台指期貨暨選擇權日報

2022/7/11

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

07月11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	2,734	2,891	1,066	82	-578	58
投信	-5,478	-991	294	25	56	0
自營商	463	-373	369	-60	-154	-30

07月11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	-379	40	33,044	-936	29,825	603
投信	0	0	-50	0	655	50
自營商	377	-39	-19,344	1,711	7,426	2,006

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
廣達	2.26	台積電	-42.10
陽明	1.93	聯發科	-7.27
台達電	1.69	玉山金	-5.42
長榮航	1.20	台塑化	-5.26
國泰金	1.19	鴻海	-4.50
華碩	1.09	聯電	-4.46
統一	0.92	南亞	-3.60
豐泰	0.86	兆豐金	-3.31
台泥	0.62	富邦金	-3.05
台灣大	0.57	南電	-2.83
前十名合計	12.32	後十名合計	-81.80

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	40.8%	54.0%
電子期前十大市場佔比	58.0%	76.0%
金融期前十大市場佔比	65.3%	73.1%
非金電期前十大市場佔比	99.3%	97.0%

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

2022/7/11

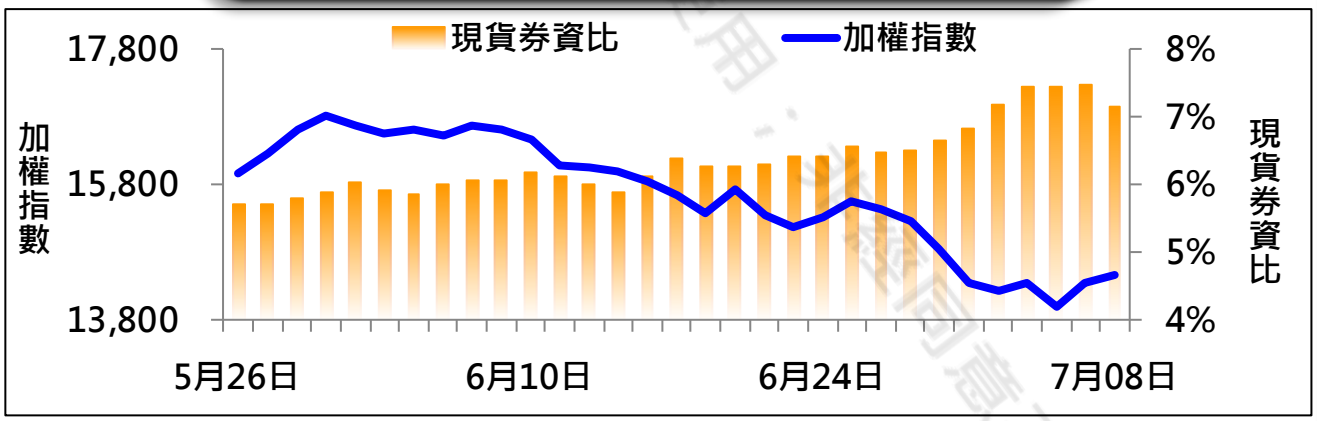
華南期貨 HUA NAN FUTURES

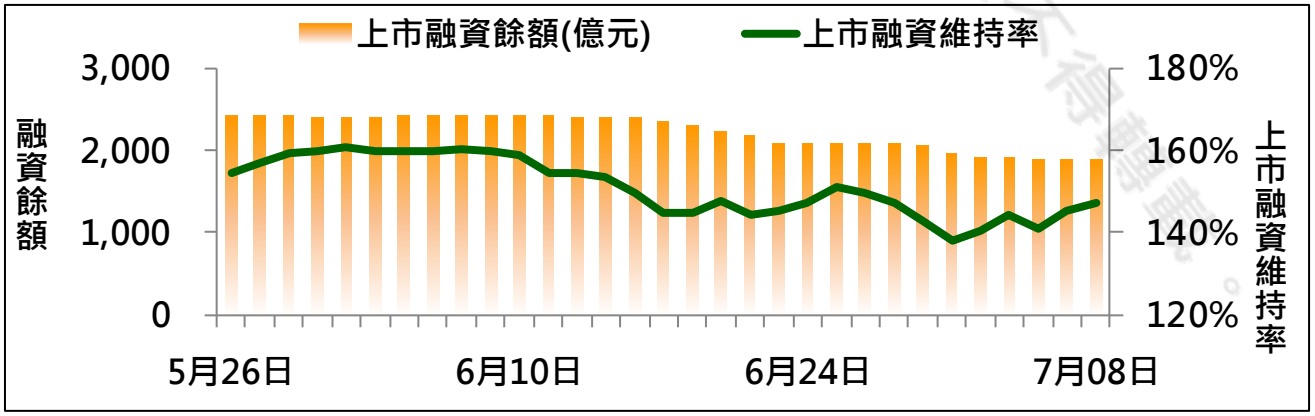
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
07月05日	-2.6	-14,361	-1,021	44.3	2,850	-9
07月06日	-84.2	-8,594	5,767	-32.6	2,243	-607
07月07日	158.8	-6,548	2,046	31.3	2,798	555
07月08日	-39.4	-157	6,391	1.3	836	-1,962
07月11日	-33.9	2,734	2,891	-17.2	463	-373

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
07月05日	17,367	23,975	-6,608	-51,317	25,404	-76,721
07月06日	18,749	21,259	-2,510	-40,683	12,660	-53,343
07月07日	31,438	24,267	7,171	-40,063	13,771	-53,834
07月08日	33,980	29,222	4,758	-21,055	5,420	-26,475
07月11日	33,044	29,825	3,219	-19,344	7,426	-26,770

現貨券資比 & 上市融資維持率



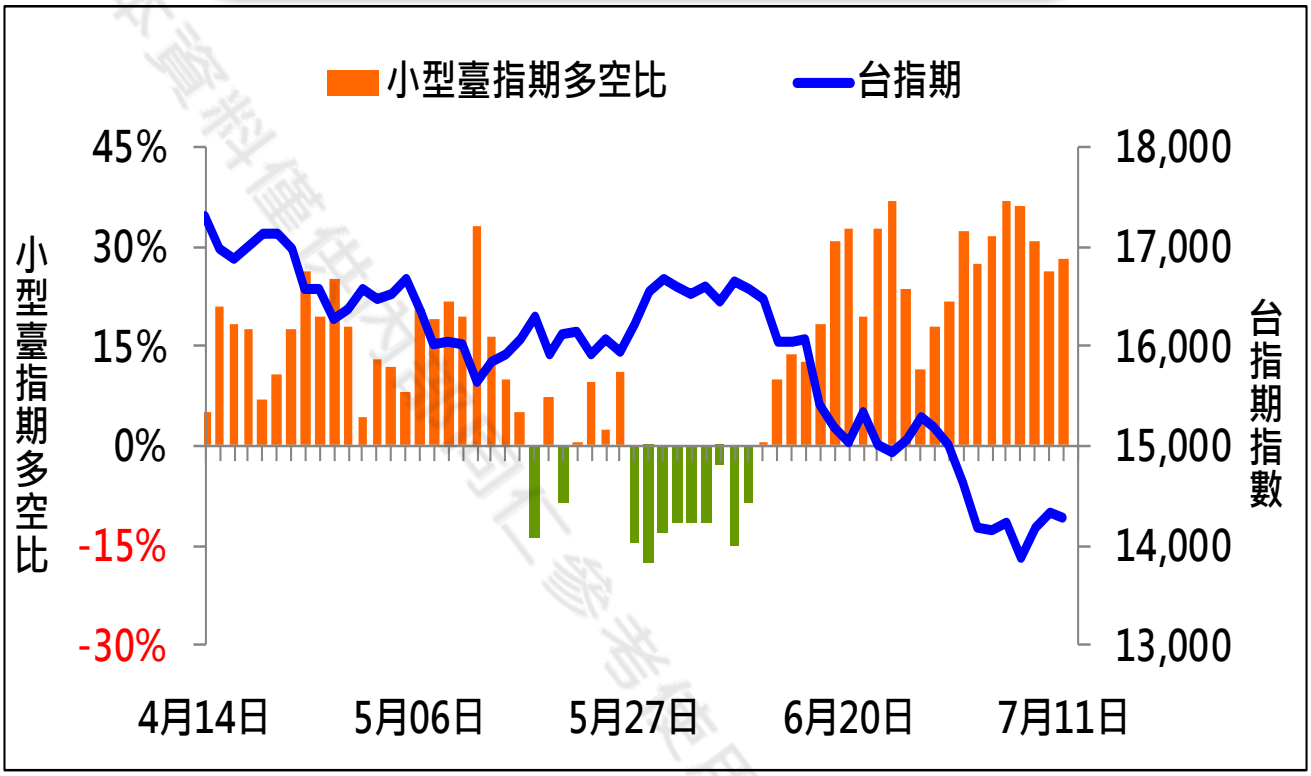


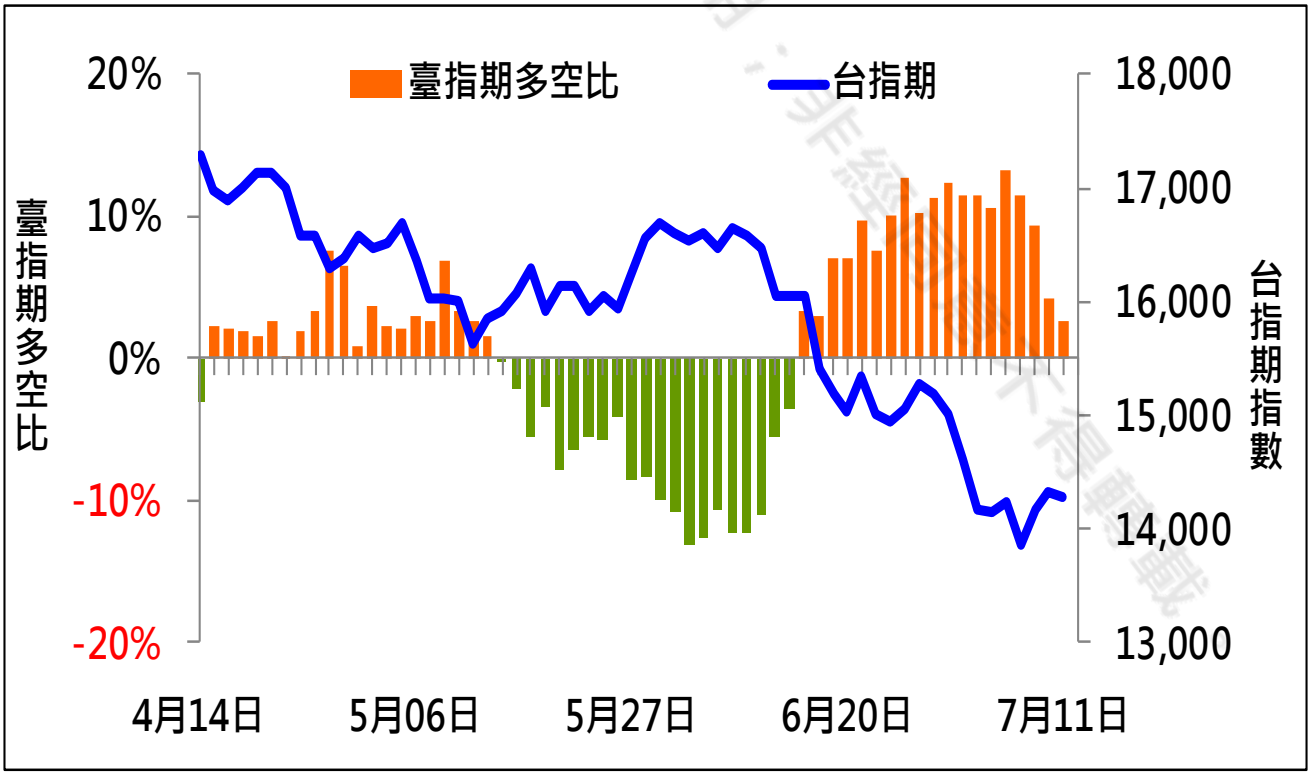
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

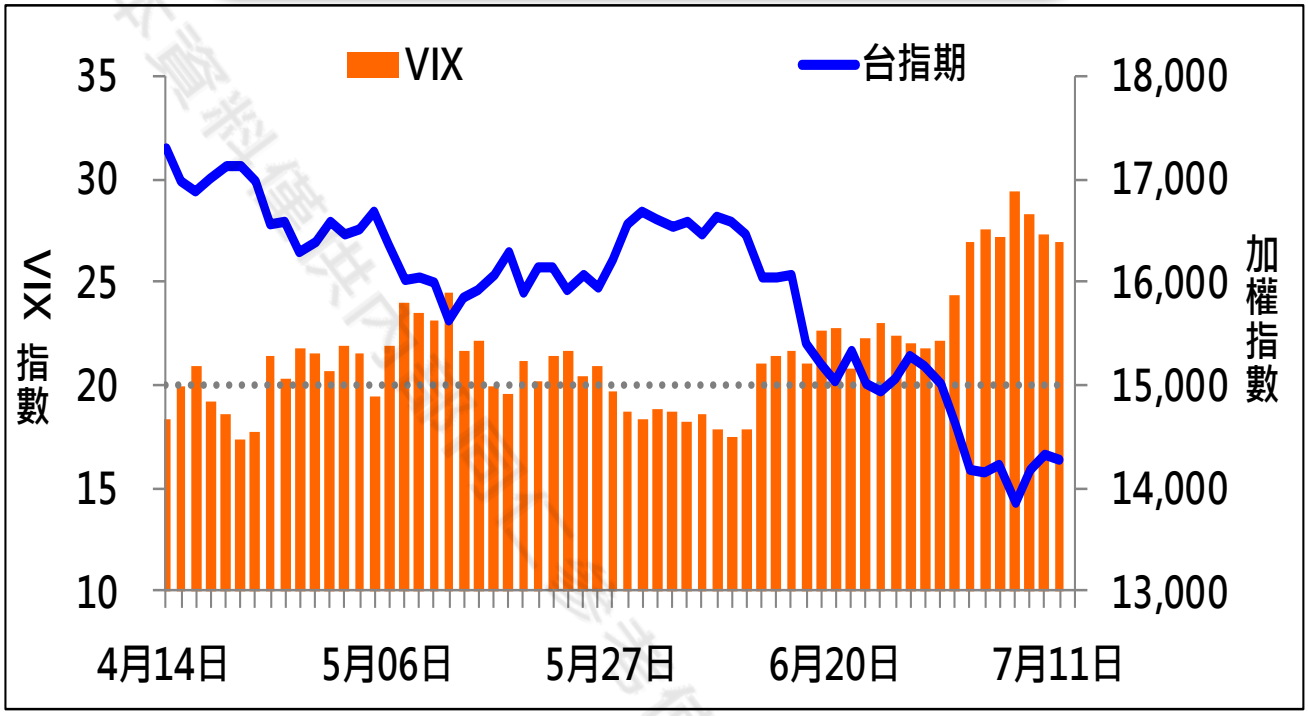
散戶多空比



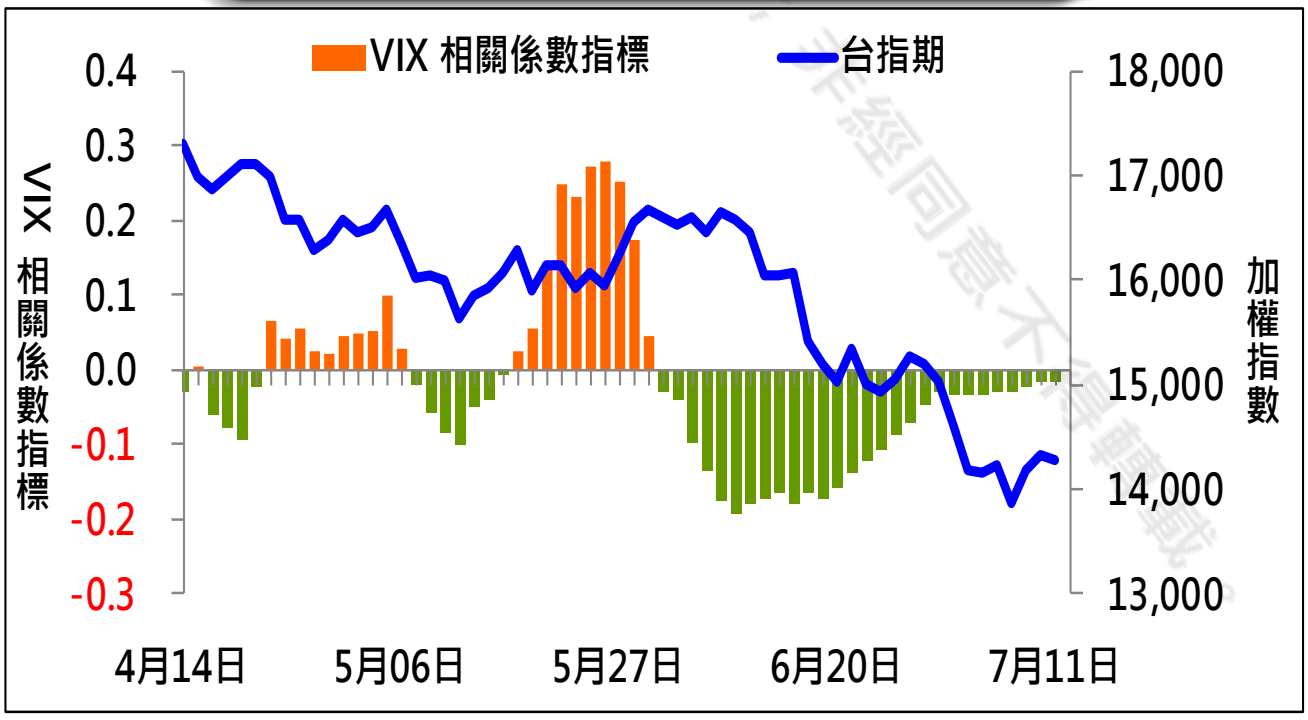


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

VIX

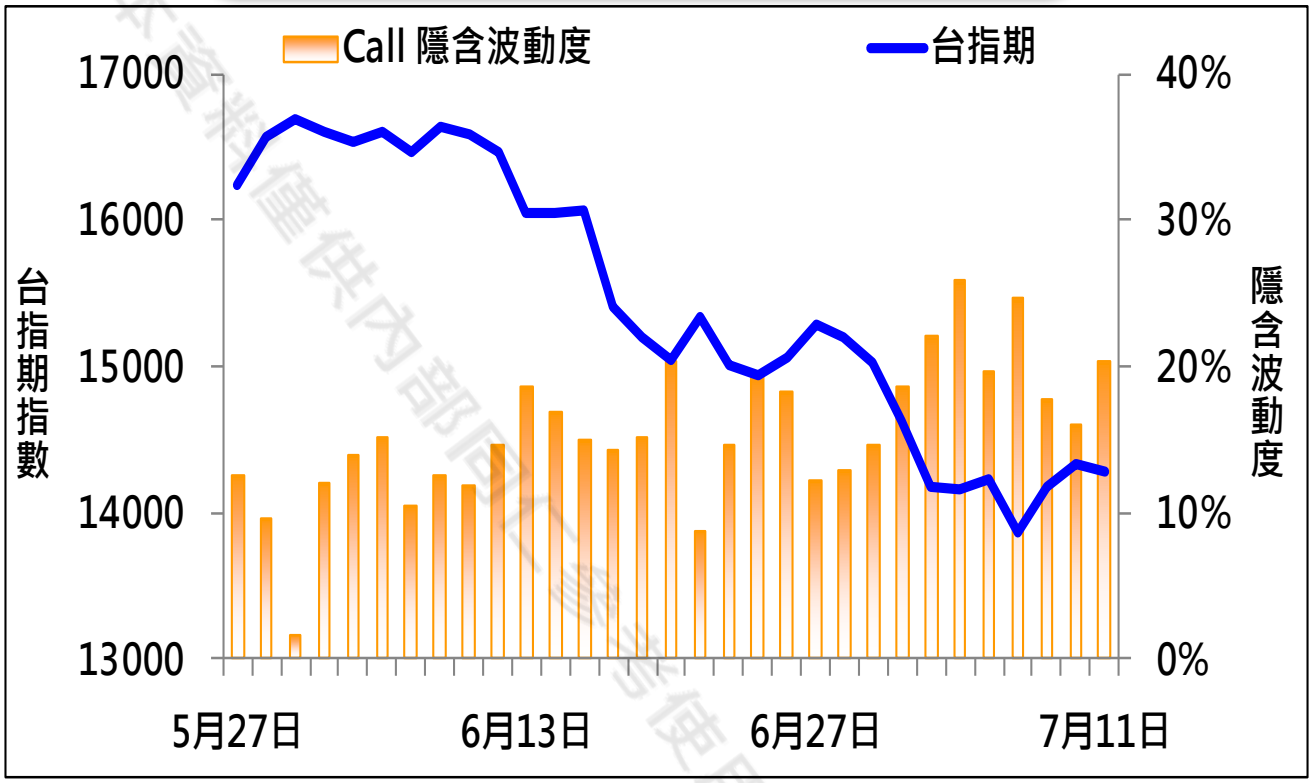


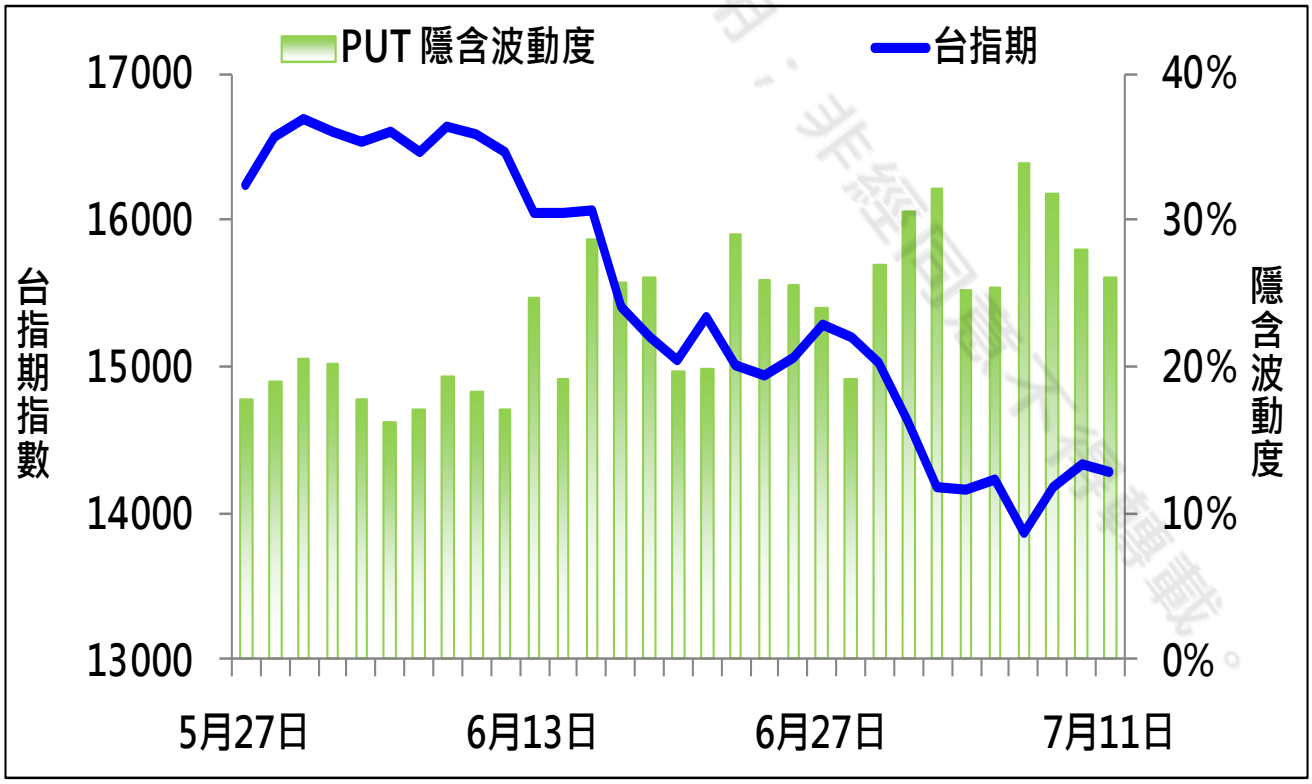
VIX 與 TWSE 相關係數指標



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

2022/7/11

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/7/11　　結算日：2022/7/13

	OI 增減	Call	202207W2 履約價	Put	OI 增減	
	0	200	13,800	5,848	796	
	-21	358	13,900	6,179	982	
	-64	1,319	14,000	7,682	2,021	
	-35	951	14,050	4,122	1,407	
	-50	1,728	14,100	6,480	2,968	※
	18	1,480	14,150	4,007	1,134	
	35	2,158	14,200	4,119	275	
	83	1,929	14,250	2,744	492	
	1,073	3,987	14,300	4,265	1,184	
	1,452	3,261	14,350	3,104	533	
	1,819	5,775	14,400	3,034	607	
	2,305	4,909	14,450	1,385	174	
	1,942	6,332	14,500	2,253	140	
	961	4,182	14,550	443	110	
	908	6,785	14,600	289	-135	
	826	5,155	14,650	59	22	
※	3,382	8,747	14,700	214	0	
	2,288	7,689	14,750	29	2	
	668	9,375	14,800	135	59	
	2,904	2,904	14,850	13	13	
	643	9,338	14,900	46	21	
	-933	6,537	15,000	5	1	
	-219	4,273	15,100	0	0	
	378	3,323	15,200	2	2	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
20,679	111,036	0.9866	109,552	16,667
昨日 P/C	1.0280	今日增減變化		-0.0413

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

2022/7/11

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/7/11　　結算日：2022/7/20

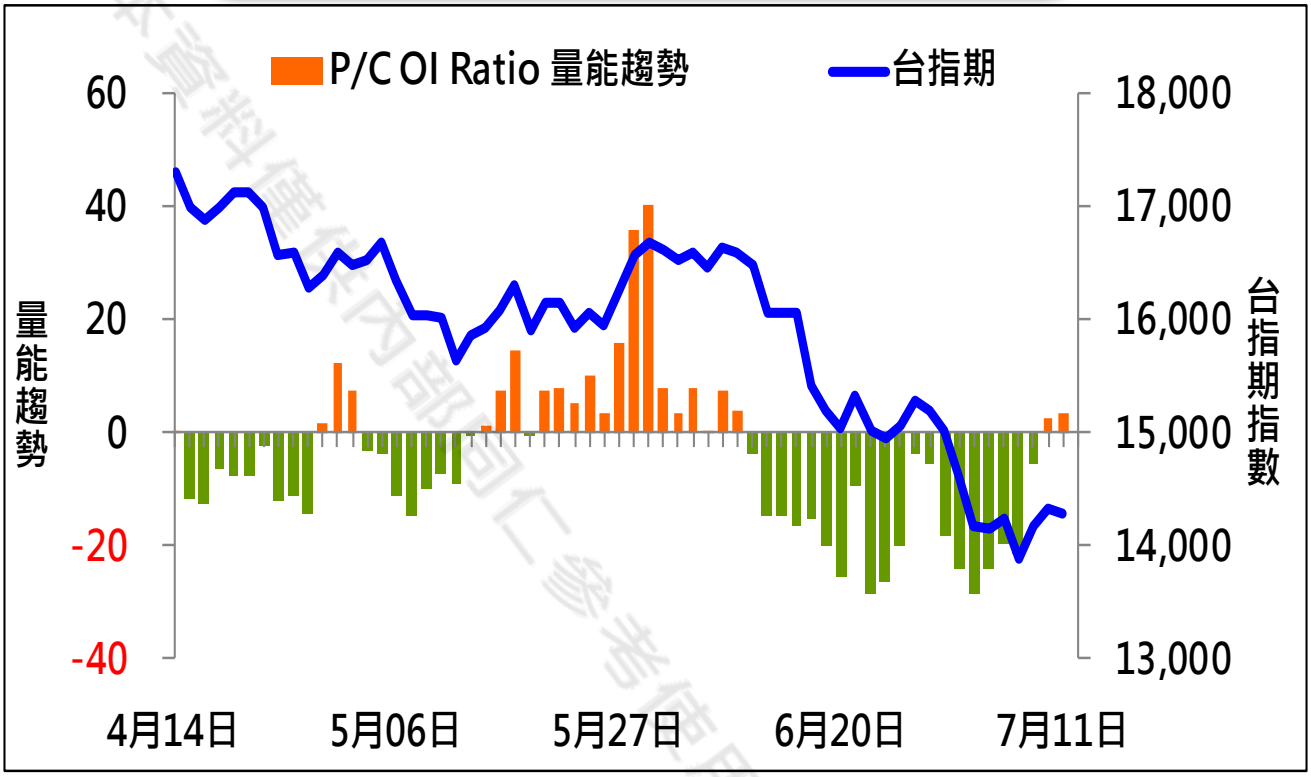
OI 增減	Call	202207 月履約價	Put	OI 增減
0	11	13,200	7,553	36
0	563	13,400	3,830	409
9	91	13,600	4,218	193
12	142	13,700	5,145	168
9	1,027	13,800	3,901	142
-78	312	13,900	4,188	664
22	679	14,000	6,939	608
121	1,018	14,100	3,808	248
32	2,099	14,200	4,203	69
754	2,601	14,300	3,428	-98
369	2,430	14,400	3,206	-21
656	6,097	14,500	4,039	-58
※ 2,016	6,244	14,600	2,604	26
1,216	5,120	14,700	1,751	-1
454	8,573	14,800	2,582	-35
2	5,024	14,900	2,209	0
406	11,733	15,000	5,728	-10
101	7,733	15,100	1,443	-1
743	7,051	15,200	1,851	-6
127	5,314	15,300	1,641	-11
1	4,964	15,400	1,605	-17
-793	3,956	15,600	1,584	-1
-56	4,087	15,800	681	0
242	9,604	16,000	2,598	-2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,802	166,163	0.6962	115,680	3,904
昨日 P/C	0.6927	今日增減變化		0.0035

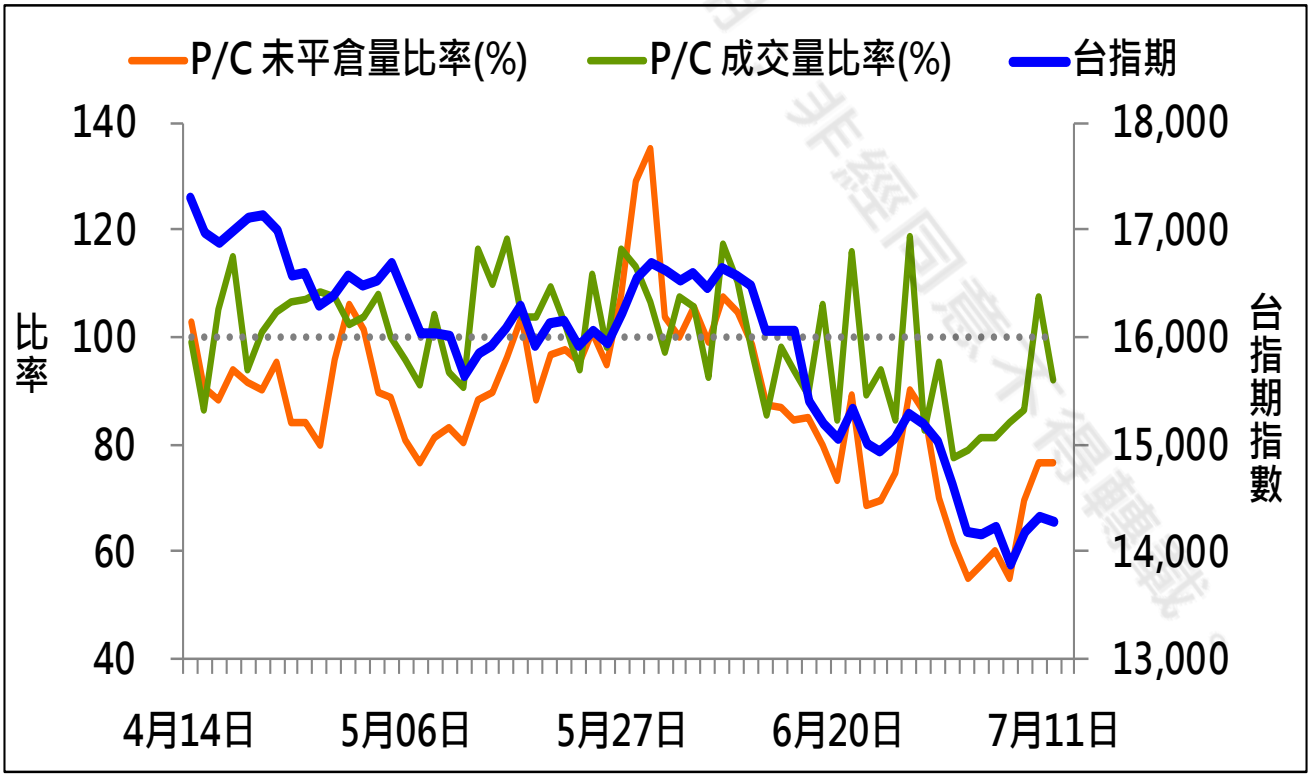
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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