

壹、期交所最新消息

公告:2012/2/3 公告中信金期貨（代號 CNF）及選擇權（代號 CNO）契約調整事宜

最新活動訊息:

100/12/30 本公司「股票期貨造市英雄報價獎勵活動」第三階段活動期間為 101 年 1 月 1 日至 3 月 31 日。

貳、財經政治要聞

◆工商時報:劉憶如：總統支持設財改會

準財長劉憶如昨日與馬總統會面後表示，馬總統支持成立財改會以凝聚稅改社會共識，預計 3 月初可敲定委員名單，著手討論財改議題，至於近日媒體關注證所稅，將留待日後財改會討論，她並沒預設立場。

◆經濟日報:陸客自由行 增至 11 城市

總統馬英九今天指出，從 3 月份開始，陸客來台自由行的城市將擴大至 11 個。知情人士指出，兩岸已多次談判，對增加開放試點城市已有默契，須最後確認才算定案。

參、國際證券與期貨市場動態報導

● TMX 將於 2013 年引進新一代交易系統

歷經 2 年的研發，多倫多交易所集團(TMX Group)表示，將於 2013 年引進下一代的交易系統 Quantum XA，該系統每筆交易速度在 100 微秒(microseconds)以下且每秒可處理高達 20 萬筆交易。TMX 將於 2013 年第 1 季引進 Quantum XA 到旗下的 TMX Select，並於同年底引進到多倫多證券交易所(Toronto Stock Exchange)及 TSX 創業交易所(TSX Venture Exchange)，估計將花費 4 百萬美元建置。(資料來源：Securities Technology Monitor)

● 歐盟恐延宕實施新法規

歐盟官員日前針對監管市值達 700 兆美元衍生性商品之新法規無法取得共識，恐因此

延宕該法規之實施日期。該法規主要爭議點在於歐盟主管機關應有多大之權力監管衍生性商品市場，目前歐盟國會傾向賦予歐洲證券及市場管理局（European Securities and Markets Authority, ESMA）較大之監管權，而部分會員國則希望其權力有所限制，在歐盟須面對銀行業財務問題及主權債務危機下，該法案延宕恐不利於歐盟關於金融改革之努力。（資料來源：Reuters）

肆、證券市場指數

資料日期：101.02.03

證券市場	收盤價	漲跌點數	漲跌幅百分比	成交值(億)
證交所加權股價指數	7674.99	22.53	0.29	1,527.28
上櫃指數	110.01	1.44	1.33	232.07
證交所電子類股指數	288.31	1.45	0.51	1,065.48
證交所金融類股指數	834.72	2.46	0.30	96.86
證交所未含金電指數	10554.55	-0.07	0.00	
證交所臺灣50指數	5310.63	9.27	0.17	
MSCI臺灣股價指數	275.18	0.55	0.20	

伍、國際指數

資料日期：101.02.03

國際股市	日本	韓國	香港	中國		英國	德國	法國
	NIKKEI	Kospi	恆生	上海綜合	深圳綜指	FTSE	DAX	CAC
指數	8831.93	1972.34	20756.98	5412.56	3345.32	5901.07	6766.67	3427.92
漲跌	-44.89	-11.96	17.53	42.42	25.53	105.00	111.04	51.26
漲跌幅	-0.51%	-0.61%	0.08%	0.79%	0.77%	1.78%	1.64%	1.50%

美國股市	道瓊工業	標準普爾	納斯達克	費城半導體	原物料期貨			
	DJ	S&P500	NASDAQ	SOXX	紐約原油	銅(LME)	黃豆	玉米
指數	12862.2	1344.9	2905.66	427.99	97.84	8565	1232.5	644.5
漲跌	156.80	19.36	45.98	7.43	1.48	220.00	15.50	1.50
漲跌幅	1.22%	1.44%	1.58%	1.74%	1.51%	2.57%	1.26%	0.23%

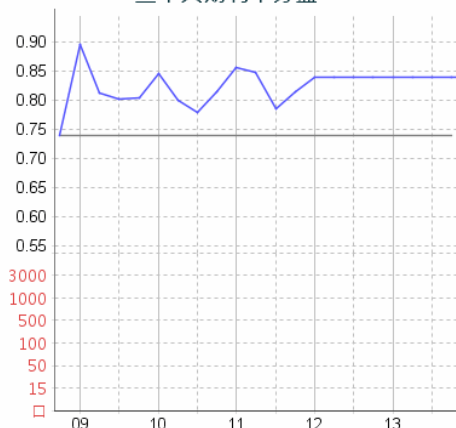
陸、利率指標

資料日期：101.02.03

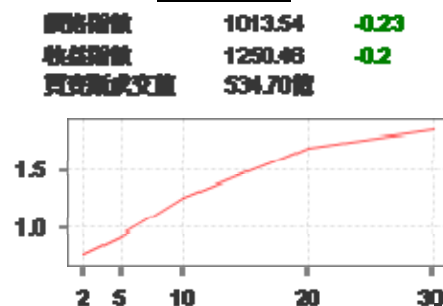
30天期利率指標	指數	漲跌
成交分盤利率指標	0.84	0.1
成交累計利率指標	0.80	0.03

三十天期利率分盤

三十天期利率現



殖利率曲線

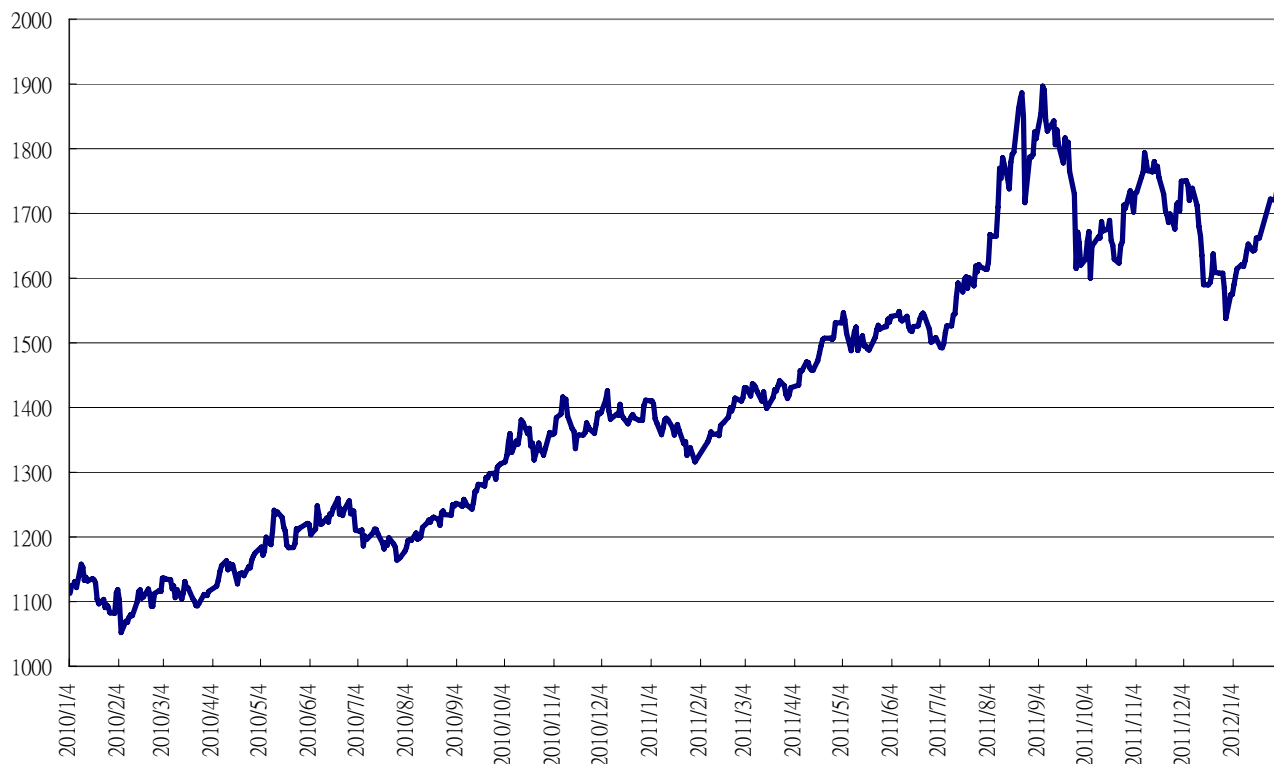


柒、黃金市場價格

資料日期：101.02.03

商品	規格	成交價	漲跌	商品	規格	成交價	漲跌
倫敦早盤定盤價	美元/盎司	1759.50	12.00	倫敦早盤新臺幣價	臺幣/台錢	6298.4	41.9
倫敦午盤定盤價	美元/盎司	1734.00	-25.50	倫敦午盤新臺幣價	臺幣/台錢	6207.1	-91.3

倫敦黃金早盤定盤價



捌、期貨選擇權行情

一、期貨選擇權市場交易量

資料日期：101.02.03

類別	商品項	序號	上市日期	商品名稱	本日交易量 (1)	占商品類別成交量 口數比率
期貨	指數期貨	1	1998.07.21	臺股期貨	81,708	46.48
		2	2001.04.09	小型臺指期貨	55,691	31.68
		3	1999.07.21	電子期貨	4,383	2.49
		4	1999.07.21	金融期貨	6,834	3.89
		5	2003.06.30	臺灣50期貨	0	0.00
		6	2007.10.08	非金電期貨	512	0.29
		7	2007.10.08	櫃買期貨	117	0.07
	商品期貨	8	2006.03.27	黃金期貨	0	0.00
		9	2008.01.28	台幣黃金期貨	219	0.12
	利率期貨	10	2004.01.02	公債期貨	0	0.00
		11	2004.05.31	30天期利率期貨	0	0.00
	個股	12	2010.01.25	股票期貨	26,324	14.97
小計					175,788	34.61
選擇權	指數選擇權	1	2001.12.24	臺指選擇權	329,774	99.28
		2	2005.03.28	電子選擇權	80	0.02
		3	2005.03.28	金融選擇權	530	0.16
		4	2007.10.08	非金電選擇權	0	0.00
		5	2007.10.08	櫃買選擇權	0	0.00
	商品	6	2009.01.19	黃金選擇權	467	0.14
	個股	7	2003.01.20	股票選擇權	1,310	0.39
小計					332,161	65.39
全市場合計					507,949	

二、期貨商品行情表

期貨商品行情表									
									101年2月3日
契約	到期月份	開盤價	最高價	最低價	最後成交價	每日結算價	漲跌	成交量(億、口)	本日未平倉量
大盤指數		7658.68	7674.99	7608.41	7674.99		22.53	1527.28	
臺股期	201202	7620	7650	7602	7642	7640	1	79813	54180
	201203	7628	7640	7593	7630	7630	-1	1728	5682
小型臺指期	201202	7621	7650	7602	7641	7640	0	53734	23478
	201203	7620	7639	7593	7633	7630	2	1644	4344
電子期	201202	286.6	287.7	284.7	286.85	286.95	0.25	4362	4382
	201203	285.15	287	284.8	286.5	286.5	0.25	21	114
金融期	201202	834.2	838.4	828.6	836	835.6	1.8	6781	4899
	201203	835.8	836	828	834	834.4	1.0	53	141
櫃買期	201202	109.55	111.65	109	110.6	110.6	0.60	98	242
	201203	110.05	111.45	110.05	111.4	111.4	1.90	19	62
非金電期	201202	10535	10535	10465	10506	10502	-23	471	596
	201203	10488	10488	10462	10485	10485	-29	39	18
臺灣五十期	201202	-	-	-	-	5280	0	0	0
	201203	-	-	-	-	5257	0	0	2
三十天期利率期									
十年期公債期	201202	-	-	-	-	99.205	0.000	0	0
	201203	-	-	-	-	98.385	0.000	0	0
黃金期USD	201203	0	0	0	0	111.805	0	0	0
	201206	0	0	0	0	113.92	0	0	0
黃金期NTD	201202	0	0	0	0	1755	0	0	1
	201204	0	0	0	0	1760	0	0	2

資料來源：台灣證券交易所、台灣期貨交易所

三、選擇權商品行情表

選擇權商品行情表											101年2月3日
契約	到期月份	履約價	買賣權	開盤價	最高價	最低價	最後成交價	每日結算價	漲跌	成交量	本日未平倉量
臺指	201202	7700	買	73	75	57	68	68	-7.0	38173	61211
	201202	7800	買	37	39.5	28.5	36.5	36.5	-2.0	36218	42027
	201202	7600	買	120	127	102	120	120	-5.0	19239	34001
	201202	7900	買	16.5	19.5	13.5	17	17	-2.0	17491	33278
	201202	7500	賣	56	63	45.5	47	47	-6.0	25782	25873
	201202	7400	賣	33	39.5	26.5	27.5	27.5	-5.5	24785	31245
	201202	7300	賣	22	24.5	15	16	16	-4.0	19032	28459
	201202	7600	賣	90	101	76	80	80	-4.0	18951	16353
	201203	7700	買	163	170	152	164	164	-4.0	3064	5516
	201203	8000	買	60	64	57	61	61	-2.0	2404	13426
	201203	7900	買	85	91	80	89	89	-1.0	1768	4998
	201203	8100	買	40	44	38	41.5	41.5	-1.5	1742	10298
	201203	7400	賣	120	129	113	114	114	0.0	2133	3307
	201203	7000	賣	40	48	40	41	41	-1.0	1613	9396
	201203	7200	賣	72	80	67	68	68	-2.0	1457	5541
201203	6600	賣	18.5	18.5	14	14	14	-2.0	1318	6861	
電子	201202	290	買	2.075	2.9	2	2.4	2.55	0.050	26	24
	201202	285	賣	4.05	4.1	2.9	3.05	3.05	-0.400	25	40
金融	201202	840	買	14	14.6	12	13.6	13.6	0.40	125	129
	201202	820	賣	10.2	10.6	9.2	9.5	9.5	-1.10	136	179
非金電	201202	11000	買	-	-	-	-	20	0.0	0	0
	201202	11400	賣	-	-	-	-	842	0.0	0	0
櫃買	201202	117.5	買	-	-	-	-	0.27	0.000	0	0
	201202	100	賣	-	-	-	-	0.06	0.000	0	0
黃金	201202	6400	買	35	40	30	40	40	9.000	166	184
	201202	5800	賣	6.5	6.5	5.5	6.5	6.5	-2.500	56	316

資料提供：台灣期貨交易所

四、股票期貨商品行情表

50大股票期貨行情表										101年2月3日
契約	到期月份	契約代碼	開盤價	最高價	最低價	最後成交價	每日結算價	漲跌	成交量	本日未平倉量
勝華期貨	201202	DTF	24.15	25.85	24.15	25.85	25.85	1.65	1175	592
友達期貨	201202	CHF	17.6	18	16.85	17.35	17.35	0.35	1127	958
勝華期貨	201203	DTF	24.2	25.8	24.2	25.8	25.8	1.65	943	757
元大金期貨	201212	DOF	17.15	17.2	17.1	17.15	17.15	0.05	800	1161
奇美電期貨	201202	DQF	14.9	15.7	14.5	15.7	15.7	1.00	715	869
友達期貨	201203	CHF	18.1	18.1	16.8	17.35	17.35	0.40	621	429
第一金期貨	201212	DPF	18.5	18.5	18.3	18.4	18.4	-0.10	600	1032
佳世達期貨	201202	CFW	7.98	8.42	7.81	8.37	8.37	0.37	577	54
彰銀期貨	201212	DCF	17.1	17.1	16.9	17	17	-0.05	540	690
國泰金期貨	201212	CKF	34.3	34.4	33.95	34.05	34.05	-0.20	455	973
潤泰全期貨	201203	DWF	59	59.4	58	58	58	0.60	431	399
潤泰全期貨	201203	DW1	60.2	61	59.9	60	59.8	0.80	419	411
兆豐金期貨	201212	CLF	21.35	21.6	21.2	21.55	21.55	0.25	400	1018
日月光期貨	201202	CTF	28.2	28.2	26.9	27.7	27.7	-0.50	381	297
華邦電期貨	201202	FZF	4.99	5.36	4.92	5.36	5.36	0.35	358	170
第一金期貨	201203	DPF	18.5	18.5	18.25	18.4	18.4	0.05	335	223
佳世達期貨	201203	CFW	8.02	8.41	7.87	8.41	8.41	0.42	317	59
奇美電期貨	201203	DQF	14.8	15.65	14.5	15.65	15.65	1.00	293	480
華寶期貨	201202	KJF	53.5	56.8	52.3	55.8	55.8	2.40	279	190
華寶期貨	201203	KJF	53.4	56.8	52.3	55.8	55.8	2.30	274	155
中鋼期貨	201202	CBF	29.35	29.45	29.35	29.45	29.45	0.25	253	471
光磊期貨	201203	FYF	13.65	14.55	13.35	14.45	14.45	0.70	249	9
農林期貨	201202	IHF	15.15	15.4	15.05	15.25	15.25	0.10	246	45
台積電期貨	201202	CDF	76.3	76.5	75.8	76.2	76.2	-0.60	245	1681
光磊期貨	201202	FYF	13.65	14.5	13.4	14.45	14.45	0.75	245	15
農林期貨	201203	IHF	15.05	15.4	14.95	15.25	15.25	0.15	228	31
力麗期貨	201202	ELF	12.35	12.75	12.35	12.45	12.45	-0.10	227	14
華邦電期貨	201203	FZF	4.89	5.23	4.89	5.23	5.23	0.29	222	46
矽品期貨	201202	CVF	32.1	32.4	31.7	32.15	32.15	-0.65	220	51
陽明期貨	201202	DAF	14.9	15.95	14.9	15.9	15.9	0.95	213	191
華票期貨	201203	HXF	10.7	10.75	10.7	10.7	10.7	-0.05	210	75
長榮期貨	201202	CZF	18.4	18.7	18.2	18.55	18.55	0.55	201	86
長榮期貨	201203	CZF	18.4	18.75	18.25	18.5	18.5	0.45	182	87
元大金期貨	201202	DOF	17.2	17.2	17	17.05	17.05	0.00	177	130
中鴻期貨	201202	FCF	10.15	10.15	10.05	10.1	10.1	-0.10	172	10
合庫金期貨	201203	LOF	18.7	18.75	18.7	18.7	18.7	-0.05	171	206
兆豐金期貨	201203	CLF	21.15	21.55	21.15	21.4	21.55	0.10	166	220
華通期貨	201203	FTF	11.5	11.9	11.25	11.7	11.7	0.20	166	11
中鴻期貨	201203	FCF	10.15	10.15	10	10.15	10.15	0.00	165	10
華票期貨	201202	HXF	10.7	10.75	10.7	10.75	10.75	0.00	161	73

資料提供：台灣期貨交易所

五、股票選擇權商品行情表

股票選擇權商品行情表											101年2月3日
契約	到期月份	履約價	買賣權	開盤價	最高價	最低價	最後成交價	每日結算價	漲跌	成交量	本日未平倉量
聯電	201202	9	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	45
	201202	10	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	255
	201202	12	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	120	120
臺積電	201202	75	賣	1.06	1.19	1.02	1.02	0.95	0.21	33	73
新光金	201202	12	買	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	20
	201202	6	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	30
	201202	7	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	20	25
陽明	201202	12	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	55	55
華新	201202	14	買	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	30
	201202	6	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	50
	201202	7	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	50
	201202	8	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	20	20
華南金	201202	12	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	35
南亞	201202	65	買	0.43	0.49	0.43	0.49	0.49	0.02	13	24
旺宏	201202	9	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	35
	201202	10	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	20	45
奇美電	201202	14	買	1.09	1.88	1.09	1.85	1.85	0.94	20	19
	201202	16	買	0.45	0.49	0.45	0.49	0.59	0.39	16	16
玉山金	201202	9	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	35
	201202	10	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	35
永豐金	201202	7	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	20
台新金	201202	8	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	55
	201202	9	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	25	25
日月光	201202	30	買	0.2	0.42	0.12	0.42	0.4	0.09	435	141
友達	201202	16	買	1.99	1.99	1.77	1.77	1.62	0.58	13	24
	201202	12	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	100	230
大同	201202	12	買	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	20	20
	201202	5	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	30
	201202	6	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	15	30
	201202	7	賣	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	20	20

資料提供：台灣期貨交易所

玖、期貨前十大交易人與三大法人交易資訊

一、期貨前十大交易人資訊

資料日期：101.02.03

契約名稱	月份	買方				賣方				全市場未沖銷部位數
		前五大交易人合計 (特定法人合計)		前十大交易人合計 (特定法人合計)		前五大交易人合計 (特定法人合計)		前十大交易人合計 (特定法人合計)		
		部位數	百分比	部位數	百分比	部位數	百分比	部位數	百分比	
臺股期貨	2012	19025	32.9%	29108	50.4%	10054	17.4%	17090	29.6%	57742
	2	(13793)	(23.9%)	(17694)	(30.6%)	(10054)	(17.4%)	(15740)	(27.3%)	
	所有	22841	32.9%	34679	50.0%	11110	16.0%	19937	28.8%	
	月份	(17609)	(25.4%)	(24742)	(35.7%)	(9144)	(13.2%)	(16059)	(23.2%)	
電子期貨	2012	1830	41.8%	2662	60.7%	1704	38.9%	2518	57.5%	4382
	2	(1619)	(36.9%)	(1949)	(44.5%)	(1478)	(33.7%)	(2031)	(46.3%)	
	所有	1830	40.5%	2684	59.4%	1704	37.7%	2519	55.8%	
	月份	(1619)	(35.8%)	(1949)	(43.1%)	(1478)	(32.7%)	(2031)	(45.0%)	
金融期貨	2012	1869	38.2%	2611	53.3%	1918	39.2%	2673	54.6%	4899
	2	(1034)	(21.1%)	(1597)	(32.6%)	(1483)	(30.3%)	(1777)	(36.3%)	
	所有	1869	36.8%	2621	51.7%	1918	37.8%	2675	52.7%	
	月份	(1034)	(20.4%)	(1597)	(31.5%)	(1483)	(29.2%)	(1777)	(35.0%)	
櫃買期貨	2012	434	72.8%	527	88.4%	528	88.6%	570	95.6%	596
	2	(368)	(61.7%)	(368)	(61.7%)	(362)	(60.7%)	(372)	(62.4%)	
	所有	436	70.3%	533	86.0%	528	85.2%	573	92.4%	
	月份	(338)	(54.5%)	(368)	(59.4%)	(362)	(58.4%)	(372)	(60.0%)	
非金電期貨	2012	1	100.0%	1	100.0%	1	100.0%	1	100.0%	1
	2	0	(0.0%)	0	(0.0%)	(1)	(100.0%)	(1)	(100.0%)	
	所有	4	100.0%	4	100.0%	4	100.0%	4	100.0%	
	月份	0	(0.0%)	0	(0.0%)	(4)	(100.0%)	(4)	(100.0%)	
黃金期貨	2012	309	53.7%	388	67.5%	270	47.0%	328	57.0%	575
	2	(94)	(16.3%)	(94)	(16.3%)	(0)	(0.0%)	(0)	(0.0%)	
	所有	341	49.4%	426	61.7%	294	42.6%	370	53.6%	
	月份	(95)	(13.8%)	(95)	(13.8%)	(0)	(0.0%)	(0)	(0.0%)	
臺幣黃金期貨	2012	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0
	3	0	(0.0%)	0	(0.0%)	(0)	(0.0%)	(0)	(0.0%)	
	所有	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	0	0.0%	
	月份	0	(0.0%)	0	(0.0%)	0	(0.0%)	0	(0.0%)	

附註:有關股票期貨之十大交易人資訊，請至本公司網站首頁交易資訊項目下查詢。

二、選擇權前十大交易人資訊

資料日期：101.02.03

契約名稱	月份	買方				賣方				全市場未沖銷部位數
		前五大交易人合計 (特定法人合計)		前十大交易人合計 (特定法人合計)		前五大交易人合計 (特定法人合計)		前十大交易人合計 (特定法人合計)		
		部位數	百分比	部位數	百分比	部位數	百分比	部位數	百分比	
臺指買權	2012	65767	22.00%	113531	0.381	95488	0.32	125258	0.42	298294
	2	-39048	-13.10%	-67948	-0.228	-32011	-0.107	-42882	-0.144	
	所有	122689	29.00%	186808	0.441	123116	0.291	169789	0.401	
	月份	-102329	-24.20%	-138045	-0.326	-41538	-0.098	-72724	-0.172	
臺指賣權	2012	79225	20.70%	113685	0.297	140070	0.365	181502	0.474	383318
	2	-19993	-5.20%	-19993	-0.052	-39542	-0.103	-66132	-0.173	
	所有	112253	22.60%	167983	0.338	169450	0.341	230194	0.463	
	月份	-33016	-6.60%	-68417	-0.138	-50211	-0.101	-102952	-0.207	
電子指數買權	2012	311	97.20%	318	0.994	309	0.966	320	1	320
	2	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
	所有	311	97.20%	318	0.994	309	0.966	320	1	
	月份	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
電子指數賣權	2012	409	94.90%	425	0.986	399	0.926	421	0.977	431
	2	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
	所有	409	94.90%	425	0.986	399	0.926	421	0.977	
	月份	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
金融指數買權	2012	856	75.40%	1017	0.896	728	0.641	951	0.838	1135
	2	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
	所有	856	75.40%	1017	0.896	728	0.641	951	0.838	
	月份	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
金融指數賣權	2012	876	91.20%	917	0.955	660	0.688	841	0.876	960
	2	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	
	所有	876	90.20%	921	0.949	660	0.68	841	0.866	
	月份	0	0.00%	0	0	0	0	0	0	

三、期貨市場三大法人成交口數與契約金額

資料日期：101.02.03

法人別	成交口數與契約金額(單位：口數；百萬元)					
	多方		空方		多空淨額	
	口數	契約金額	口數	契約金額	口數	契約金額
自營商	219,821	22,214	232,370	21,266	-12,549	947
投信	9	14	200	215	-191	-201
外資	49,884	30,280	50,198	30,128	-314	152
合計	269,714	52,508	282,768	51,609	-13,054	898

四、期貨市場三大法人未平倉口數與契約金額

資料日期：101.02.03

法人別	未平倉口數與契約金額(單位：口數；百萬元)					
	多方		空方		多空淨額	
	口數	契約金額	口數	契約金額	口數	契約金額
自營商	293,412	21,412	276,123	13,045	17,289	8,367
投信	12,583	3,698	1,488	968	11,095	2,730
外資	368,770	58,190	267,687	45,077	101,083	13,113
合計	674,765	83,300	545,298	59,090	129,467	24,210

五、證券市場三大法人買賣金額統計

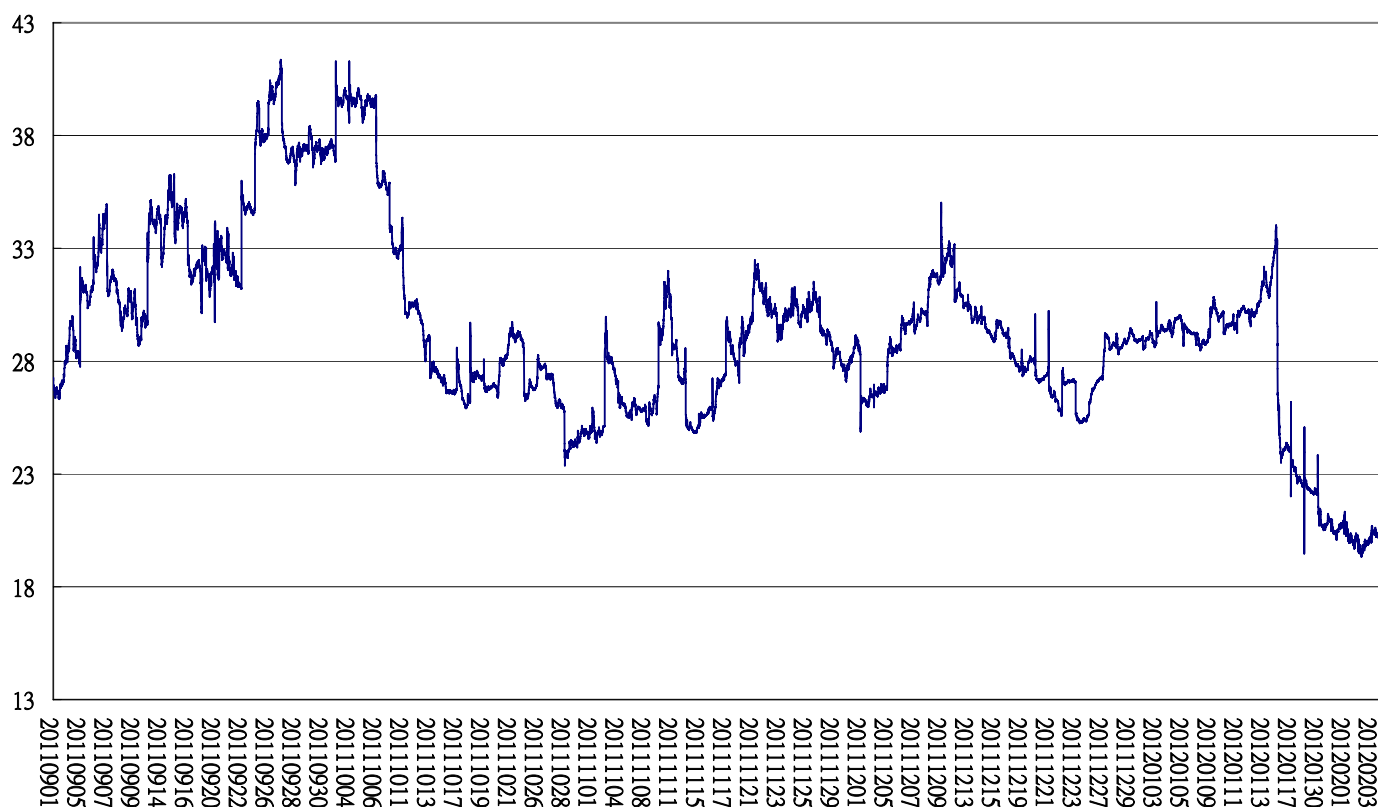
101年02月03日 三大法人買賣金額統計表(元)(單位：百萬元)			
單位名稱	買進金額	賣出金額	買賣差額
自營商	5,775	3,745	2,031
投信	5,150	5,281	-131
外資	24,508	23,558	950
合計	35,433	32,584	2,850

附註：

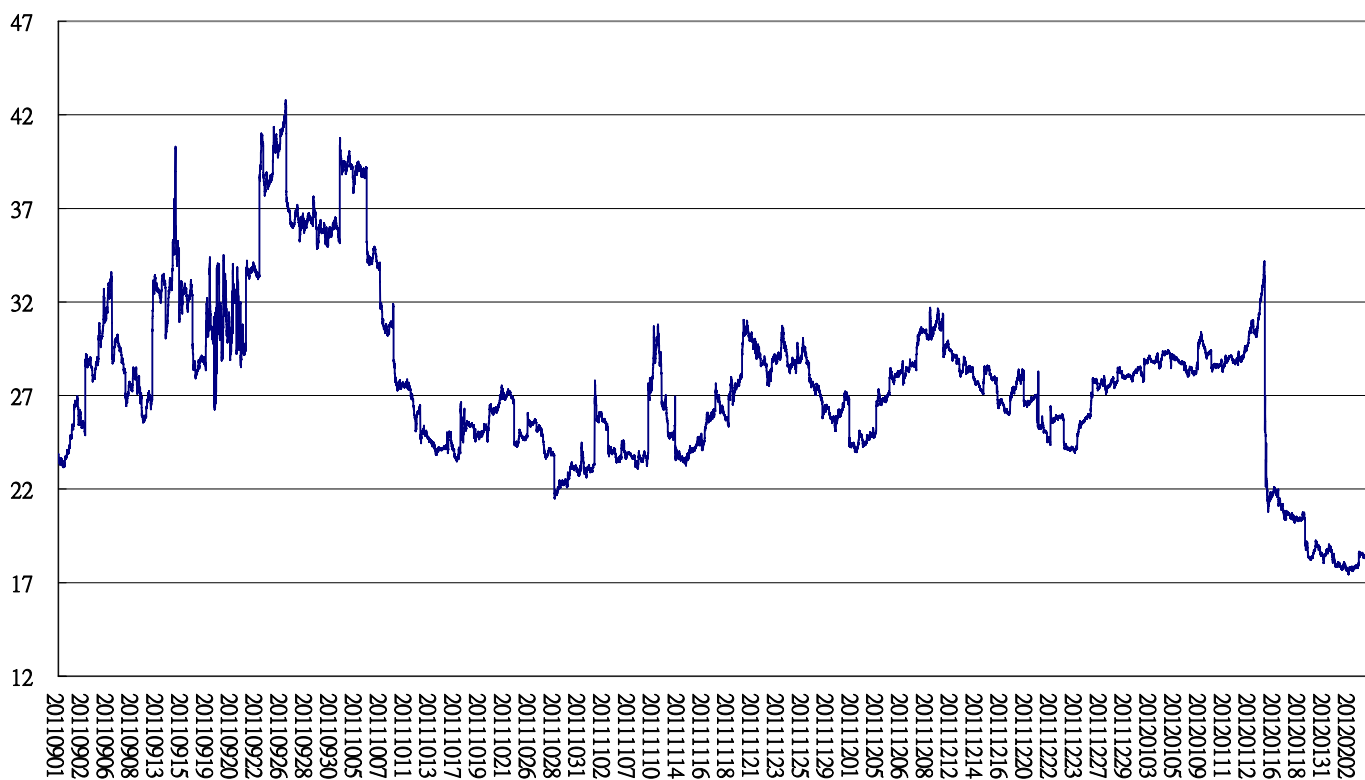
- 期貨市場三大法人資訊自 97 年 4 月 7 日開始公佈，並提供 96 年 7 月 1 日以來之歷史資料。
- 該表僅包含本公司指數類期貨契約、選擇權契約及股票選擇權契約
- 「多方」係指交易人看多指數之交易或未平倉口數，其型態包括買進期貨、買進選擇權買權、賣出選擇權賣權
- 「空方」係指交易人看空指數之交易或未平倉口數，其型態包括賣出期貨、賣出選擇權買權、買進選擇權賣權
- 「契約金額」係以當日交易或未平倉口數依下列方式計算：
 - (1)期貨：以每筆交易價格乘以契約乘數再乘以交易口數後加總
 - (2)選擇權：以每筆交易權利金乘以契約乘數再乘以交易口數後加總
 - (3)未平倉契約金額以各期貨或選擇權序列當日結算價格，乘以契約乘數再乘以未平倉口數後加總
 - (4)美元計價商品依上述方法計算後，再乘以當日美元匯率
- 「自營商」包括期貨自營商、證券自營商
- 「投信」包括證券投信基金、期貨信託基金
- 「外資」包括境內外外資機構法人

拾、臺指選擇權波動率指數(VIX)

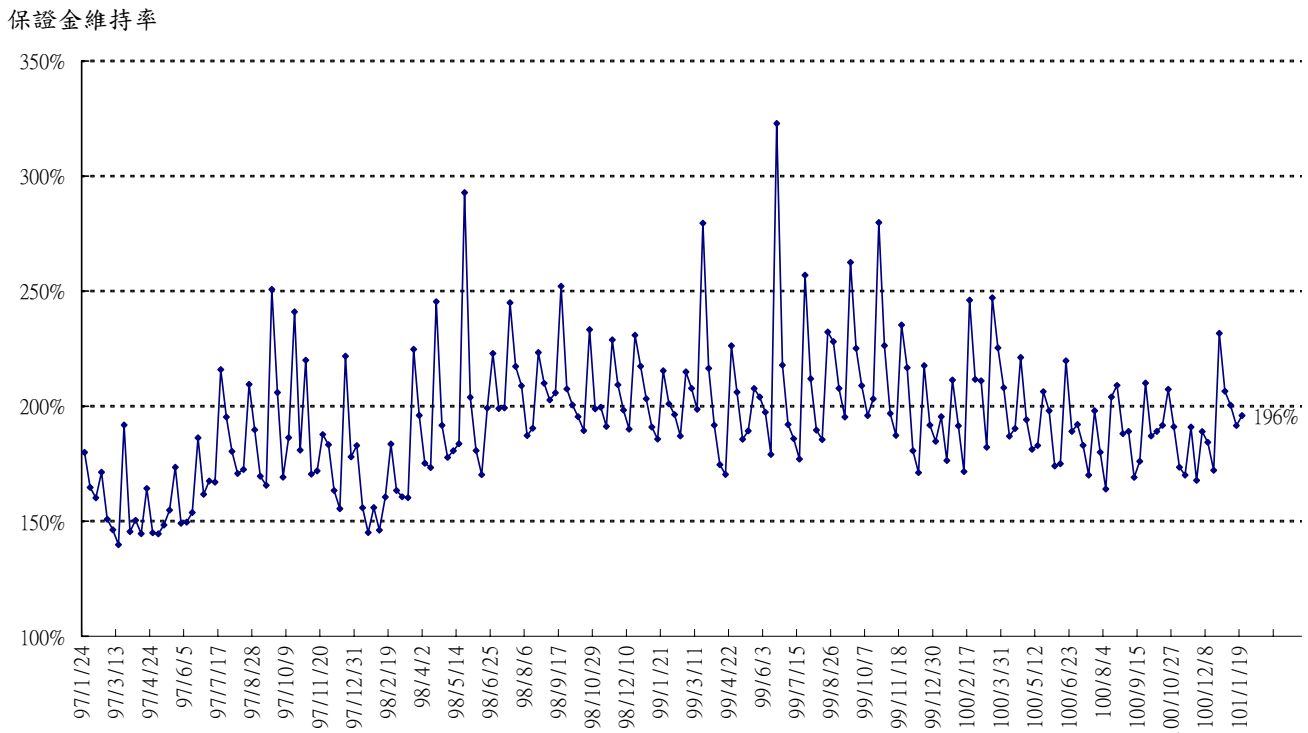
以 CBOE 新 VIX 指數編製公式計算者



以 CBOE 舊 VIX 指數編製公式計算者



每週市場結算保證金維持率變化圖



說明:1. 市場結算保證金維持率=市場結算保證金帳戶權益總額/市場未沖銷部位應存有結算保證金總額
 2. 101年1月19日之市場結算保證金維持率為196%

註：臺灣期貨交易所股份有限公司(以下簡稱本公司)每日市場資訊係根據各項市場資訊加以整理彙集，本公司不保證適用程度、品質滿意度或作其他保證，本公司已盡其所有努力確保所有提供資訊之正確性，但對於錯誤、遺漏或因信賴或使用資訊所造成之任何損失不負任何直接責任或間接責任（包括因過失之責任）。