



## 法人籌碼動態

05月17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	91	2,631	-60	166	-741	-73
投信	-9,694	336	136	0	14	0
自營商	11,536	-1,100	-179	20	-330	-175
05月17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	52	-1	15,426	2,552	37,605	1,326
投信	1	0	0	0	965	0
自營商	-34	9	8,487	1,897	-15,981	-8,453

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
台積電	85.28	萬海	-4.01	台指期前十大 市場佔比	47.9%	45.1%
聯發科	8.41	富邦金	-3.53			
日月光投控	3.77	長榮	-3.48			
旭隼	3.02	國泰金	-2.90	電子期前十大 市場佔比	51.2%	56.1%
矽力-KY	2.95	陽明	-2.87			
台塑化	2.82	玉山金	-2.20			
和泰車	2.69	兆豐金	-2.01	金融期前十大 市場佔比	48.3%	56.8%
聯電	2.67	智邦	-1.84			
國巨	2.53	中信金	-1.32			
欣興	2.43	中華電	-1.28	非金電期前十大 市場佔比	98.0%	94.9%
前十名合計	116.56	後十名合計	-25.43			

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 (109)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



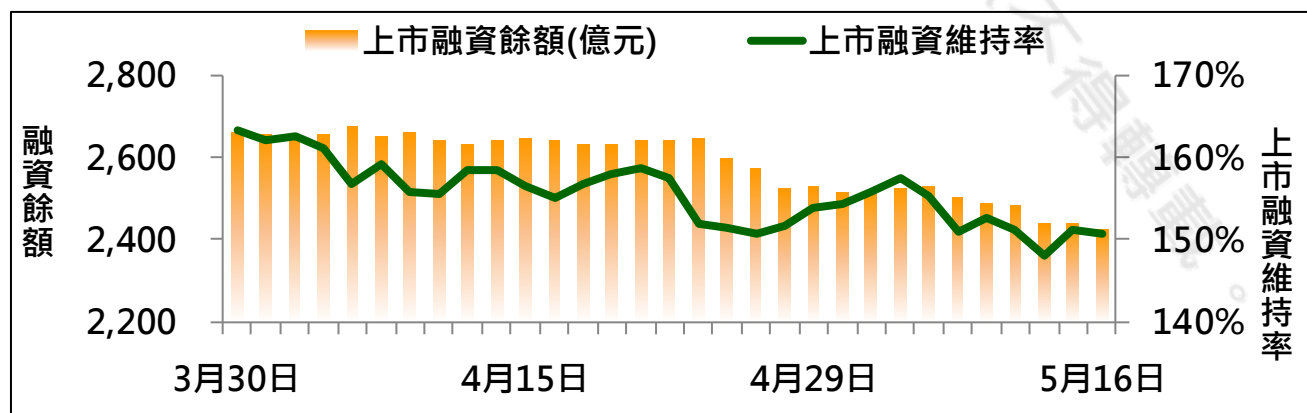
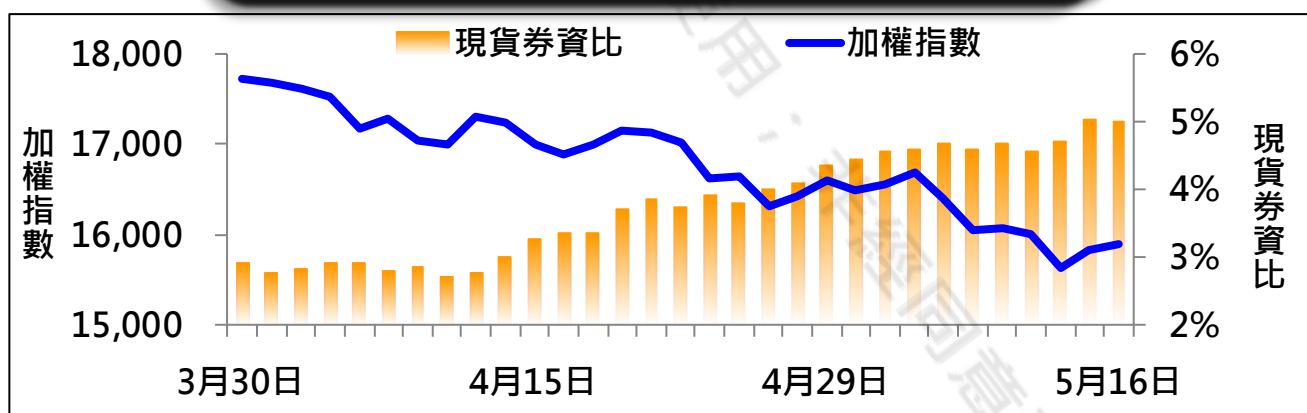
## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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11日	-150.8	-9,158	3,728	-7.5	15,859	-40
05月12日	-103.2	-6,639	2,519	-60.0	15,187	-672
05月13日	28.0	-5,519	1,120	31.9	14,383	-804
05月16日	-16.7	-2,540	2,979	-8.7	12,636	-1,747
05月17日	-8.6	91	2,631	14.3	11,536	-1,100

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11日	5,853	33,583	-27,730	-5,895	4,198	-10,093
05月12日	8,142	33,343	-25,201	-4,879	-3,031	-1,848
05月13日	11,104	35,851	-24,747	-2,570	-5,553	2,983
05月16日	12,874	36,279	-23,405	6,590	-7,528	14,118
05月17日	15,426	37,605	-22,179	8,487	-15,981	24,468

## 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。

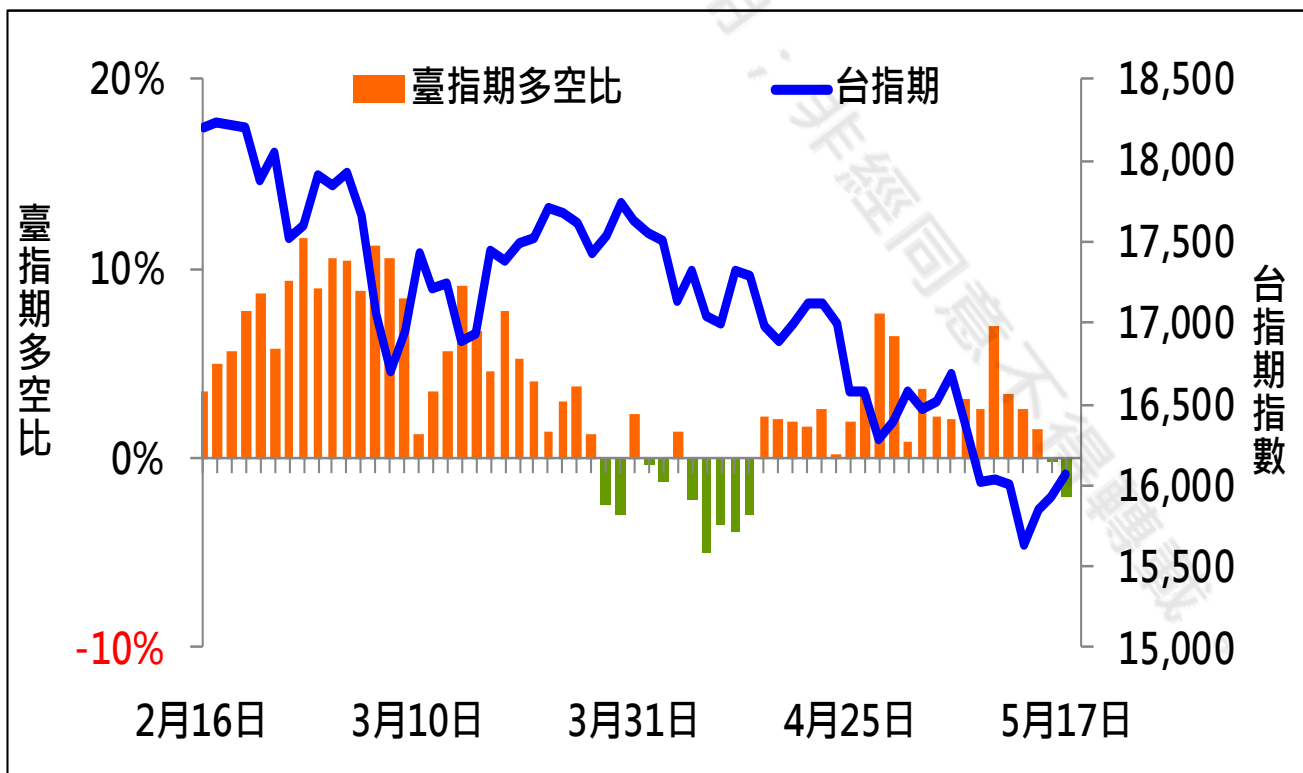
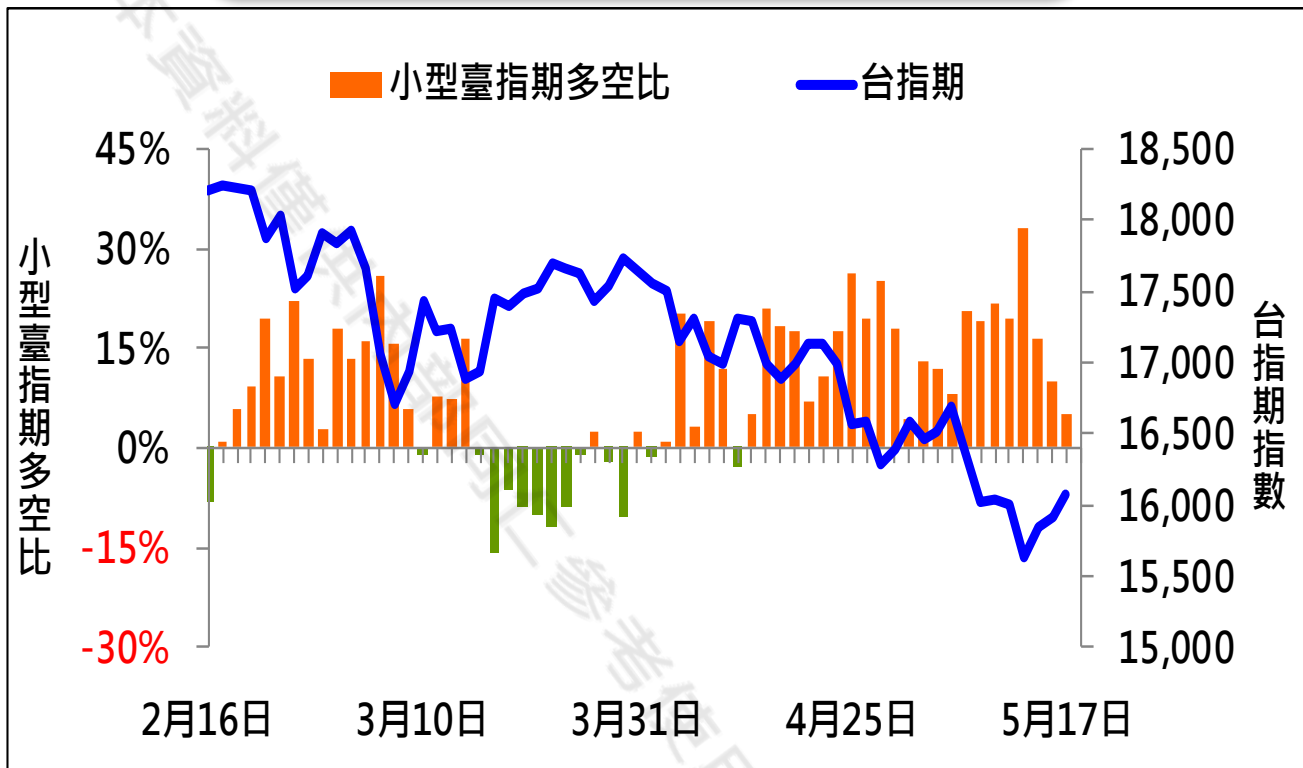
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



## 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。

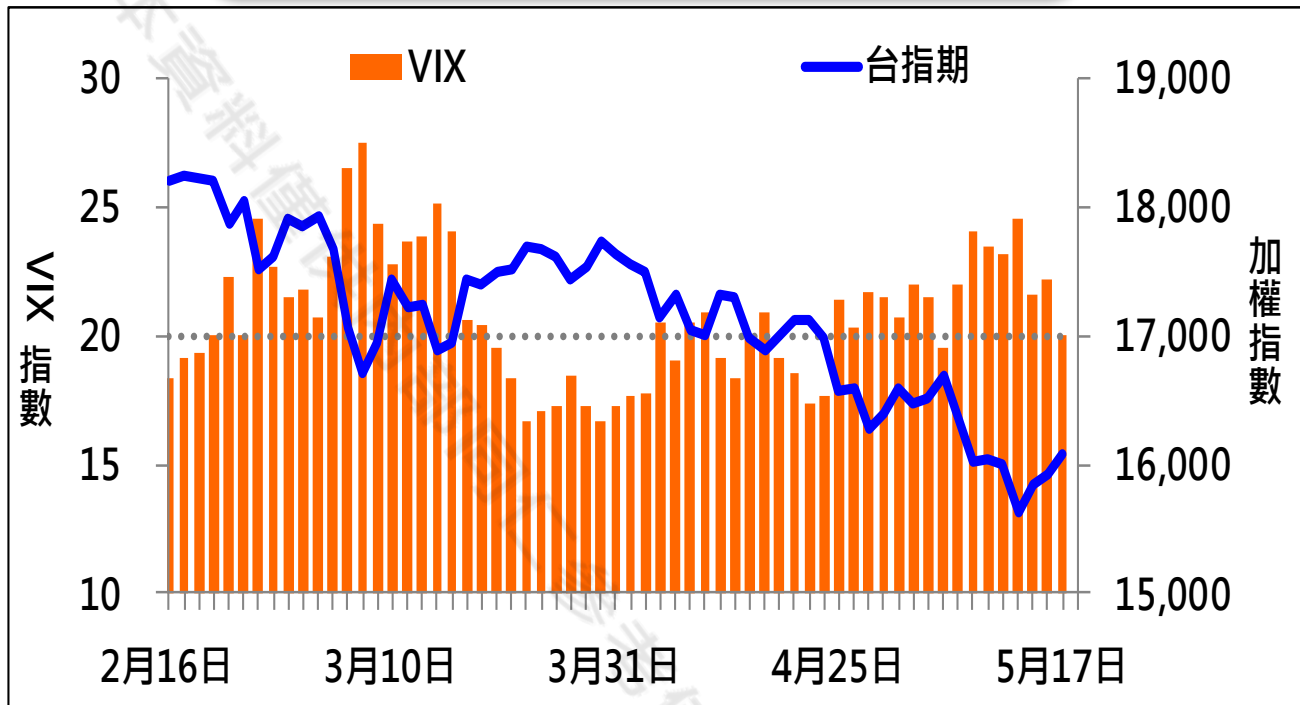
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

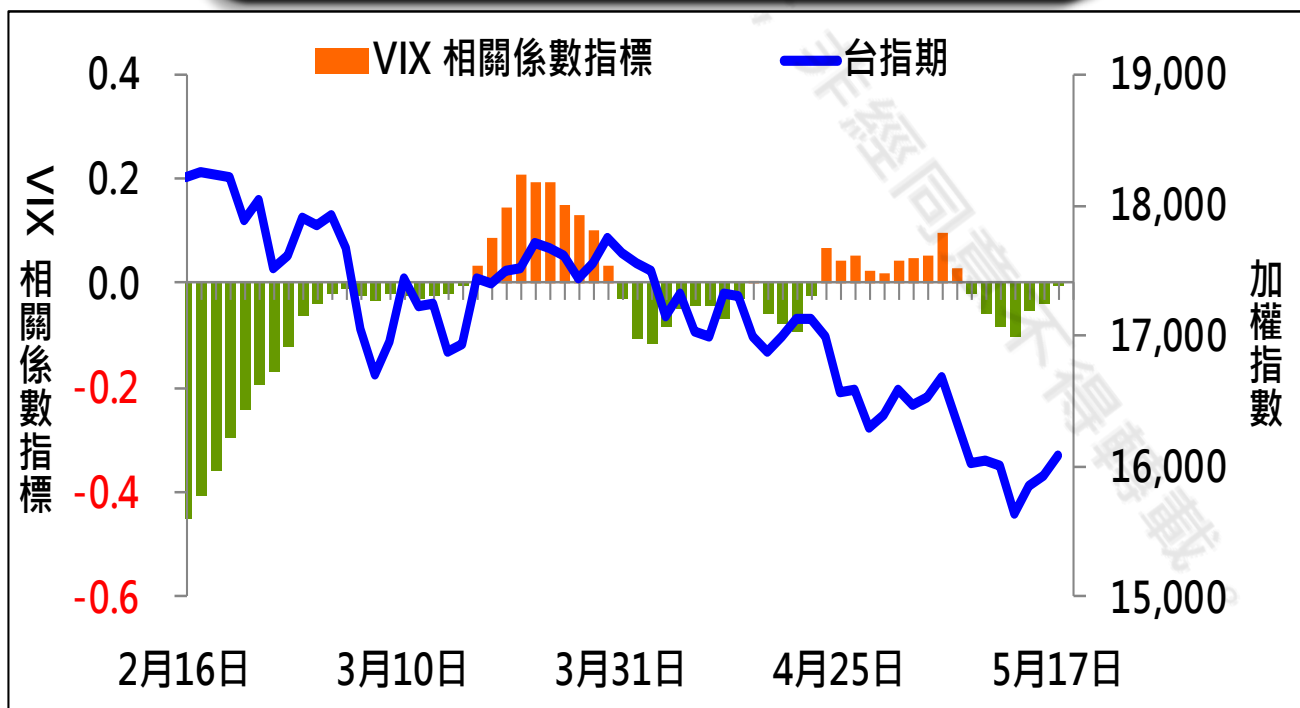
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



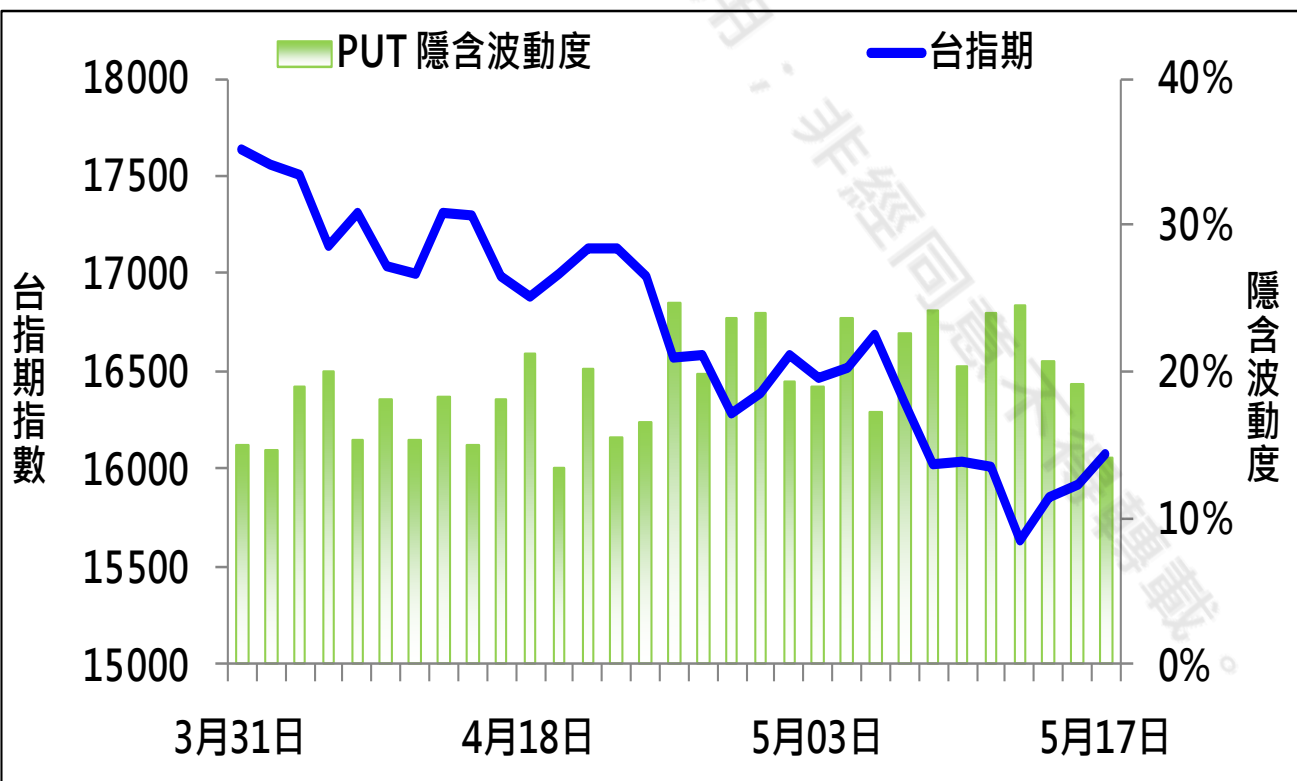
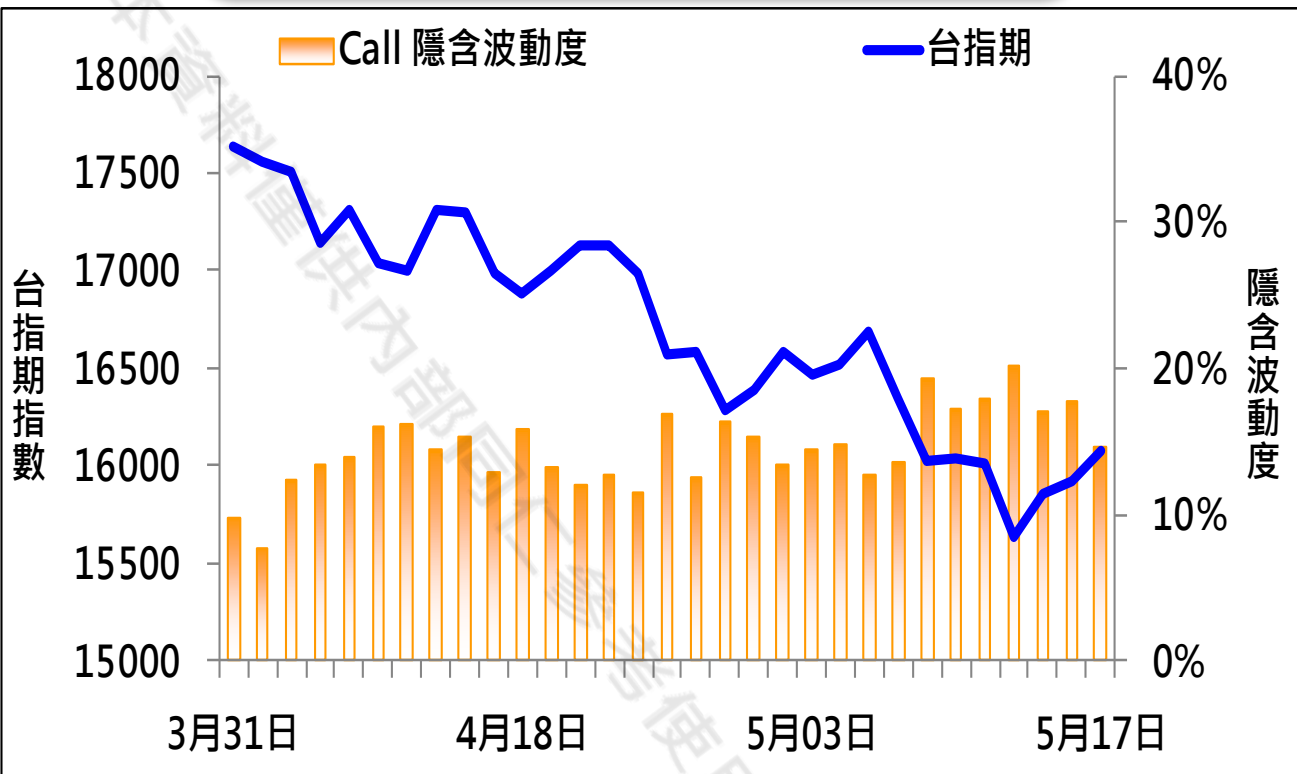
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)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 (109)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



## 近月選擇權OI變化

日期：2022/5/17

結算日：2022/5/18

OI 增減	Call	202205月 履約價	Put	OI 增減
0	1	15,250	1,643	-115
0	84	15,300	9,657	-605
-3	191	15,400	8,756	-1,458
-95	636	15,500	13,062	-2,661
-146	911	15,600	8,955	-1,403
-15	893	15,650	5,948	45
-319	1,737	15,700	8,763	-1,507
-43	1,224	15,750	6,666	1,274
-383	3,557	15,800	10,356	332
13	2,194	15,850	5,824	2,541
-1,007	4,428	15,900	12,587	3,777
-522	4,152	15,950	6,559	4,284
-1,772	11,338	16,000	11,970	5,144
770	7,187	16,050	6,415	4,587
-227	11,232	16,100	7,133	4,412
1,633	10,814	16,150	1,361	974
※ 3,045	19,397	16,200	5,358	560
883	11,148	16,250	294	156
-3,383	13,591	16,300	2,630	-2
-58	6,513	16,350	118	23
-401	12,602	16,400	3,083	-13
-448	9,534	16,500	2,452	-73
-329	5,686	16,700	2,358	-41
-159	5,799	16,900	1,451	-17
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
-4,449	237,220	0.9488	225,073	12,946
昨日 P/C	0.8778	今日增減變化		0.0710

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 (109)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



## 次月選擇權OI變化

日期：2022/5/17

結算日：2022/6/15

OI 增減	Call	202206月 履約價	Put	OI 增減
0	3	13,000	5,070	424
0	5	14,000	1,316	117
5	29	15,000	4,667	961
0	10	15,100	1,281	331
0	8	15,200	1,703	301
0	1	15,300	884	34
10	46	15,400	1,932	303
-89	136	15,500	2,845	379
-5	428	15,600	2,285	289
-12	352	15,700	939	170
-6	847	15,800	1,767	361
-18	426	15,900	1,173	145
107	1,036	16,000	2,190	381
44	914	16,100	846	66
195	1,172	16,200	993	19
293	1,631	16,300	369	10
-65	2,378	16,400	470	-16
※ 1,166	4,080	16,500	328	27
625	2,600	16,600	299	8
507	1,867	16,700	68	1
436	1,881	16,800	482	0
150	1,302	16,900	80	0
446	2,874	17,000	294	3
161	991	17,100	106	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,074	45,008	1.1474	51,641	5,991
昨日 P/C	1.0190	今日增減變化		0.1283

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。

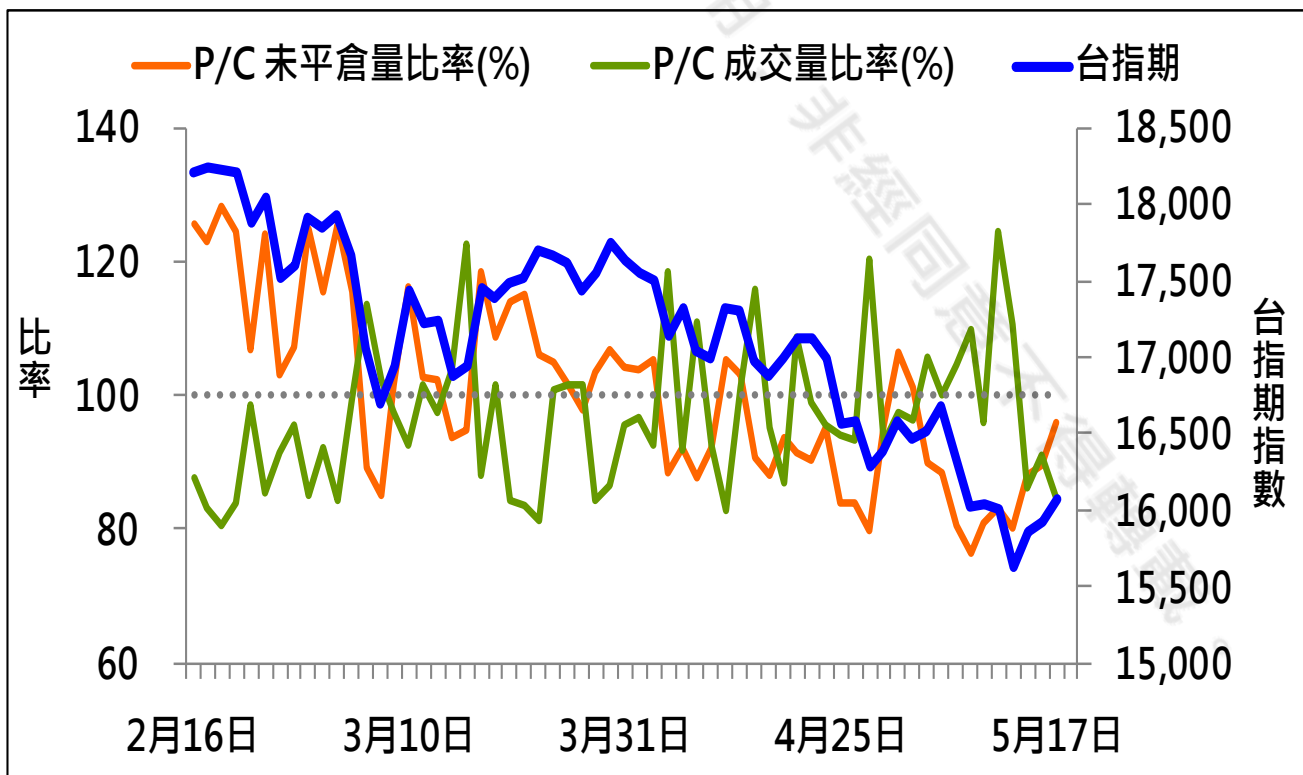
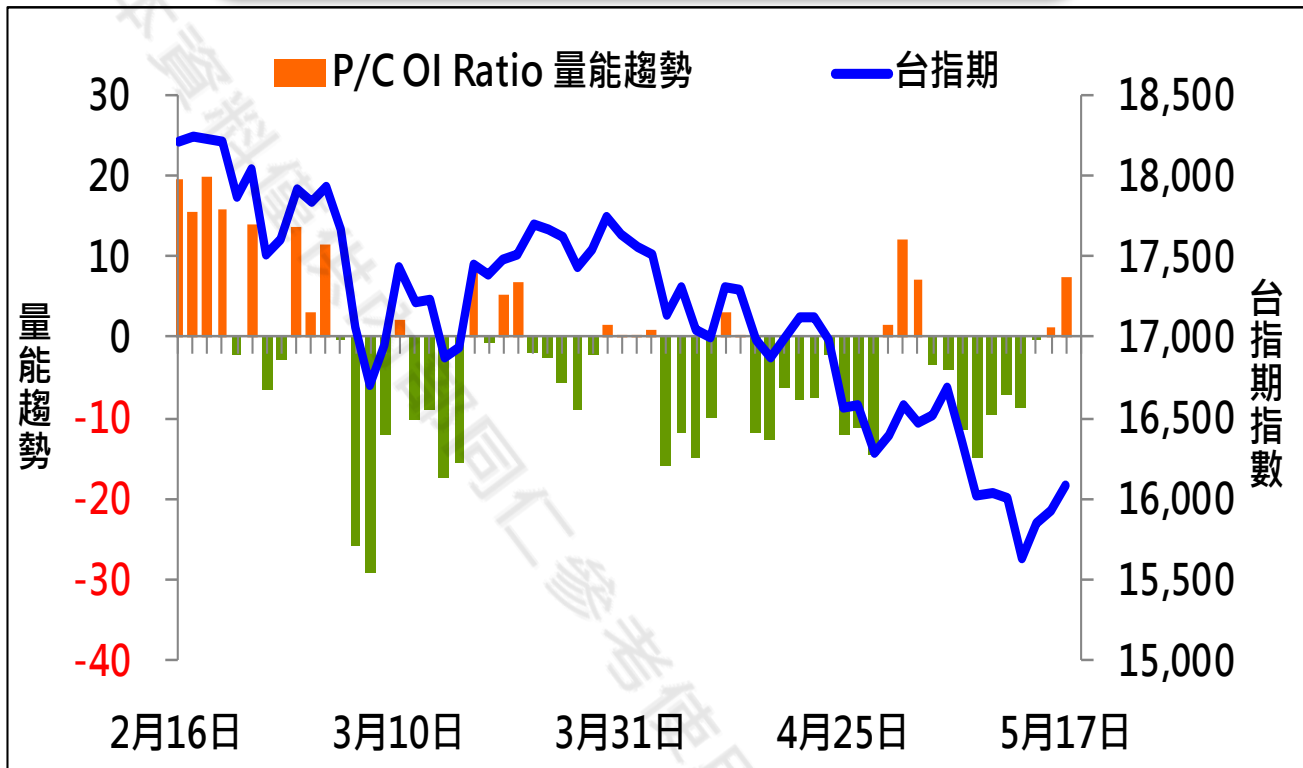
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 (109)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



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易者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，交易者須自行判斷與負責，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 (109)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 (109)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