
兆豐期貨顧問事業部-盤後資料整理與解析

 日期/時間
2023/5/3

台灣市場-指數收盤表現				
指數名稱	成交價	漲跌	漲跌幅	金額(億元)
加權指數	15553	-83.07	-0.53%	2019.16
50指數	11661	-61.74	-0.53%	-
100指數	14168	-91.96	-0.64%	-
電子類	724.01	-4.13	-0.57%	1000.49
金融類	1563.7	-4.28	-0.27%	53.77
未金電	15277	-86.78	-0.56%	823.66

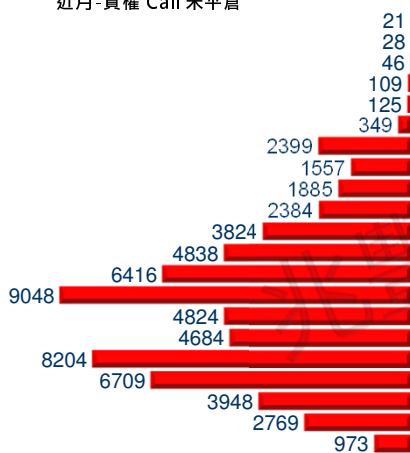
亞洲市場-指數收盤表現				
指數名稱	成交價	漲跌	漲跌幅%	時間
加權指數	15553.41	-83.07	-0.53%	133100
日經指數	29157.95	34.77	0.12%	150001
韓國首爾(D)	2501.4	-22.99	-0.91%	153040
恆生指數	19635.81	-298.00	-1.49%	151722
深圳綜合	2056.04	28.57	1.41%	150003
上海綜合	3323.27	37.39	1.14%	150009
道瓊指數	33684.53	-367.17	-1.08%	162000

台灣市場-期貨近月契約收盤表現											
契約名稱	結算價	開盤價	最高價	最低價	昨收	漲跌	漲跌幅	成交量	成交量增減	未平倉量	平倉量增減
台指期貨	15549	15559	15595	15523	15552	▼-83	▼-0.53%	110636	-7520	72685	-1448
電子期貨	723.55	724.95	726.15	721.85	723.45	▼-4.3	▼-0.59%	1257	-344	1936	94
金融期貨	1563.4	1558.4	1566.2	1557	1563.4	▼-3.2	▼-0.20%	579	-249	1271	11
非金電期	-	15553	15590	15531	15566	▼-63	▼-0.40%	1323	-37	0	0
富台期	1358	1357	1358.5	1357	1357.25	1	0.06%	587	496	94442	518

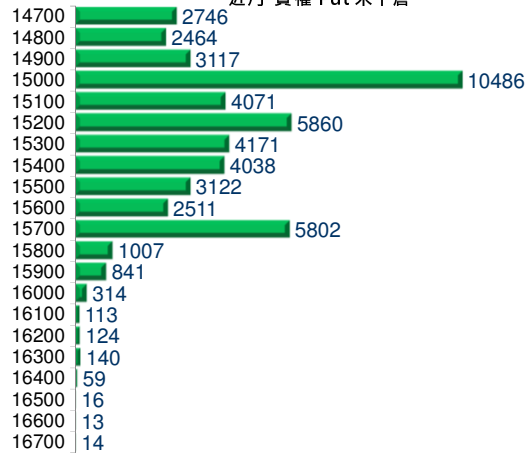
註：以上報價係提供台灣期貨交易所之結算價，與當日期貨收盤價之漲跌或有些許差異，特此告知。

台灣市場-選擇權契約總結分析											
商品/分析	選擇權(交易量)數據		選擇權(未平倉量)數據						Ratio(全市)		Ratio(近月)
	成交量最大	增加最多	(未平倉最大)	(增加最多)	(減少最多)	未平倉數量(全市)	平倉量增減(全市)	未平倉數量(近月)	平倉量增減(近月)	VOL P/C Ratio	VOL P/C Ratio
CALL 履約價	16000	15700	16000	16000	16500	126785	(46398)	74093	3672	1.017182	1.062894
PUT 履約價	15200	15200	15000	15000	15500	129592	(85714)	74142	2119	1.022140	1.000661

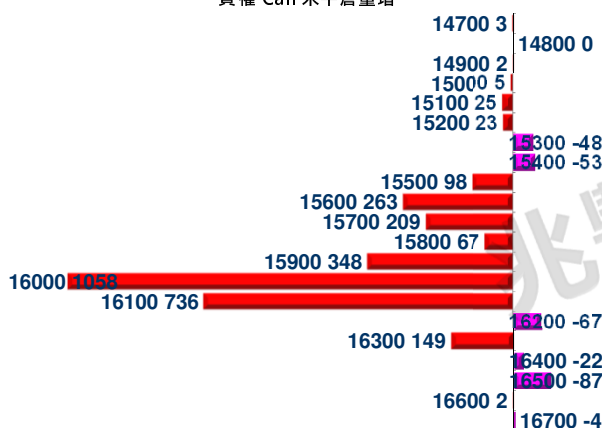
近月-買權 Call 未平倉



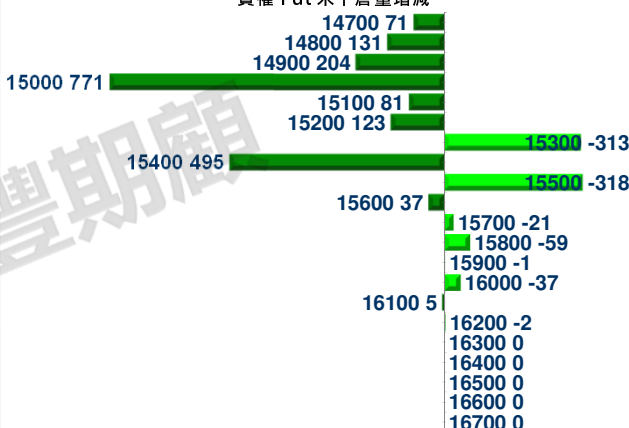
近月-賣權 Put 未平倉

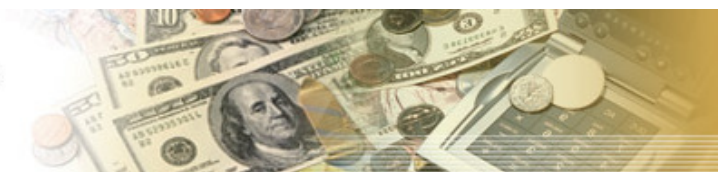


買權 Call 未平倉量增



賣權 Put 未平倉量增減





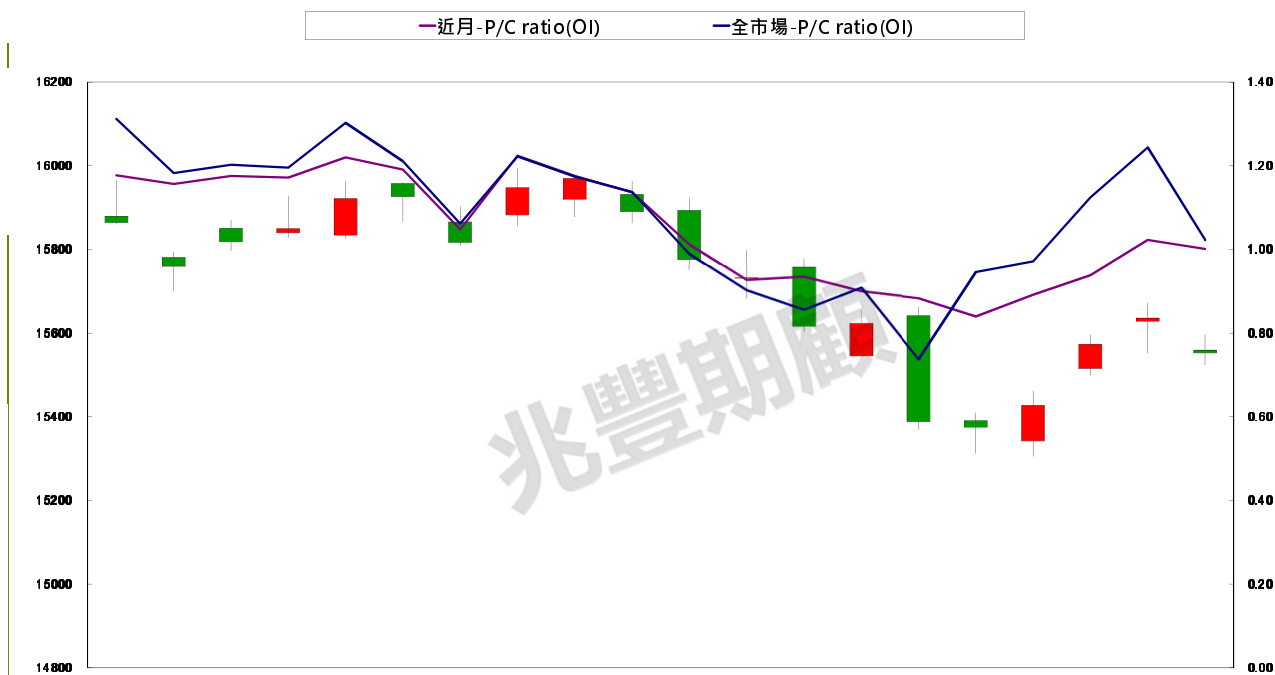
近月選擇權契約-量能分析

2023/5/3

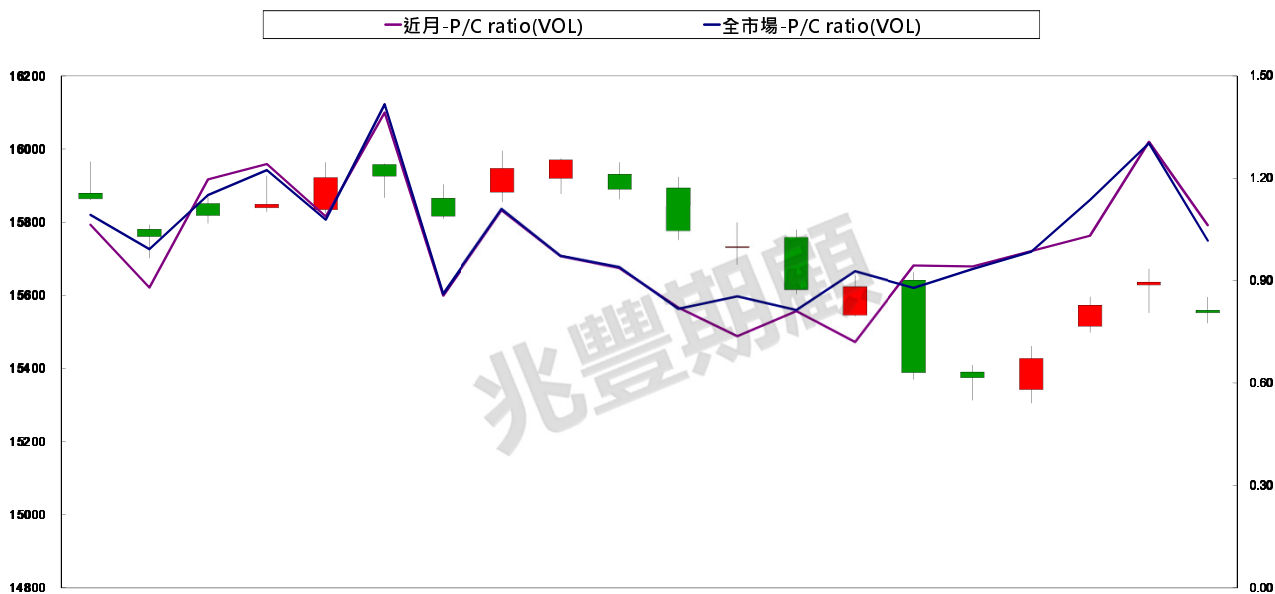
當日成交量前五名-近月選擇權契約收盤表現

買權 Call						賣權 Put					
月份	履約價	結算價	漲跌	成交量	未平倉量	月份	履約價	結算價	漲跌	成交量	未平倉量
202305	15700	97	▼-34	2958	3824	202305	15400	111	▲+29	2522	4038
202305	15800	61	▼-28	2291	4838	202305	15200	62	▲+18	2272	5860
202305	16000	22	▼-13	2230	9048	202305	15000	34	▲+10	1988	10486
202305	15900	38.5	▼-18.5	1965	6416	202305	15300	83	▲+21	1760	4171
202305	15600	141	▼-43	1619	2384	202305	15500	147	▲+36	1610	3122

近月選擇權契約 (OI) Put/Call Ratio 走勢圖 V.S 台指期當月走勢圖表



近月選擇權契約 (VOL) Put/Call Ratio 走勢圖 V.S 台指期當月走勢圖表



台股現貨籌碼面資料整理

三大法人現貨買賣金額(億)

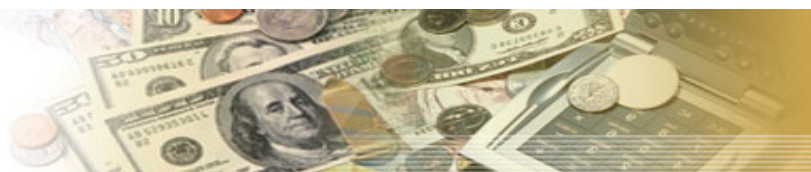
法人對象	外資及陸資	自營商	投信	三大法人合併
買進金額	509.22	71.83	36.36	617.41
賣出金額	600.41	100.24	29.48	730.14
買賣差額	-91.20	-28.41	6.88	-112.73

加權指數走勢 V.S 三大法人期、現貨買賣超走勢圖表



本報告係依據已公開之資料進行整理研判，本公司不負任何法律責任。本報告內容亦禁止轉載，違者必究。

主管機關核准可證照字號：108年金管期總字第002號 兆豐期貨地址：台北市中正區忠孝東路二段95號2F 電話(02)2327-8895

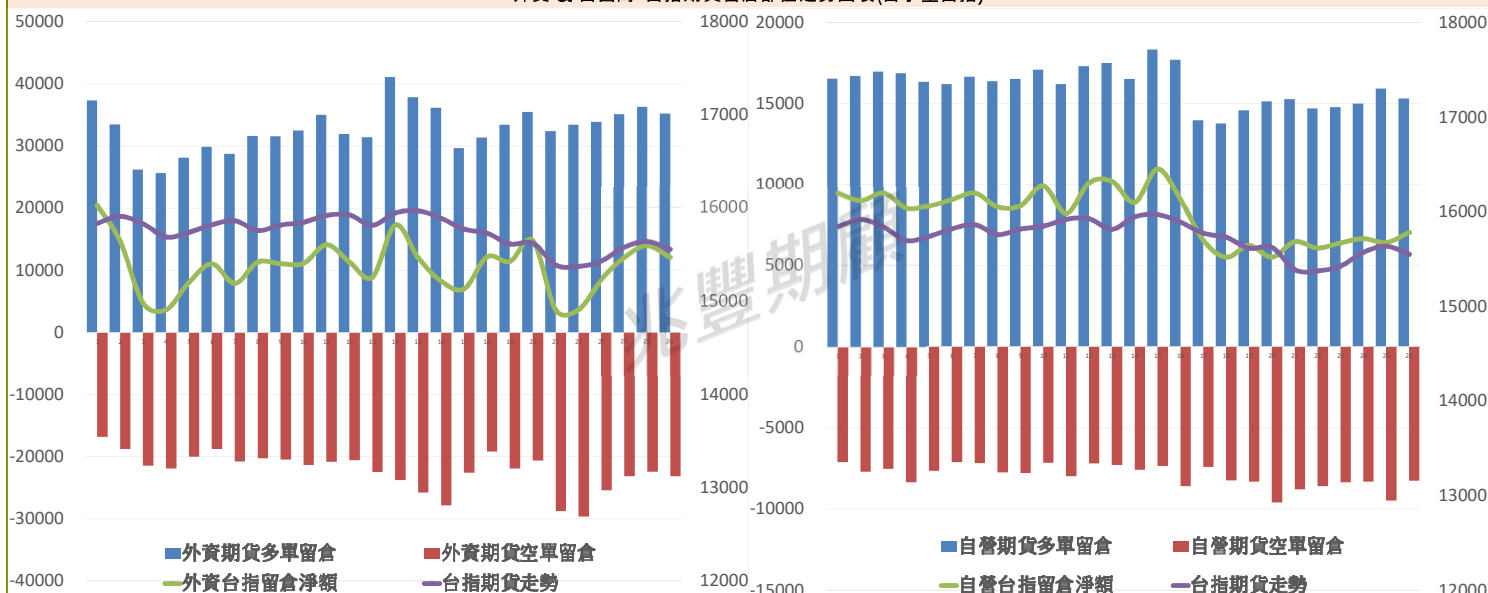


台股期貨&選擇權籌碼面資料整理(一)

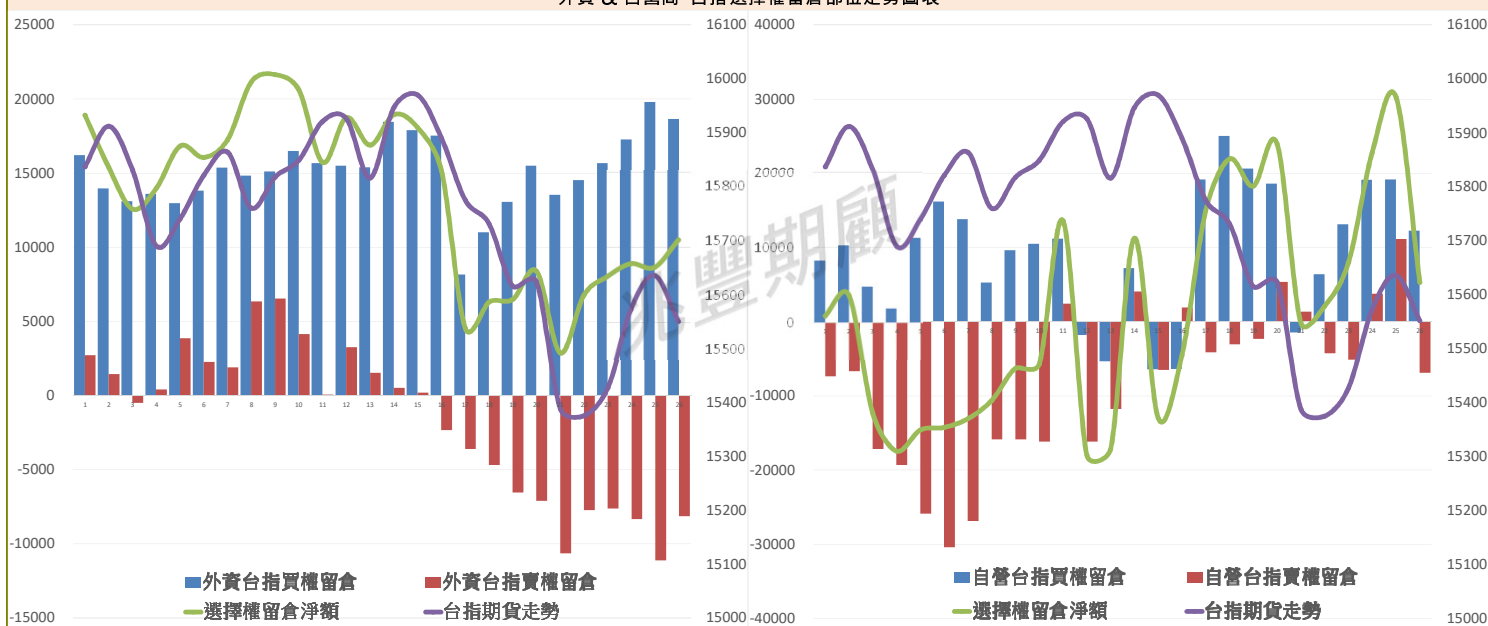
Futures	三大法人期貨留倉部位變化											
	外資及陸資			自營商			投信			三大法人合併		
	淨部位	本日增減	合約價值	淨部位	本日增減	合約價值	淨部位	本日增減	合約價值	淨部位	本日增減	合約價值
台指期貨(含小台)	12019	-1857	412.81	7062	637	172.13	-7702	-185	-239.94	11378	-1405	345.00
電子期貨	459	23	13.28	215	-37	6.23	174	0	5.04	848	-14	24.55
金融期貨	-268	-11	-4.19	39	62	0.61	79	0	1.24	-150	51	-2.35
非金電期貨	0	0	0.00	-101	0	-0.85	0	0	0.00	-101	0	-0.85

Options	三大法人選擇權留倉部位變化											
	外資及陸資			自營商			投信			三大法人合併		
	留倉部位	本日增減	合約價值	留倉部位	本日增減	合約價值	留倉部位	本日增減	合約價值	留倉部位	本日增減	合約價值
買權 Call	18647	-72	0.46	12228	-12509	1.83	0	0	0.00	30875	-12581	2.29
賣權 Put	8153	-158	0.31	6909	6977	1.02	337	0	-0.01	15399	6819	1.32
選擇權留倉淨額	10494	86	0.15	5319	-19486	0.81	-337	0	0.02	15476	-19400	0.98

外資 & 自營商 台指期貨留倉部位走勢圖表(含小型台指)



外資 & 自營商 台指選擇權留倉部位走勢圖表



本報告係依據已公開之資料進行整理研判，本公司不負任何法律責任。本報告內容亦禁止轉載，違者必究。
 主管機關核准許可證照字號：108年金管期總字第002號 兆豐期貨地址：台北市中正區忠孝東路二段95號2F 電話(02)2327-8895



兆豐期貨 Mega Futures



台股期貨&選擇權籌碼面資料整理(二)

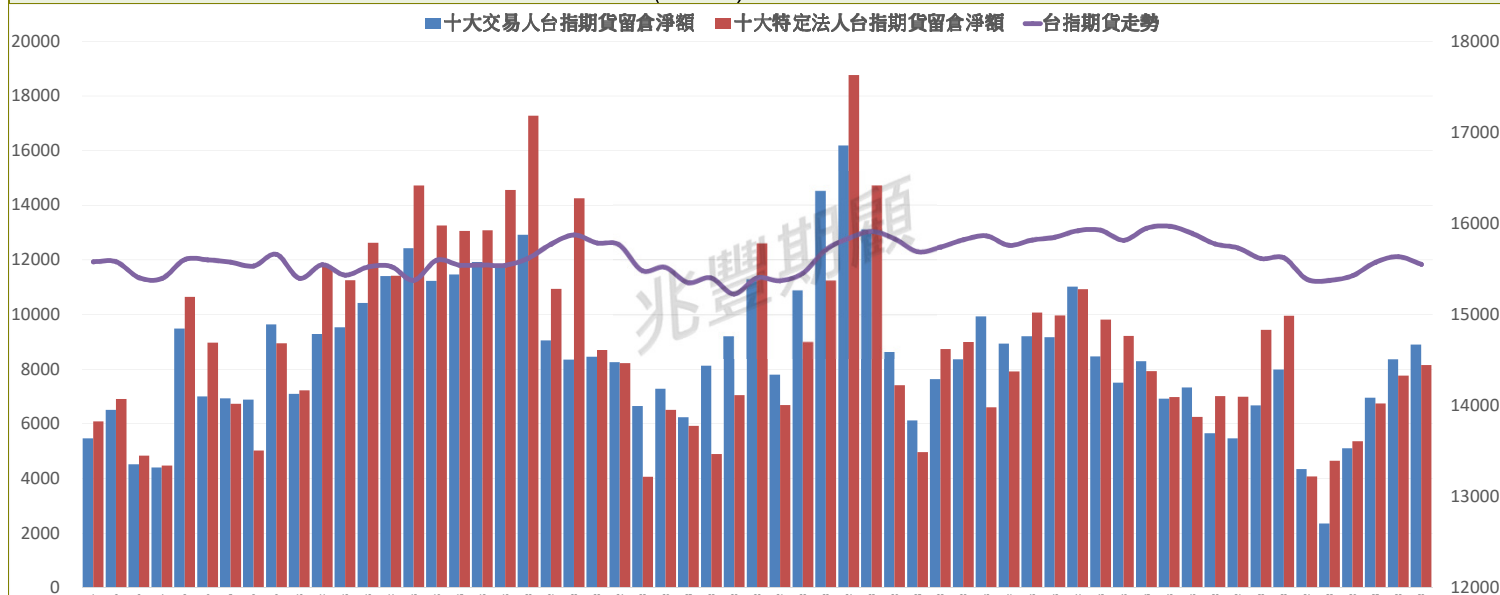
Futures	(大額交易者)期貨留倉部位變化			
	五大交易人		十大交易人	
	淨部位	本日增減	淨部位	本日增減
台指期貨(含小台)	6614	1268	8892	531
電子期貨	-357	60	-275	29
金融期貨	155	0	169	39
非金電期貨	30	-2	17	-3

Options	(大額交易者)選擇權留倉部位變化			
	五大交易人		十大交易人	
	淨部位	本日增減	淨部位	本日增減
買權 Call	35417	-3103	33386	-4727
賣權 Put	-12860	-18099	-11886	-18347
選擇權留倉淨額	48277	14996	45272	13620

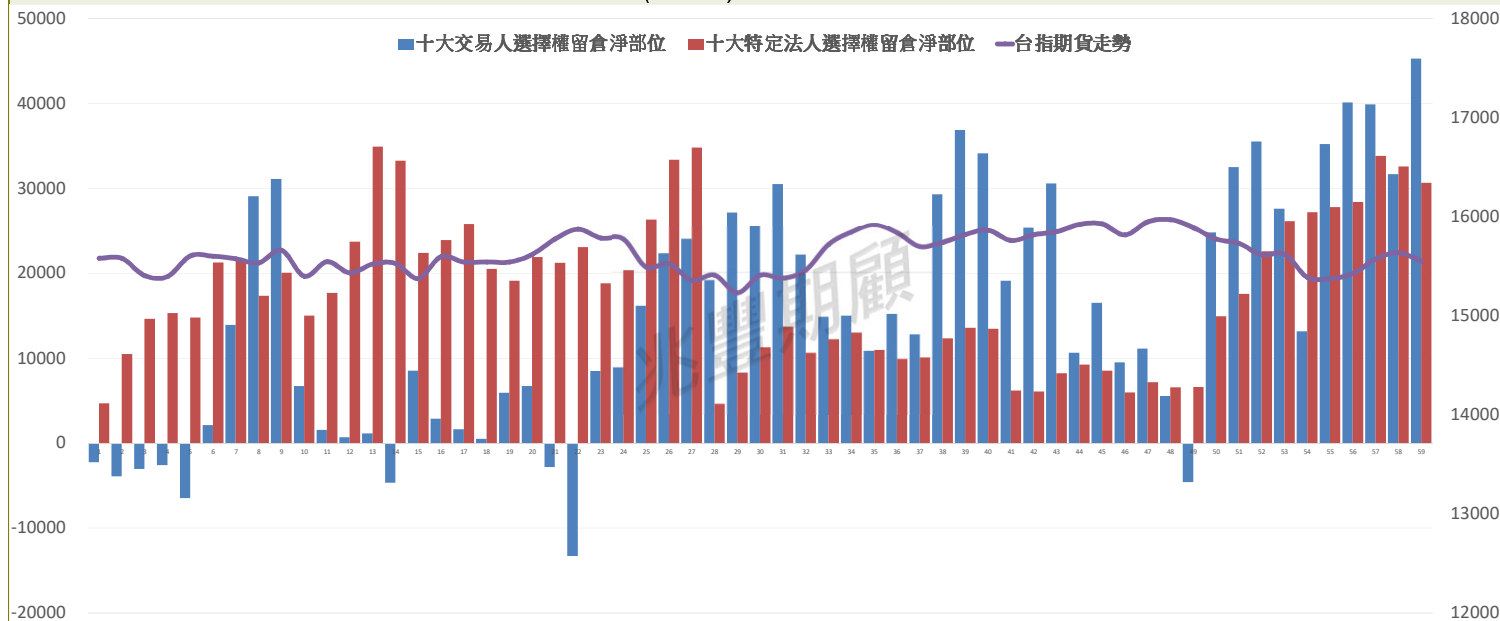
Futures	(特定法人)期貨留倉部位變化			
	五大特定法人		十大特定法人	
	淨部位	本日增減	淨部位	本日增減
台指期貨(含小台)	9114	728	8152	393
電子期貨	322	70	505	84
金融期貨	-299	1	-184	87
非金電期貨	61	3	72	14

Options	(特定法人)選擇權留倉部位變化			
	五大特定法人		十大特定法人	
	淨部位	本日增減	淨部位	本日增減
買權 Call	21049	757	18591	-1701
賣權 Put	-11148	-3028	-12065	207
選擇權留倉淨額	32197	3785	30656	-1908

前十大交易人(特定法人)台指期貨留倉部位走勢圖表



前十大交易人(特定法人)台指選擇權留倉部位走勢圖表



本報告係依據已公開之資料進行整理研判，本公司不負任何法律責任。本報告內容亦禁止轉載，違者必究。
主管機關核准可證照字號：108年金管期總字第002號 兆豐期貨地址：台北市中正區忠孝東路二段95號2F 電話(02)2327-8895

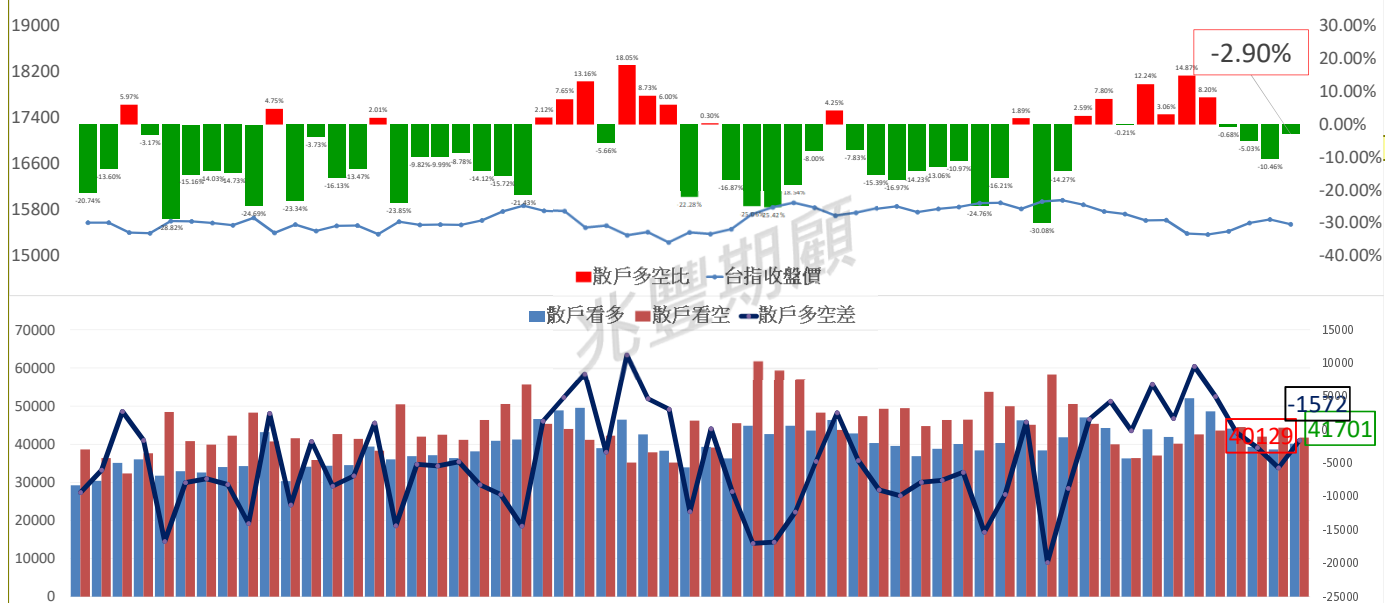


兆豐期貨 Mega Futures

台指VIX 恐慌指數



散戶籌碼變化圖



本日經濟數據整理

預告區間

時間	地區	項目	重要性	前值	市場預估	結果
05/03 04:30	美國	<4月28日>API原油庫存變化	中		-100萬	-393.9萬
05/03 17:00	歐元區	<3月>失業率	高		6.8%	
05/03 19:00	美國	<4月28日>MBA-30年期抵押貸款利率	中			
05/03 20:15	美國	<4月>ADP就業人口變化	中		12萬	
05/03 21:45	美國	<4月>S&P Global綜合PMI-終值	中		53.5	
05/03 21:45	美國	<4月>S&P Global服務業PMI-終值	中		53.7	
05/03 22:00	美國	<4月>ISM服務業PMI	高		50.6	
05/03 22:00	美國	<4月>ISM服務業就業人口	中		51	
05/03 22:30	美國	<4月28日>EIA原油庫存變化	中			