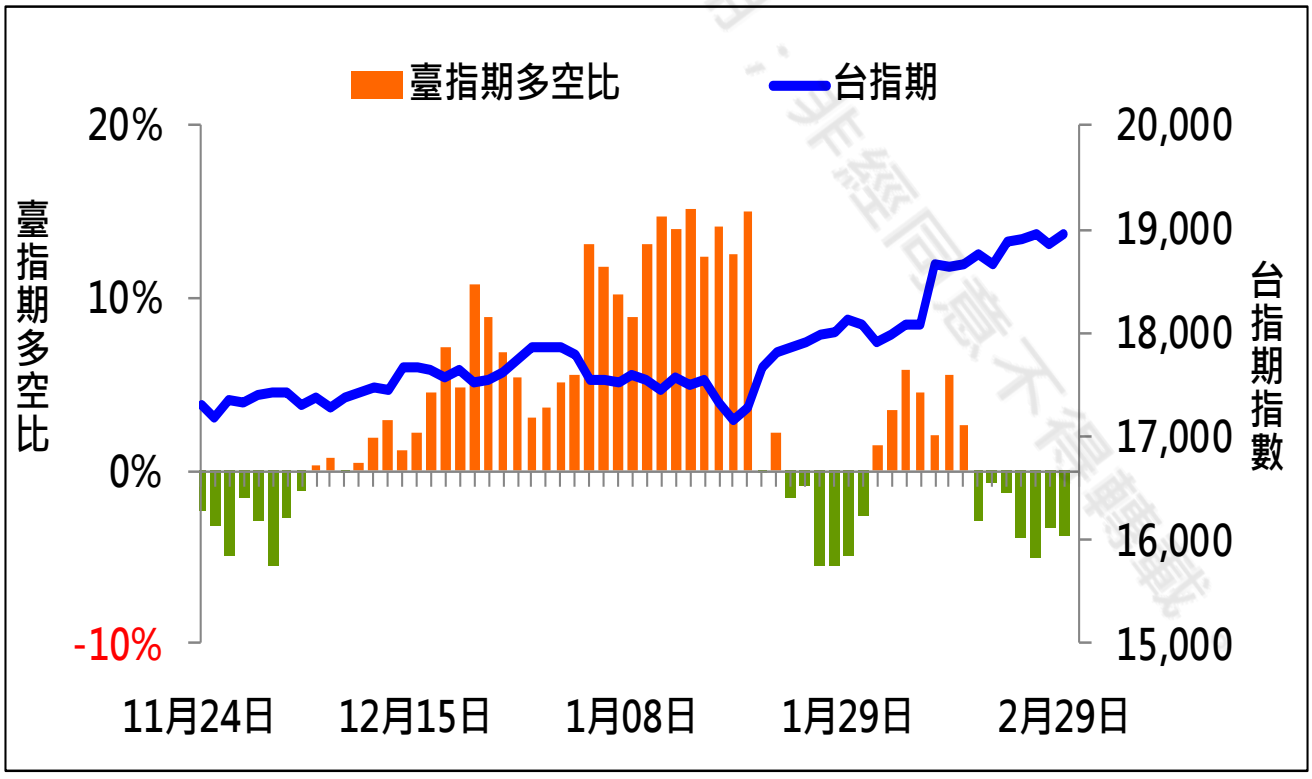
台指期貨暨選擇權日報

2024/2/29

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

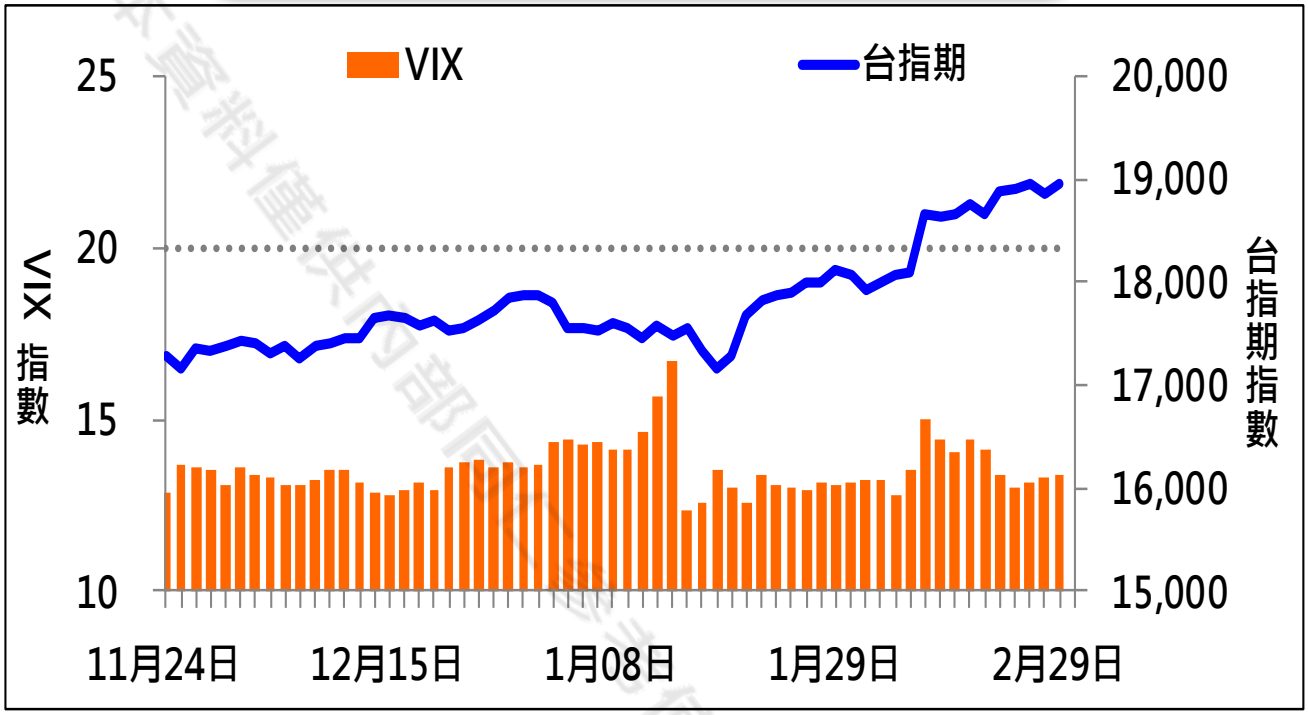
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

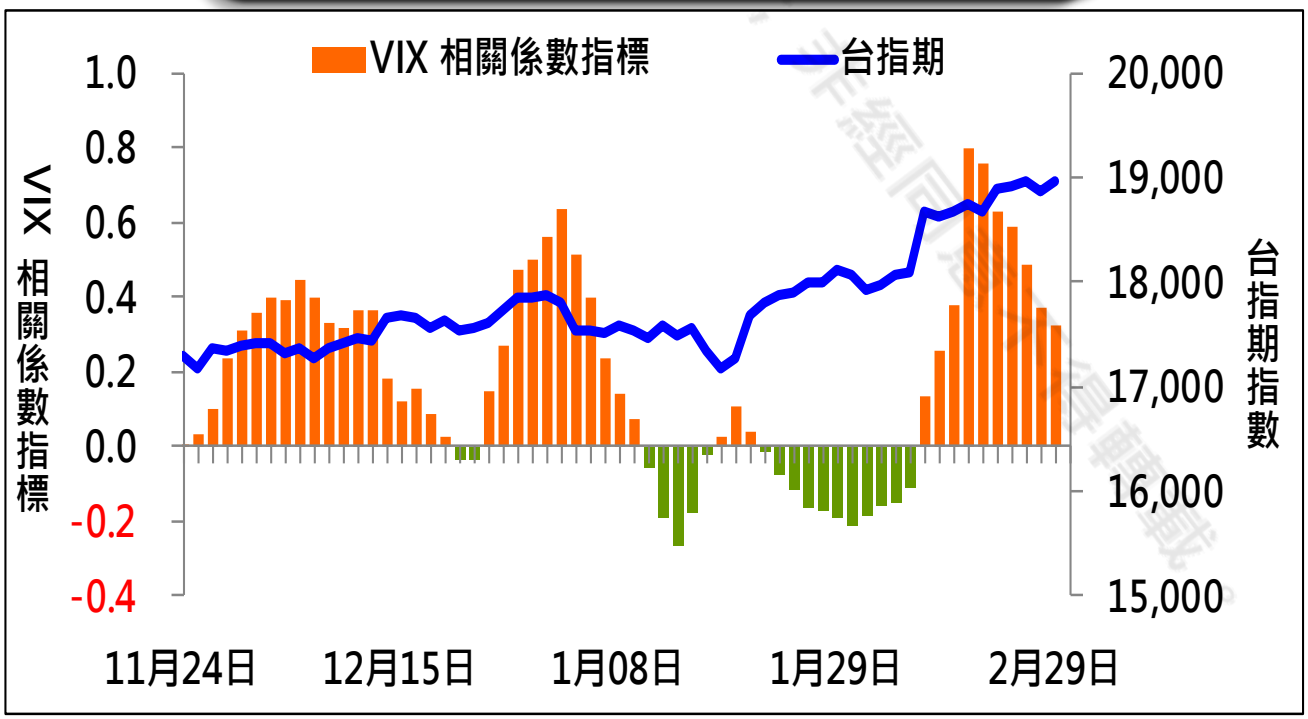
2024/2/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

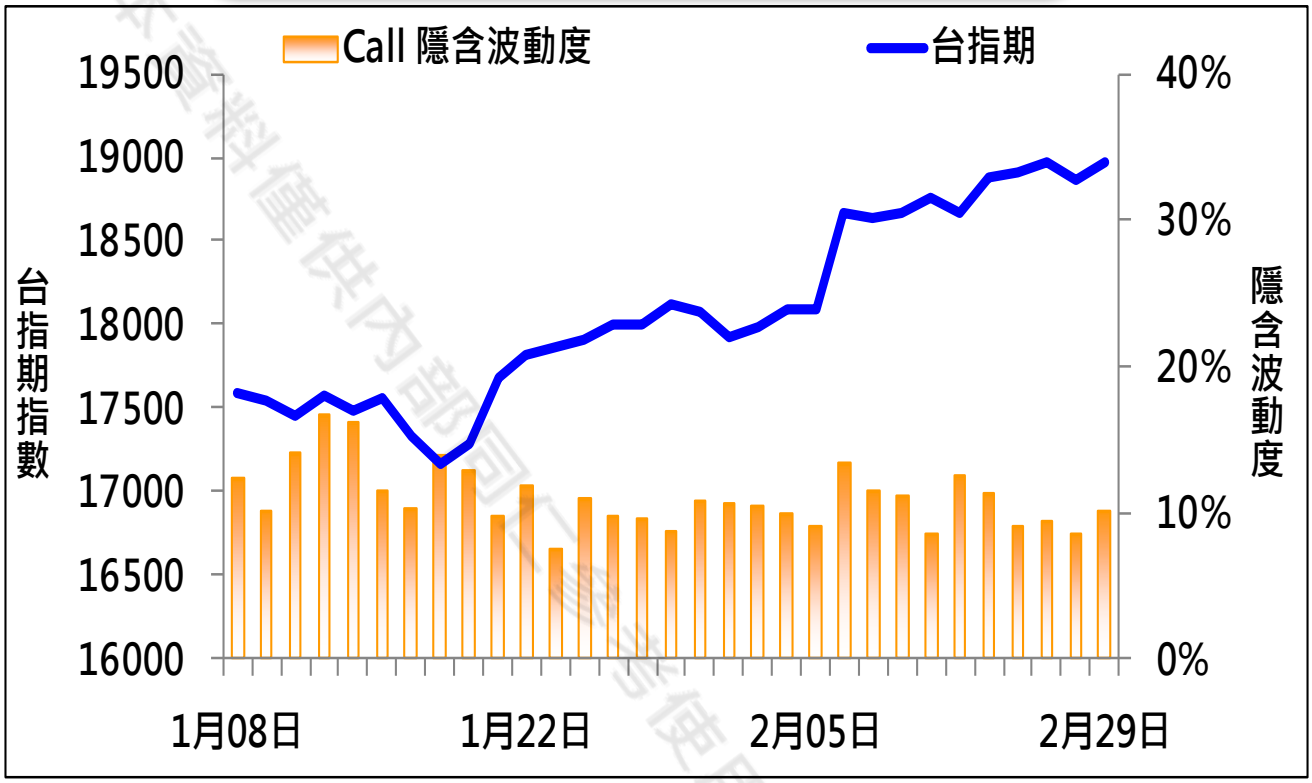


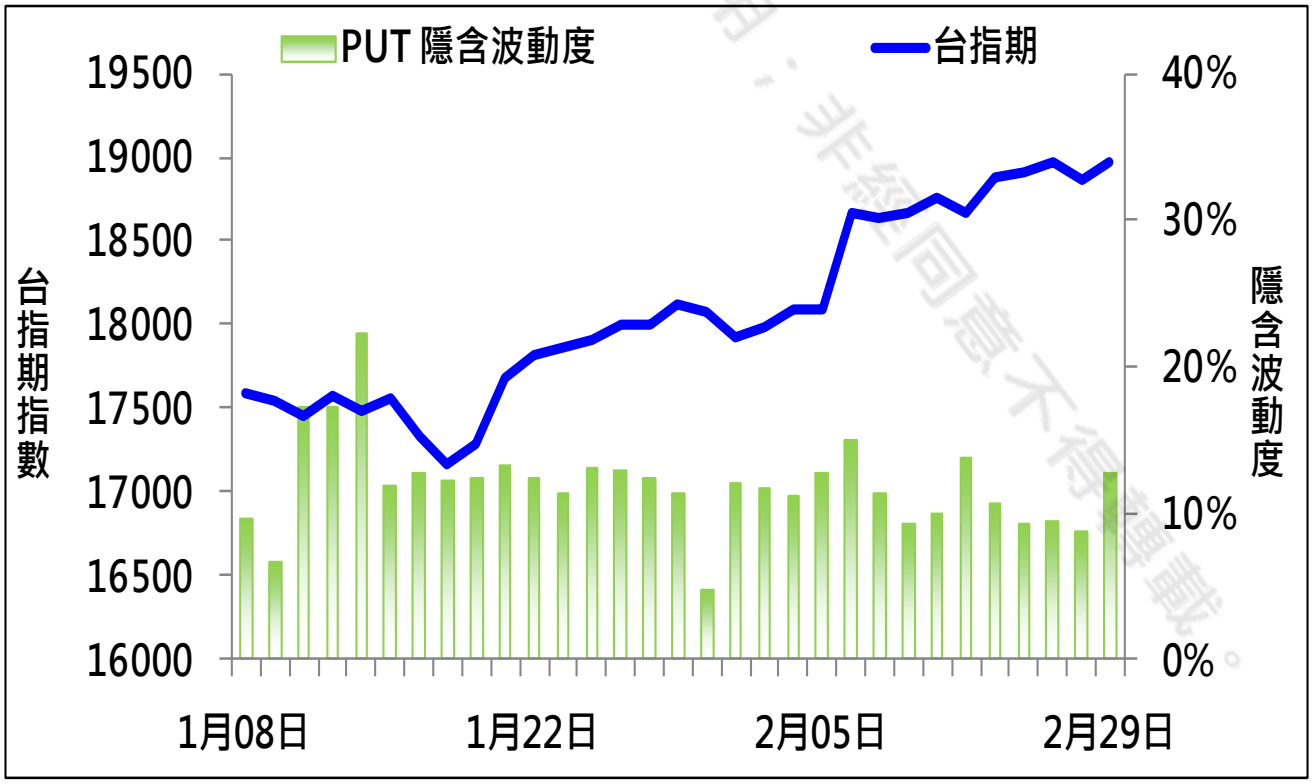
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2024/2/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

資料日期：2024/2/29　　結算日：2024/3/6

	OI 增減	Call	202403W1 履約價	Put	OI 增減	
	2	5	18,250	639	380	
	1	4	18,300	1,435	300	
	1	1	18,350	1,245	641	
	35	56	18,400	2,410	1,012	
	1	3	18,450	1,986	829	
	11	32	18,500	4,586	2,803	
	-4	34	18,550	2,370	1,291	
	46	93	18,600	3,762	2,166	
	25	73	18,650	2,358	1,404	
	179	321	18,700	3,870	2,825	※
	-93	103	18,750	3,531	2,801	
	195	677	18,800	3,773	2,643	
	296	668	18,850	2,649	2,214	
	695	1,152	18,900	3,877	2,768	
	637	1,453	18,950	1,490	1,212	
※	2,210	3,581	19,000	1,239	689	
	1,481	3,303	19,050	377	202	
	1,753	3,591	19,100	251	202	
	1,922	3,227	19,150	63	34	
	1,559	4,354	19,200	67	48	
	1,437	2,757	19,250	12	5	
	2,083	3,794	19,300	34	4	
	1,921	2,367	19,350	2	2	
	2,207	3,141	19,400	27	20	
	491	599	19,450	0	0	
	19,512	37,770	總計	51,516	29,712	
	P/C	1.3639	||	增減	0.1697	

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

2024/2/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

資料日期：2024/2/29　　結算日：2024/3/20

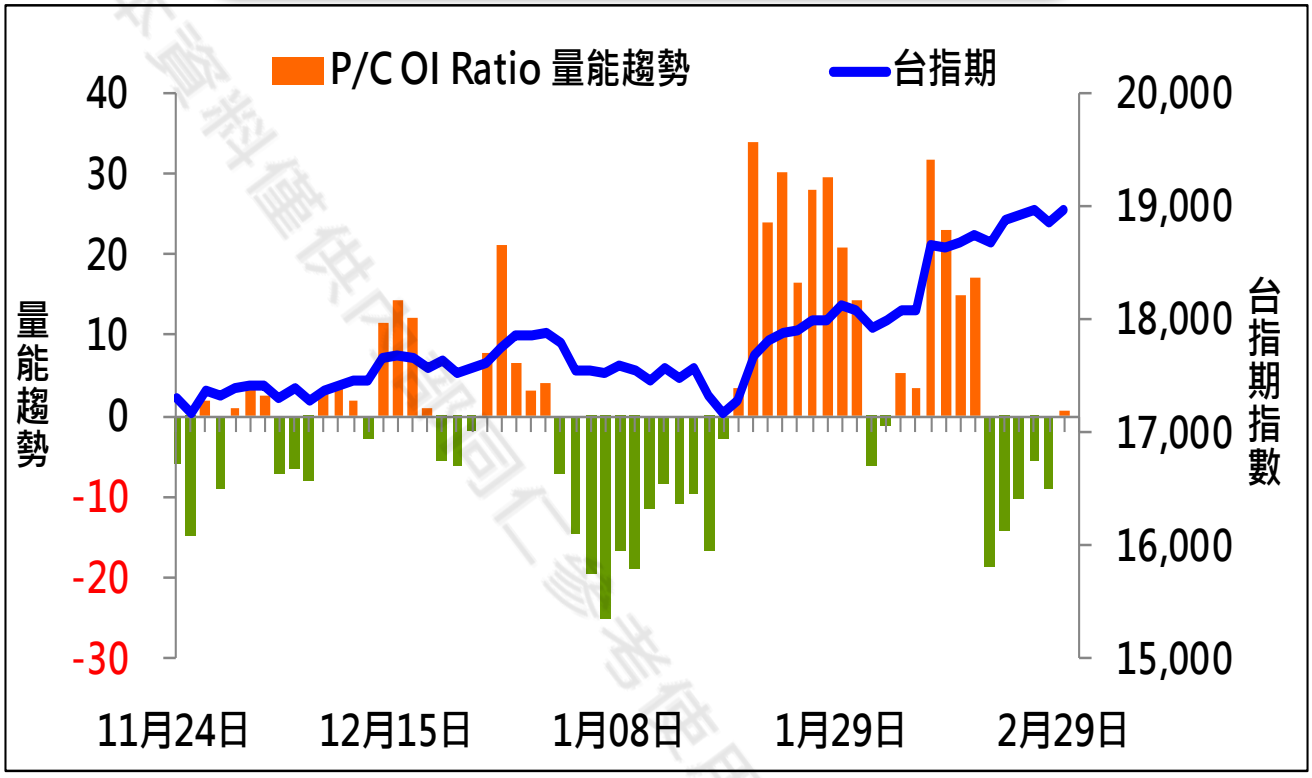
	OI 增減	Call	202403 月 履約價	Put	OI 增減	
	0	145	17,500	5,728	78	
	-3	138	17,600	1,331	15	
	-1	213	17,700	1,306	13	
	-1	123	17,800	3,056	-54	
	-2	148	17,900	3,127	71	
	0	183	18,000	6,899	951	
	9	172	18,100	3,036	305	
	-2	414	18,200	5,651	1,211	※
	-5	202	18,300	4,074	467	
	-4	539	18,400	3,449	283	
	1	839	18,500	4,573	618	
	27	1,756	18,600	5,010	13	
	-51	1,642	18,700	3,391	438	
	269	2,950	18,800	2,689	517	
	330	3,453	18,900	2,563	476	
※	685	5,401	19,000	914	254	
	183	2,777	19,100	317	115	
	-429	5,261	19,200	255	22	
	208	6,202	19,300	80	15	
	267	6,973	19,400	460	0	
	371	6,651	19,500	39	3	
	81	3,977	19,600	45	-1	
	96	2,183	19,700	22	11	
	9	16	21,500	0	0	
	2,075	80,848	總計	86,634	6,123	
	P/C	1.0716	||	增減	0.0495	

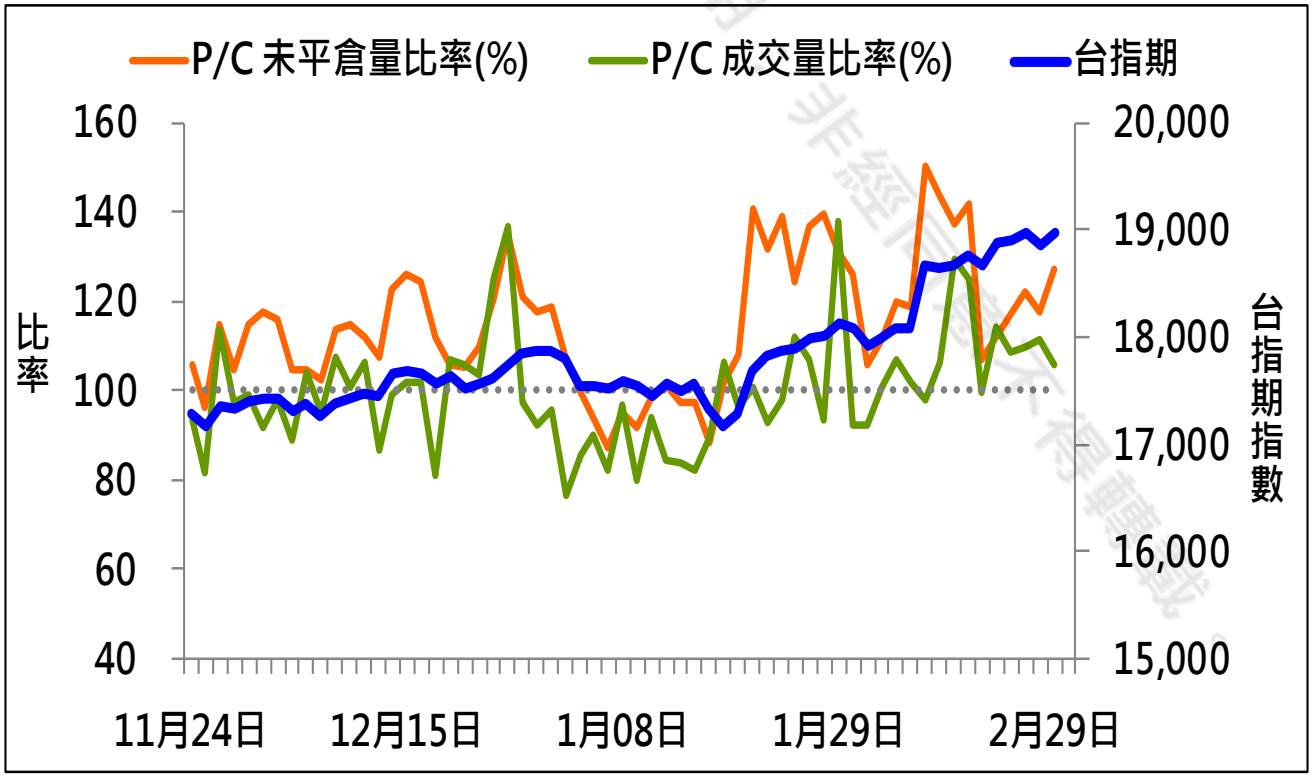
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

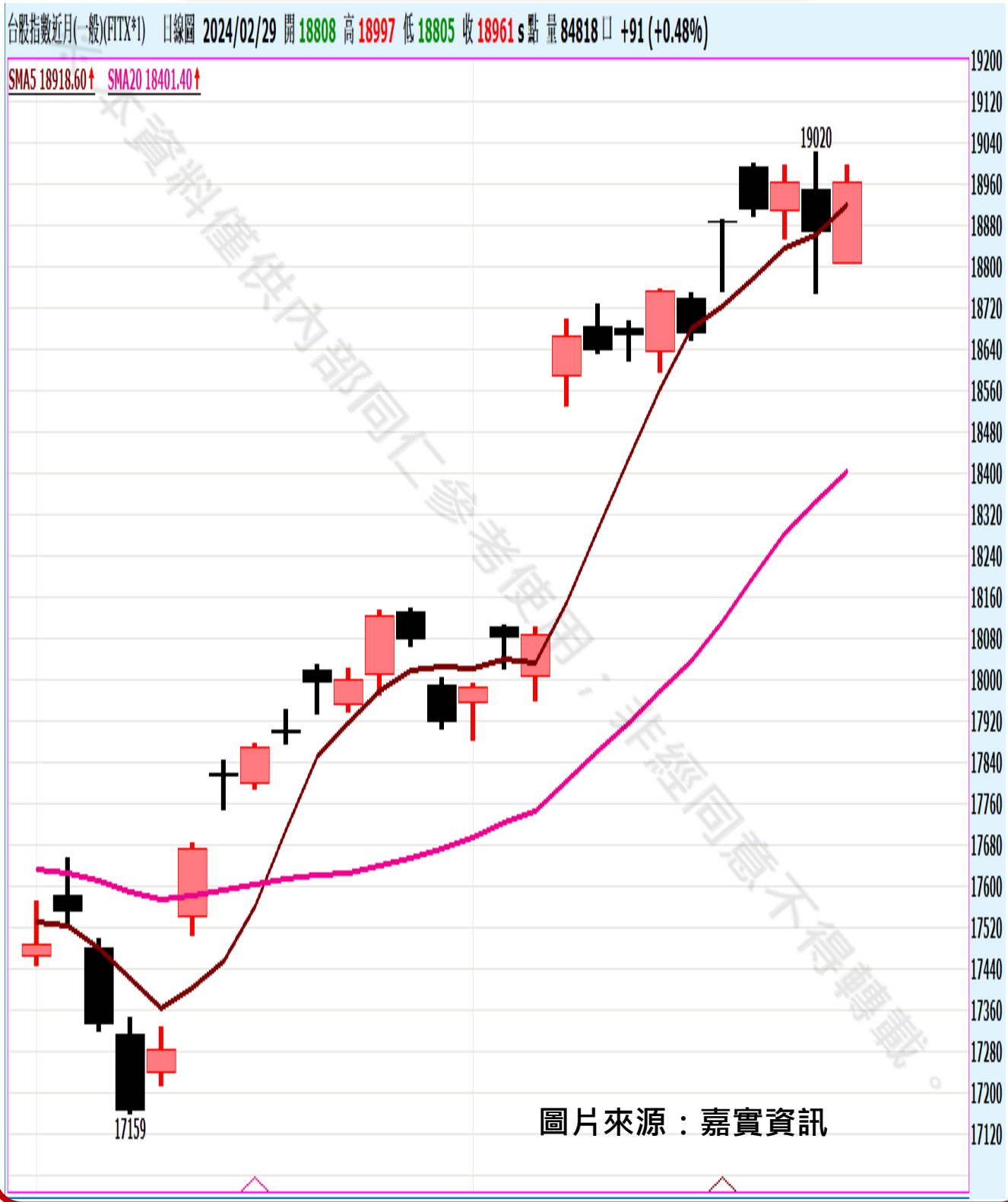
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

2024/2/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

盤後重點觀察



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

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