



元富證券

元富期貨

MasterLink Futures

國內盤後日報

期貨顧問部

2023/10/13

OPEN DELTA

外資期權合計：為淨空單81口大台
淨空單較前一日增加1711口大台

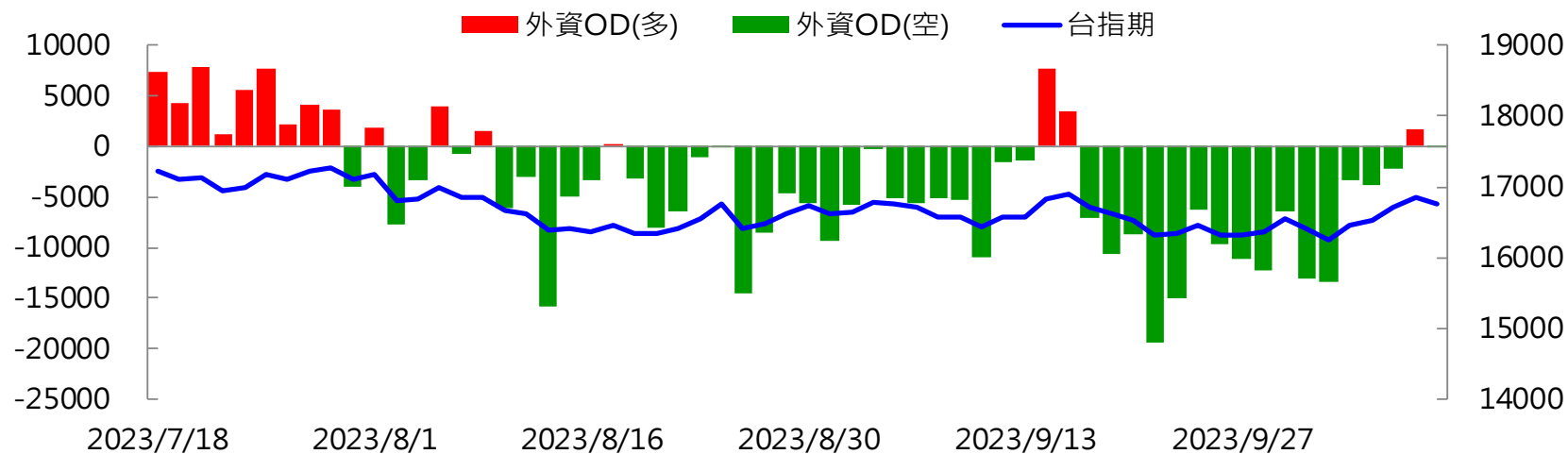
		未平倉口數	成本	約當履約價	總Delta	OPTIONS DELTA	增減		
買權	買方	46021	133.5	16704	6759	1938	-393		
	賣方	20111	117.3	16733	-2771				
	淨買賣	25910			3988				
賣權	買方	53332	38.8	16613	-4044				
	賣方	21186	56.5	16674	1993				
	淨買賣	32146			-2051				
								FUTURES DELTA	增減
大台	淨多空	-468			-468			-2018	-1318
小台	淨多空	-6201			-1550				
				總Delta		-81	-1711		

自營期權合計：為淨多單1326口大台
淨多單較前一日減少154口大台

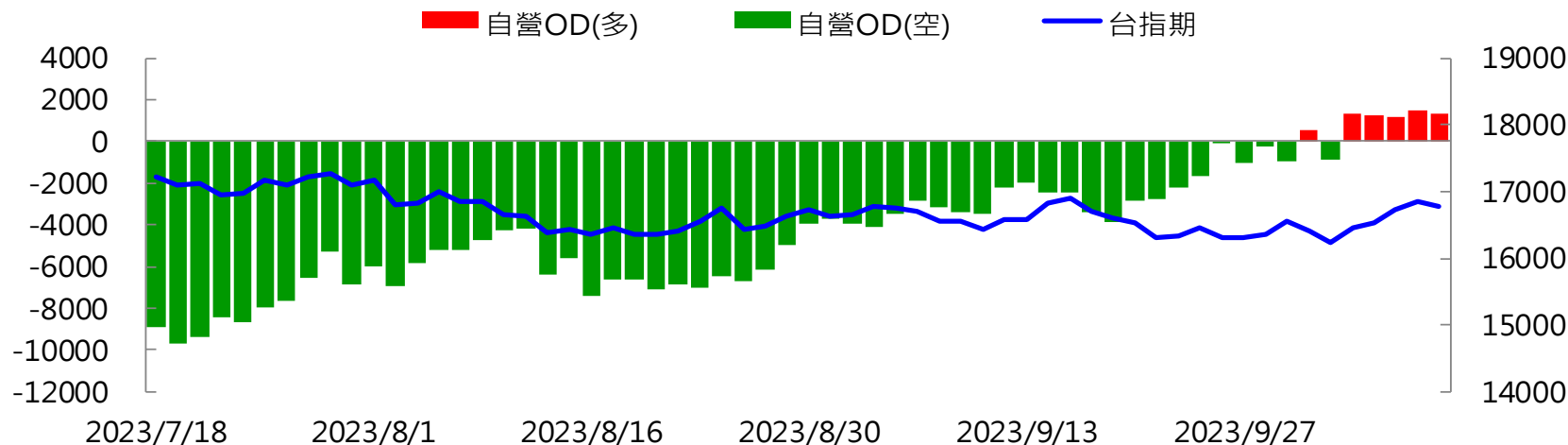
		未平倉口數	成本	約當履約價	總Delta	OPTION DELTA	增減		
買權	買方	63791	117.7	16732	8804	-368	-976		
	賣方	60842	97.5	16768	-7706				
	淨買賣	2949			1097				
賣權	買方	53491	84.4	16746	-6235				
	賣方	51697	54.8	16668	4770				
	淨買賣	1794			-1465				
								FUTURE DELTA	增減
大台	淨多空	648			648			1694	822
小台	淨多空	4184			1046				
				總Delta		1326	-154		

OPEN DELTA

外資Opendelta約-81口

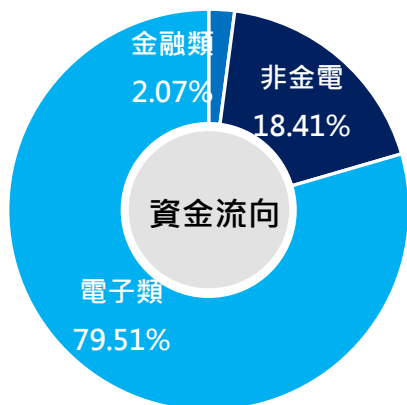


自營Opendelta約1326口

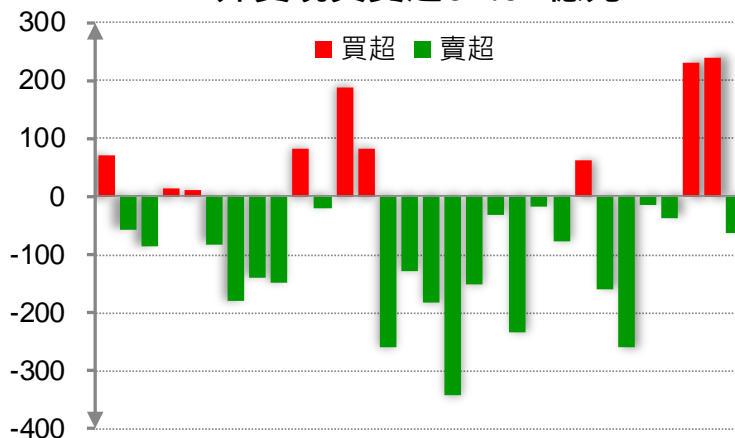


■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

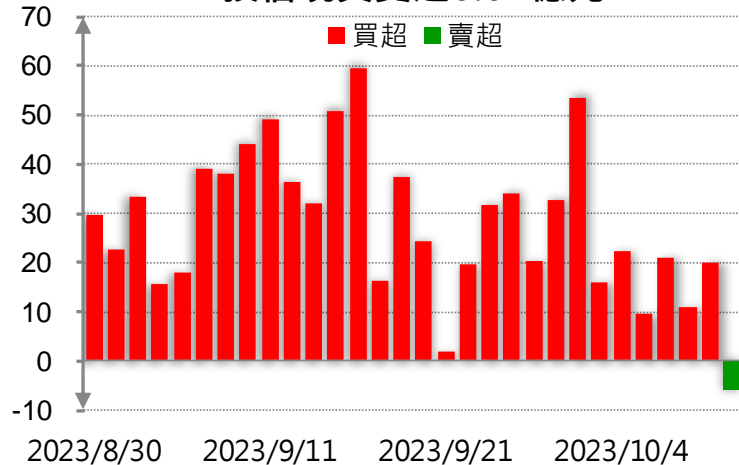
三大法人籌碼



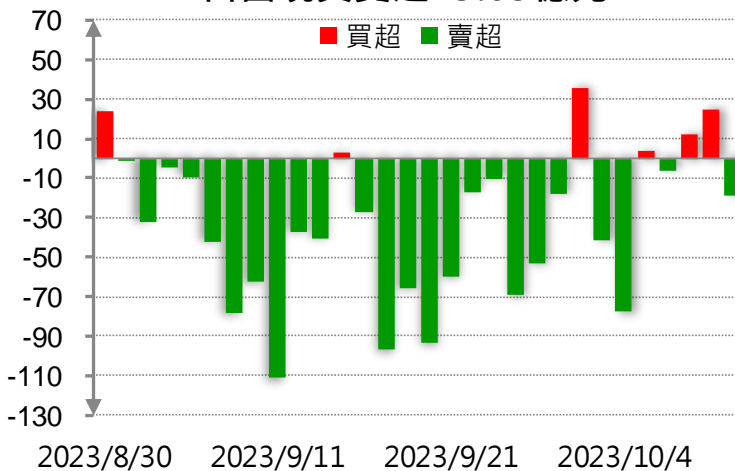
外資現貨賣超61.01億元



投信現貨賣超6.01億元



自營現貨賣超19.03億元



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

台指盤後籌碼

三大法人 證，期，權 買賣超 (金額)

	現貨	期貨	選擇權	Total
外資	-61.01億	-44.56億	0.06億	-105.51億
自營商	-19.03億	27.60億	-0.78億	7.79億
投信	-6.01億	-3.23億	0.00億	-9.24億
Total	-86.04億	-20.19億	-0.72億	-106.95億

台指期十大交易人 Futures OI (口)

	近月	增減	遠月	增減	全月	增減
十大合計	-5956	729	785	361	-5171	1090
特定法人	-6715	2389	845	420	-5870	2809

■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

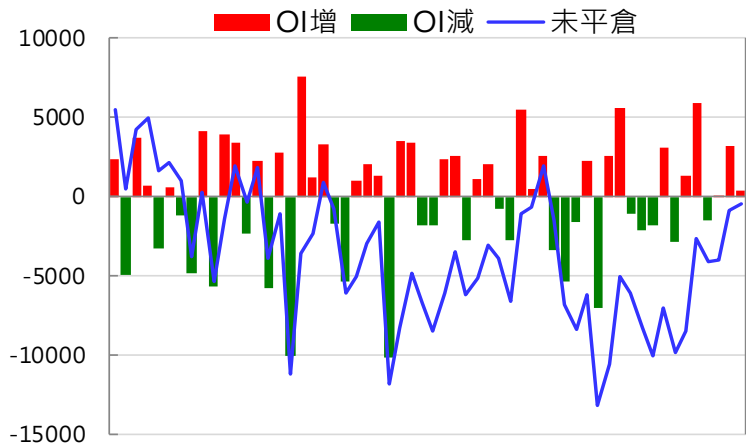
三大法人期權未平倉量

Call								
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減		
外資	46021	5169	20111	929	25910	4240		
自營商	63791	3681	60842	11443	2949	-7762		
投信	200	0	50	0	150	0		
Put								
	Buy	增減	Sell	增減	淨部位	增減		
外資	53332	7027	21186	2755	32146	4272		
自營商	53491	5727	51697	163	1794	5564		
投信	250	0	118	0	132	0		
大台指期		小台指期		電子期		金融期		
	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減	未平倉	增減
外資	-468	409	-6201	-6908	-421	-27	124	-32
自營商	648	1314	4184	-1967	-105	-12	-438	-2
投信	3718	-96	167	-1	172	-1	16	0

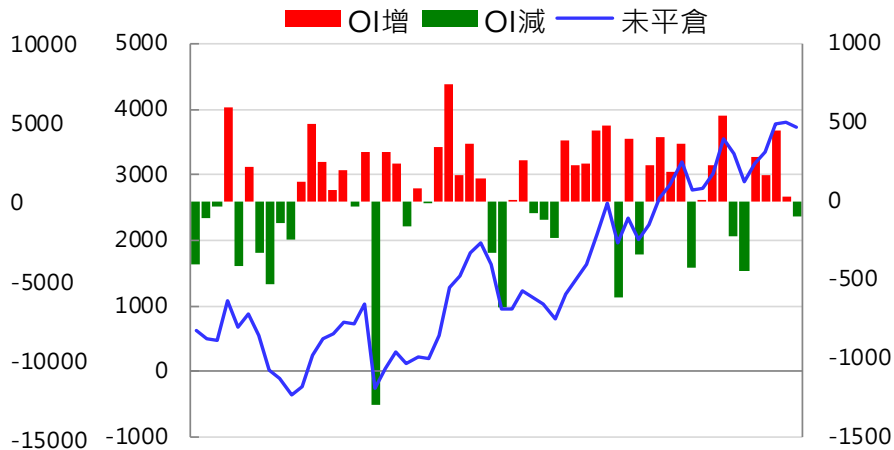
■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料 | 單位：口

三大&十大OI

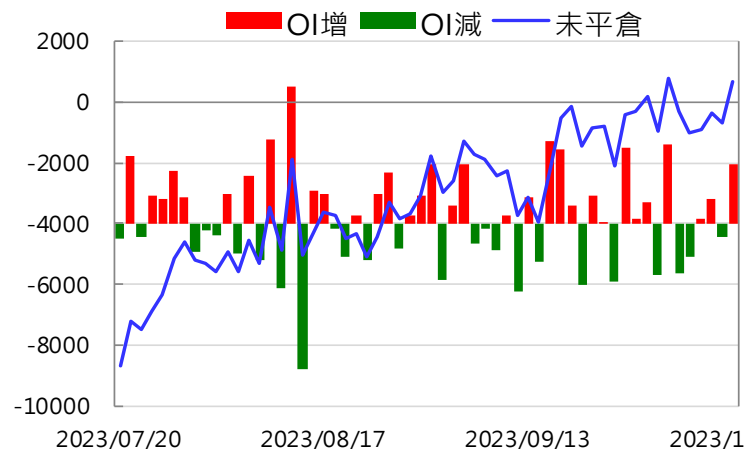
外資期貨未平倉-468口



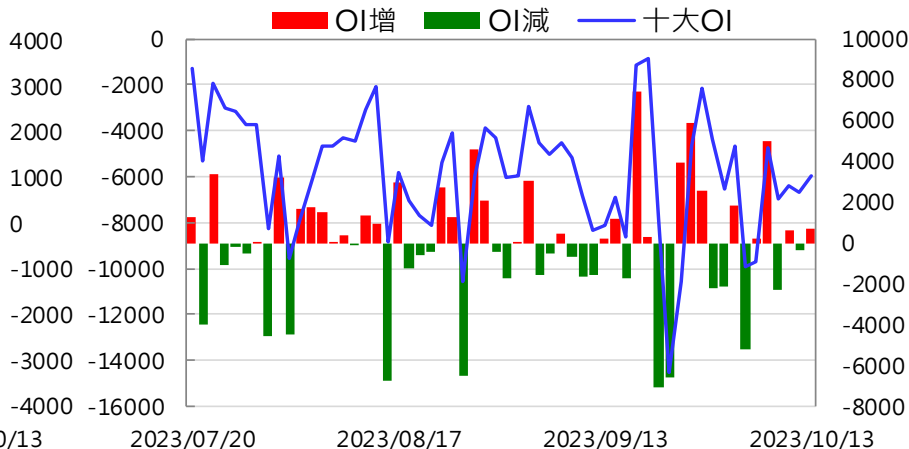
投信期貨未平倉3718口



自營期貨未平倉648口



近月十大未平倉-5956口



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

雙週選未平倉量

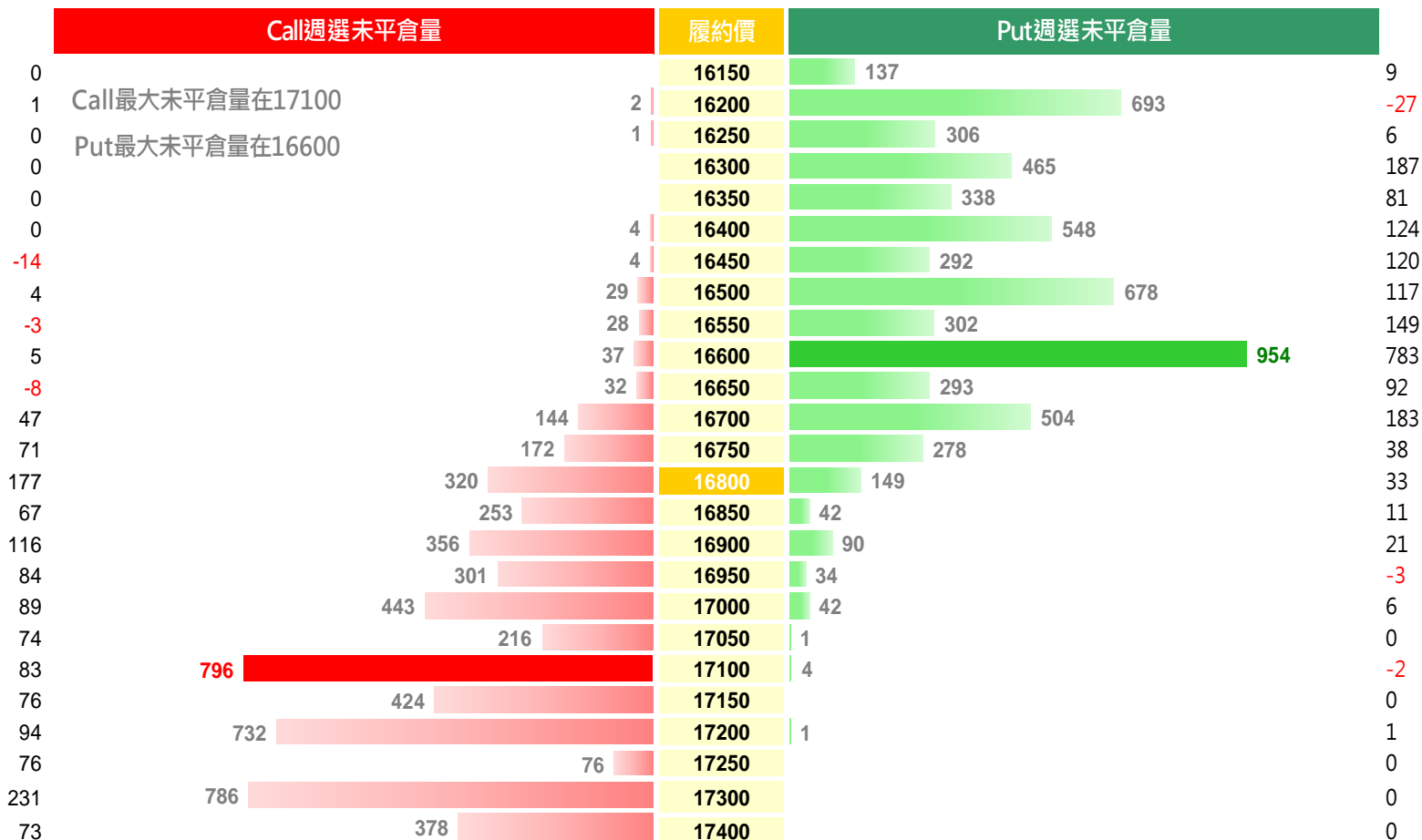
Call總未平倉量為6955口，增加1830口

Put總未平倉量為8687口，增加2884口

2023/10/13

202310W4

週選到期天數： 12天



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

近月未平倉量

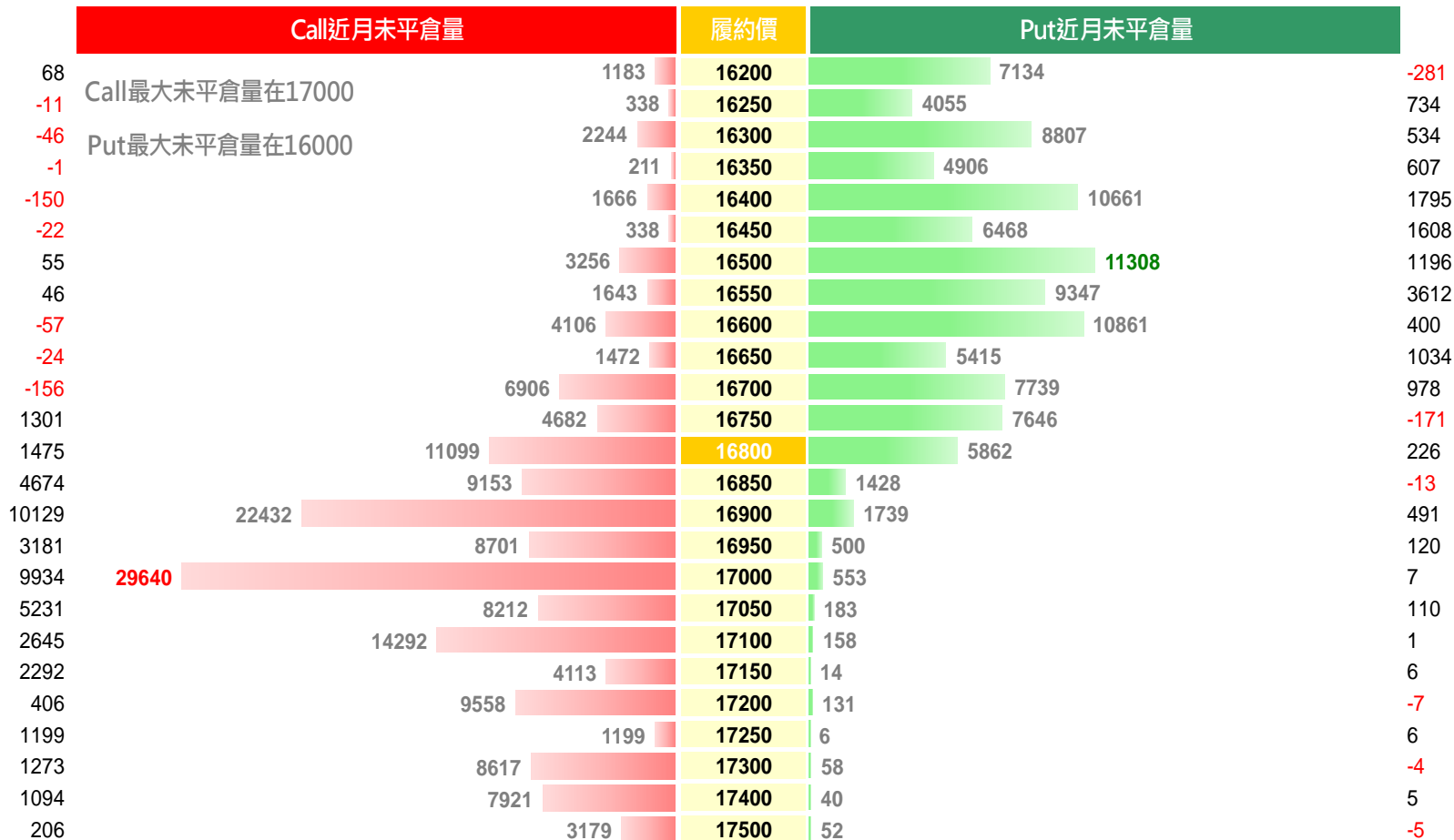
Call總未平倉量為180927口 · 增加43626口

Put總未平倉量為172698口 · 增加10974口

2023/10/13

202310

近月到期天數： 5天



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

次月未平倉量

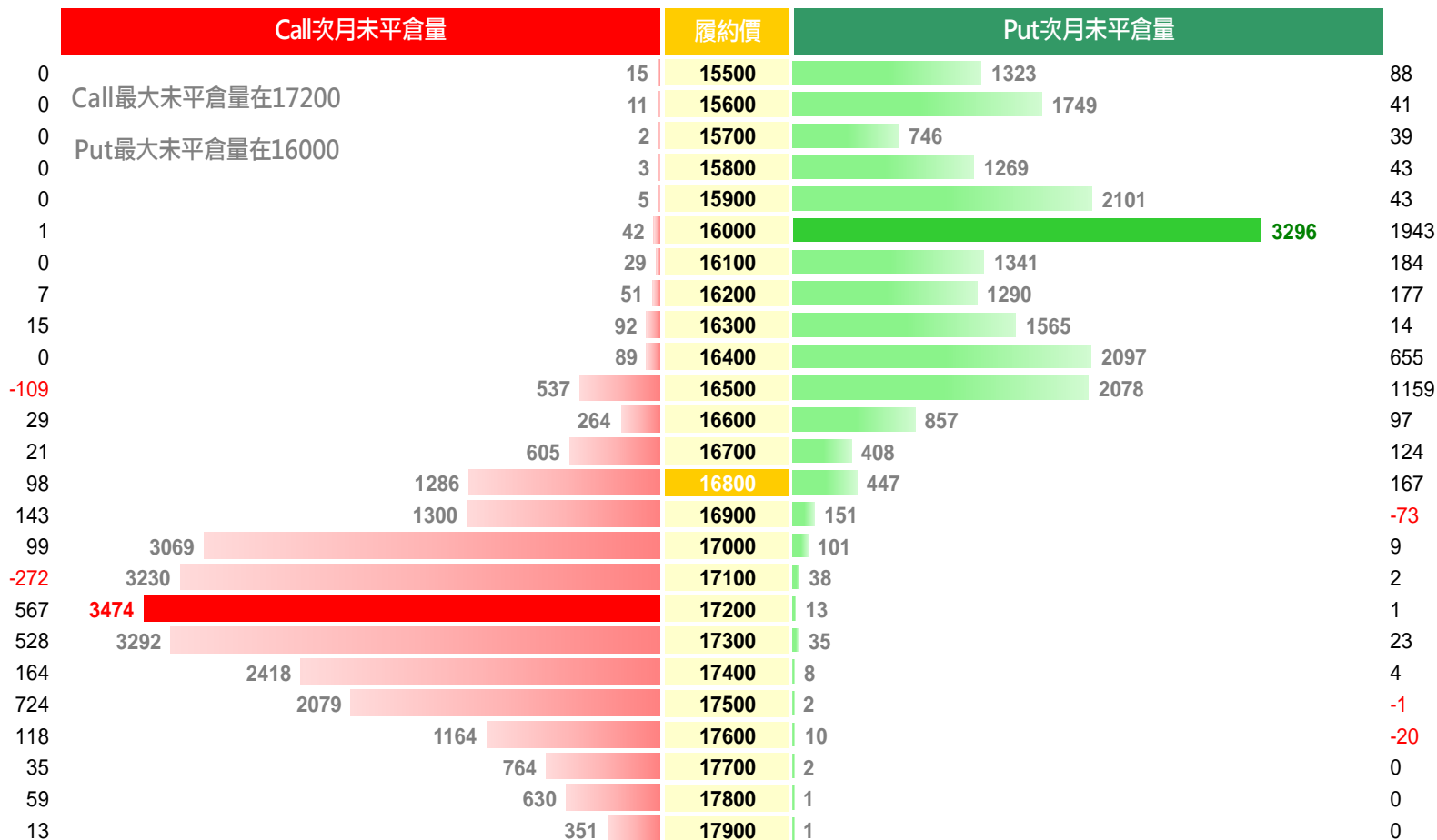
Call總未平倉量為31856口 · 增加2798口

Put總未平倉量為28799口 · 增加6154口

2023/10/13

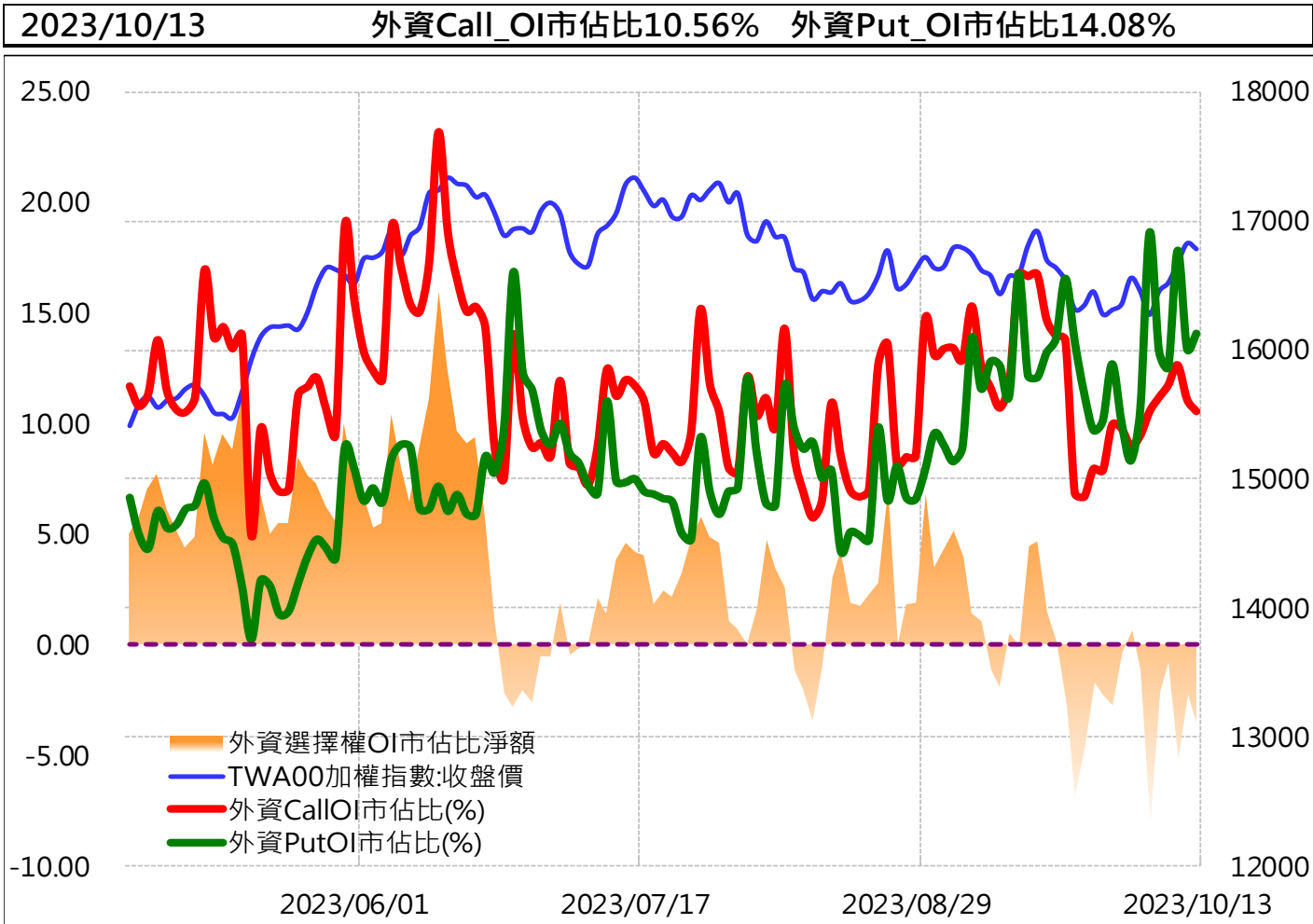
202311

次月到期天數： 33天



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

外資選擇權未平倉市佔比



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

VIX&P/C RATIO

台指期

16770.00

漲跌 ▼ -78.00

P/C ratio

0.93

漲跌 ▼ -0.14

VIX

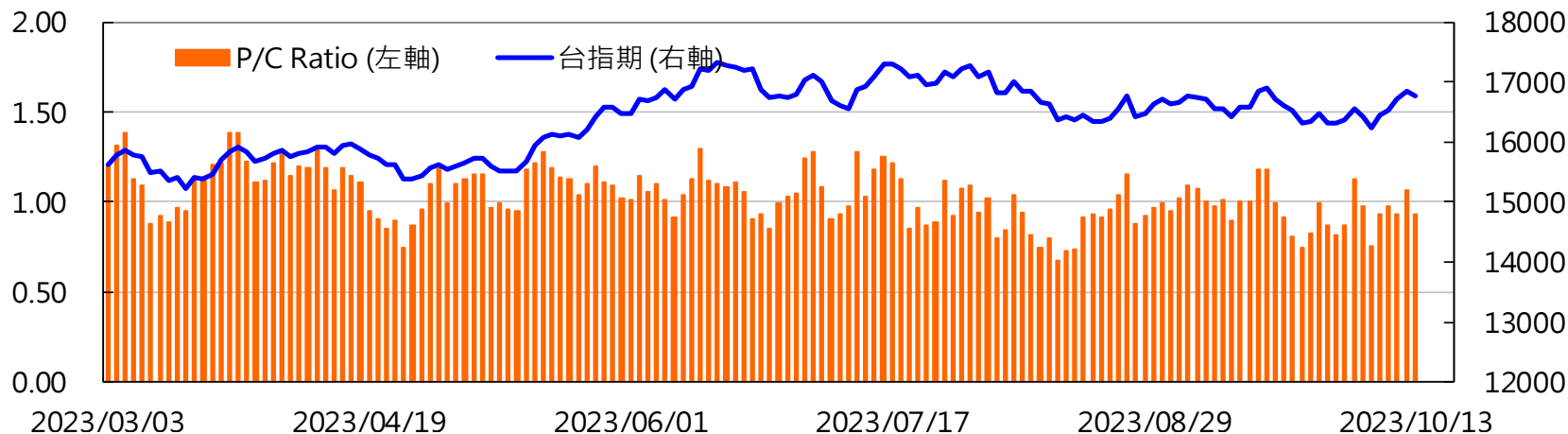
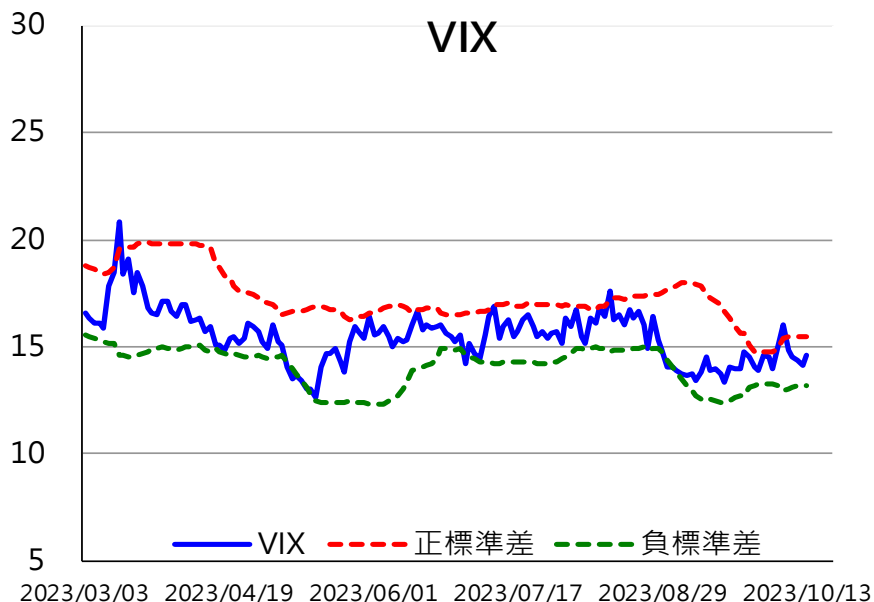
14.63

漲跌 ▲ 0.53

2個標準差(正) 15.49

2個標準差(負) 13.21

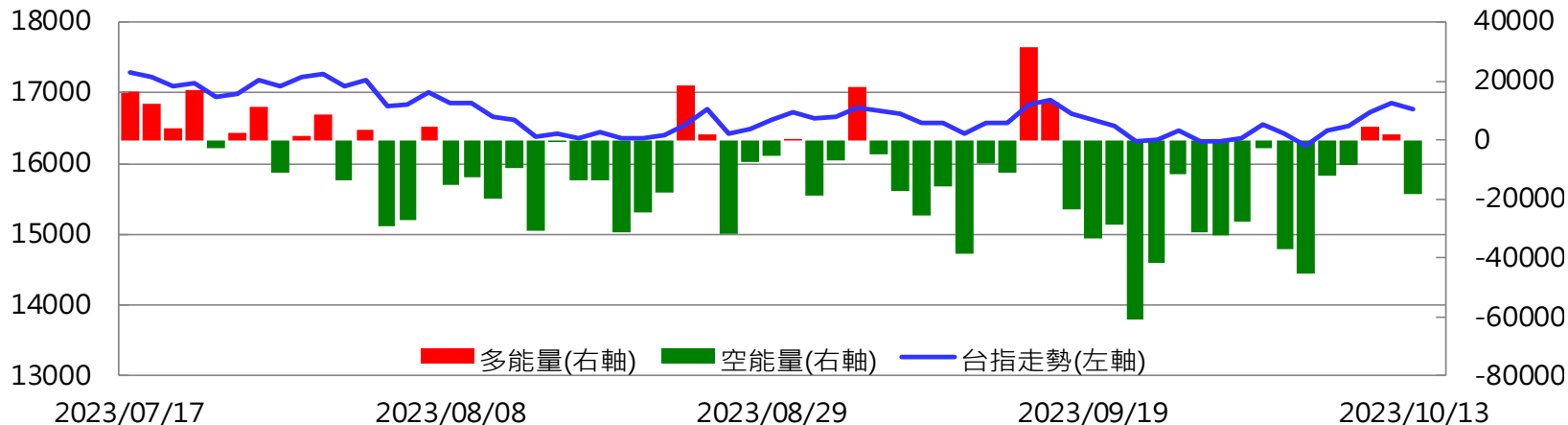
成本線 15.10



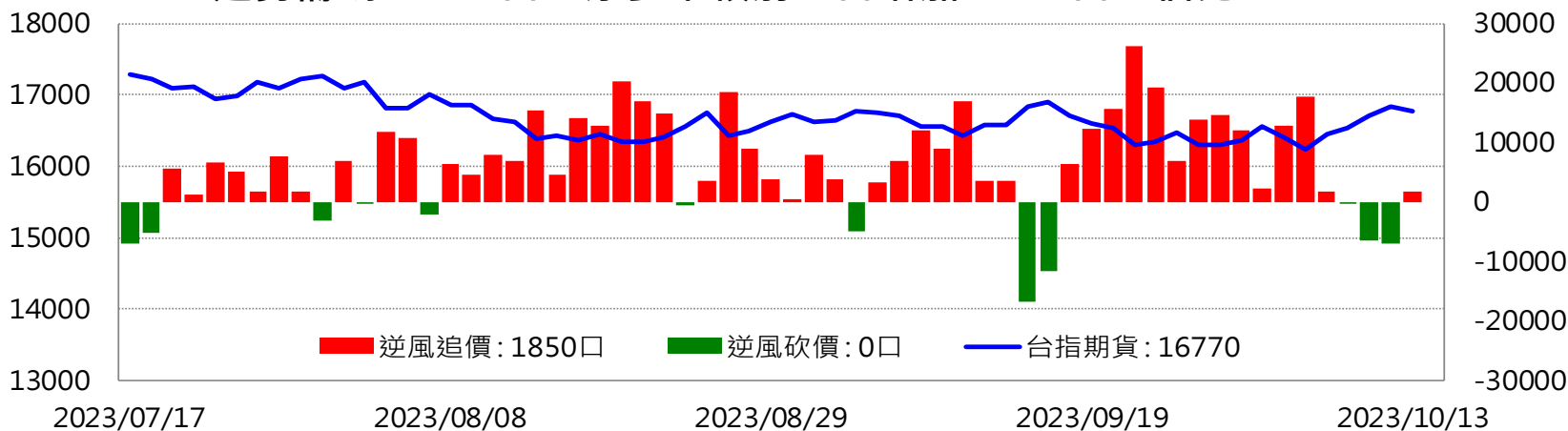
■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

獨家籌碼指標

多空能量指標 -18603口、淨空單較前一日增加 20724口，佔比22.43%



逆勢籌碼 1850口、淨多單較前一日增加 8876口，佔比3.35%



■ 以上為日盤資料，不包括夜盤資料

權值股貢獻點數

加權指數 16782.57 下跌43.34點 漲跌幅-0.26%

排序	代號 股票	收盤價	漲跌幅	上漲影響點數
1	2330 台積電	553	0.55%	24.88
2	2454 聯發科	842	3.31%	13.81
3	1590 亞德客-KY	1075	4.88%	3.20
4	6415 矽力*-KY	321	8.08%	2.94
5	2345 智邦	545	2.83%	2.69
6	2317 鴻海	107.5	0.47%	2.22
7	3008 大立光	2175	1.16%	1.07
8	3034 聯詠	436.5	1.04%	0.88
9	2449 京元電子	83.1	2.59%	0.82
10	2363 矽統	47.7	6.12%	0.66
合計前十大 上漲 影響點數				53.15

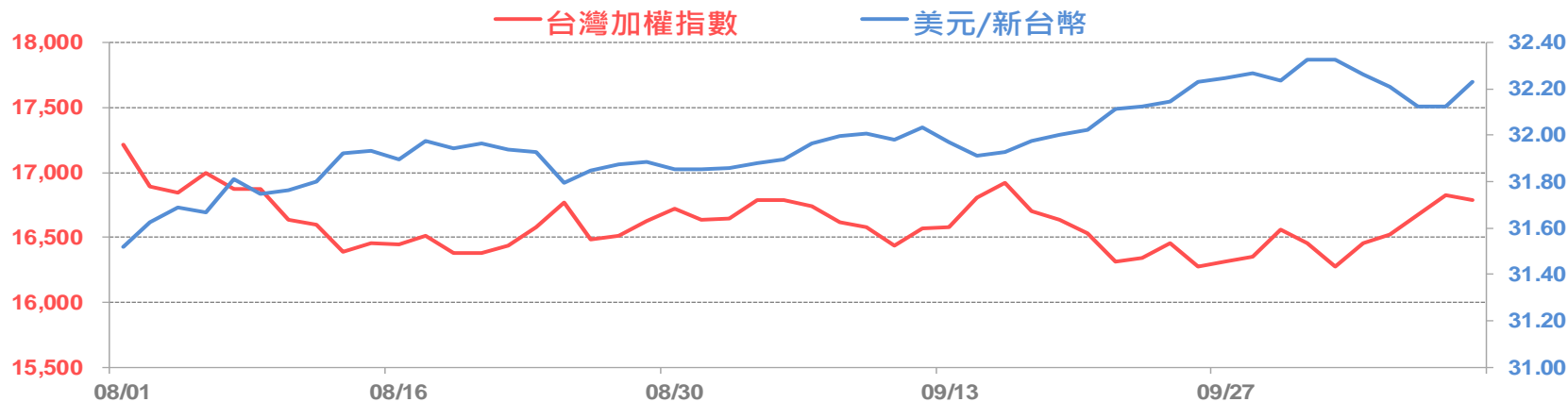
排序	代號 股票	收盤價	漲跌幅	下跌影響點數
1	2382 廣達	226	-5.04%	-14.82
2	2308 台達電	328.5	-2.23%	-6.23
3	2301 光寶科	115.5	-5.71%	-5.30
4	2882 國泰金	45.3	-1.84%	-3.99
5	6505 台塑化	80.1	-1.6%	-3.96
6	1303 南亞	66.3	-2.07%	-3.55
7	2881 富邦金	60.9	-1.3%	-3.33
8	3231 緯創	99.1	-3.32%	-3.16
9	2357 華碩	365	-3.31%	-2.97
10	2376 技嘉	271	-4.75%	-2.74
合計前十大 下跌 影響點數				-50.04

加權指數VS.台幣匯率

請選擇指數 → 台灣加權指數

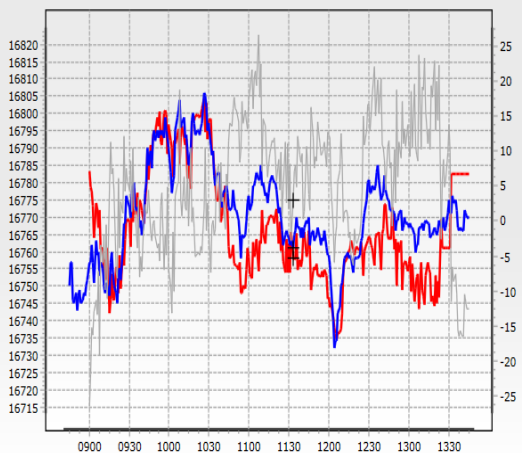
請選擇幣別 → 美元/新台幣

相關係數 → -0.66

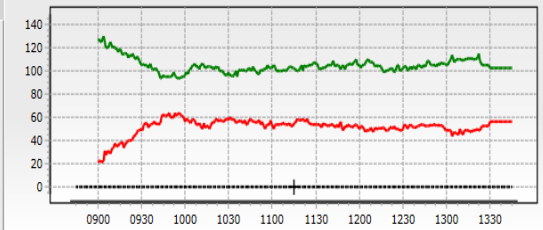


籌碼分析器

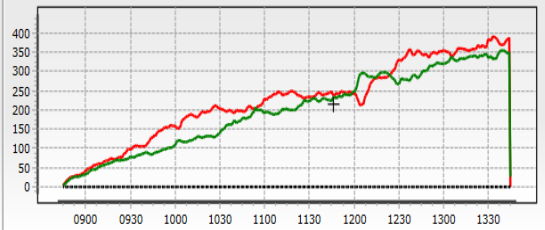
期現貨走勢(即時) 16.758 16.761 3
 昨量:2965.72 現量:2986 預估量:2986.08



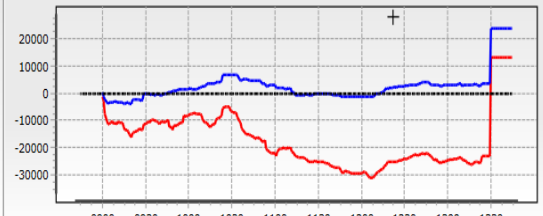
權值強弱(即時) 56 102



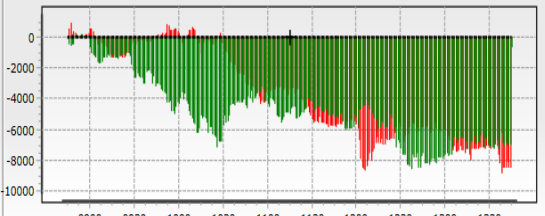
週選力道(單位-百萬)(即時) 0 26.4



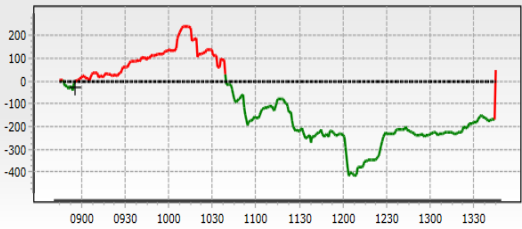
現貨趨勢(即時) 前50 12,976 前20 24,156



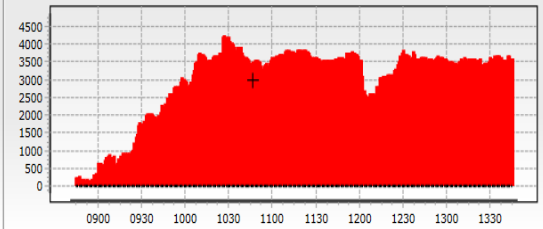
週選走勢(即時) 0 -683



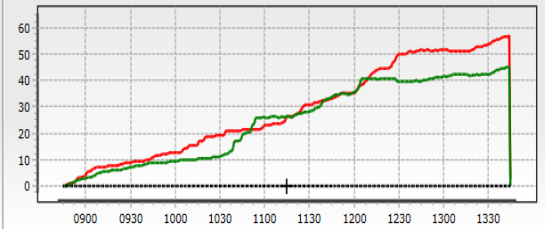
籌碼先鋒(即時) 46.2



期貨趨勢(即時) 3,586



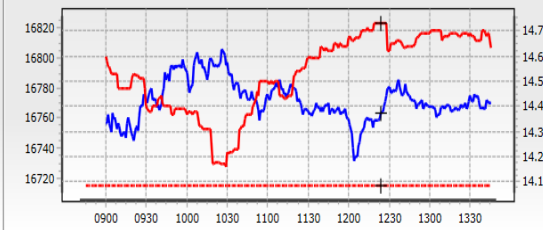
月選力道(單位-百萬)(即時) 2.8 0



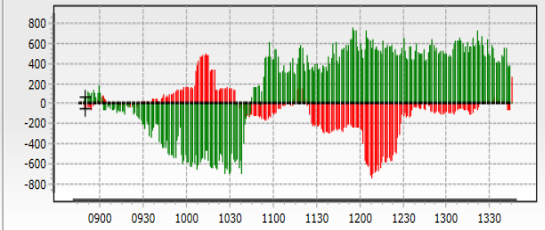
逆空飛翔(即時) -1.576



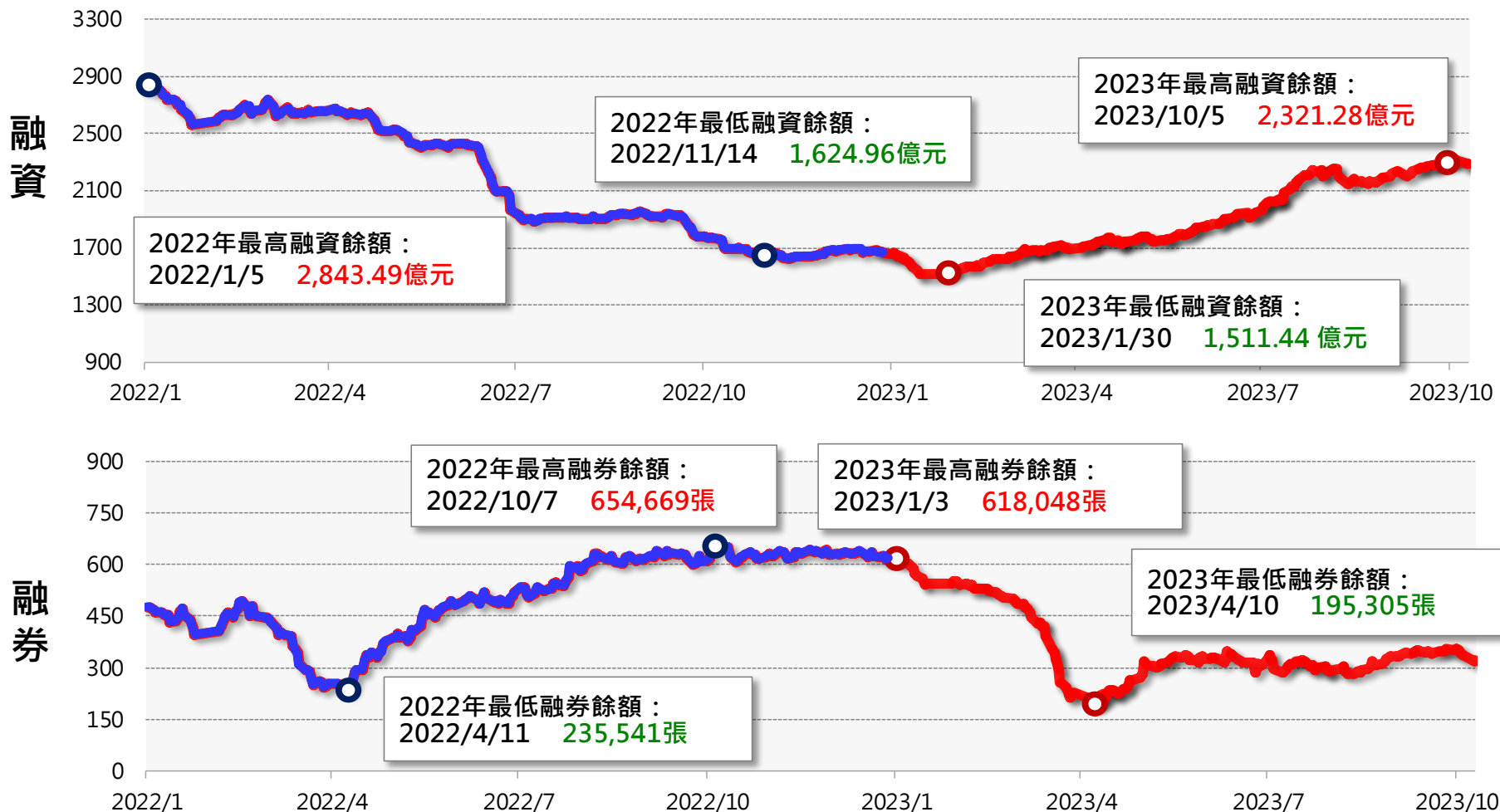
台指期 VIX(即時) 台指期 16.763 VIX 14.7 VIX均價(昨) 14.1



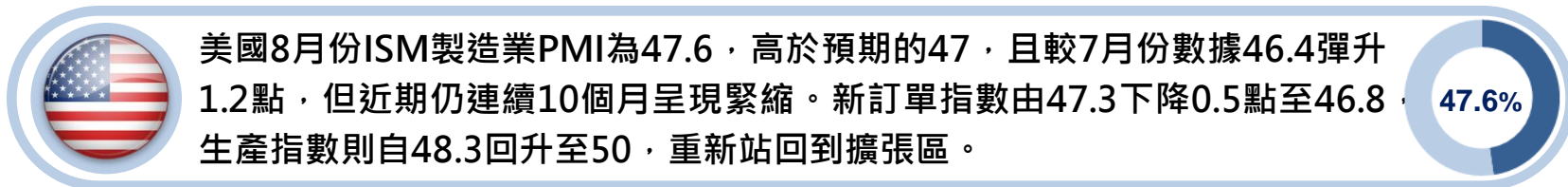
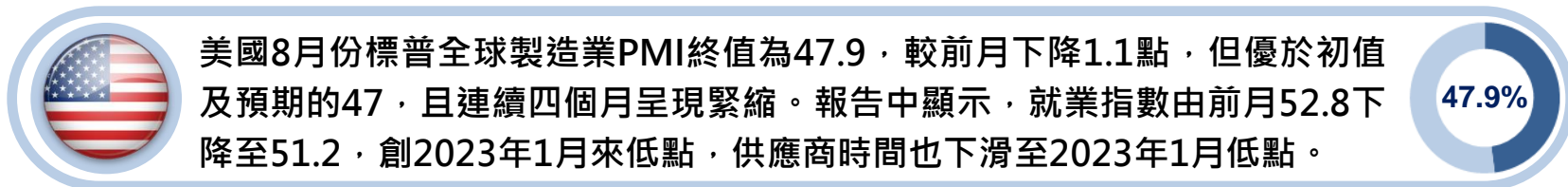
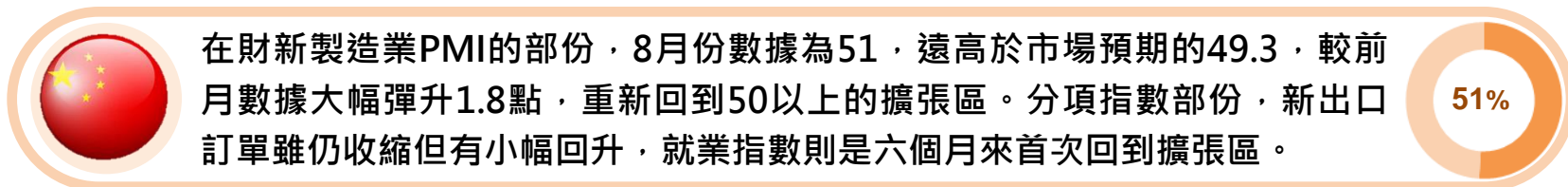
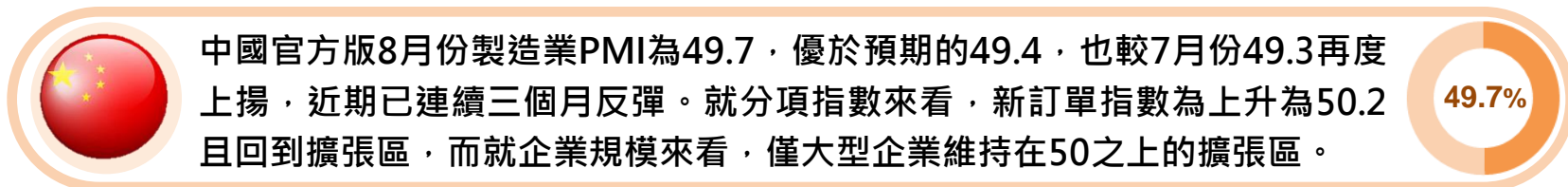
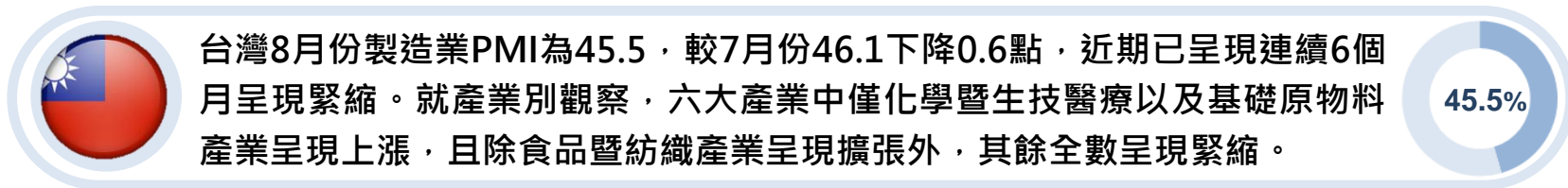
月選走勢(即時) -52 69



最高最低融資融券餘額



2023年8月份各國PMI



2023年8月份各國PMI



德國8月份製造業PMI上升至39.1，較前月38.8小幅回升0.3點，與初值及預測值相同，中斷先前連續五個月的下跌，並且連續14個月呈現收縮。數據顯示，製造業產出降速為2020年5月以來最快，新出口訂單降速則有所放緩。

39.1%



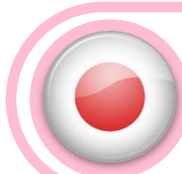
法國方面，8月份製造業PMI終值為46，低於初值以及預測的46.4，但仍較前月份上升0.9點，近期已呈現連續七個月收縮。報告中顯示，製造業產出連續15個月呈現緊縮、新訂單降速加劇，而就業降速則為三年來最快。

46%



英國8月份製造業PMI終值為43，較前月大幅下降2.3點，但優於初值及預期的42.5，近期連續六個月下跌且連續十三個月緊縮。報告指出，產出連續下降六個月，採購成本則是連續下降四個月，降幅為2016年1月以來最大。

43%



日本8月份製造業PMI終值為49.6，低於初值及預測的49.7，持平於7月份數據49.6，近期呈現連續三個月緊縮。報告中顯示，產出及新訂單持續位於緊縮區，投入成本通膨重新加速，就業分項指數則出現29個月以來最弱成長。

49.6%



歐元區8月製造業PMI終值為43.5，較前月份42.7上升0.8點，終止先前連續六個月的下跌、但仍連續十四個月呈現緊縮。報告中指出，新訂單指數由39.1下降至39，為疫情大流行以來第二低水準，生產成本則連六個月萎縮。

43.5%

10/9-10/13 焦點數據

10/9

星期一

10/9-10-15

世銀IMF年會

日內

台、日、韓 休市一日

14:00

德國 工業生產

16:00

中國 M2貨幣供給

10/10

星期二

日內

台股 國慶休市一日

7:50

日本 淨出口額

9:00

中國 M2貨幣供給

17:30

英國 BOE公布會議紀要

18:00

美國 NFIB小型企業信心

22:00

美國 批發銷售

10/11

星期三

日內

美國 眾議院預定議長選舉

14:00

德國 消費者物價終值

16:00

台灣 淨出口額

20:30

美國 生產者物價

22:30

美國 EIA戰備儲油庫存

10/12

星期四

2:00

美國 Fed公布會議紀要

4:30

美國 API原油庫存

7:50

日本 生產者物價

14:00

英國 8月GDP成長率

英國 淨出口額

英國 工業生產

19:30

歐元區 ECB公布會議紀要

20:30

美國 消費者物價

美國 核心消費者物價

美國 初請失業金人數

23:00

美國 EIA原油庫存

10/13

星期五

9:30

中國 消費者物價

中國 生產者物價

11:00

中國 淨出口額

14:45

法國 消費者物價

17:00

歐元區 工業生產

20:30

美國 進出口物價指數

美股盤前

聯合健康(UNH) 公布財報

摩根大通(JPM) 公布財報

花旗(C) 公布財報

22:00

美國 密大消費者信心

本報告純屬研究性質，僅供元富集團內部同仁參考，不保證其完整性及精確性，且不提供或嘗試遊說客戶做為交易買賣之投資依據。報告中所有的意見與預估，係取自本公司相信為可靠之資料來源，且為特定日期所為之判斷，有其時效性，爾後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。期貨及選擇操作為低保證金之高度財務槓桿特性，在可能產生極大利潤的同時也可能產生極大損失，投資人應審慎考慮考本身的財務能力及經濟狀況所能承擔的風險。