台指期貨暨選擇權日報

2022/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

07月28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	10,107	1,359	986	109	-276	-90
投信	-3,648	239	295	6	64	0
自營商	-163	438	40	-44	-174	54

07月28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	-35	-3	17,389	3,310	12,979	25
投信	0	0	-150	0	447	0
自營商	32	3	-5,543	2,303	22,846	5,723

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台達電	6.75	台積電	-8.43
富邦金	4.36	欣興	-8.39
日月光投控	3.82	南電	-5.25
國泰金	2.63	長榮	-3.44
聯發科	2.60	聯電	-2.64
鴻海	2.25	統一超	-2.20
兆豐金	1.99	儒鴻	-2.05
台塑	1.86	萬海	-1.98
南亞	1.80	陽明	-1.93
第一金	1.69	友達	-1.41
前十名合計	29.76	後十名合計	-37.72

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	40.9%	43.2%
電子期前十大市場佔比	68.0%	70.7%
金融期前十大市場佔比	51.9%	54.9%
非金電期前十大市場佔比	96.6%	89.7%

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

2022/7/28

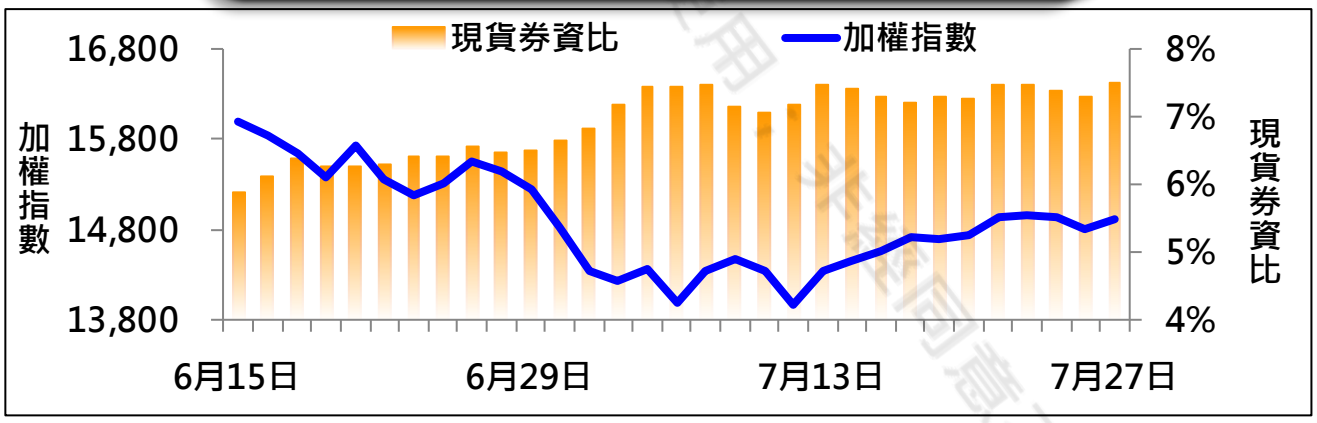
華南期貨 HUA NAN FUTURES

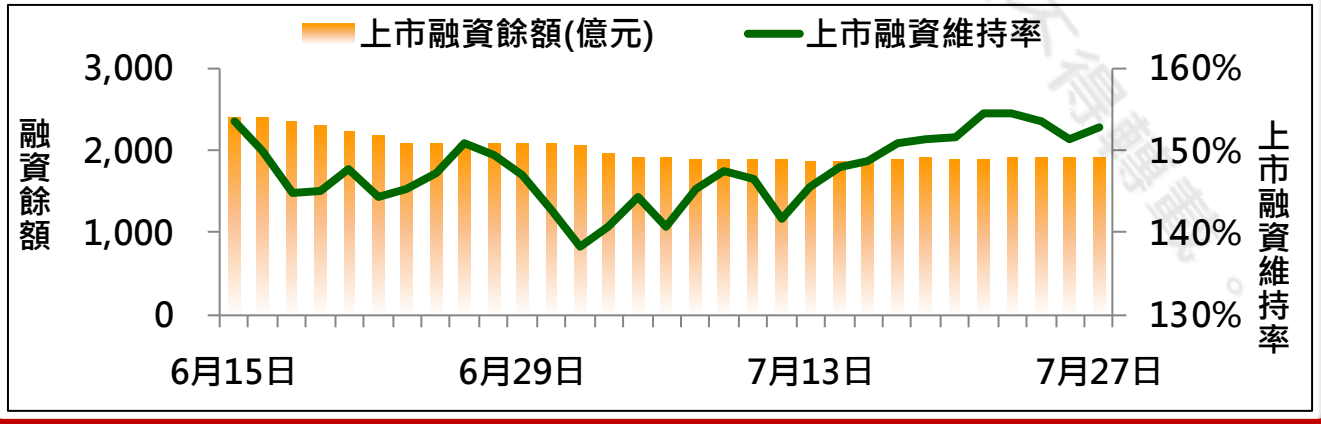
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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22日	-40.3	8,675	1,916	-23.0	887	-64
07月25日	-15.1	10,519	1,844	-4.1	-116	-1,003
07月26日	-32.4	9,354	-1,165	-26.4	-896	-780
07月27日	61.6	8,748	-606	-0.2	-601	295
07月28日	-43.3	10,107	1,359	-5.5	-163	438

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22日	18,200	12,400	5,800	-11,666	15,004	-26,670
07月25日	18,465	15,008	3,457	-5,325	11,507	-16,832
07月26日	17,550	15,584	1,966	-11,642	15,346	-26,988
07月27日	14,079	12,954	1,125	-7,846	17,123	-24,969
07月28日	17,389	12,979	4,410	-5,543	22,846	-28,389

現貨券資比 & 上市融資維持率



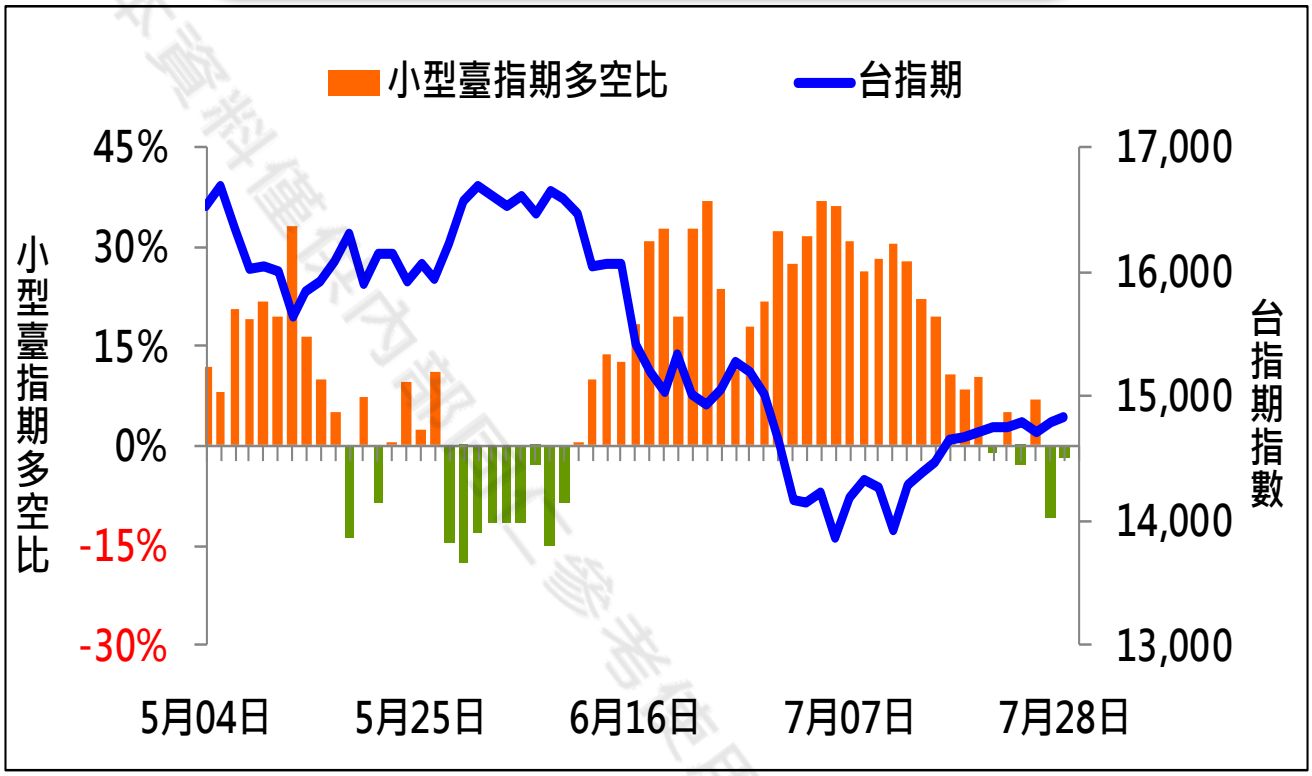


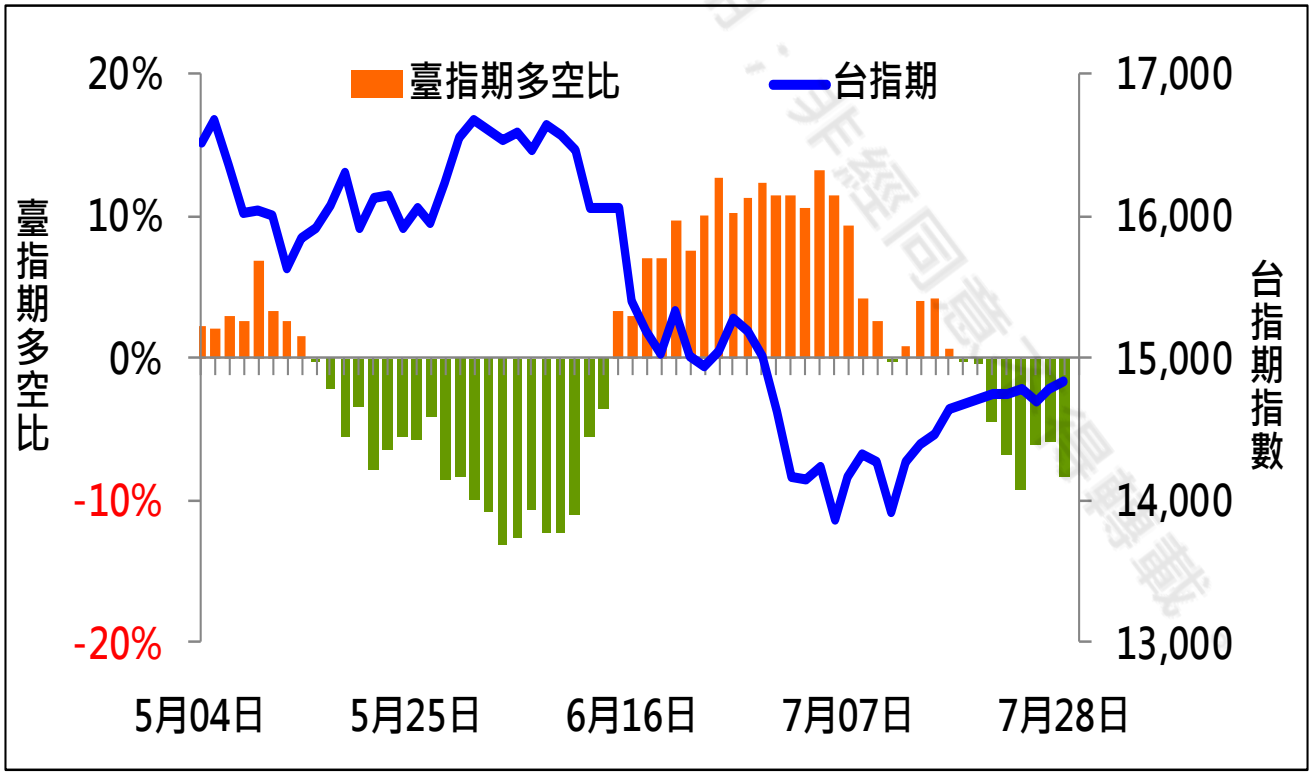
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

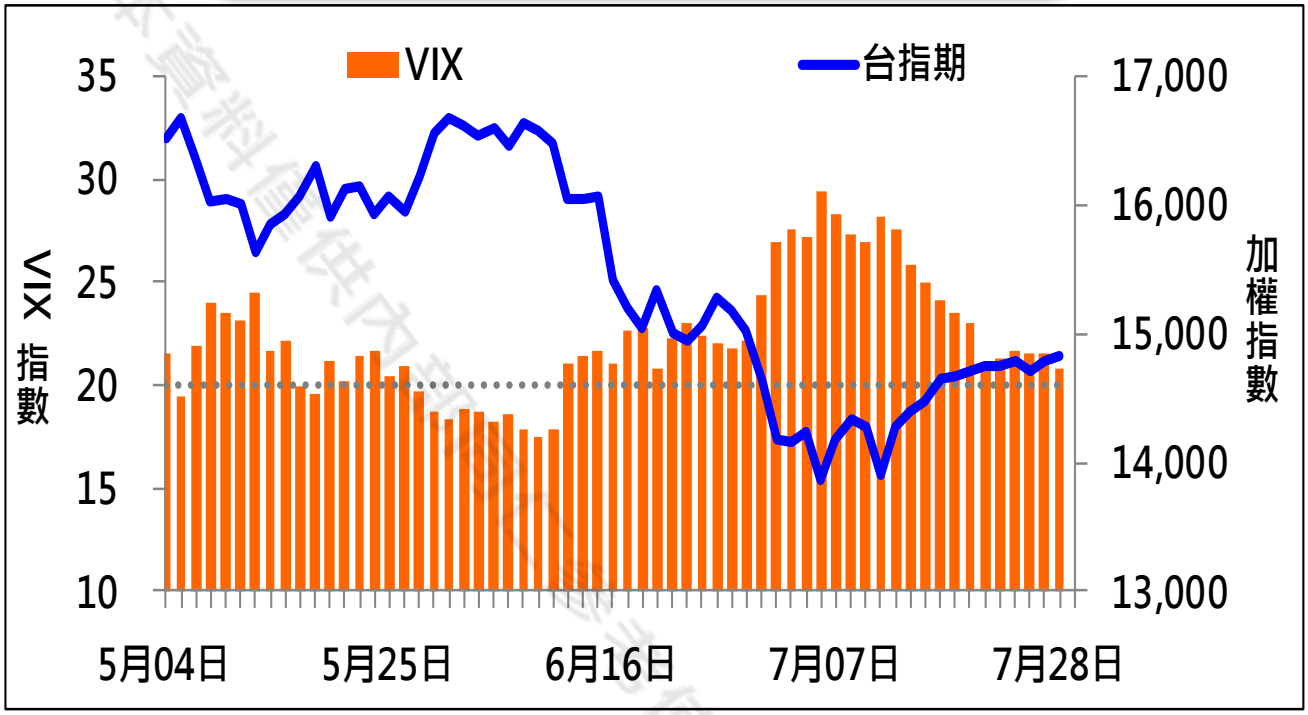




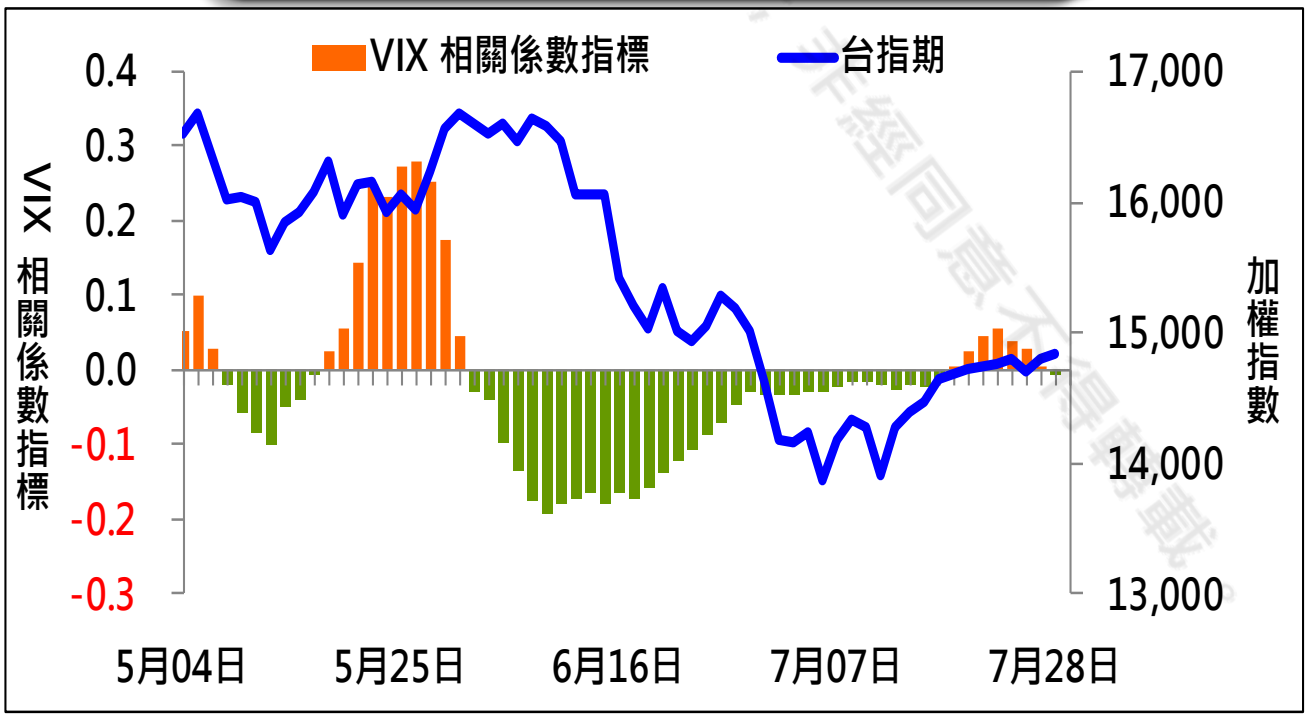
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

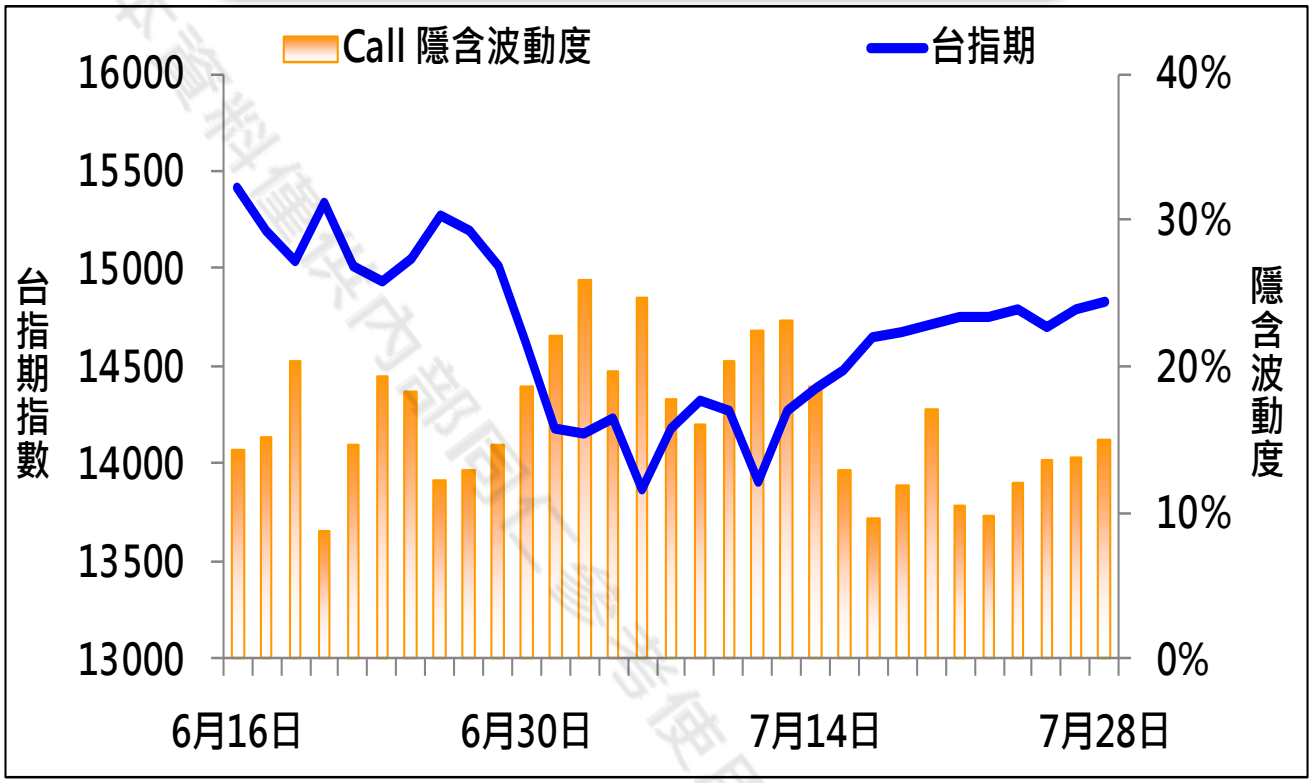


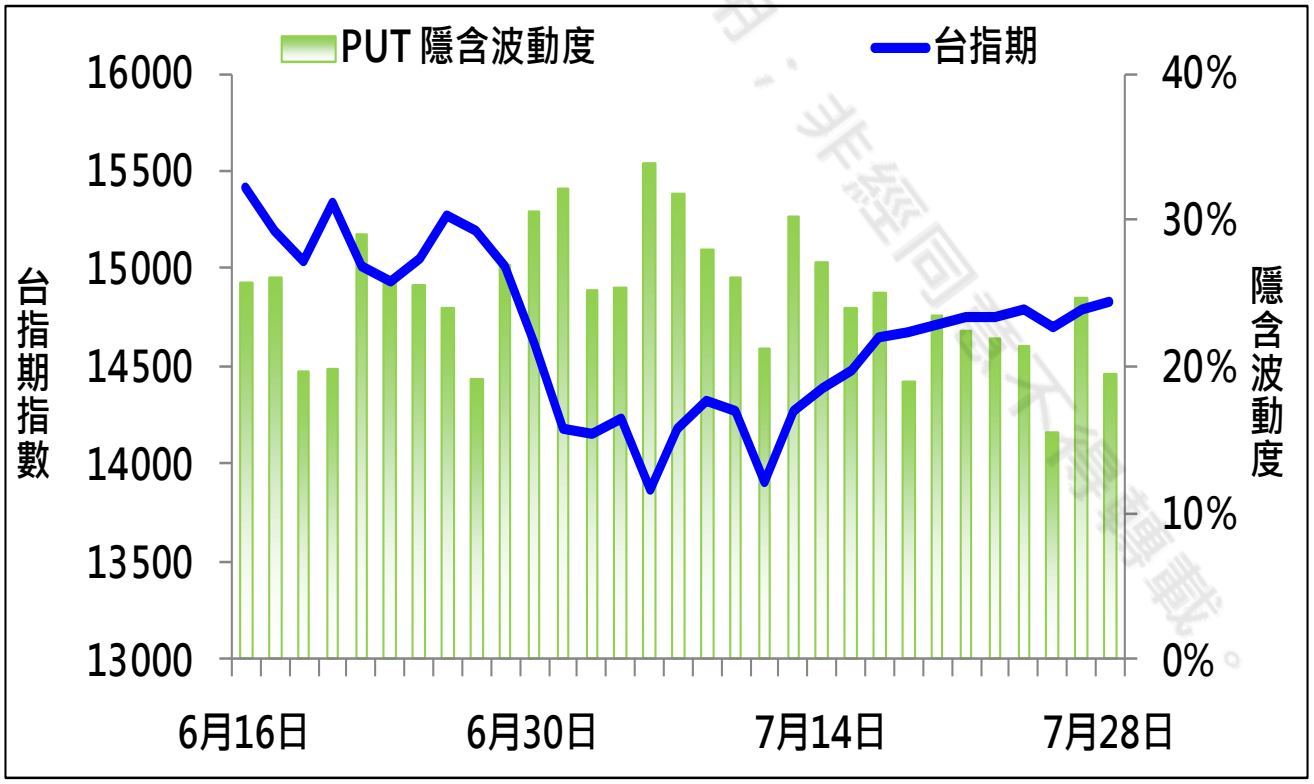
VIX 與 TWSE 相關係數指標



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

2022/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/7/28　　結算日：2022/8/3

	OI 增減	Call	202208W1 履約價	Put	OI 增減	
	0	1	14,200	4,149	2,290	
	0	57	14,300	6,233	4,397	※
	2	16	14,400	4,794	3,253	
	15	26	14,450	3,327	2,792	
	6	72	14,500	5,158	4,072	
	36	43	14,550	3,388	2,956	
	73	351	14,600	4,275	3,365	
	27	94	14,650	2,388	1,878	
	36	195	14,700	3,231	2,258	
	-6	427	14,750	1,425	1,003	
	445	1,274	14,800	2,203	1,586	
	616	1,818	14,850	1,273	963	
	495	2,788	14,900	1,630	1,382	
	932	1,934	14,950	834	782	
	2,893	4,869	15,000	766	683	
	2,140	3,232	15,050	255	250	
	2,417	4,907	15,100	200	167	
	2,372	3,975	15,150	35	22	
	4,165	6,667	15,200	66	58	
	4,187	5,569	15,250	30	29	
※	5,878	7,619	15,300	17	16	
	3,280	3,280	15,350	12	12	
	2,813	4,284	15,400	12	8	
	5,282	6,960	15,500	1	1	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
40,832	64,983	0.9289	60,361	40,208
昨日 P/C	0.8345	今日增減變化		0.0944

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

2022/7/28

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/7/28　　結算日：2022/8/17

OI 增減	Call	202208 月 履約價	Put	OI 增減
0	50	13,600	2,844	289
0	92	13,700	3,339	-46
-1	93	13,800	3,845	161
-1	28	13,900	2,900	210
1	138	14,000	5,872	601
2	170	14,100	2,259	148
-3	520	14,200	5,252	-46
11	858	14,300	2,672	-328
14	1,736	14,400	3,458	301
4	1,313	14,500	4,282	215
28	2,115	14,600	3,513	379
6	3,156	14,700	3,103	493
22	4,384	14,800	2,522	338
-63	5,096	14,900	1,083	209
63	6,242	15,000	1,217	242
198	7,666	15,100	376	84
※ 1,176	8,984	15,200	202	59
88	5,458	15,300	90	22
537	5,457	15,400	81	13
393	7,943	15,500	47	1
179	7,022	15,600	72	-3
208	3,513	15,700	47	-1
239	2,043	15,800	111	36
683	2,470	15,900	28	-1

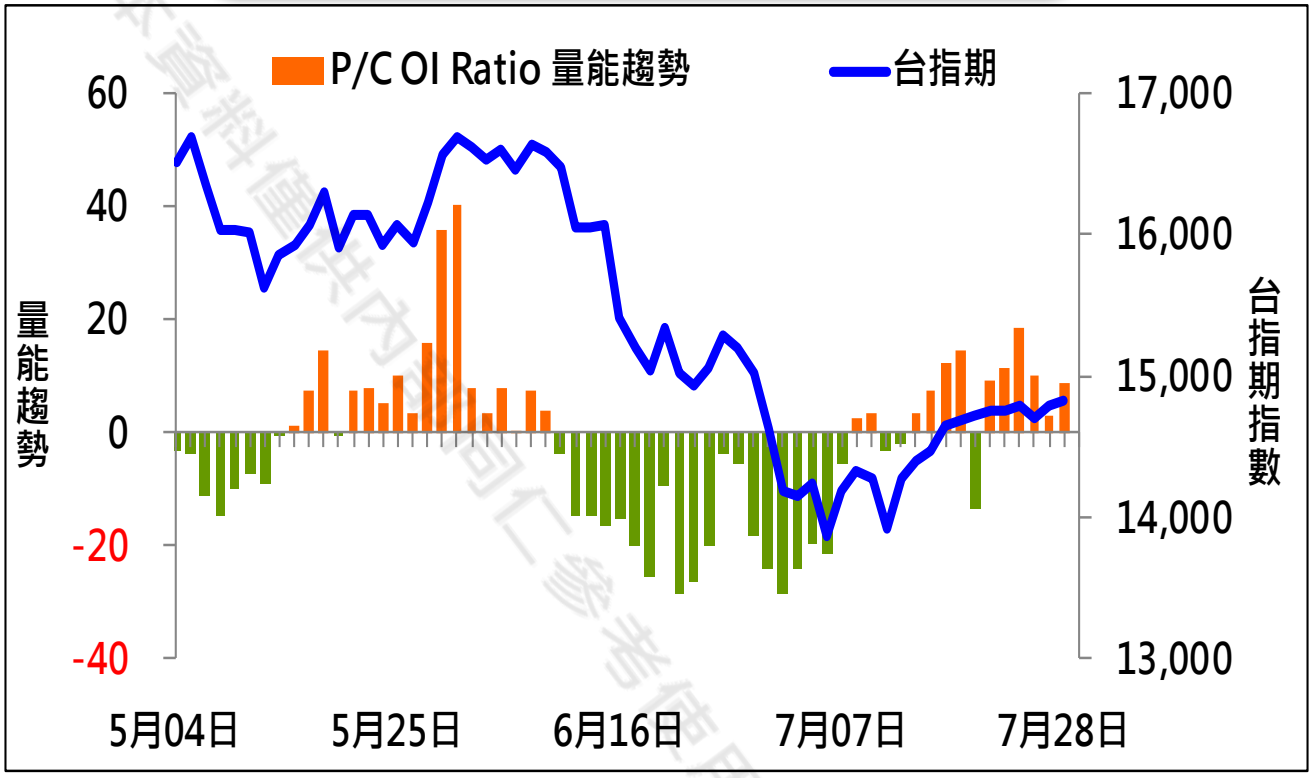
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,631	107,337	0.8285	88,930	6,893
昨日 P/C	0.7988	今日增減變化		0.0298

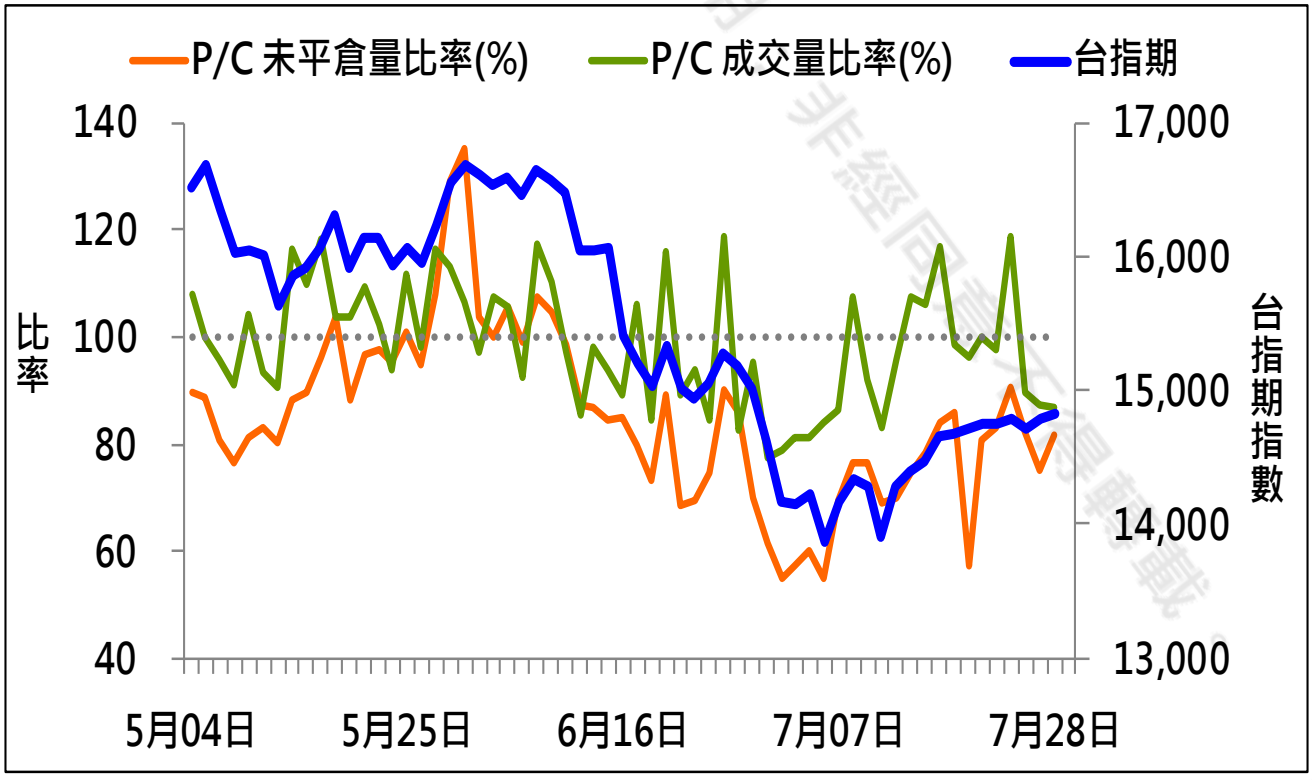
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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