台指期貨暨選擇權日報

2022/11/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

11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	4,475	-1,113	824	76	-11	15
投信	-7,334	841	203	16	73	0
自營商	2,372	1,123	200	-35	177	18

11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	37	11	29,931	6,015	15,874	1,017
投信	0	0	-200	0	164	0
自營商	-27	-20	-25,833	-784	6,071	-8,444

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台積電	65.95	鴻海	-2.20
聯發科	11.69	台灣大	-1.90
長榮	7.57	遠傳	-1.35
日月光投控	5.54	國巨	-1.30
富邦金	5.54	中華電	-1.23
南亞	5.29	長榮航	-0.85
聯電	4.56	緯穎	-0.83
華新	4.33	華航	-0.76
研華	3.70	合庫金	-0.67
中信金	3.50	南電	-0.51
前十名合計	117.68	後十名合計	-11.61

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	40.0%	48.0%
電子期前十大市場佔比	64.2%	74.5%
金融期前十大市場佔比	59.7%	53.1%
非金電期前十大市場佔比	93.6%	97.5%

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

2022/11/7

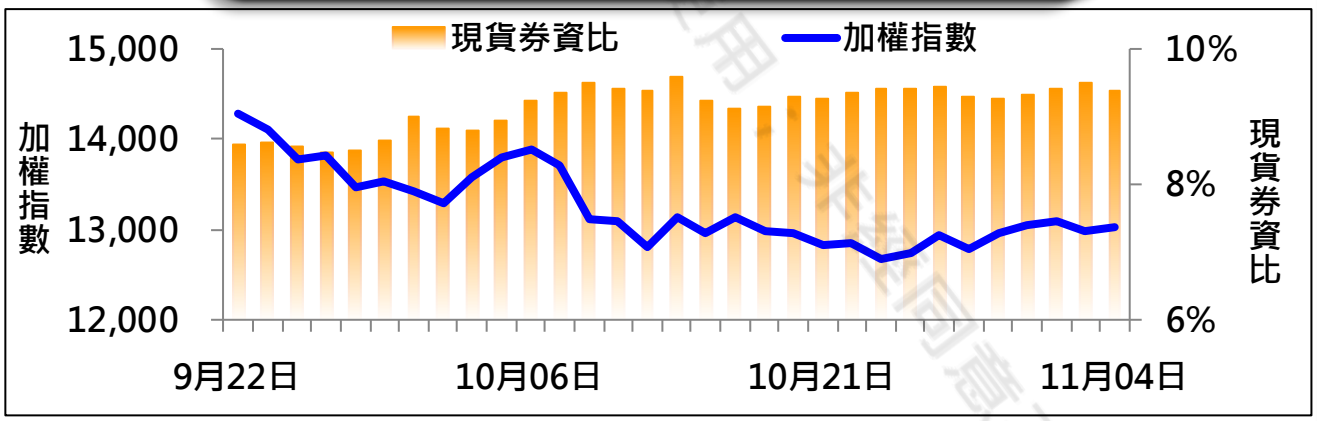
華南期貨 HUA NAN FUTURES

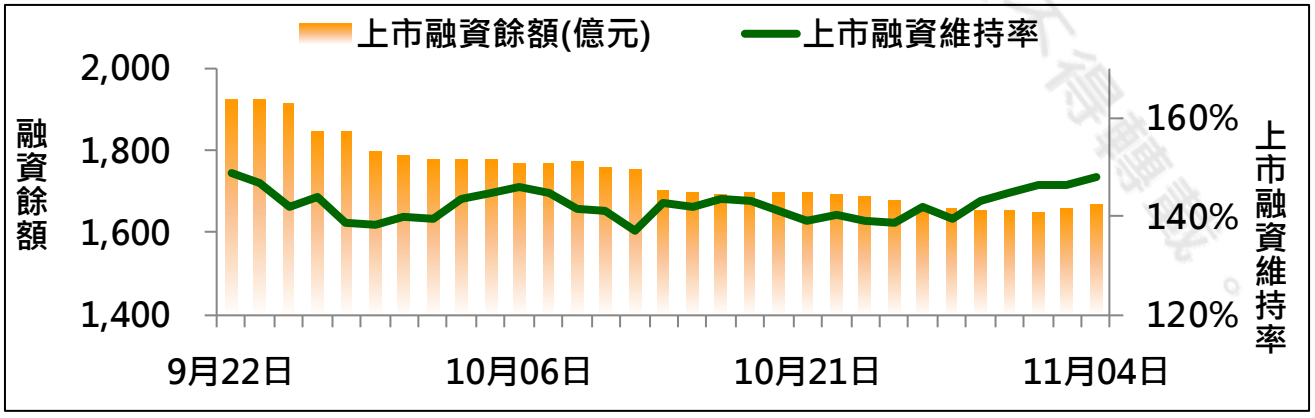
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
11月01日	-10.7	6,177	-2,692	23.6	1,407	-98
11月02日	-5.1	7,334	1,157	5.2	952	-455
11月03日	-126.3	6,034	-1,300	-14.9	1,508	556
11月04日	-87.8	5,588	-446	6.6	1,249	-259
11月07日	92.1	4,475	-1,113	5.2	2,372	1,123

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
11月01日	21,246	17,390	3,856	-16,520	838	-17,358
11月02日	23,409	14,599	8,810	-19,411	3,746	-23,157
11月03日	23,956	14,618	9,338	-25,105	15,290	-40,395
11月04日	23,916	14,857	9,059	-25,049	14,515	-39,564
11月07日	29,931	15,874	14,057	-25,833	6,071	-31,904

現貨券資比 & 上市融資維持率



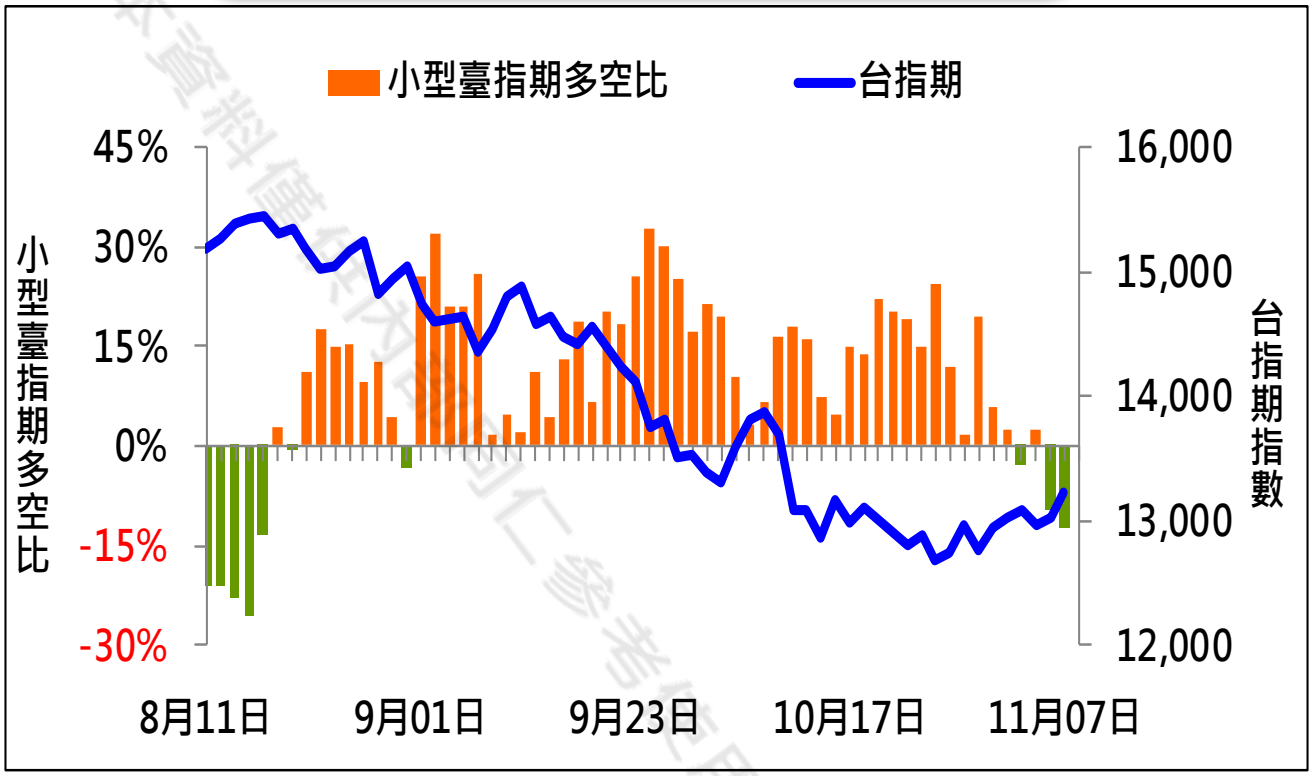


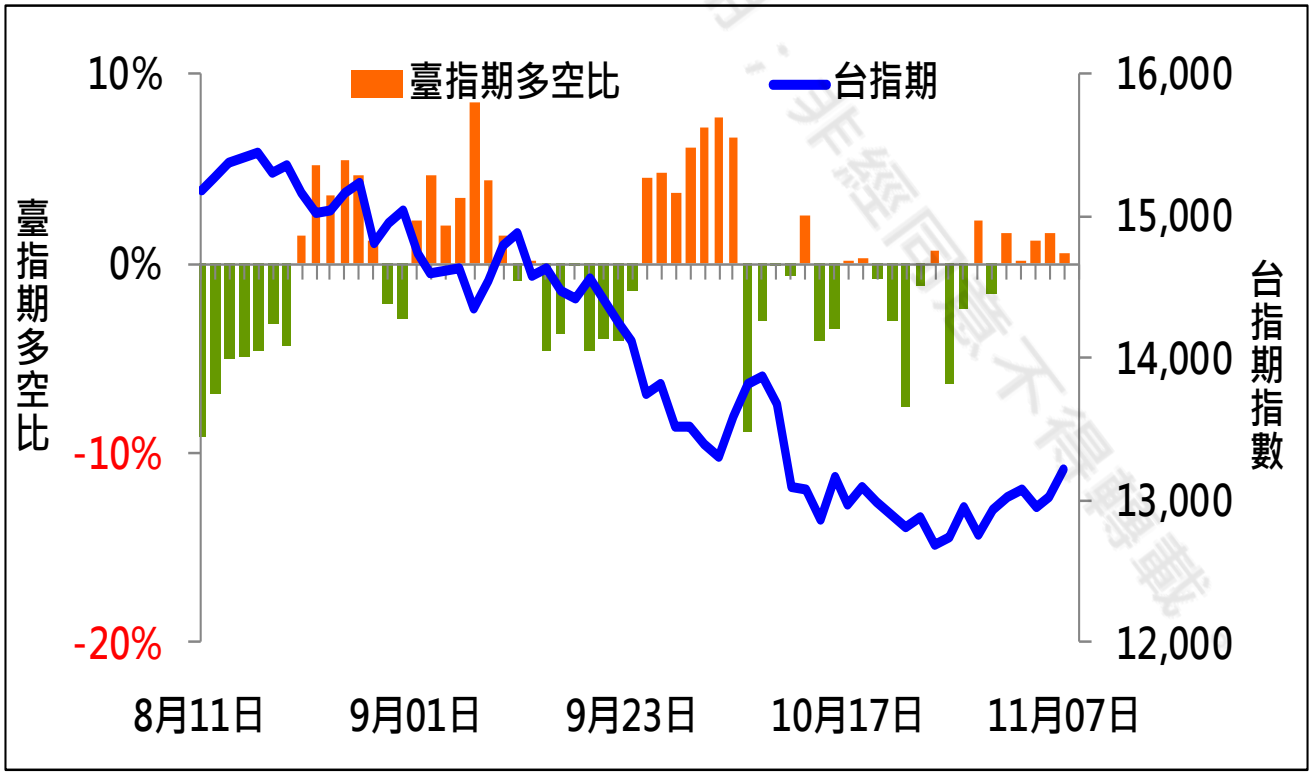
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

散戶多空比





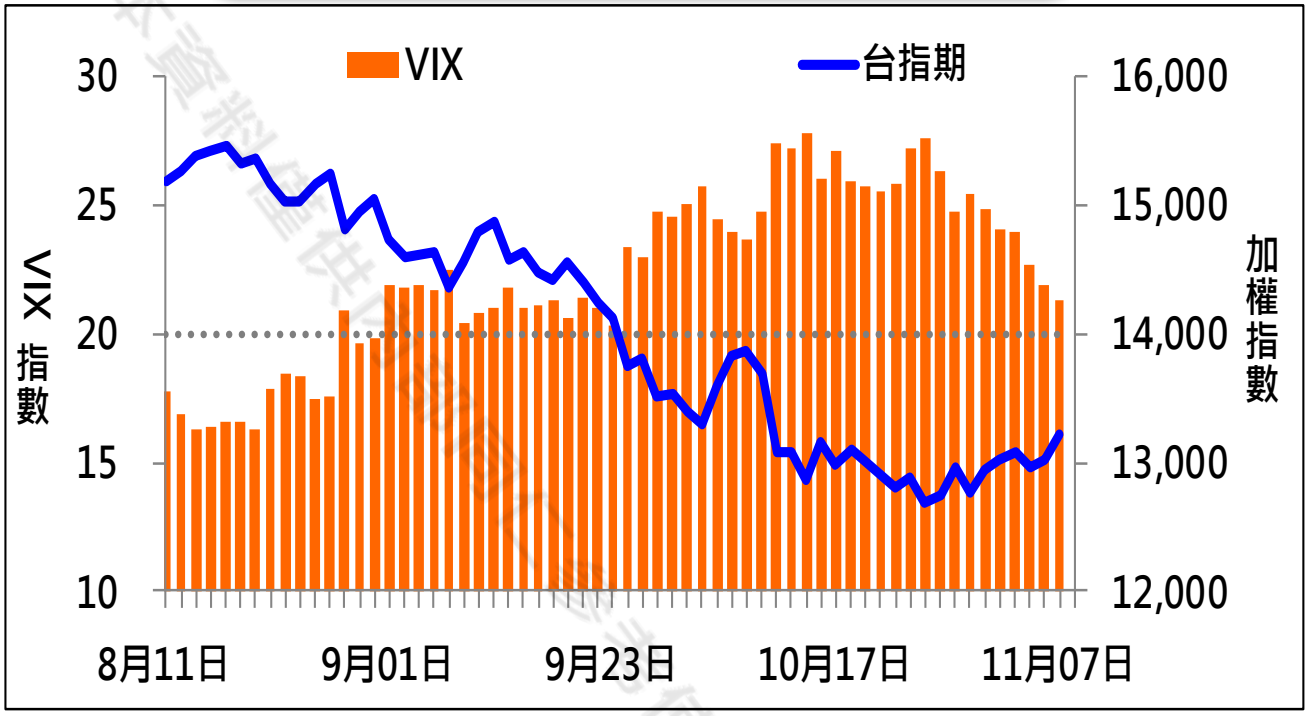
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

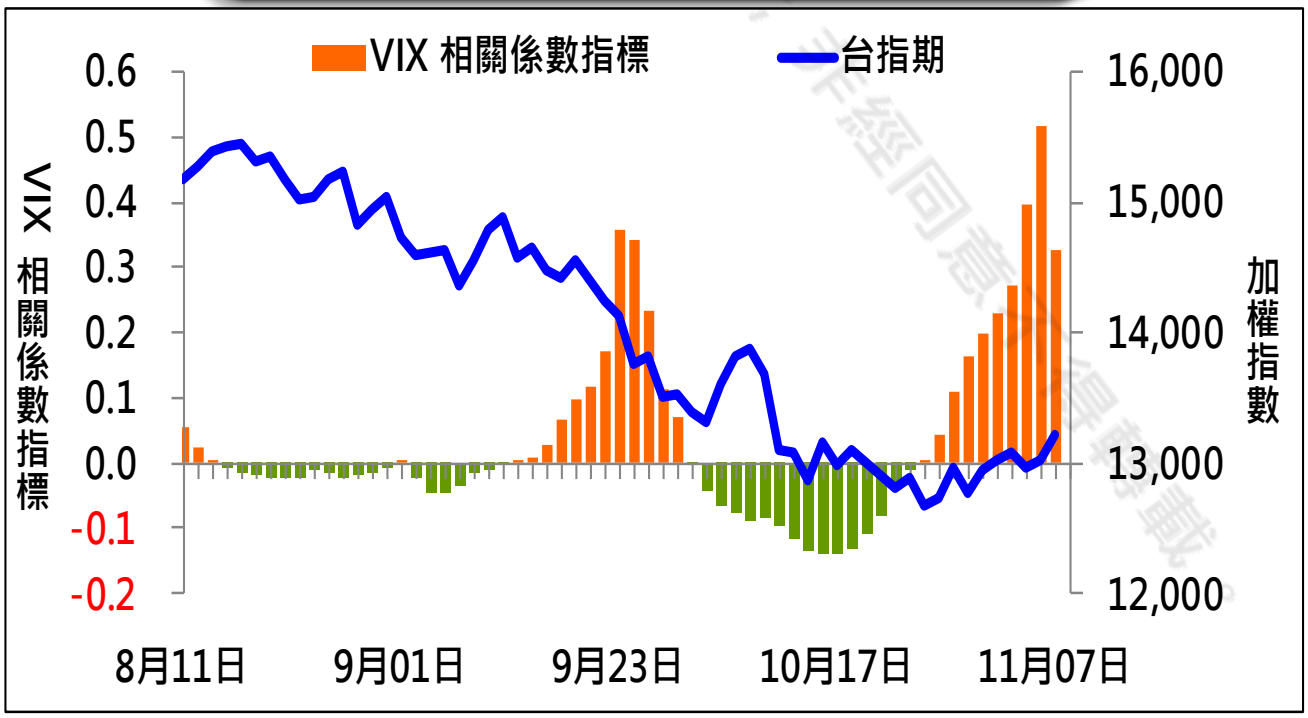
2022/11/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



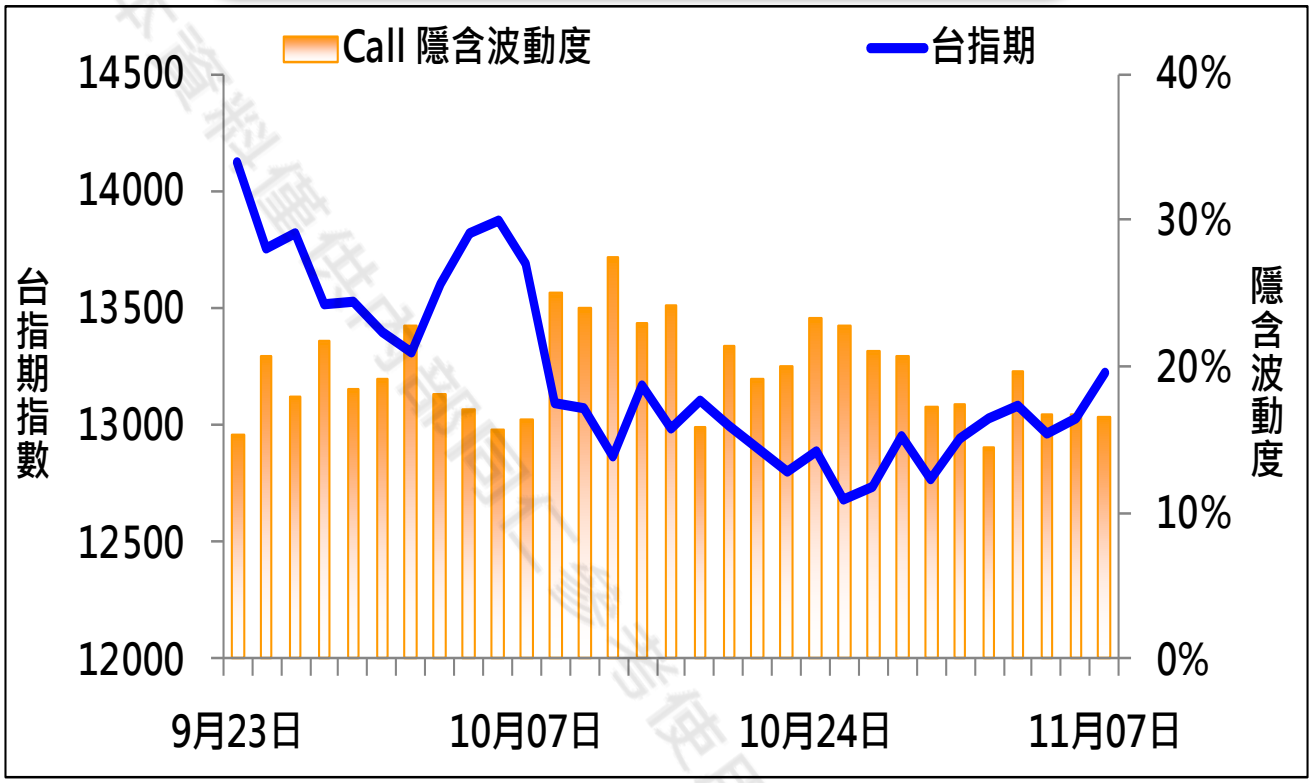
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

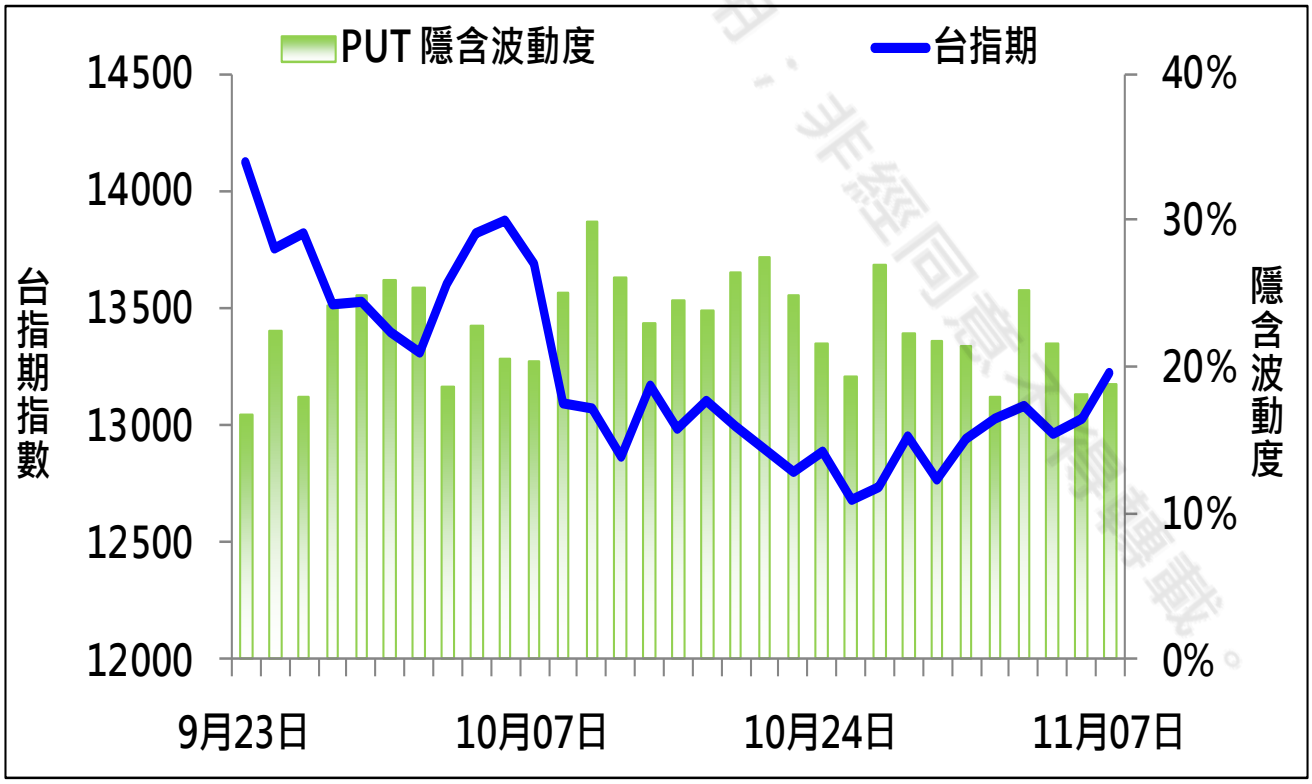
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

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

2022/11/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/11/7　　結算日：2022/11/9

	OI 增減	Call	202211W2 履約價	Put	OI 增減	
	-5	8	12,400	4,444	-460	
	-2	38	12,500	6,937	-1,057	
	-10	102	12,600	4,824	-2,212	
	1	45	12,650	3,320	-1,971	
	-63	405	12,700	6,416	730	
	-84	351	12,750	3,154	-923	
	-77	898	12,800	8,594	2,392	
	-327	698	12,850	6,305	2,387	
	-666	1,056	12,900	8,449	3,124	
	-720	1,249	12,950	6,708	4,237	
	-1,834	1,687	13,000	9,874	6,061	
	-1,572	1,737	13,050	7,042	4,801	
	-1,306	3,854	13,100	8,407	7,153	※
	-897	3,613	13,150	4,733	4,229	
	-1,137	7,284	13,200	5,277	4,893	
	-548	5,893	13,250	3,715	3,537	
	2,405	11,816	13,300	2,089	2,004	
※	4,888	10,675	13,350	422	404	
	3,402	10,757	13,400	444	277	
	2,696	4,695	13,450	204	204	
	1,383	7,069	13,500	55	35	
	1,219	7,704	13,600	36	29	
	-53	4,121	13,700	4	-1	
	0	2,949	13,800	6	6	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,466	91,652	1.2494	114,509	38,718
昨日 P/C	0.8897	今日增減變化		0.3597

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

2022/11/7

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/11/7　　結算日：2022/11/16

OI 增減	Call	202211 月履約價	Put	OI 增減	
-23	138	12,600	6,286	1,616	
-77	1,394	12,700	5,253	-191	
-76	2,336	12,800	7,230	23	
-268	1,915	12,900	4,256	945	
-1,167	4,632	13,000	6,295	3,179	※
-707	5,710	13,100	3,224	1,029	
10	6,123	13,200	2,471	867	
151	6,876	13,300	733	285	
-1,330	7,595	13,400	725	298	
-482	10,297	13,500	555	107	
-41	7,658	13,600	225	24	
-69	8,211	13,700	138	7	
167	9,295	13,800	535	-2	
-630	4,758	13,900	113	2	
-82	13,353	14,000	86	1	
96	2,065	14,100	48	1	
※ 290	3,315	14,200	45	-13	
-59	2,537	14,300	43	-2	
4	4,395	14,400	56	0	
-10	2,683	14,500	425	0	
11	1,667	14,600	442	0	
-6	1,007	14,700	402	0	
1	2,633	14,800	8,942	0	
-2	1,153	14,900	402	0	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
-4,296	130,350	0.8961	116,804	4,219	
昨日 P/C	0.8362	今日增減變化		0.0599	

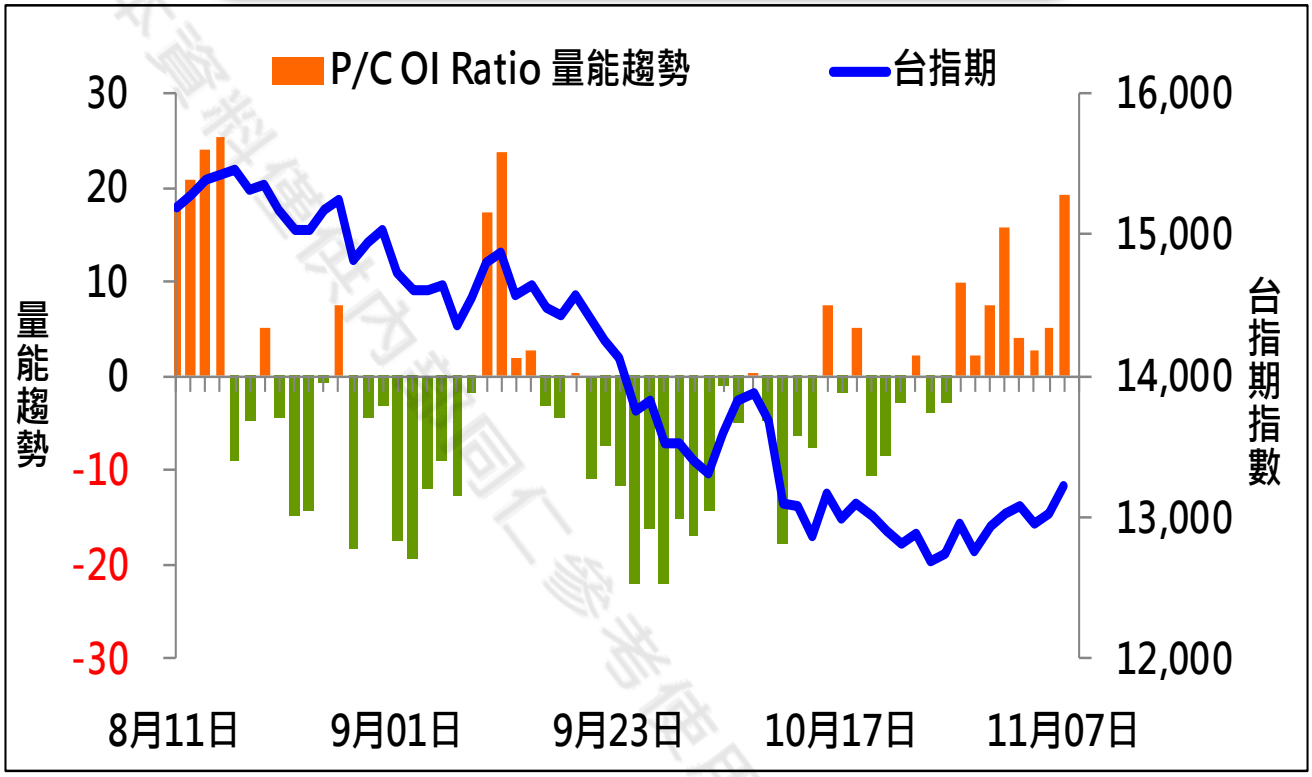
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

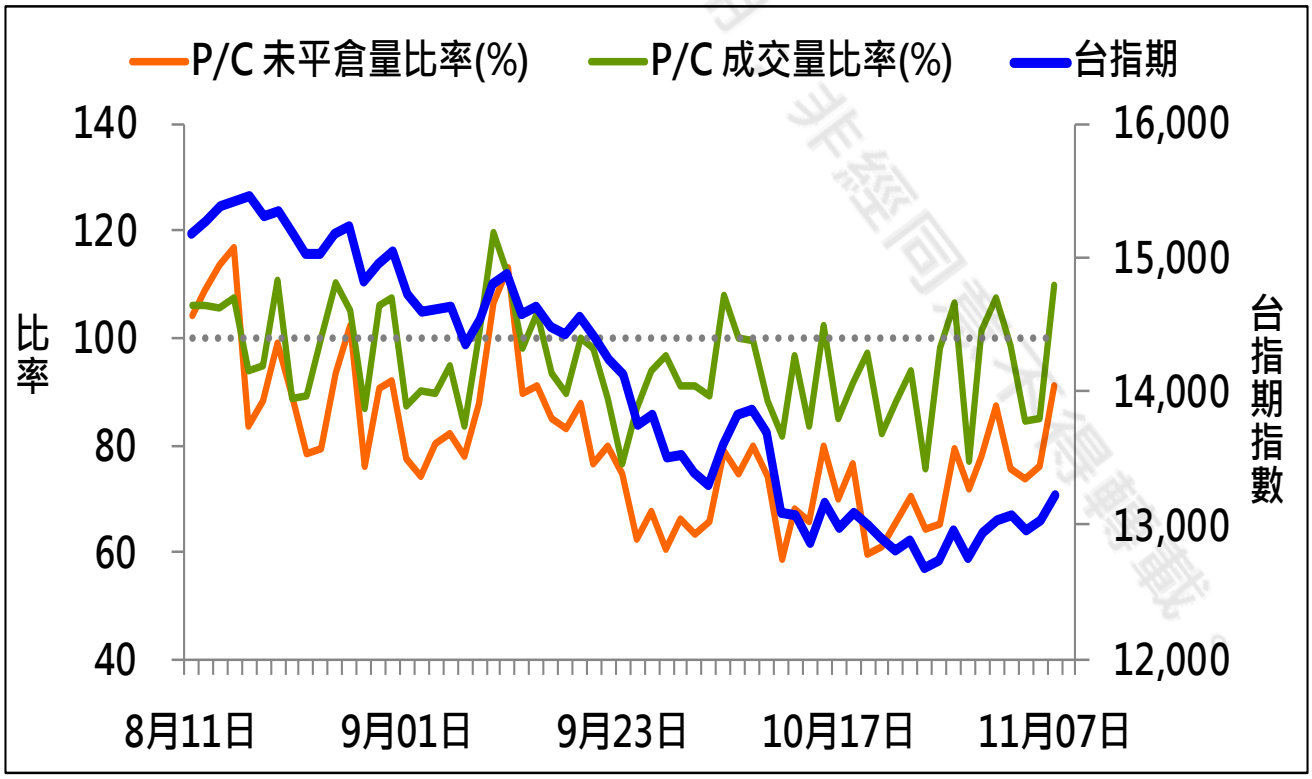
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

華南期貨 HUA NAN FUTURES

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

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