台指期貨暨選擇權日報

2024/5/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

05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	-15,465	-5,305	-80	-100	-612	-49
投信	11,464	-382	191	0	9	0
自營商	-4,931	1,501	-217	60	-174	-6

05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	45	-8	7,858	-1,468	26,352	-1,686
投信	0	0	30	0	16	0
自營商	-87	17	4,593	-12,251	-3,878	3,385

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
智邦	4.49	台積電	-66.58
奇鋐	3.44	鴻海	-22.25
大立光	3.43	聯發科	-10.27
力成	3.41	富邦金	-6.57
瑞昱	3.29	國泰金	-6.24
健策	2.03	中信金	-4.52
群光	1.22	矽力*-KY	-4.32
南電	1.04	台達電	-4.17
愛山林	0.87	元大金	-4.07
鴻準	0.86	兆豐金	-3.70
前十名合計	24.09	後十名合計	-132.68

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	43.2%	50.5%
電子期前十大市場佔比	56.8%	63.7%
金融期前十大市場佔比	38.9%	72.9%
非金電期前十大市場佔比	85.5%	80.0%

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

2024/5/29

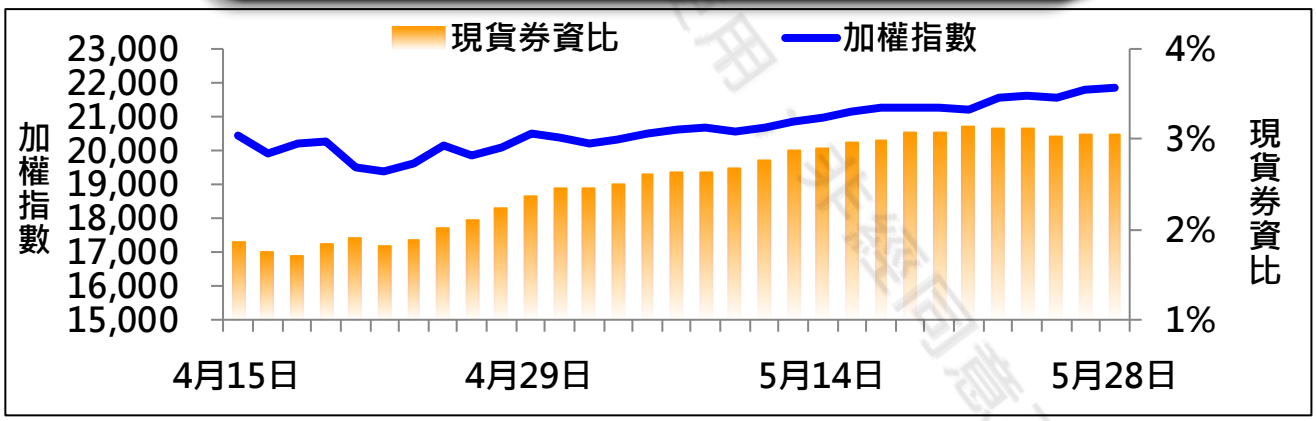
華南期貨 HUA NAN FUTURES

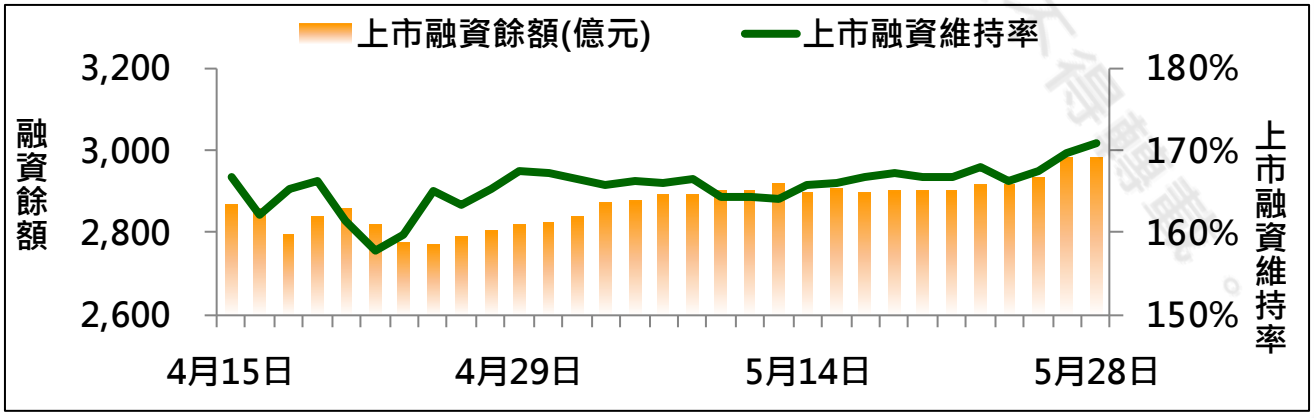
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
05月23日	166.8	-8,725	-3,062	-2.0	-6,281	656
05月24日	60.6	-8,402	323	26.0	-6,314	-33
05月27日	34.0	-9,297	-895	69.2	-6,120	194
05月28日	-24.0	-10,160	-863	19.3	-6,432	-312
05月29日	-274.9	-15,465	-5,305	-11.1	-4,931	1,501

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
05月23日	8,523	19,781	-11,258	15,274	1,705	13,569
05月24日	7,721	21,472	-13,751	20,317	-1,634	21,951
05月27日	9,494	24,016	-14,522	17,238	-169	17,407
05月28日	9,326	28,038	-18,712	16,844	-7,263	24,107
05月29日	7,858	26,352	-18,494	4,593	-3,878	8,471

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

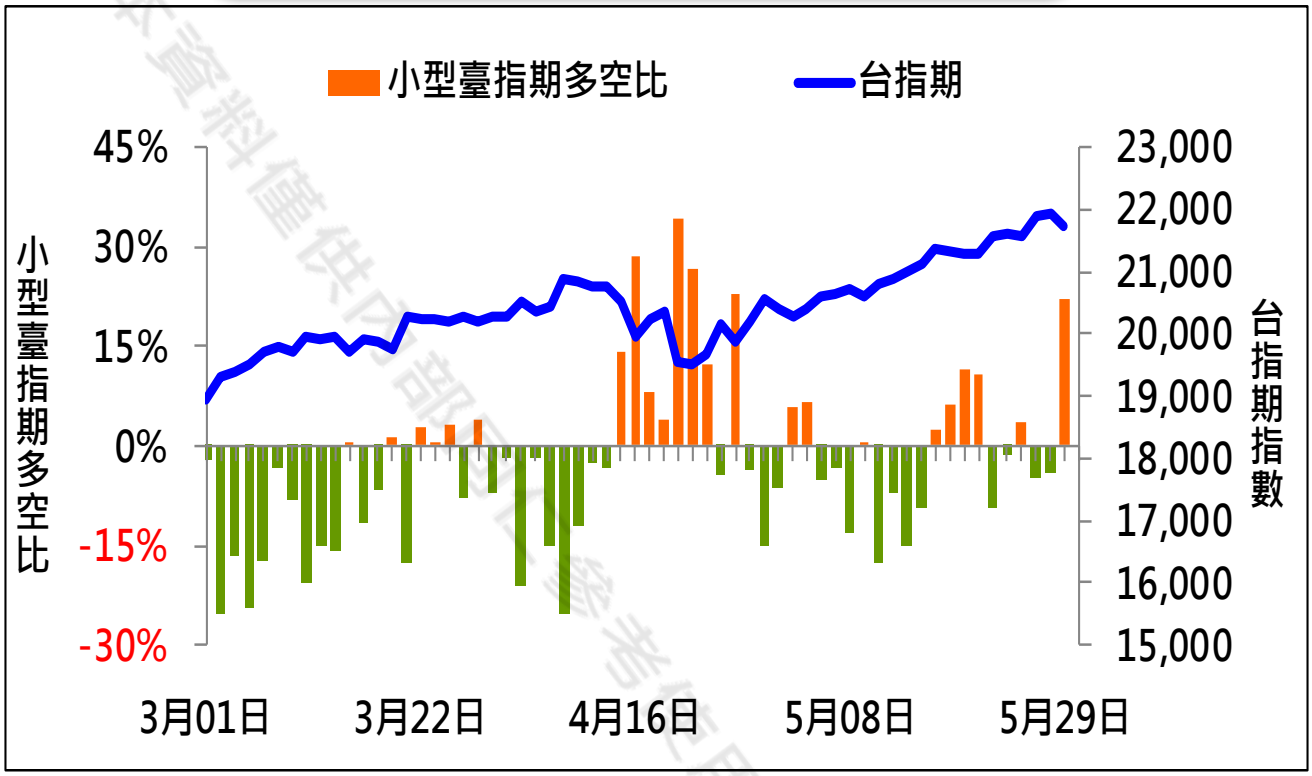
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

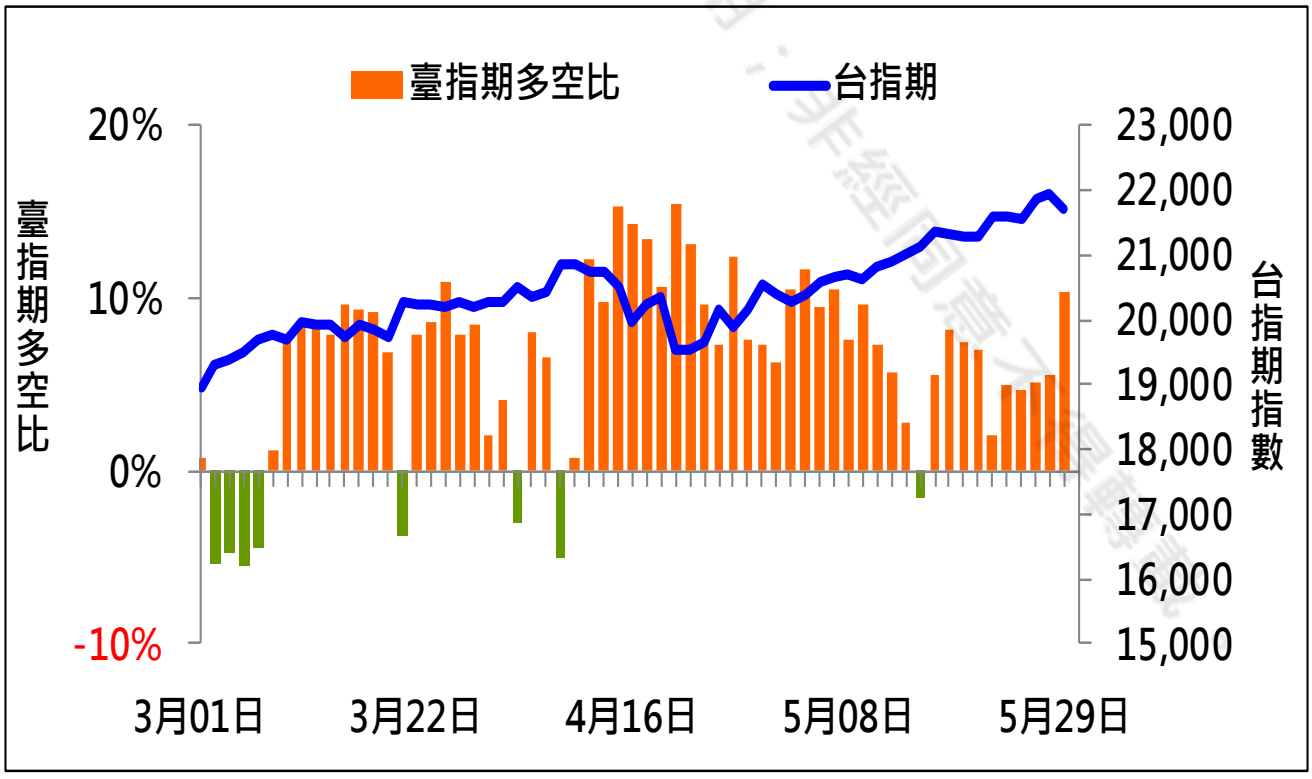
台指期貨暨選擇權日報

2024/5/29

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

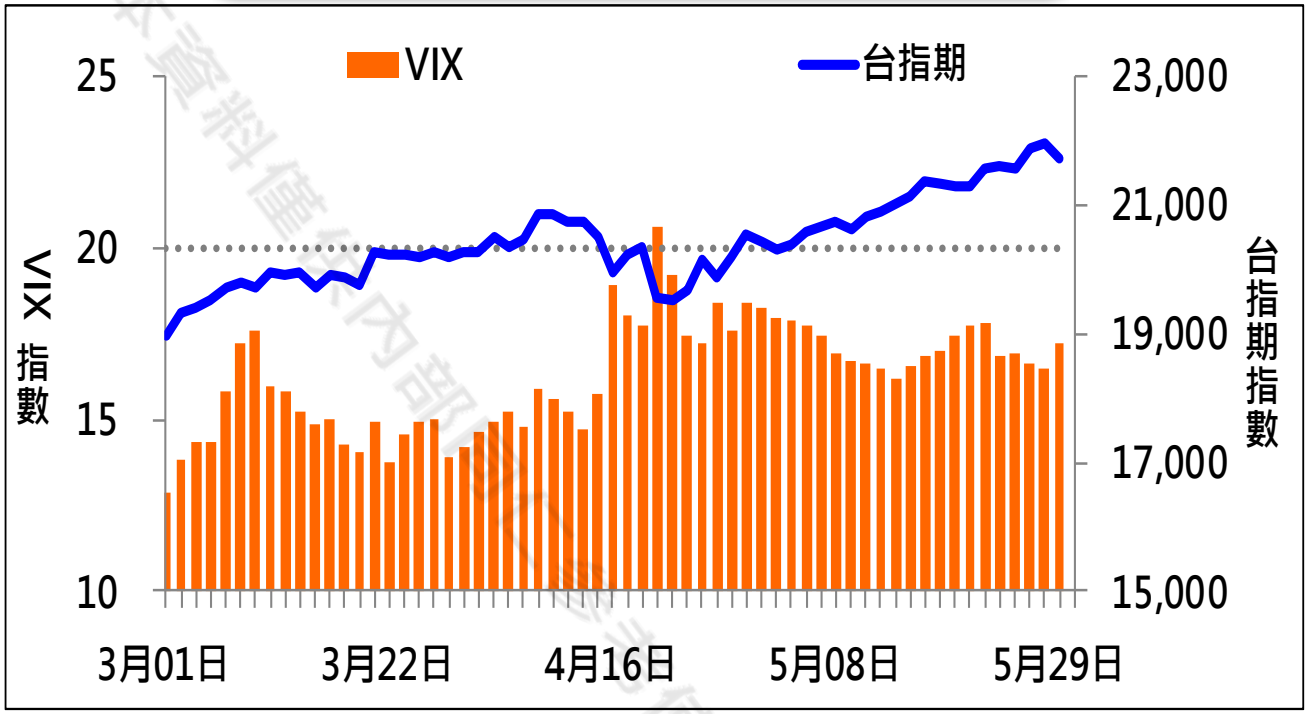
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

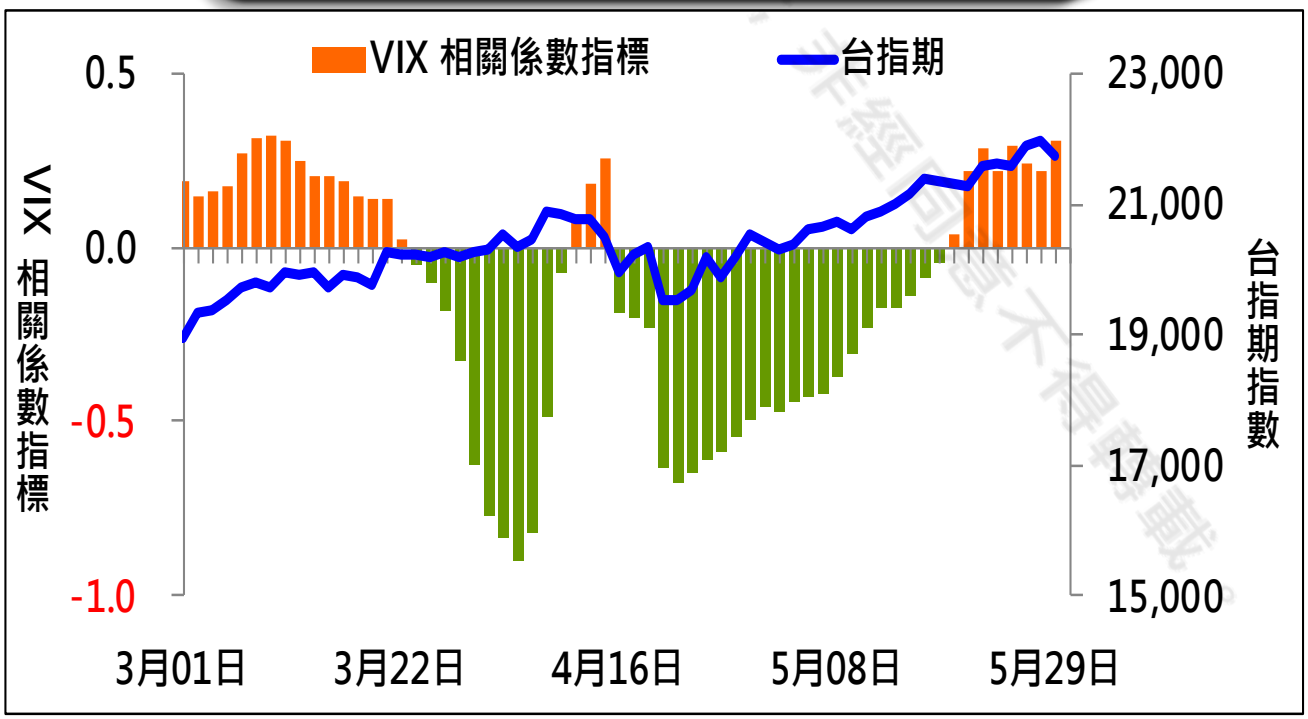
2024/5/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



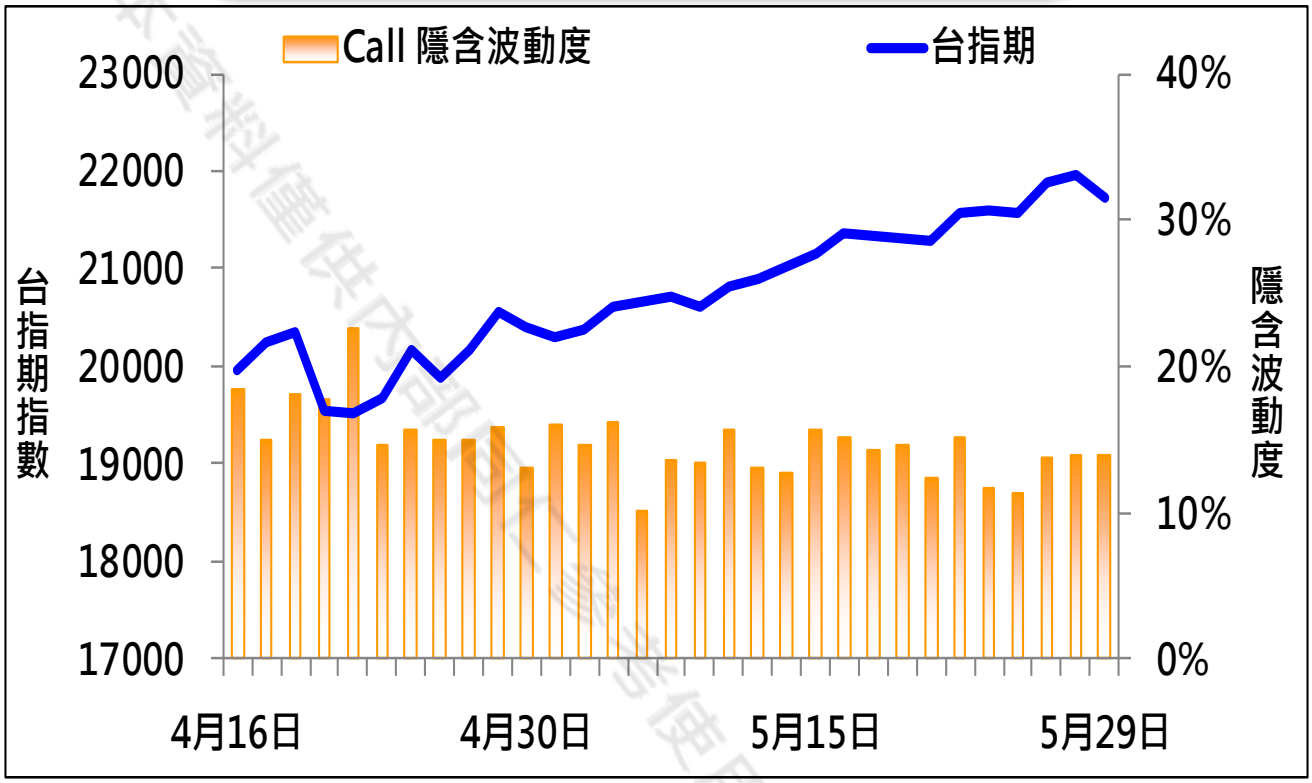
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

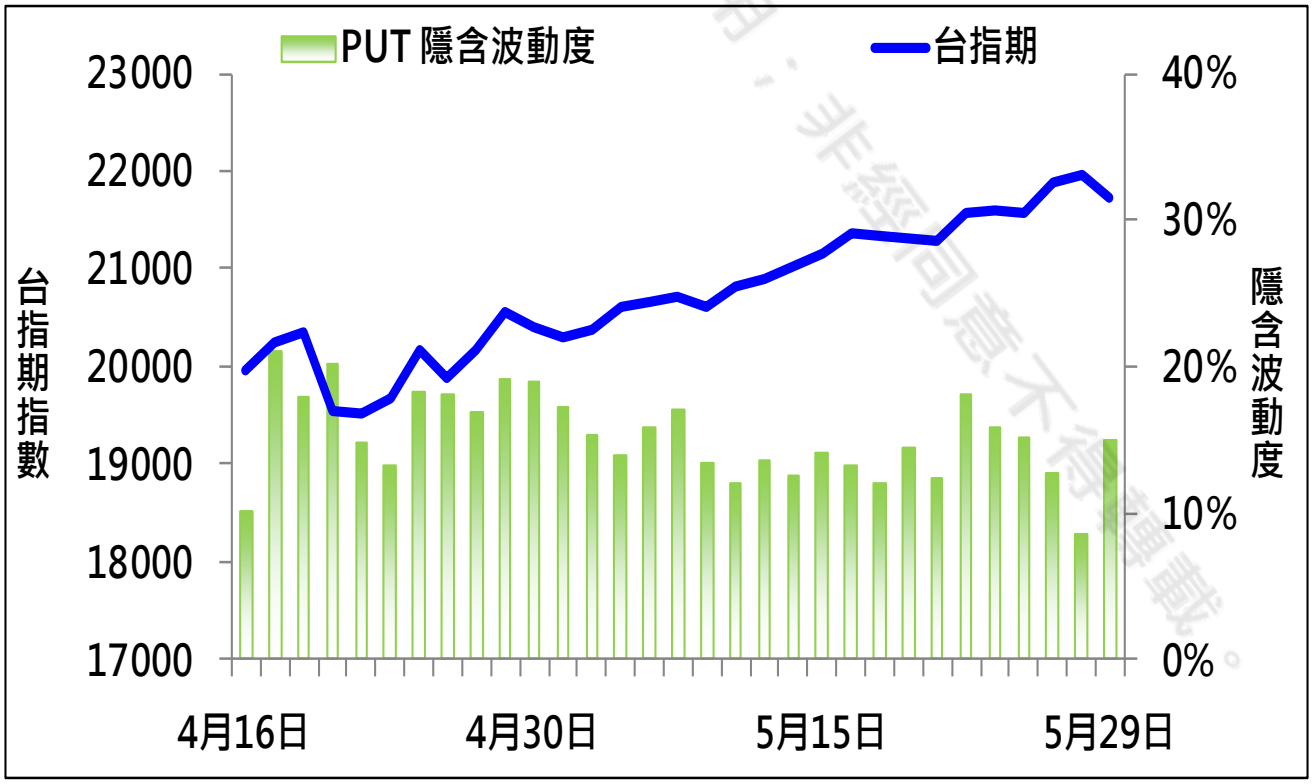
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

CALL、PUT隱含波動率





本資料僅供內部人員參考使用，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

2024/5/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

資料日期：2024/5/29　　結算日：2024/6/5

OI 增減	Call	202406W1 履約價	Put	OI 增減	
0	0	20,850	792	172	
-1	0	20,900	1,614	1,234	※
1	1	20,950	751	594	
6	19	21,000	1,560	1,088	
10	11	21,050	1,329	937	
10	17	21,100	827	424	
0	20	21,150	699	393	
8	35	21,200	1,887	1,203	
0	25	21,250	690	186	
31	60	21,300	1,965	1,103	
-5	55	21,350	1,004	443	
34	163	21,400	1,220	551	
-4	19	21,450	833	540	
2	446	21,500	2,041	1,115	
10	107	21,550	733	458	
108	345	21,600	1,276	694	
107	164	21,650	608	399	
583	723	21,700	1,252	756	
694	754	21,750	914	739	
1,182	1,407	21,800	724	384	
774	940	21,850	336	54	
1,408	1,677	21,900	463	135	
751	1,016	21,950	89	48	
1,871	3,035	22,000	87	-23	
1,417	1,940	22,050	13	3	
1,253	1,837	22,100	44	-46	
1,229	1,404	22,150	90	66	
※ 1,960	2,764	22,200	49	26	
20,593	31,006	總計	31,389	16,493	
P/C	1.0124	||	增減	-0.4182	

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

2024/5/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

次月選擇權OI變化

資料日期：2024/5/29　　結算日：2024/6/19

	OI 增減	Call	202406 月 履約價	Put	OI 增減	
	0	208	19,500	2,201	-21	
	0	489	20,500	2,693	10	
	0	590	20,600	3,787	-67	
	-50	442	20,700	6,791	52	
	-101	3,316	20,800	9,290	5	
	-3	428	20,900	2,552	83	
	1	1,334	21,000	3,982	-541	
	1	730	21,100	1,848	-115	
	-238	1,619	21,200	2,089	266	
	-7	1,744	21,300	2,545	-206	
	-183	3,072	21,400	3,062	936	※
	20	3,252	21,500	2,236	240	
	8	4,998	21,600	1,607	-135	
	-29	3,055	21,700	1,084	309	
	-6	2,900	21,800	1,267	187	
	71	2,855	21,900	607	112	
※	833	4,652	22,000	616	50	
	251	2,227	22,100	198	76	
	532	4,220	22,200	669	55	
	169	2,521	22,300	82	9	
	89	2,242	22,400	71	26	
	118	3,178	22,500	16	11	
	815	2,755	22,600	4	-1	
	350	3,222	22,700	0	0	
	223	1,783	22,800	44	0	
	3,800	68,580	總計	97,890	338	
	P/C	1.4274	||	增減	-0.0785	

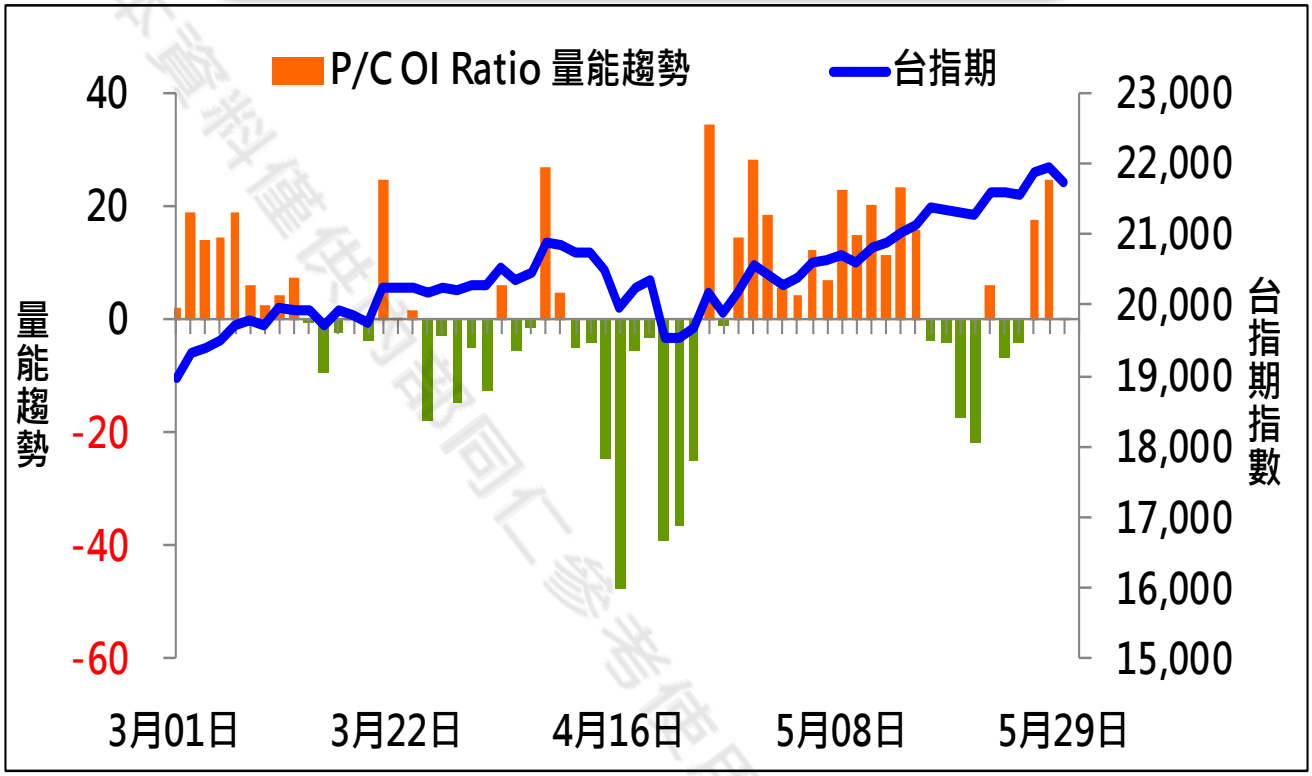
※本報告僅供內部參考，非經同意不得轉載。

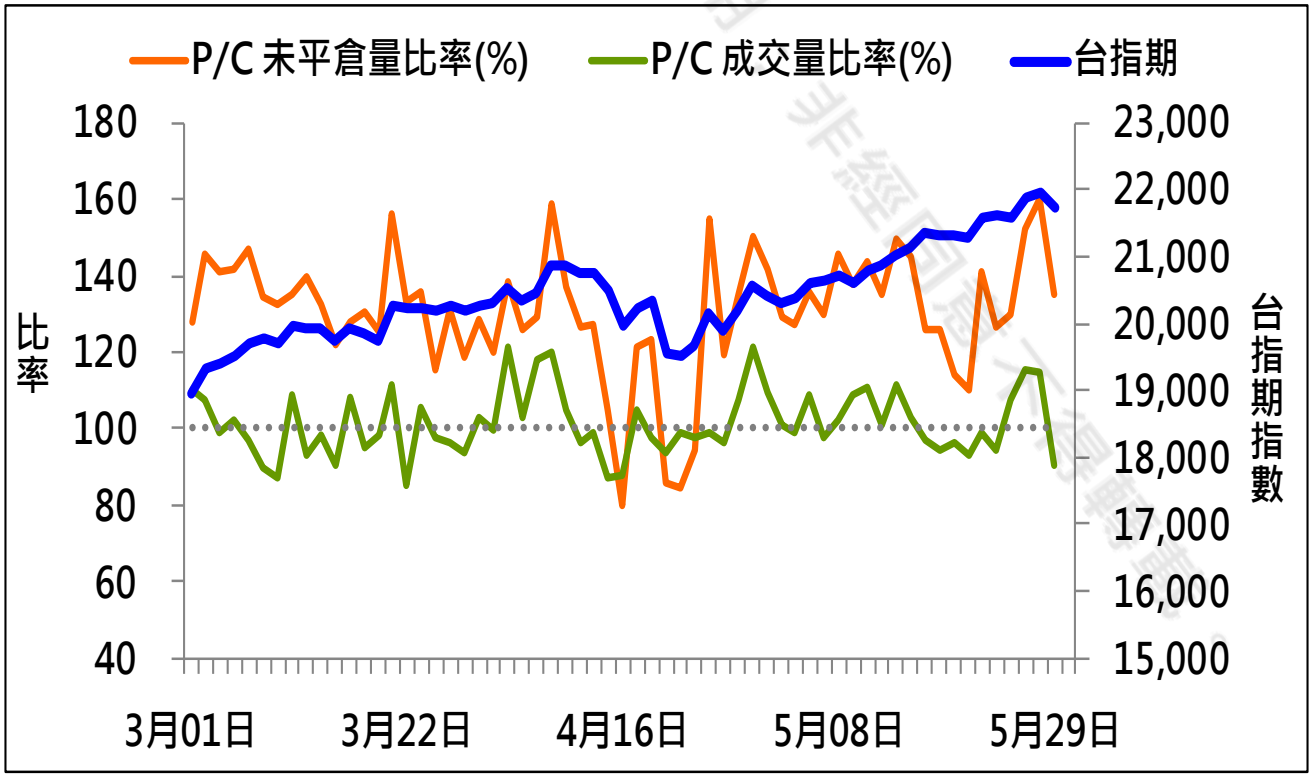
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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。

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