台指期貨暨選擇權日報

2022/6/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

06月07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	6,617	-1,911	971	-45	-617	-168
投信	-5,771	-411	137	0	39	0
自營商	10,093	-69	-128	-22	-316	26

06月07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	-8	2	23,438	626	18,600	511
投信	0	0	-150	0	464	0
自營商	29	-3	6,782	-1,974	4,974	-739

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
富邦媒	4.40	台積電	-41.82
亞德客-KY	1.94	鴻海	-8.94
長榮	1.71	聯發科	-7.74
億豐	1.56	台達電	-5.03
AES-KY	1.24	台塑化	-4.30
上銀	1.15	台塑	-3.08
美時	0.97	和泰車	-2.82
創意	0.95	日月光投控	-2.81
新唐	0.74	富邦金	-2.59
貿聯-KY	0.73	研華	-2.50
前十名合計	15.39	後十名合計	-81.62

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	54.8%	44.4%
電子期前十大市場佔比	64.4%	68.6%
金融期前十大市場佔比	53.4%	59.6%
非金電期前十大市場佔比	97.8%	92.8%

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

台指期貨暨選擇權日報

2022/6/7

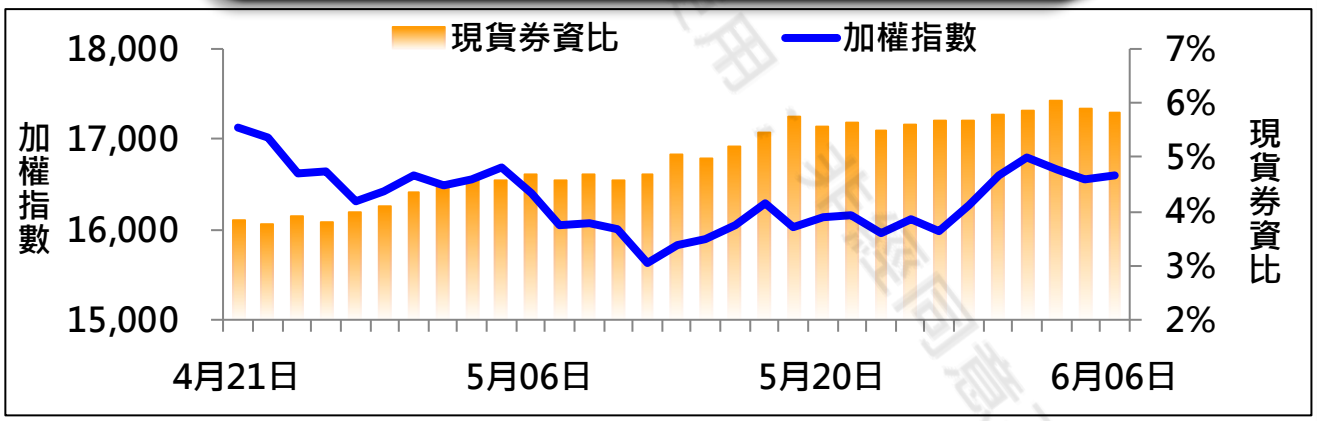
華南期貨 HUA NAN FUTURES

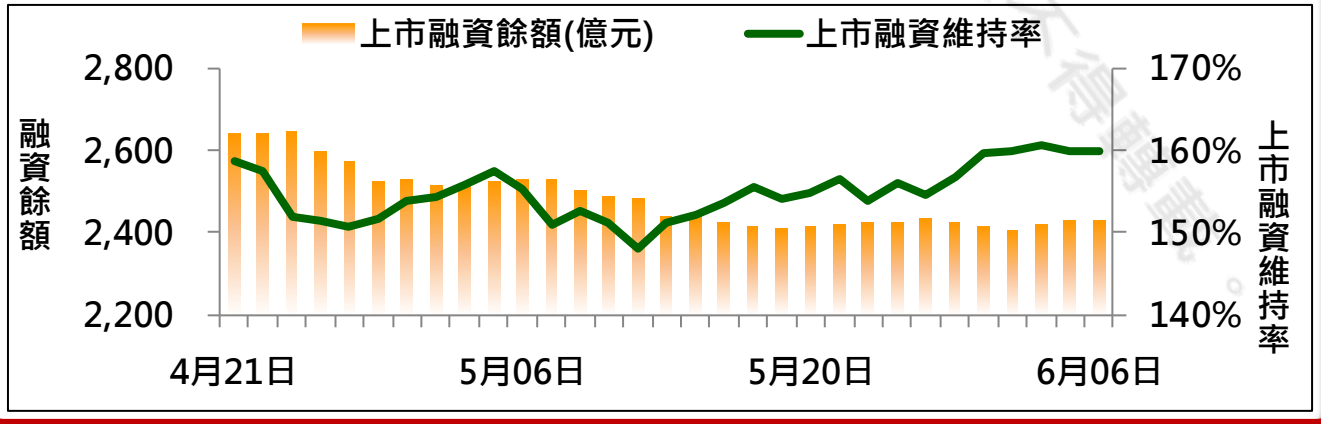
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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31日	232.5	7,991	999	-10.2	8,017	-1,759
06月01日	-101.0	7,434	-557	-8.2	9,428	1,411
06月02日	-84.9	10,257	2,823	-3.7	9,372	-56
06月06日	-22.3	8,528	-1,729	18.6	10,162	790
06月07日	-159.2	6,617	-1,911	20.5	10,093	-69

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31日	19,621	21,625	-2,004	22,270	-22,267	44,537
06月01日	19,254	17,913	1,341	13,230	-8,998	22,228
06月02日	20,950	18,443	2,507	11,090	-3,962	15,052
06月06日	22,812	18,089	4,723	8,756	5,713	3,043
06月07日	23,438	18,600	4,838	6,782	4,974	1,808

現貨券資比 & 上市融資維持率



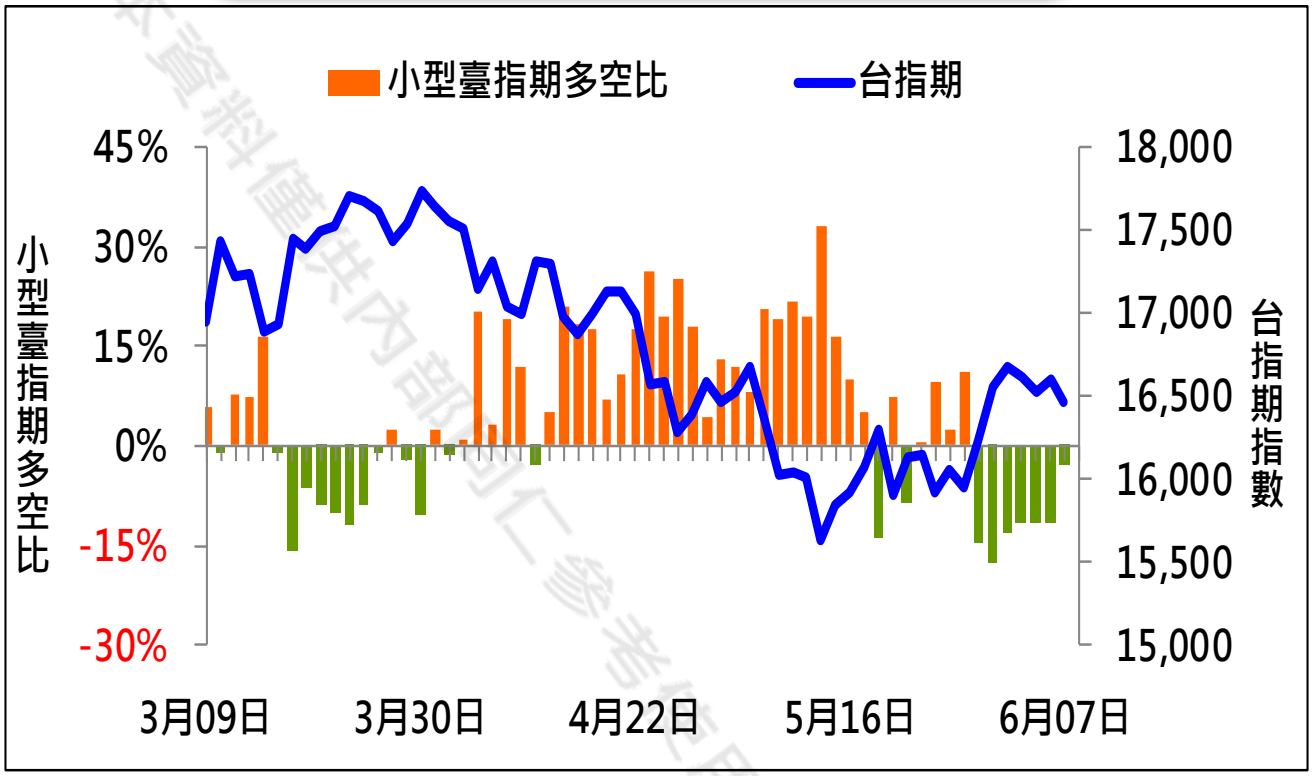


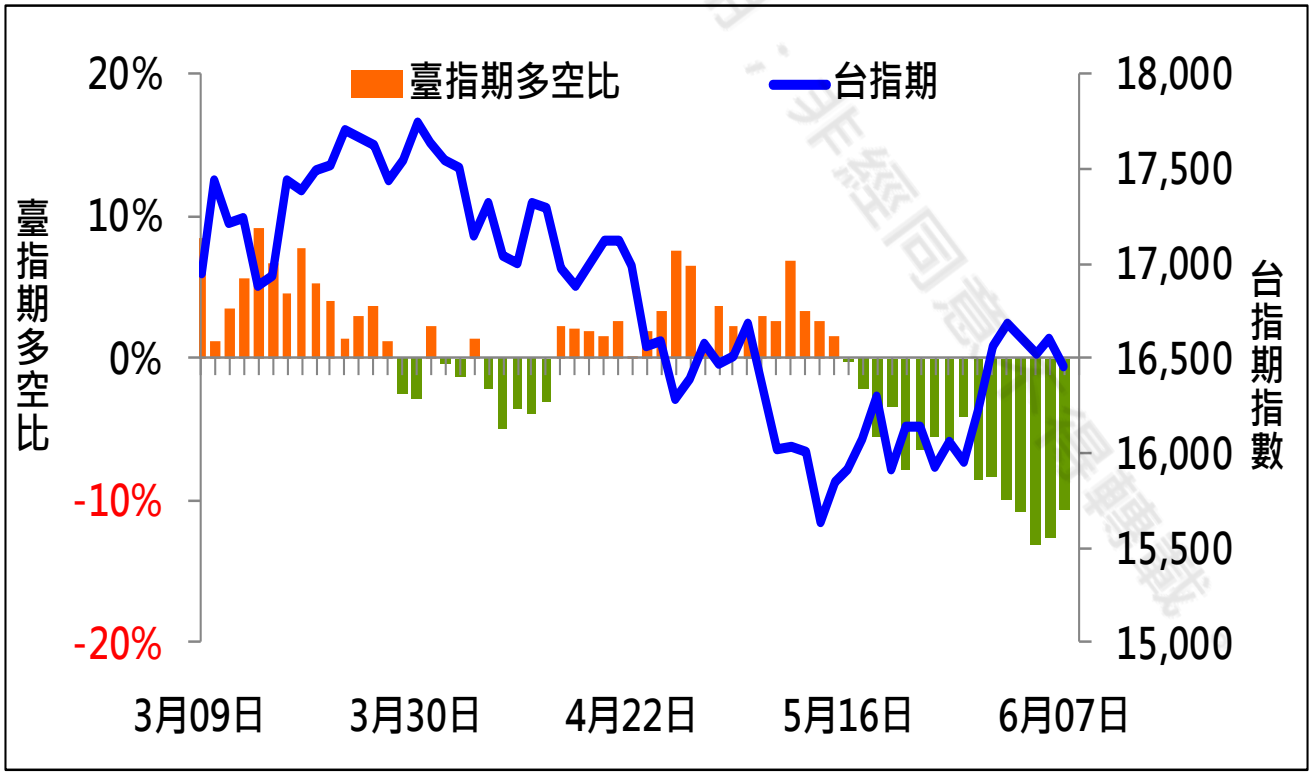
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

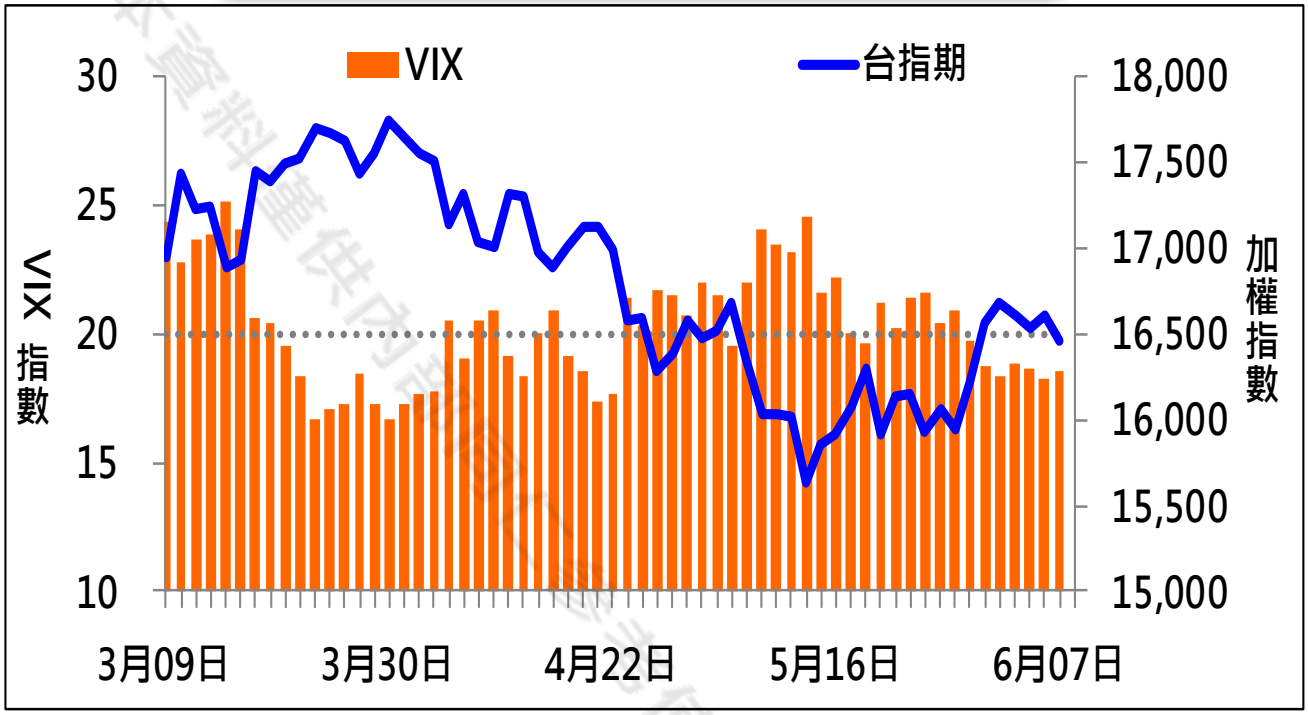




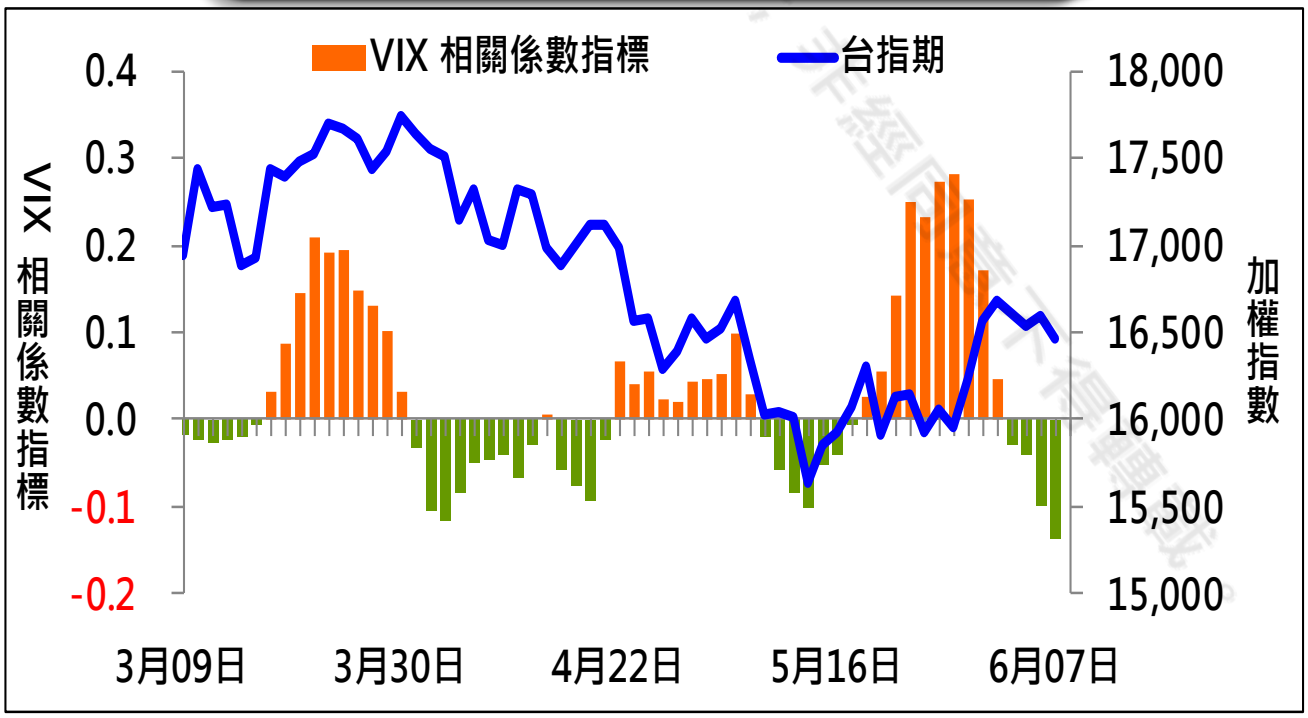
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

VIX



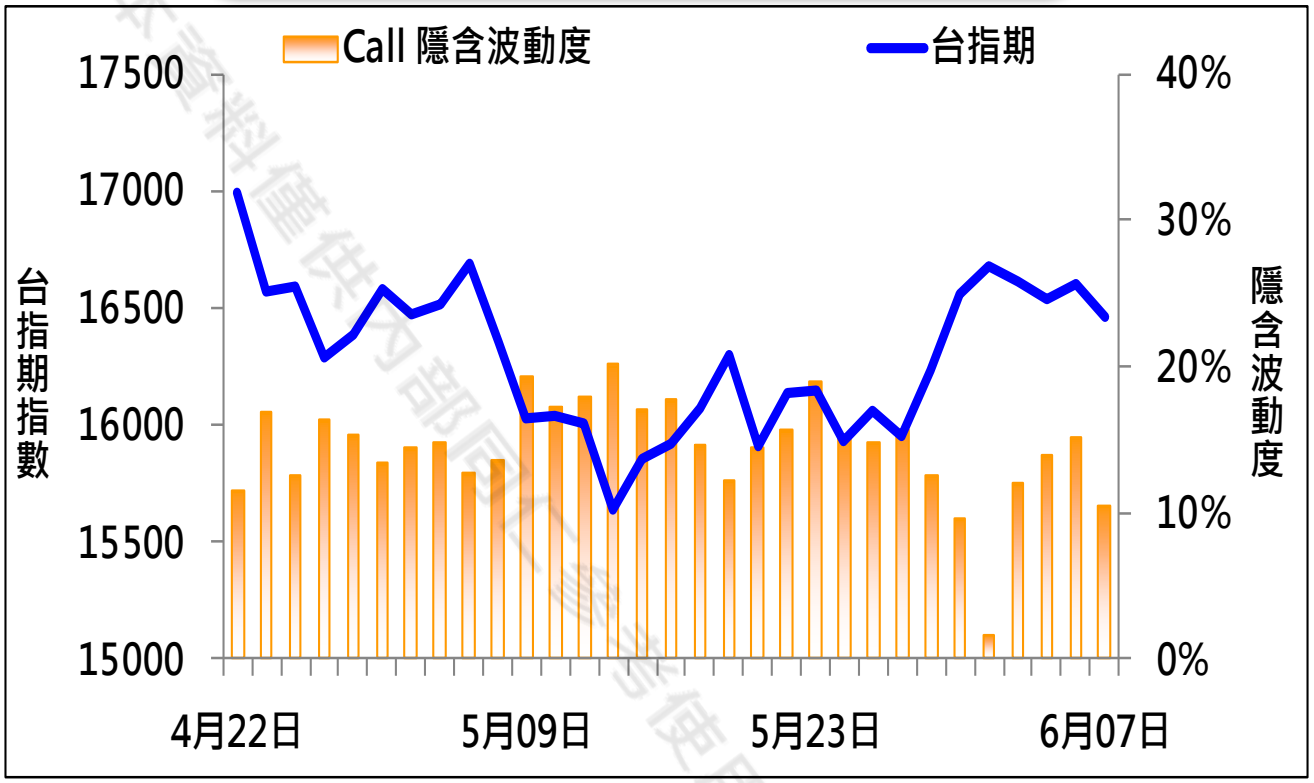
VIX 與 TWSE 相關係數指標

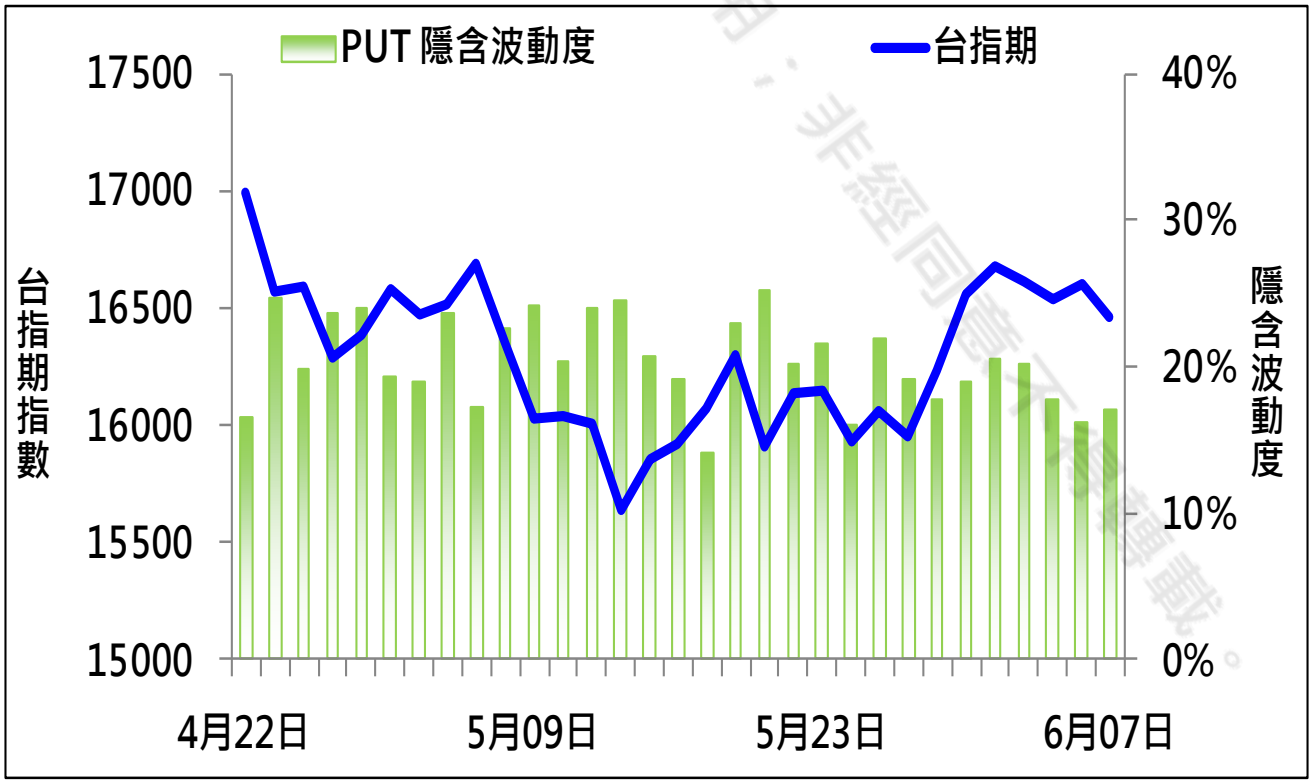


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

台指期貨暨選擇權日報

2022/6/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/6/7　　結算日：2022/6/8

	OI 增減	Call	202206W2 履約價	Put	OI 增減	
	0	0	15,700	2,625	-24	
	3	3	15,800	3,396	13	
	-1	1	15,900	5,441	178	
	1	13	16,000	6,015	-1,001	
	0	17	16,100	5,626	-1,259	
	2	2	16,150	3,140	669	
	8	27	16,200	7,520	338	
	80	112	16,250	6,252	1,138	
	89	196	16,300	8,240	1,404	
	238	352	16,350	6,614	2,417	
	725	876	16,400	9,338	3,912	※
	2,696	3,141	16,450	7,144	2,086	
	4,839	6,314	16,500	7,753	1,165	
	4,276	6,966	16,550	4,424	969	
	4,790	9,487	16,600	5,866	591	
※	7,227	11,707	16,650	3,191	-84	
	4,861	12,095	16,700	2,324	319	
	859	7,176	16,750	689	32	
	-242	8,061	16,800	641	41	
	-1,480	5,697	16,850	226	22	
	-1,147	5,693	16,900	239	-25	
	-1,836	4,625	16,950	27	5	
	-484	7,057	17,000	33	-1	
	-229	4,018	17,050	17	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
24,900	107,372	0.9456	101,530	12,653
昨日 P/C	1.0777	今日增減變化		-0.1321

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

台指期貨暨選擇權日報

2022/6/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/6/7　　結算日：2022/6/15

OI 增減	Call	202206 月 履約價	Put	OI 增減
0	7	14,800	3,458	3
0	0	14,900	2,982	4
-3	32	15,000	11,273	559
0	6	15,100	2,179	90
-7	130	15,200	2,366	-96
0	9	15,300	3,167	-38
0	37	15,400	4,690	-267
-4	519	15,500	6,138	260
-26	410	15,600	4,587	-330
-16	448	15,700	4,828	178
-11	1,021	15,800	5,195	389
5	1,850	15,900	6,384	42
-99	2,689	16,000	9,506	71
-194	2,063	16,100	4,988	465
-551	2,876	16,200	5,879	-318
-47	2,641	16,300	4,316	-38
-204	3,577	16,400	2,974	107
205	5,933	16,500	3,381	46
186	6,068	16,600	2,055	-373
721	8,837	16,700	1,207	15
※ 2,266	10,077	16,800	1,308	-56
947	9,538	16,900	411	41
586	14,243	17,000	905	-30
116	6,008	17,100	158	4

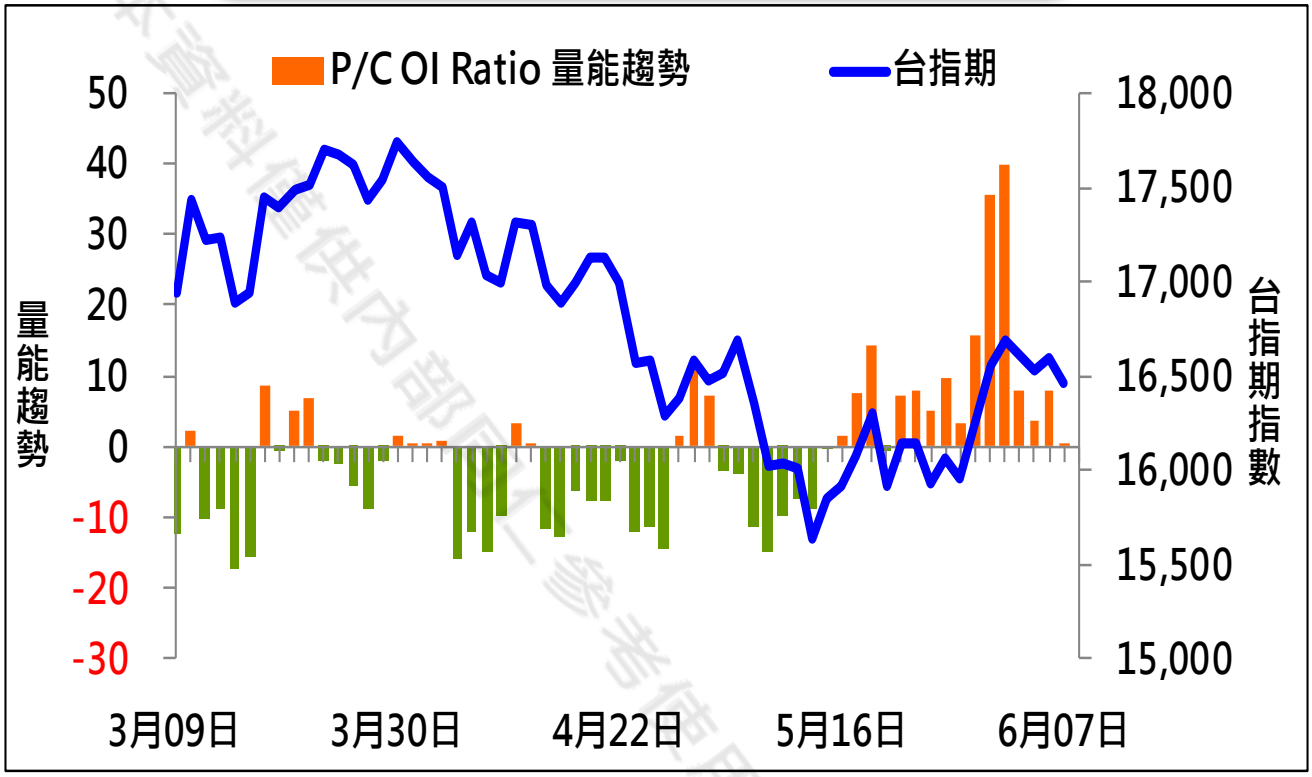
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,865	115,650	1.1061	127,917	1,779
昨日 P/C	1.1284	今日增減變化		-0.0224

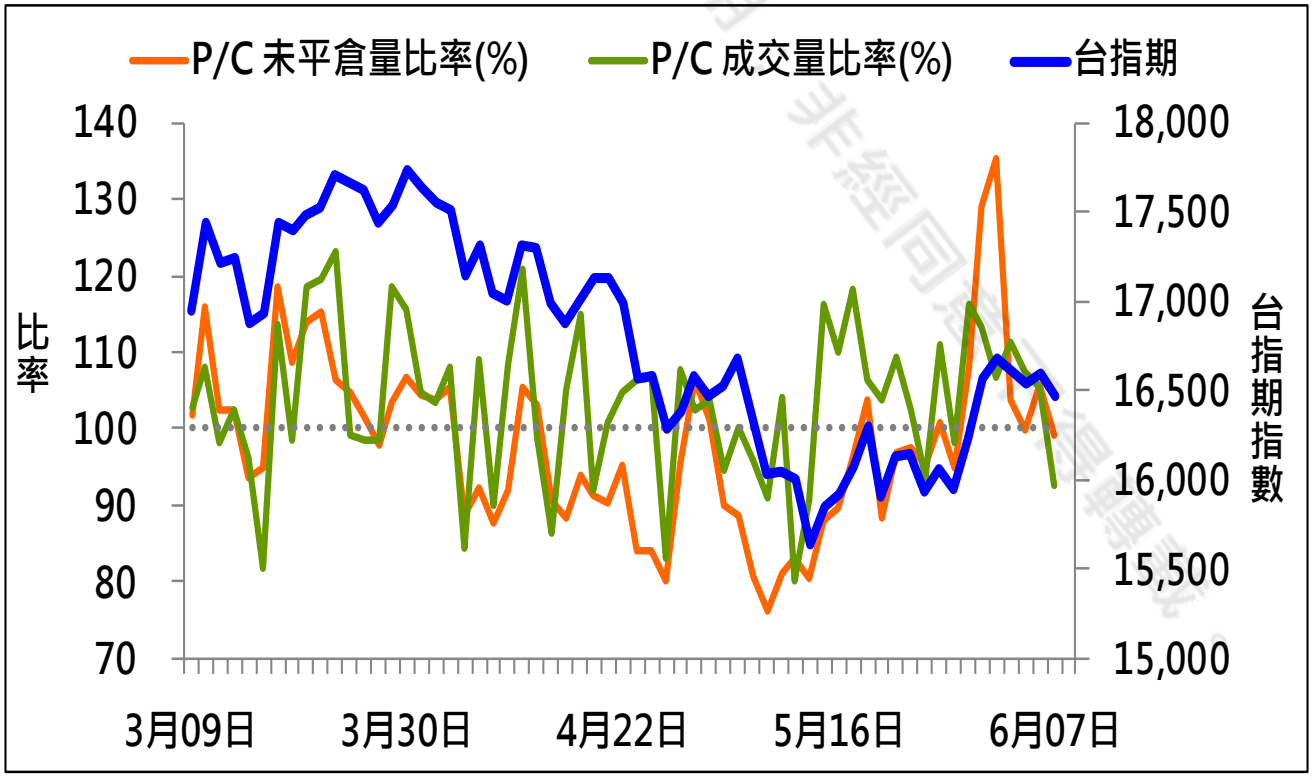
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

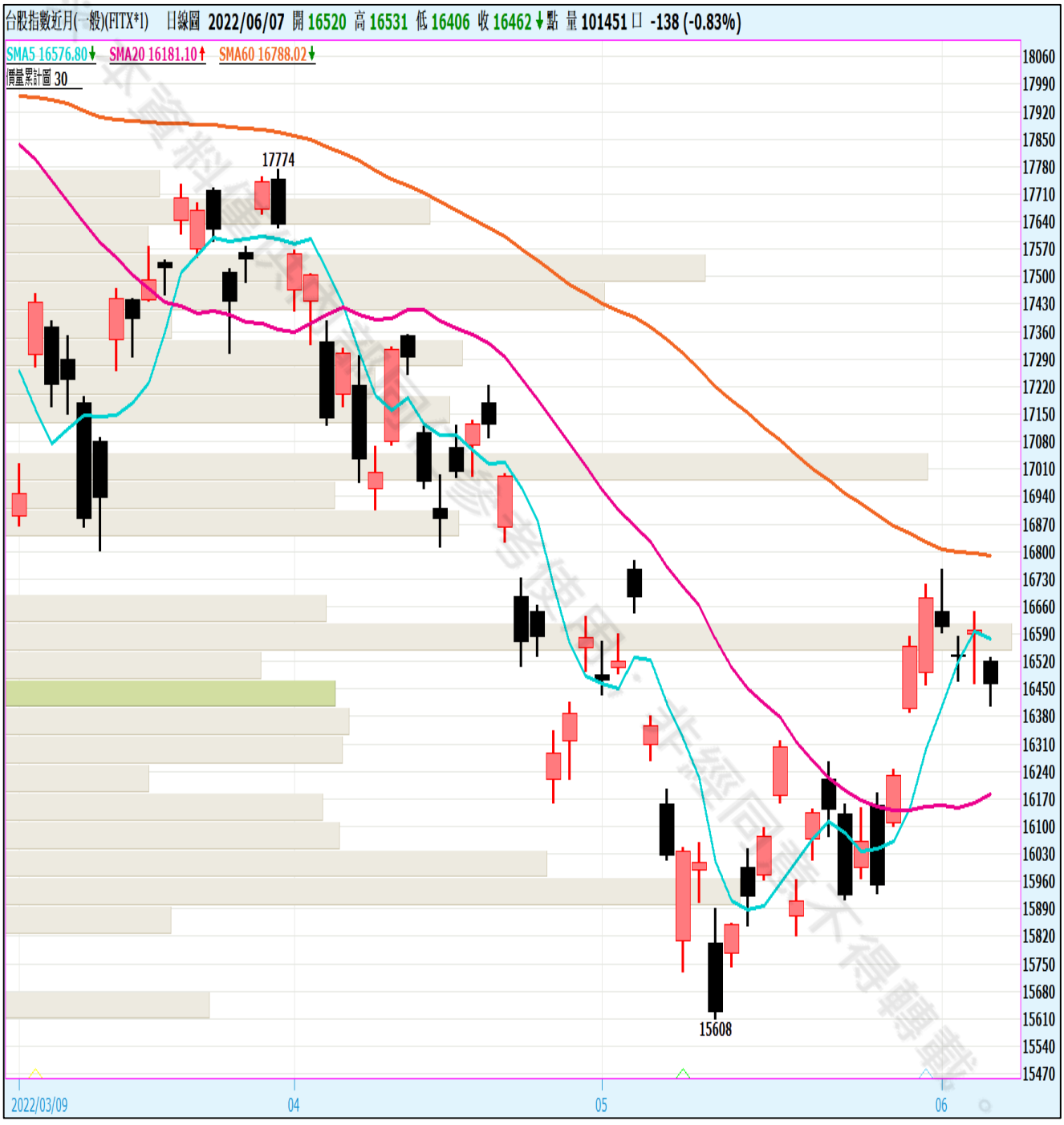
成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖





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 (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