台指期貨暨選擇權日報

2022/10/13

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

10月13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	9,286	6,999	1,024	-78	-140	-94
投信	-9,622	-355	166	0	73	0
自營商	3,702	-1,271	191	-112	69	-59

10月13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	-69	-13	32,823	6,614	23,686	-1,193
投信	0	0	0	0	489	0
自營商	63	10	-23,553	-885	-11,496	-8,393

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
鴻海	2.20	台積電	-20.59
統一超	1.32	國泰金	-9.81
友達	1.07	台塑化	-7.87
微星	0.67	中租-KY	-6.88
遠傳	0.52	富邦金	-6.17
致茂	0.47	長榮航	-4.67
美利達	0.38	長榮	-4.20
群創	0.34	玉山金	-3.85
仁寶	0.28	台塑	-3.84
信邦	0.26	中信金	-3.81
前十名合計	7.51	後十名合計	-71.69

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	41.4%	48.2%
電子期前十大市場佔比	61.2%	67.6%
金融期前十大市場佔比	71.1%	51.1%
非金電期前十大市場佔比	100.0%	97.3%

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

2022/10/13

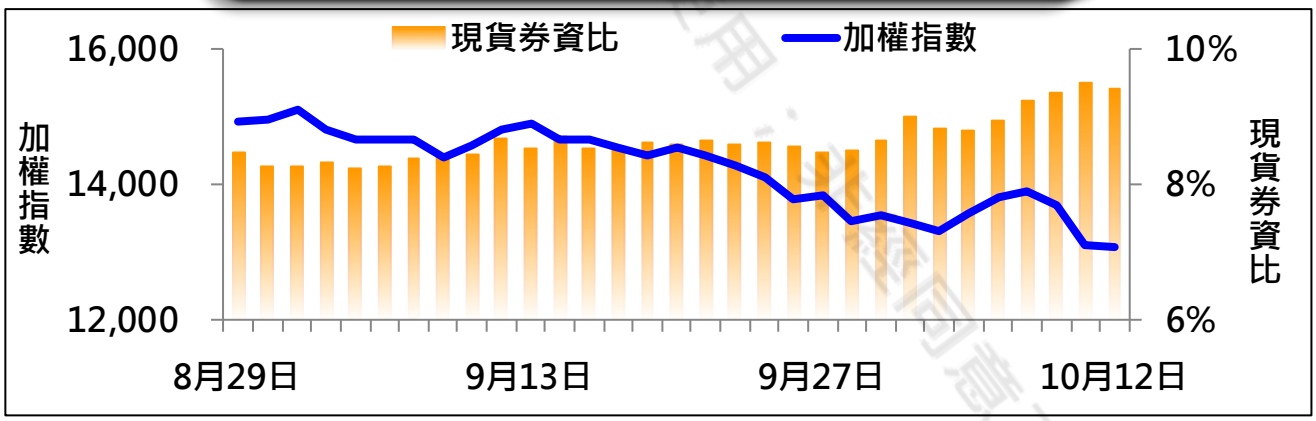
華南期貨 HUA NAN FUTURES

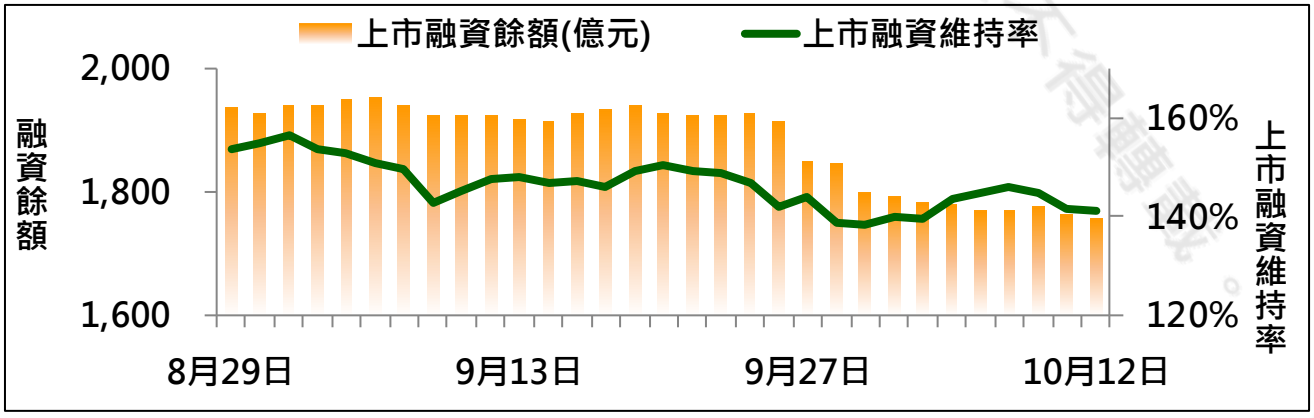
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
10月06日	127.0	2,721	-5,428	-12.6	7,131	930
10月07日	-92.8	1,784	-937	-36.4	5,469	-1,662
10月11日	-343.0	3,987	2,203	-62.1	5,580	111
10月12日	-166.4	2,287	-1,700	-7.1	4,973	-607
10月13日	-97.7	9,286	6,999	-31.7	3,702	-1,271

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
10月06日	18,300	30,080	-11,780	-19,901	-4,042	-15,859
10月07日	23,788	31,490	-7,702	-19,446	-5,028	-14,418
10月11日	27,835	28,946	-1,111	-38,628	-4,154	-34,474
10月12日	26,209	24,879	1,330	-22,668	-3,103	-19,565
10月13日	32,823	23,686	9,137	-23,553	-11,496	-12,057

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

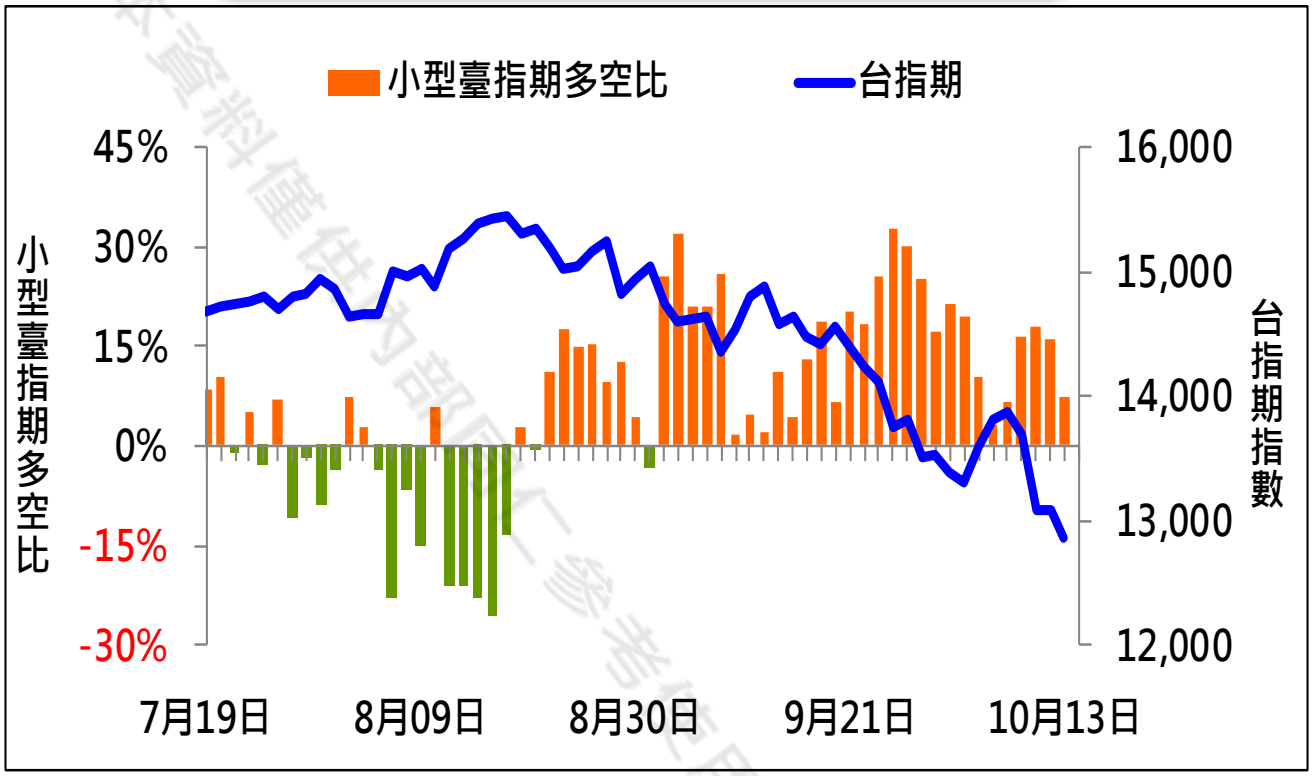
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

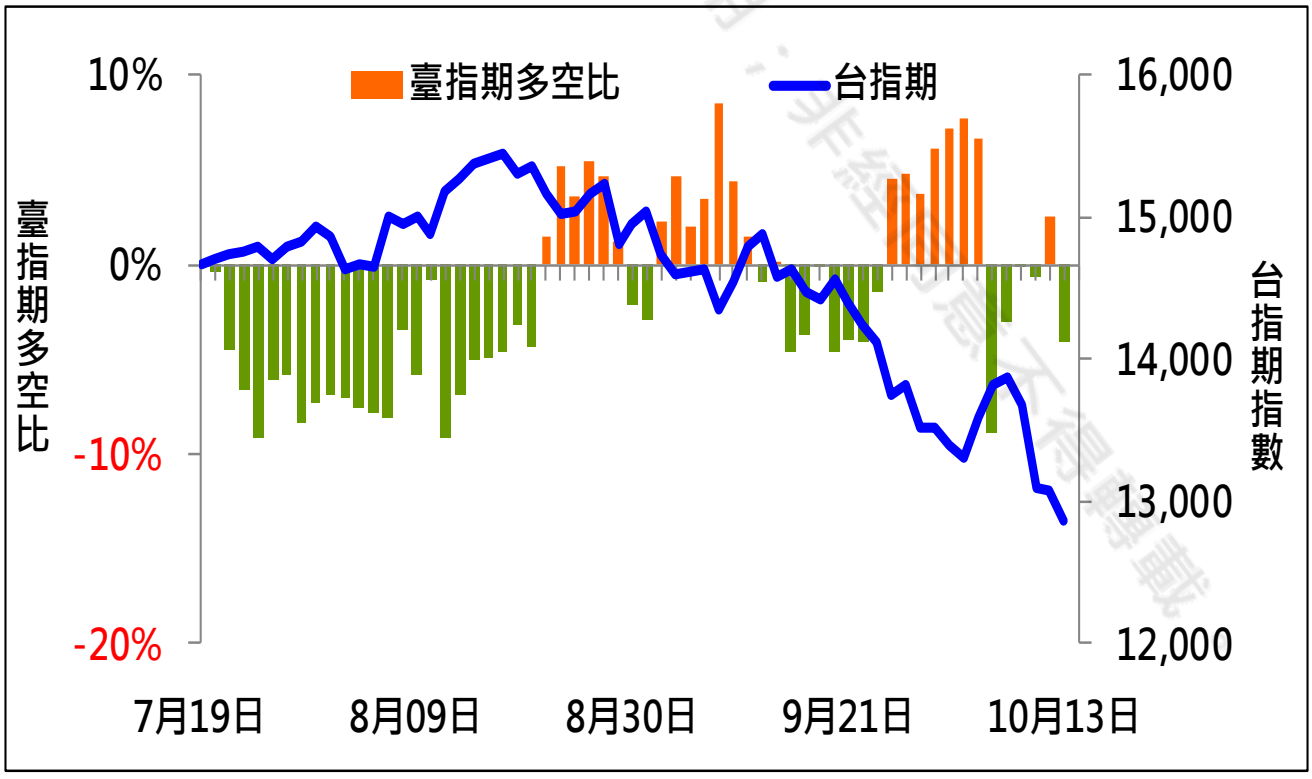
台指期貨暨選擇權日報

2022/10/13

華南期貨 HUA NAN FUTURES

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

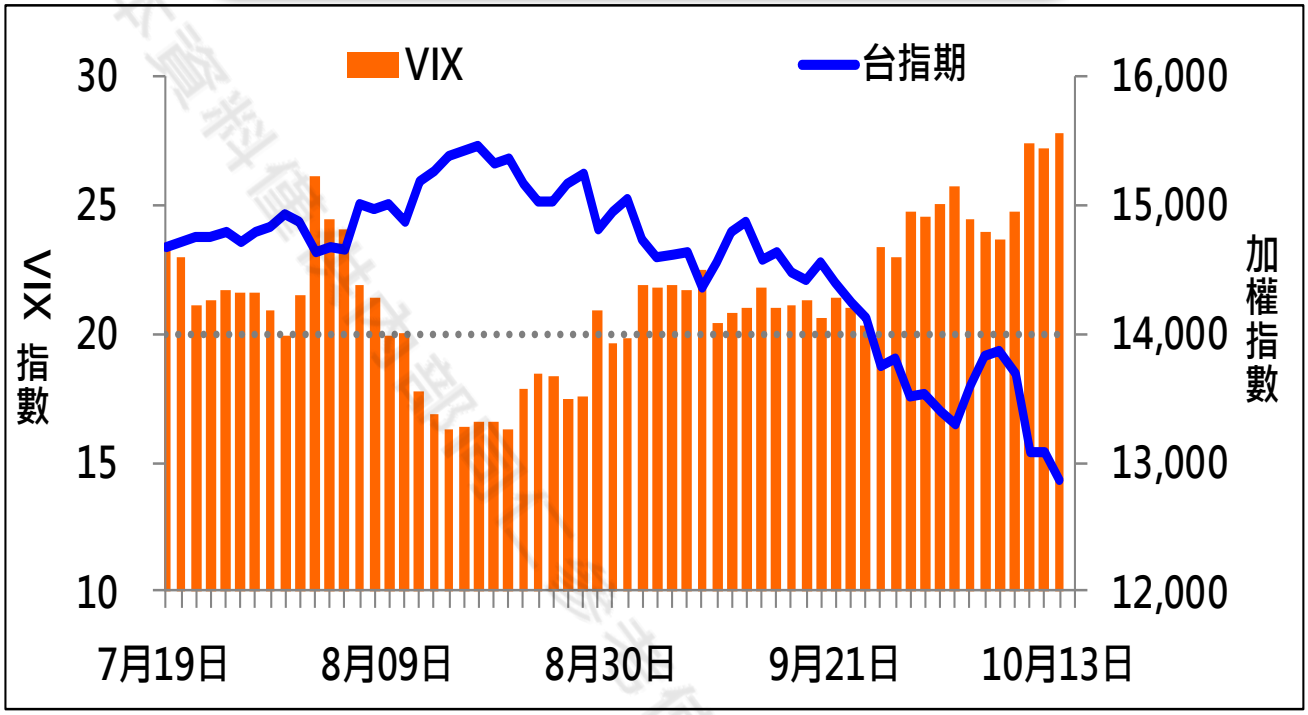
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

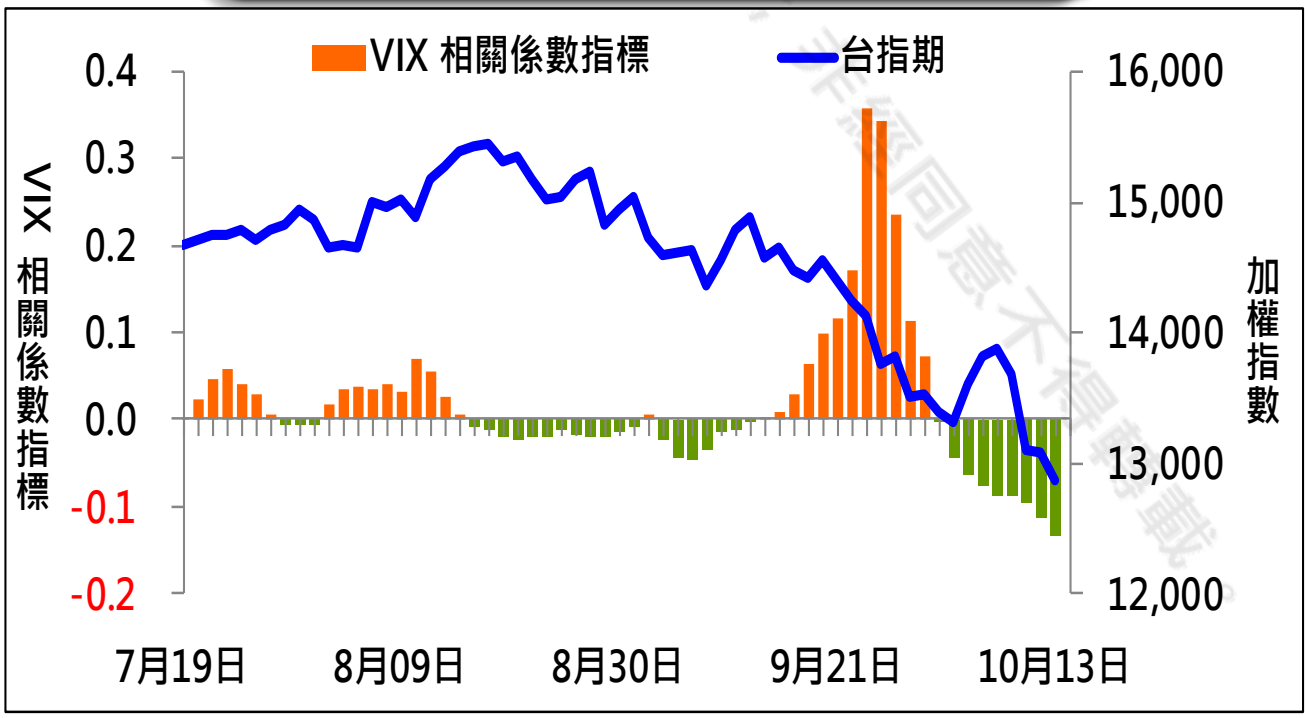
2022/10/13

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

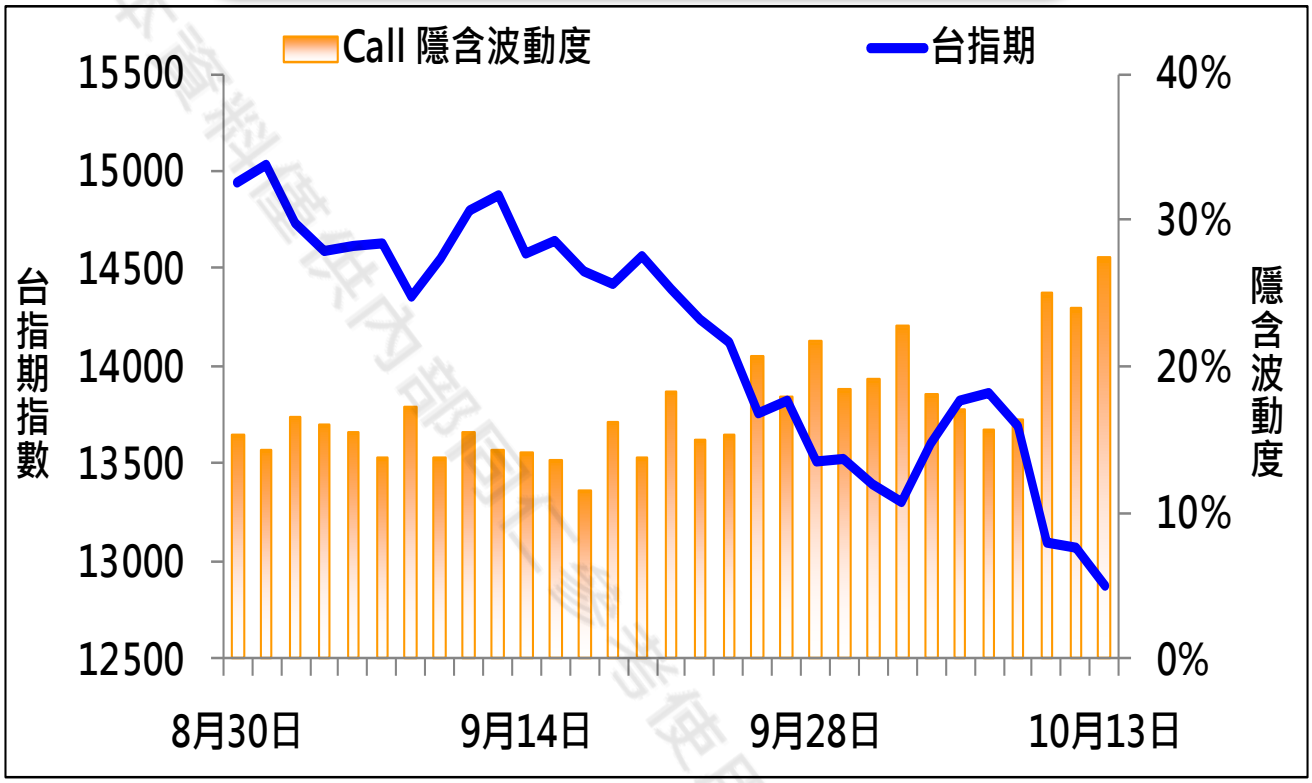


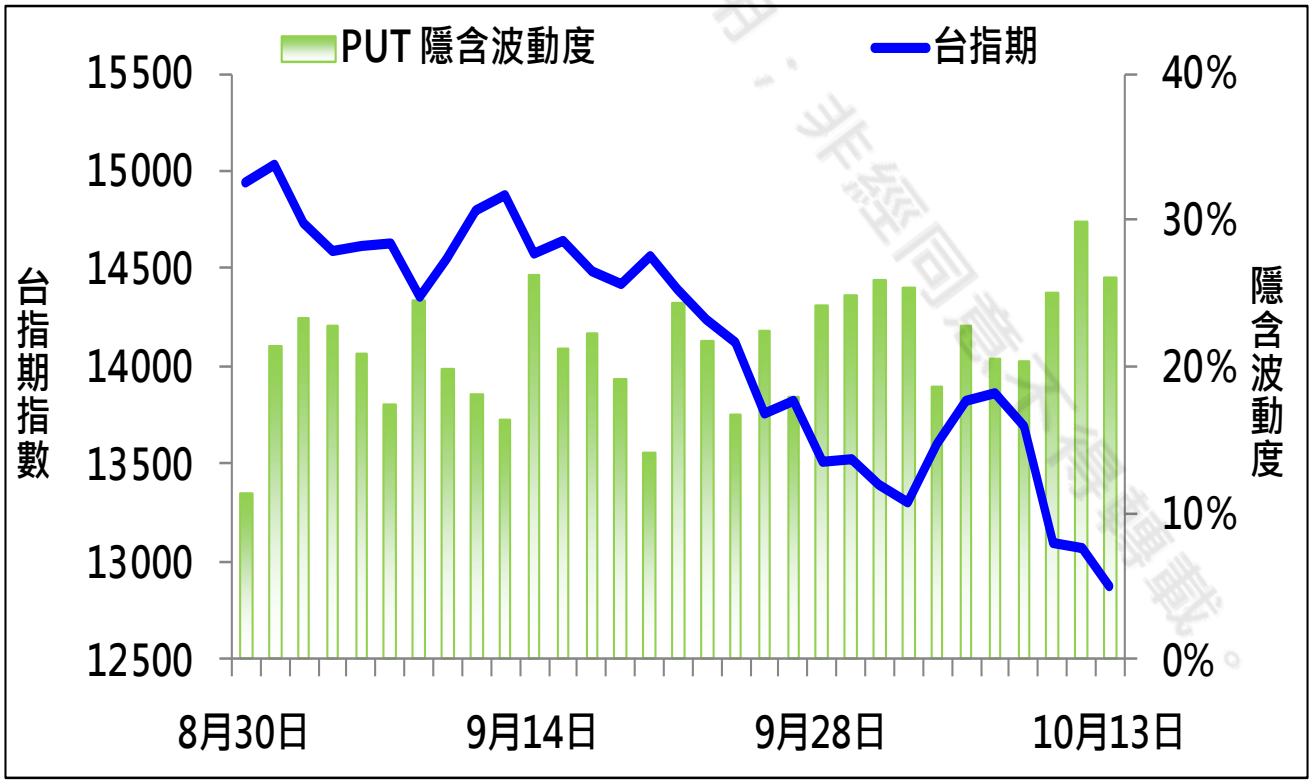
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2022/10/13

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/10/13　　結算日：2022/10/19

OI 增減	Call	202210 月 履約價	Put	OI 增減	
1	3	12,000	8,844	2,065	
1	2	12,100	4,048	1,882	
25	30	12,200	6,460	2,259	
8	24	12,300	6,278	2,180	
81	913	12,400	5,829	1,422	
72	123	12,500	7,855	3,227	※
177	238	12,600	6,569	2,026	
418	520	12,700	5,456	1,069	
250	250	12,750	1,335	952	
773	1,312	12,800	6,535	621	
678	702	12,850	1,450	727	
1,168	1,554	12,900	4,606	1,193	
854	955	12,950	1,577	759	
1,524	3,535	13,000	7,107	30	
2,489	2,725	13,050	1,153	736	
3,339	4,661	13,100	3,514	-252	
2,750	3,086	13,150	370	256	
4,239	6,345	13,200	3,688	63	
3,018	3,805	13,250	270	205	
3,331	7,137	13,300	4,556	-703	
2,344	3,989	13,350	88	24	
3,029	10,837	13,400	3,833	-547	
4,327	11,846	13,500	4,096	-717	
※ 4,847	12,606	13,600	3,860	-172	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
45,504	203,275	0.6870	139,660	25,625
昨日 P/C	0.7228	今日增減變化		-0.0357

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

2022/10/13

華南期貨 HUA NAN FUTURES

次月選擇權OI變化

日期：2022/10/13　　結算日：2022/11/16

OI 增減	Call	202211 月 履約價	Put	OI 增減
3	6	12,500	2,169	552
10	18	12,600	340	101
40	57	12,700	469	193
101	118	12,800	1,395	175
375	420	12,900	611	56
129	253	13,000	1,186	28
53	159	13,100	1,686	65
156	408	13,200	1,278	-76
147	352	13,400	256	8
703	1,062	13,600	117	-32
422	2,580	13,800	514	29
858	2,453	14,000	63	-9
-21	1,288	14,200	64	0
63	1,121	14,400	47	0
268	949	14,600	428	-2
154	1,436	14,800	8,942	0
11	1,077	15,000	406	0
19	276	15,400	3	0
0	97	15,800	1	0
0	84	16,200	0	0
0	138	16,600	1	0
0	140	17,000	1	0
0	20	17,400	1	0
30	5,863	17,800	1	0

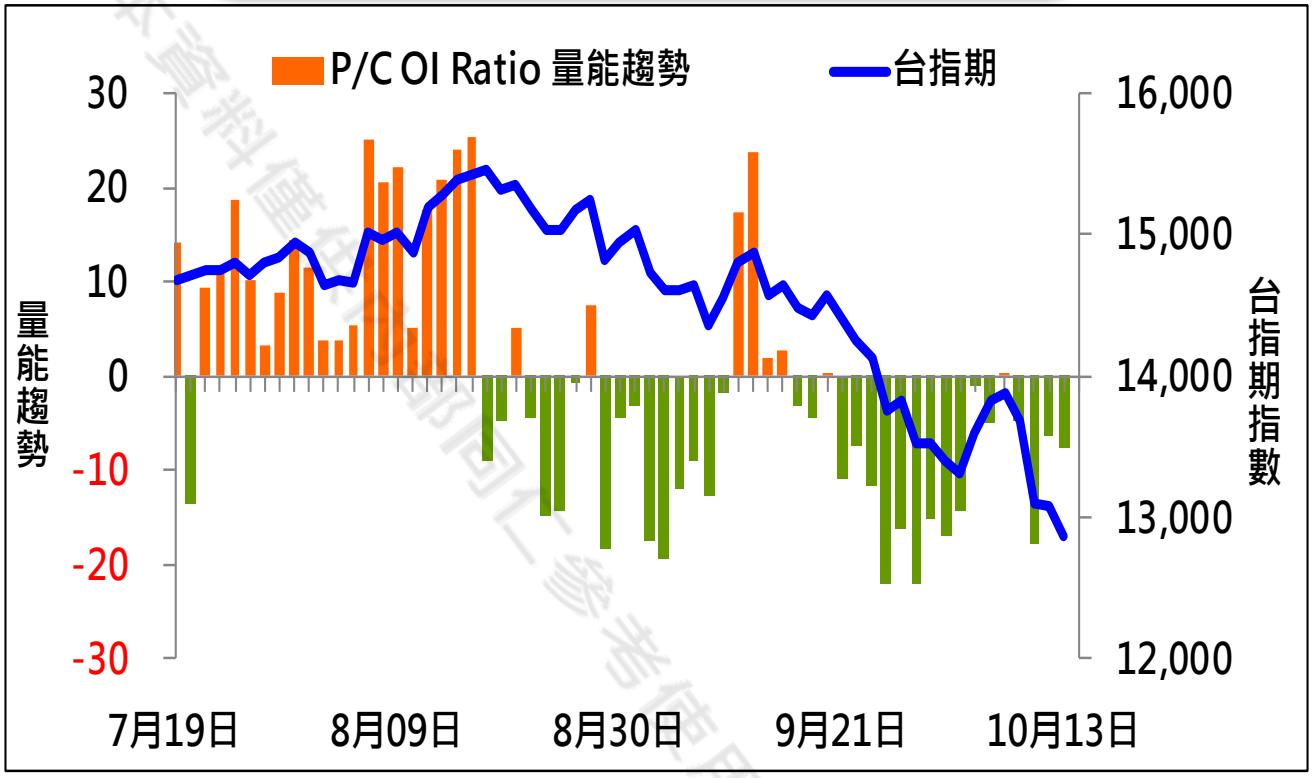
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,303	36,328	0.9067	32,938	3,948
昨日 P/C	0.9344	今日增減變化		-0.0277

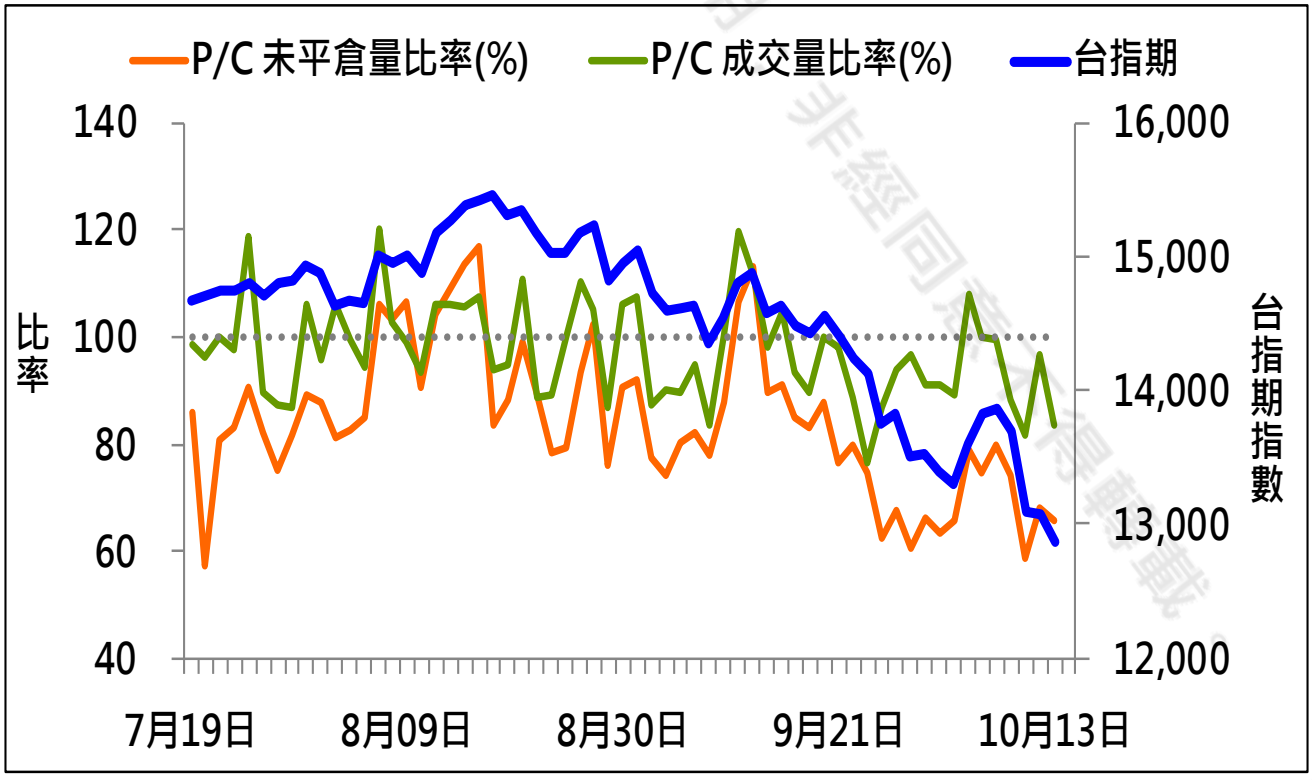
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

台指期貨暨選擇權日報

2022/10/13

華南期貨 HUA NAN FUTURES

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