台指期貨暨選擇權日報

2022/6/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

06月16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	-6,478	-180	976	187	-804	54
投信	-6,432	2,255	135	0	37	0
自營商	10,128	-1,326	6	-37	192	-26

06月16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	-210	-8	13,070	2,332	8,641	-1,486
投信	0	0	0	0	5	0
自營商	199	-10	4,152	6,093	7,320	-1,443

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台達電	2.10	長榮	-14.52
中信金	1.94	欣興	-8.33
玉山金	1.51	萬海	-7.48
日月光投控	1.41	聯發科	-5.68
旭隼	0.71	陽明	-5.64
瑞昱	0.58	台塑化	-3.38
國泰金	0.47	南電	-2.82
智邦	0.45	矽力-KY	-2.74
富邦金	0.43	國巨	-2.72
文曄	0.43	中華電	-2.50
前十名合計	10.02	後十名合計	-55.82

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	50.1%	49.7%
電子期前十大市場佔比	63.5%	72.1%
金融期前十大市場佔比	52.2%	59.8%
非金電期前十大市場佔比	98.1%	96.9%

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

2022/6/16

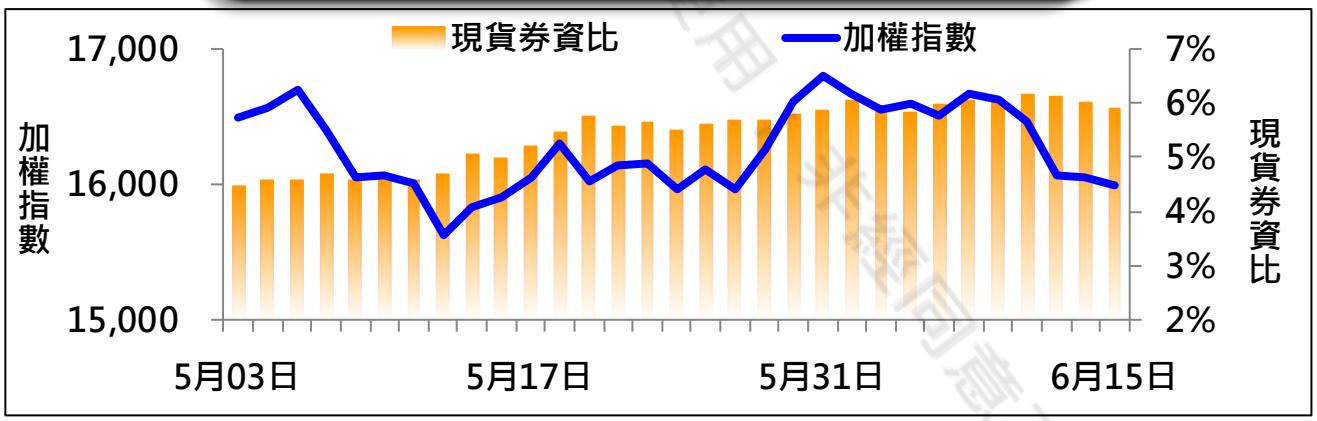
華南期貨 HUA NAN FUTURES

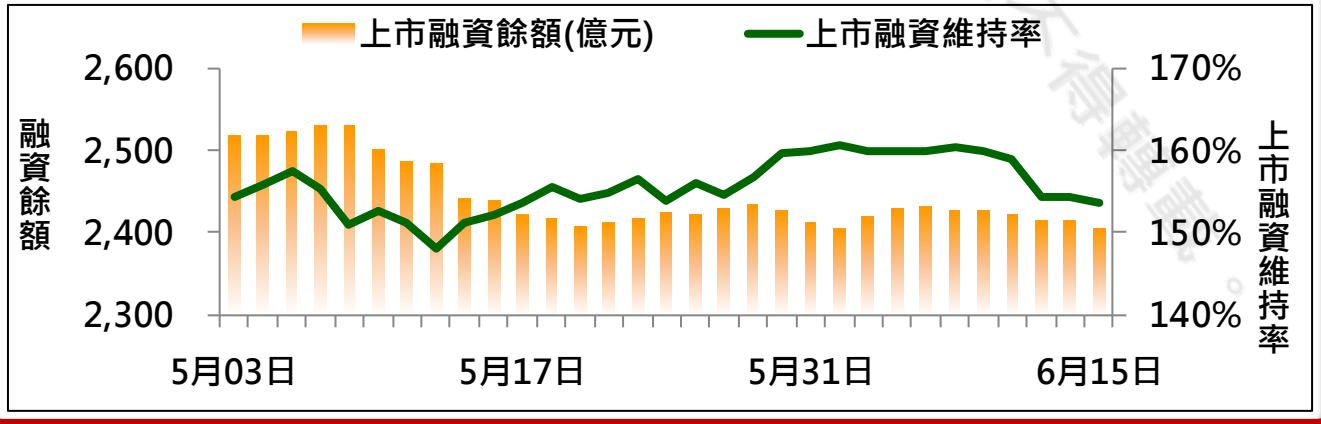
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
06月10日	-185.6	6,910	-994	11.7	10,634	162
06月13日	-480.3	4,790	-2,120	-30.2	9,832	-802
06月14日	-236.9	2,073	-2,717	17.9	10,546	714
06月15日	-191.8	-6,298	-8,371	61.2	11,454	908
06月16日	6.5	-6,478	-180	-45.9	10,128	-1,326

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
06月10日	28,310	17,094	11,216	3,196	1,352	1,844
06月13日	31,837	21,069	10,768	-10,892	-526	-10,366
06月14日	39,712	26,336	13,376	-27,006	10,798	-37,804
06月15日	10,738	10,127	611	-1,941	8,763	-10,704
06月16日	13,070	8,641	4,429	4,152	7,320	-3,168

現貨券資比 & 上市融資維持率



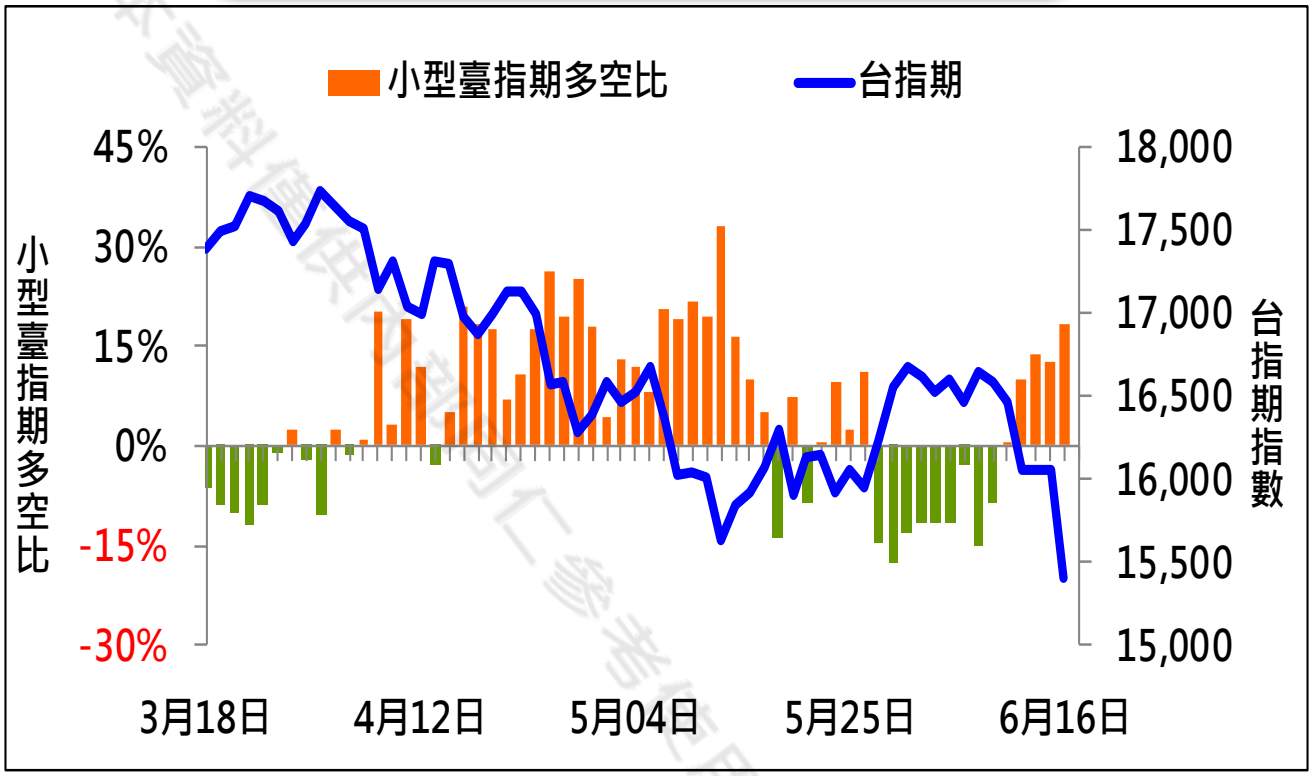


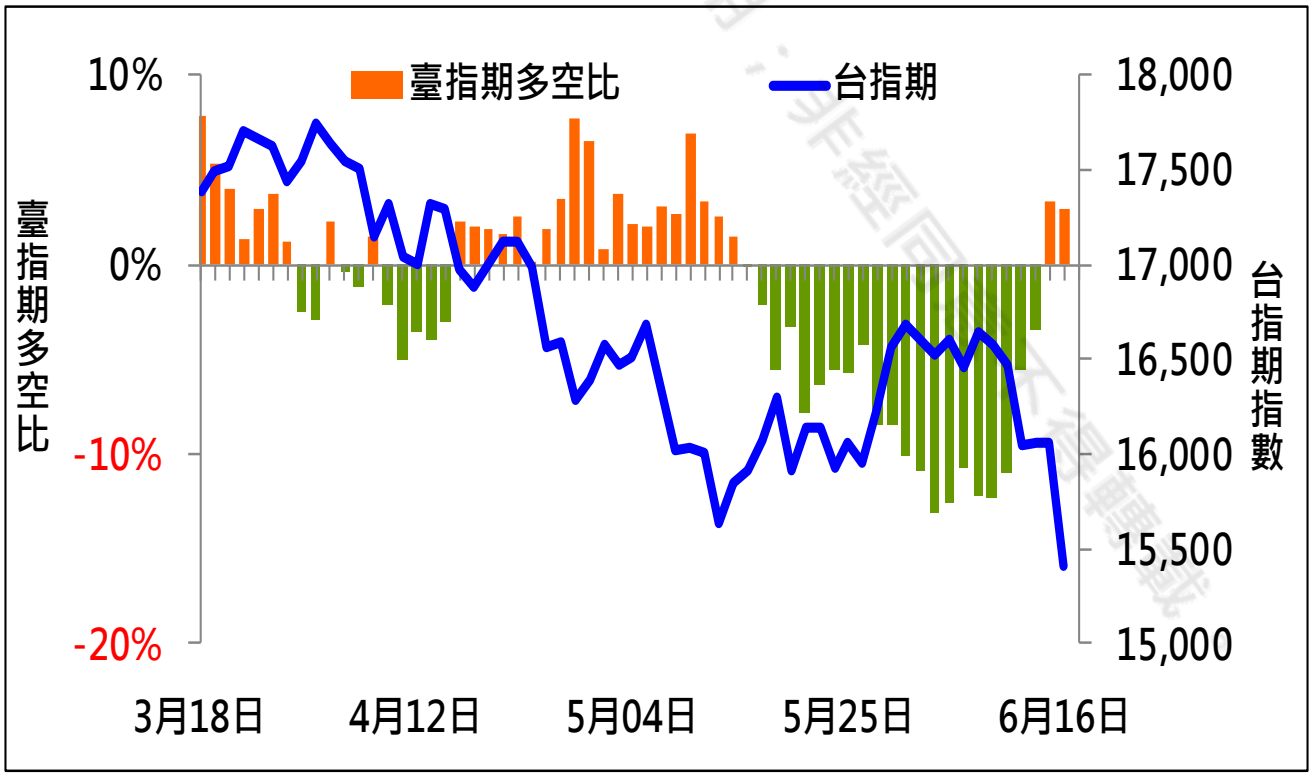
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

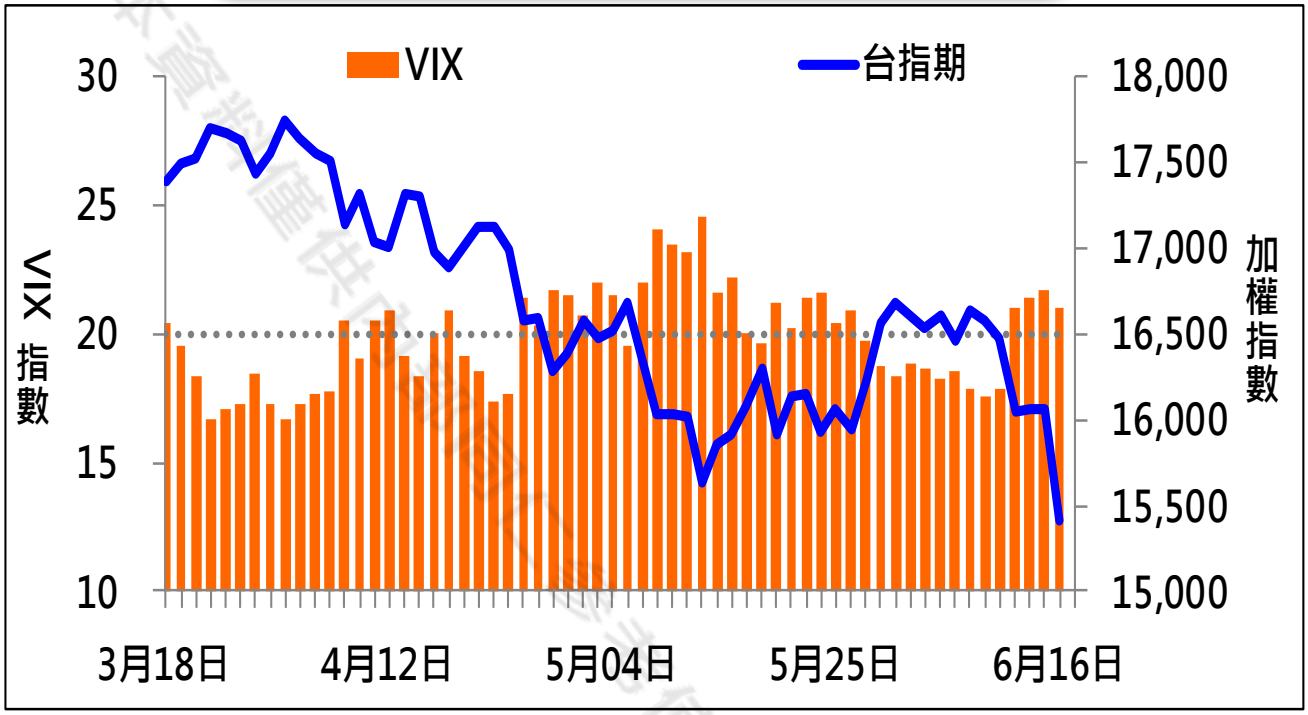




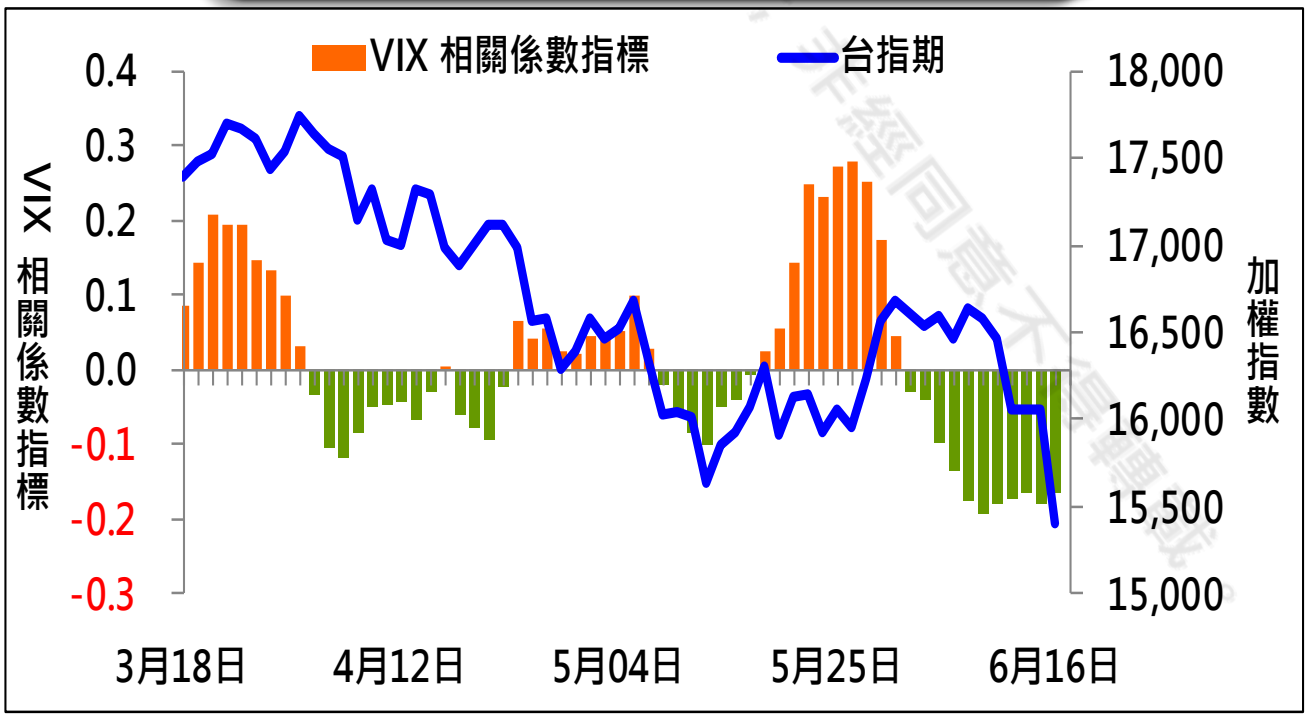
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

VIX

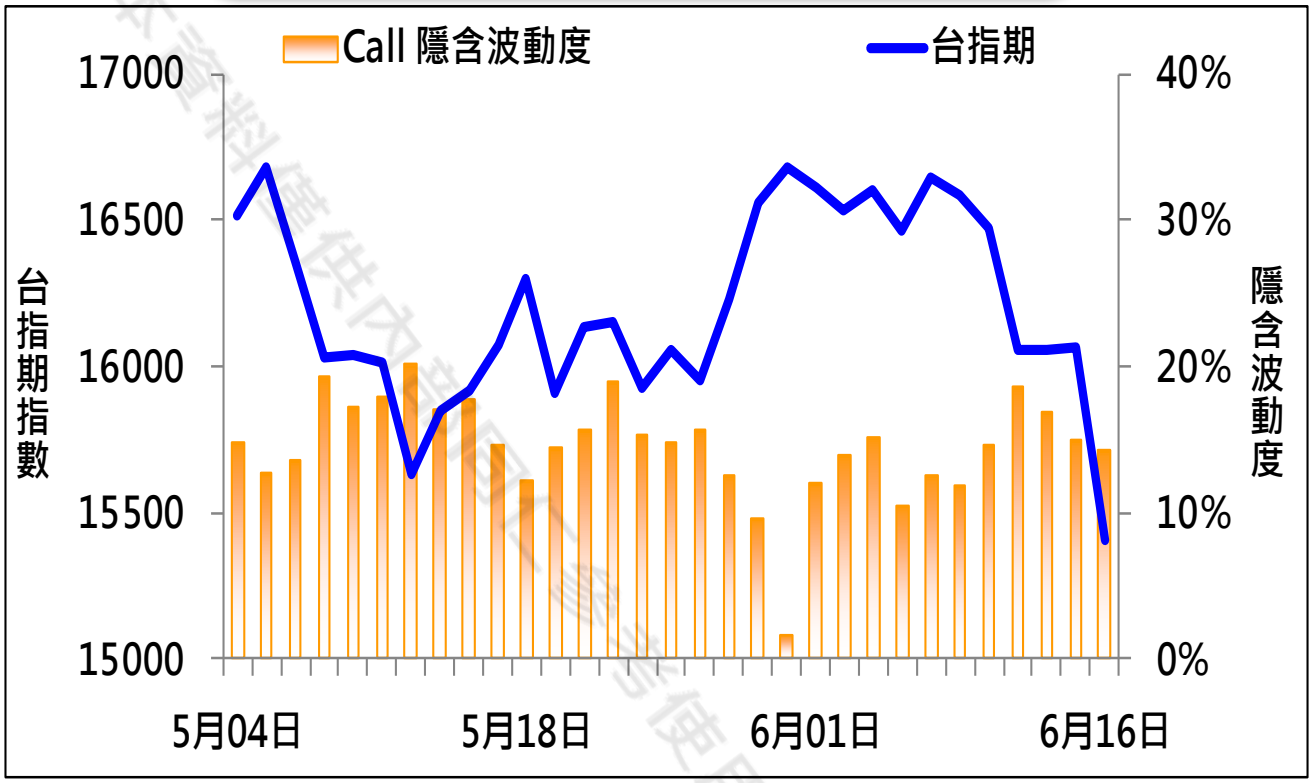


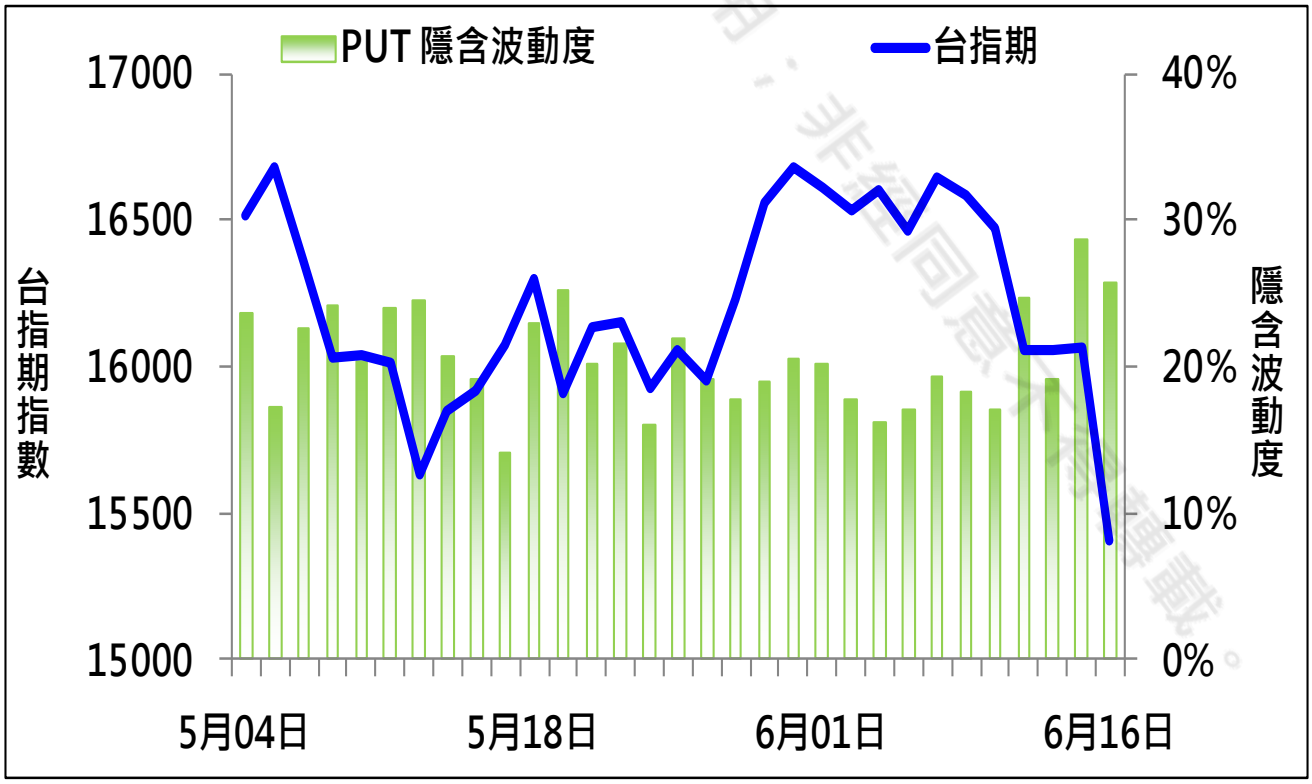
VIX 與 TWSE 相關係數指標



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

2022/6/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/6/16　　結算日：2022/6/22

	OI 增減	Call	202206W4 履約價	Put	OI 增減	
	0	0	15,200	4,035	2,781	
	25	25	15,300	4,391	3,408	
	7	27	15,400	5,176	3,364	
	56	58	15,500	5,200	3,884	
	61	61	15,550	1,678	1,678	
	134	187	15,600	5,689	3,929	※
	94	99	15,650	2,390	1,748	
	464	553	15,700	3,998	3,324	
	425	490	15,750	1,493	1,070	
	809	1,132	15,800	3,080	2,261	
	782	996	15,850	1,364	986	
	1,157	2,000	15,900	2,329	1,384	
	308	1,800	15,950	1,526	952	
	3,264	4,483	16,000	2,324	1,007	
	2,498	3,524	16,050	1,325	818	
	3,330	4,851	16,100	1,157	804	
	2,133	3,486	16,150	585	531	
	4,605	5,617	16,200	566	422	
	3,287	4,358	16,250	404	331	
※	6,069	8,403	16,300	155	79	
	3,619	4,611	16,350	77	49	
	4,978	6,351	16,400	93	71	
	3,070	4,121	16,450	12	6	
	3,060	5,207	16,500	16	7	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
52,212	75,432	0.9616	72,535	48,108
昨日 P/C	1.0520	今日增減變化		-0.0904

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

2022/6/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/6/16　　結算日：2022/7/20

	OI 增減	Call	202207 月 履約價	Put	OI 增減	
	0	0	14,500	2,933	187	
	1	1	14,600	2,023	270	
	1	415	14,800	2,363	224	
	6	51	15,000	5,101	-66	
	10	45	15,100	2,247	676	
	21	115	15,200	1,731	-76	
	33	254	15,300	1,673	-24	
	209	286	15,400	1,896	104	
	227	622	15,500	2,713	-17	
	67	623	15,600	1,970	-279	
	233	673	15,700	1,711	1,027	※
	436	965	15,800	852	76	
	210	2,009	15,900	423	3	
	906	3,296	16,000	2,907	112	
	858	2,654	16,100	869	14	
	694	6,069	16,200	530	-1	
	1,160	4,992	16,300	1,291	-53	
	38	3,953	16,400	159	0	
	864	5,178	16,500	138	21	
※	1,352	4,602	16,600	108	-5	
	440	4,059	16,700	192	75	
	230	3,247	16,800	19	0	
	434	2,897	16,900	7	-2	
	1,112	8,737	17,000	50	19	

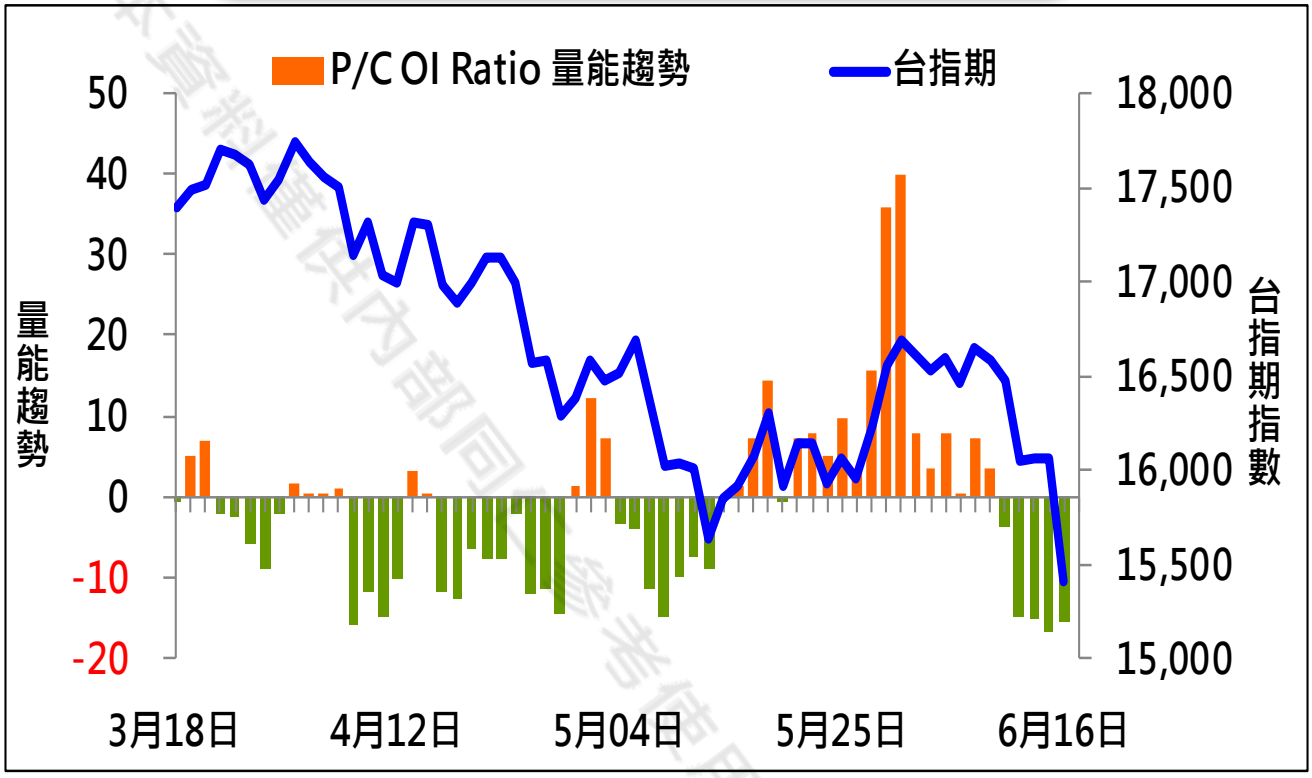
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
9,891	71,183	0.7481	53,252	5,290
昨日 P/C	0.7825	今日增減變化		-0.0344

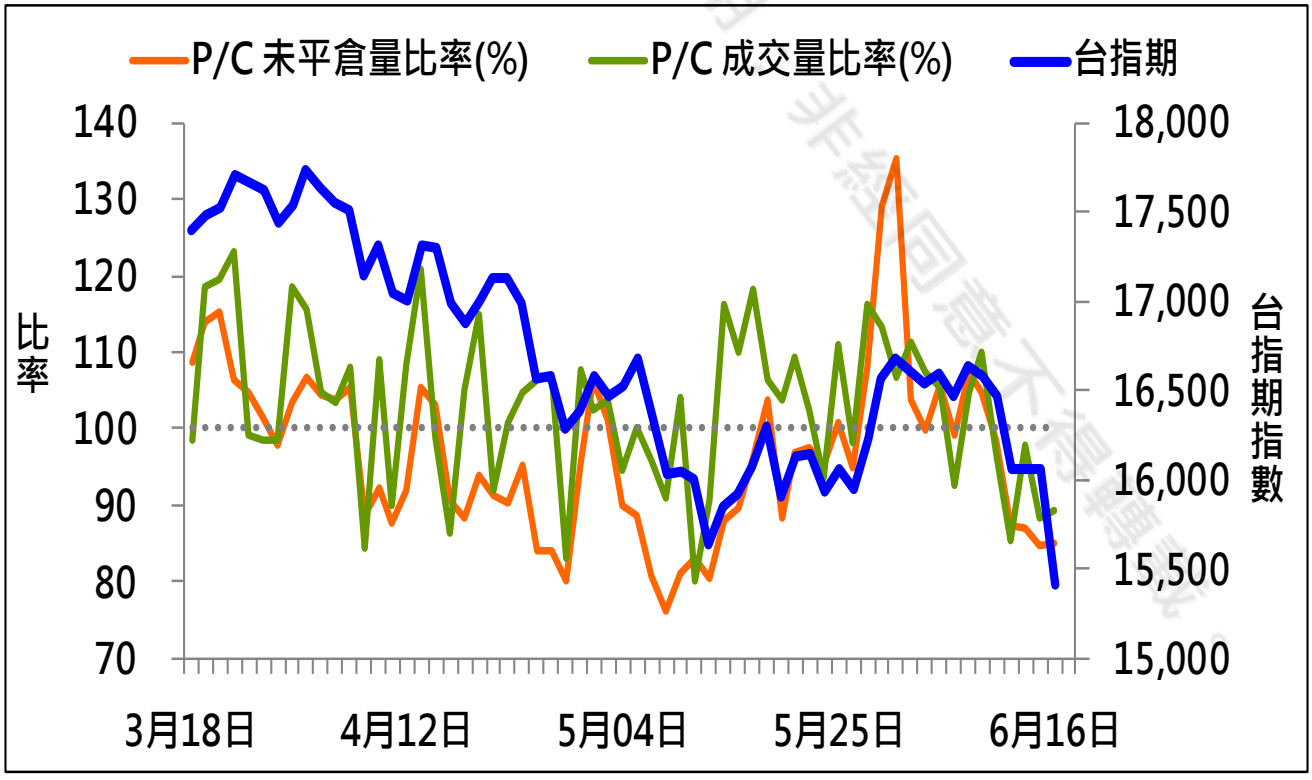
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

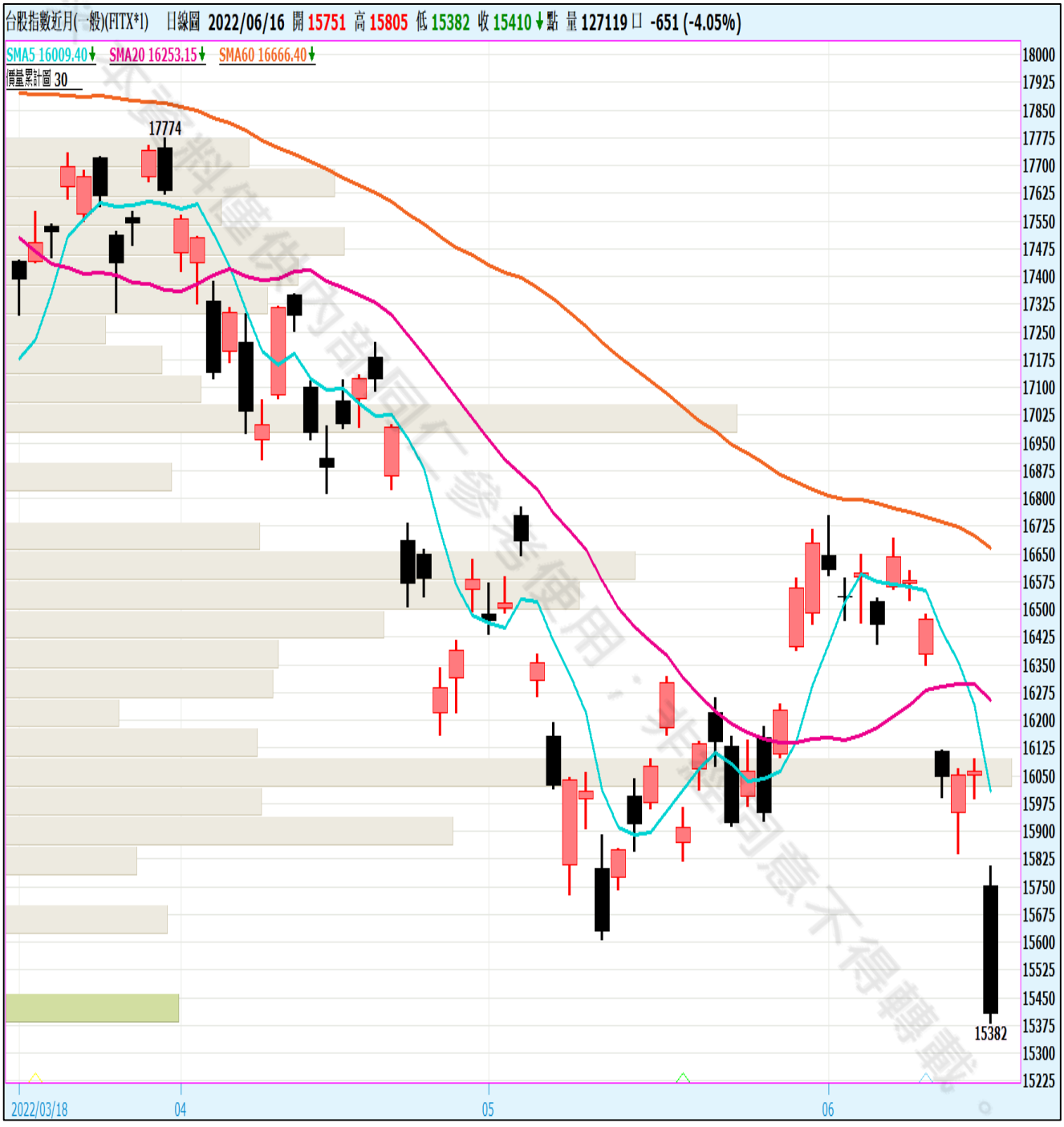
成交量及未平倉量比率 & 量能趨勢圖





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。

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