台指期貨暨選擇權日報

2022/11/10

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

11月10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	-278	-9,284	806	-81	-116	-51
投信	-5,831	240	227	0	73	0
自營商	2,608	1,663	168	-32	194	-1

11月10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	18	-20	35,651	1,399	14,760	2,561
投信	0	0	-200	0	164	0
自營商	-23	18	-29,555	-12,628	18,059	14,063

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
聯發科	5.08	台積電	-78.31
長榮	4.21	鴻海	-8.81
萬海	2.14	富邦金	-3.84
聯詠	0.97	緯穎	-2.83
欣興	0.94	台達電	-2.48
可成	0.81	台塑化	-2.42
聯電	0.79	國泰金	-2.34
台化	0.56	兆豐金	-2.22
矽力*-KY	0.48	研華	-1.85
大立光	0.42	友達	-1.68
前十名合計	16.41	後十名合計	-106.78

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	41.4%	49.1%
電子期前十大市場佔比	66.3%	72.3%
金融期前十大市場佔比	59.0%	52.3%
非金電期前十大市場佔比	96.7%	100.0%

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

2022/11/10

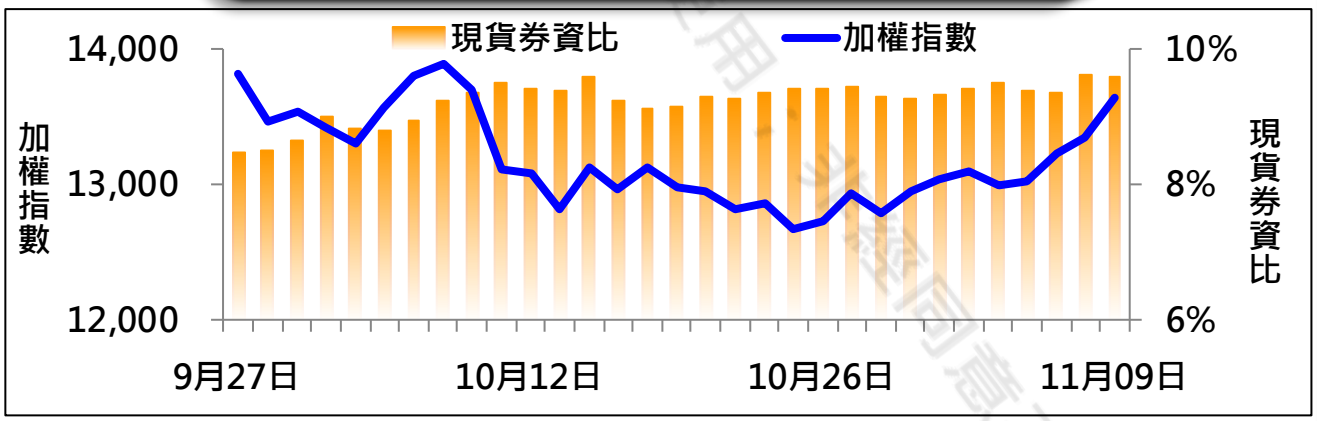
華南期貨 HUA NAN FUTURES

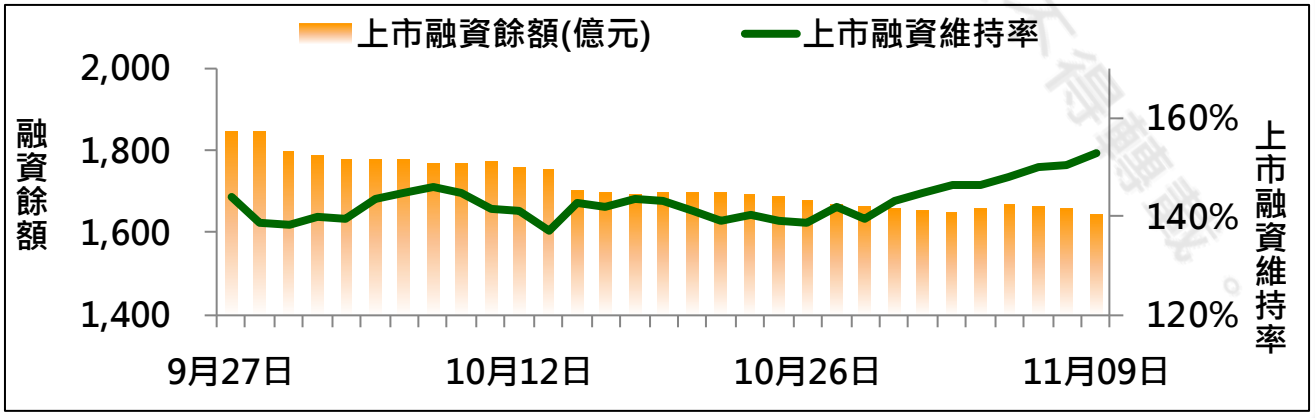
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月08日	91.0	4,582	107	-8.5	823	-1,549
11月09日	241.3	9,006	4,424	-22.7	945	122
11月10日	-16.8	-278	-9,284	-44.0	2,608	1,663

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
11月08日	29,078	16,360	12,718	-13,202	-8,861	-4,341
11月09日	34,252	12,199	22,053	-16,927	3,996	-20,923
11月10日	35,651	14,760	20,891	-29,555	18,059	-47,614

現貨券資比 & 上市融資維持率



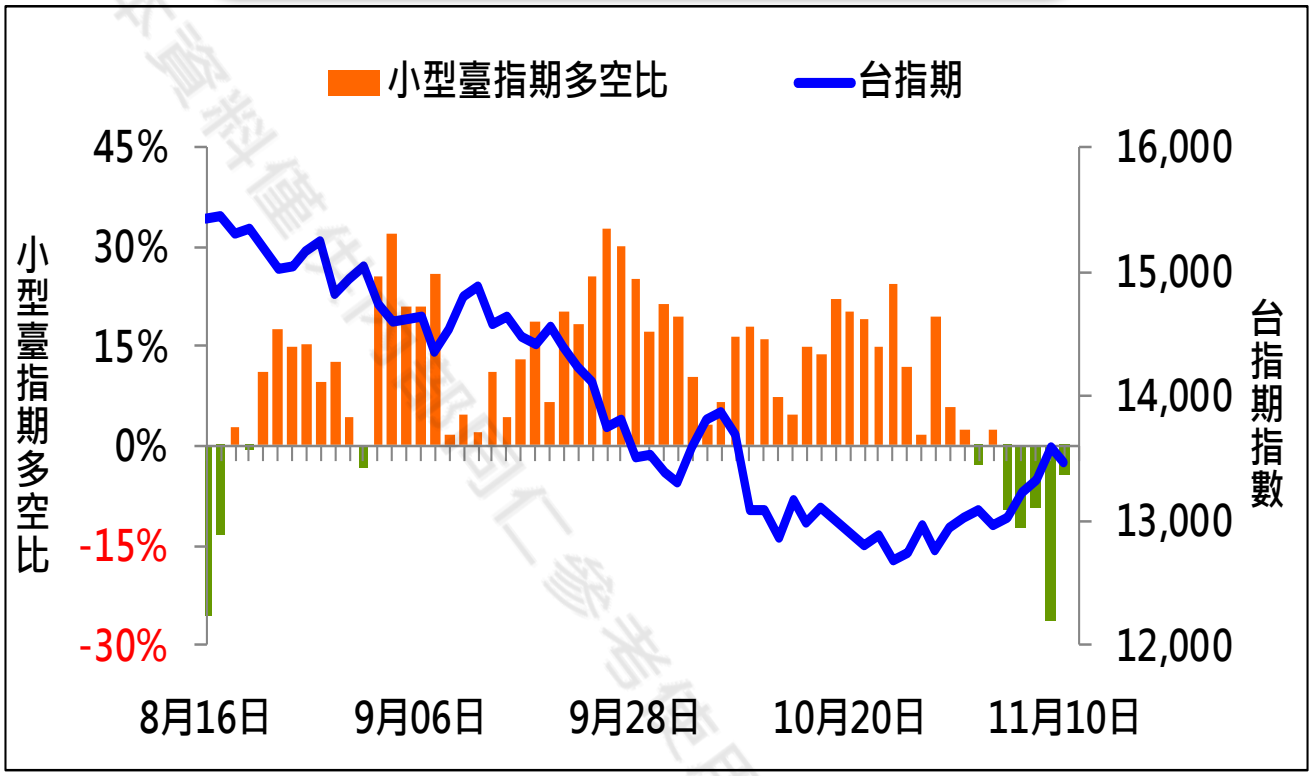


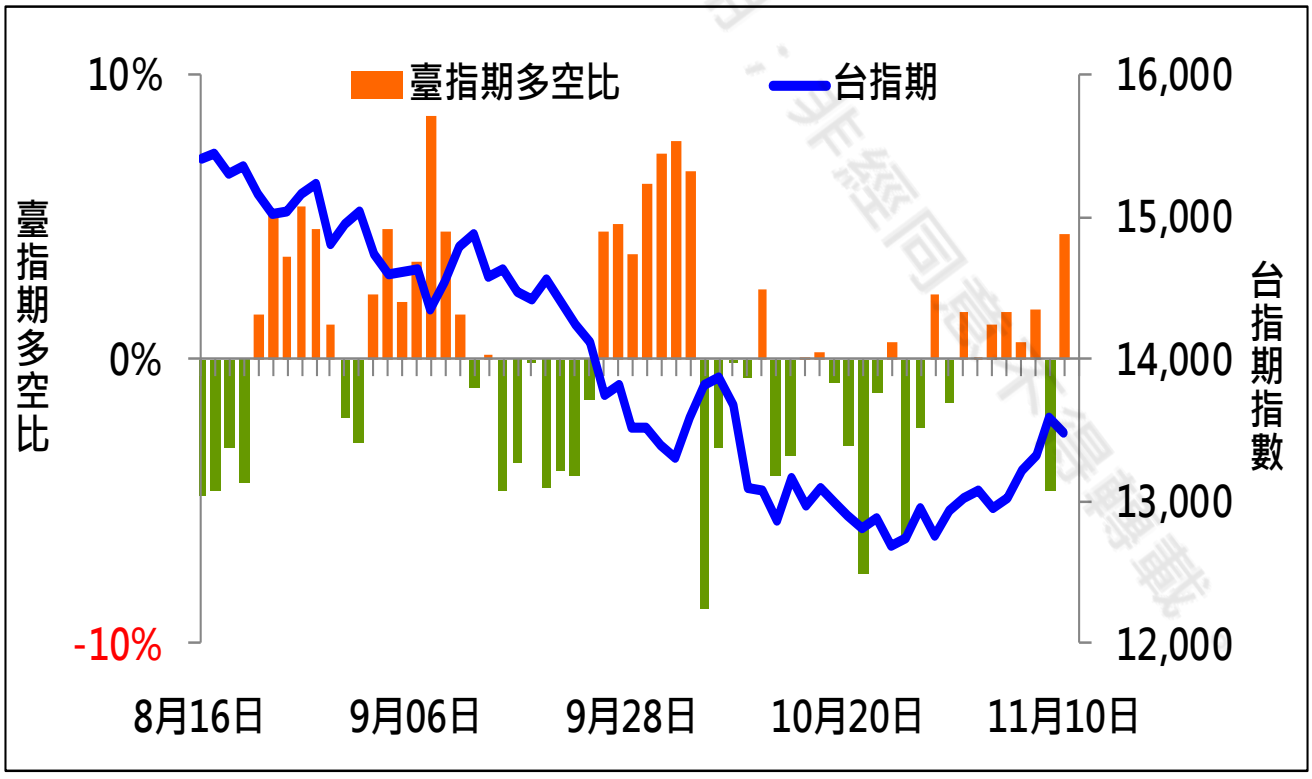
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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





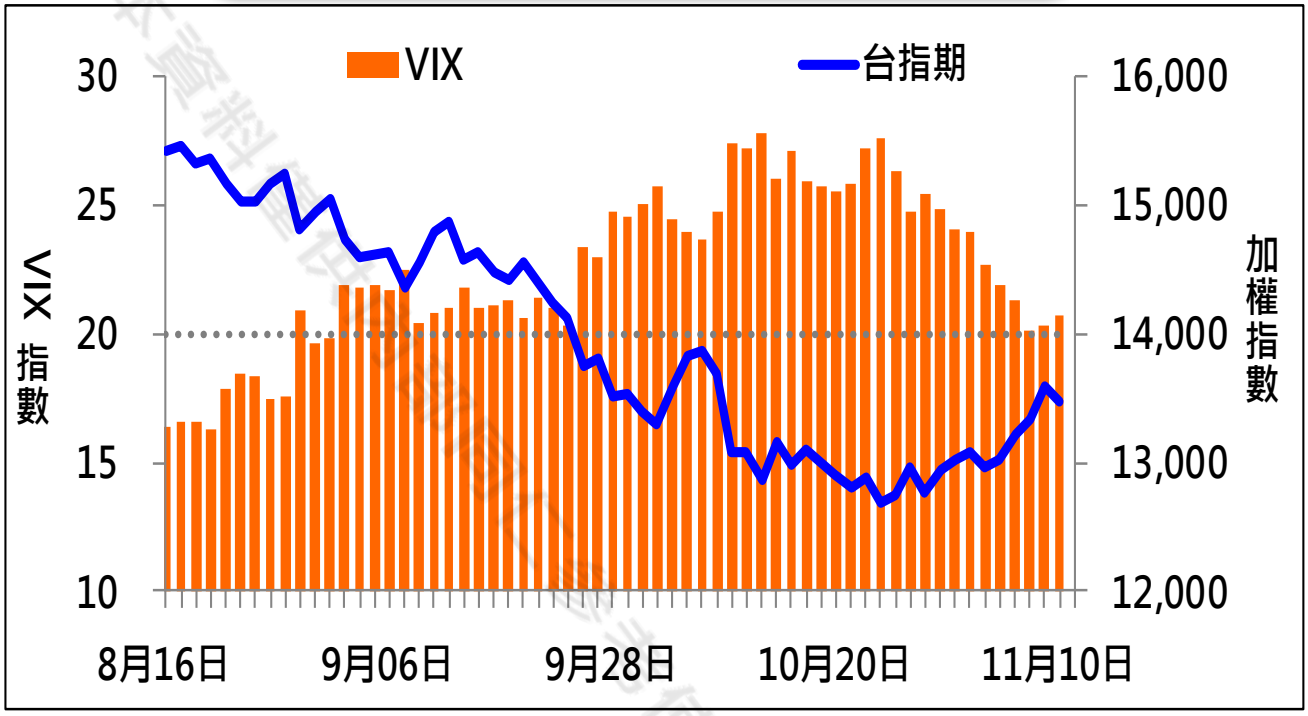
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

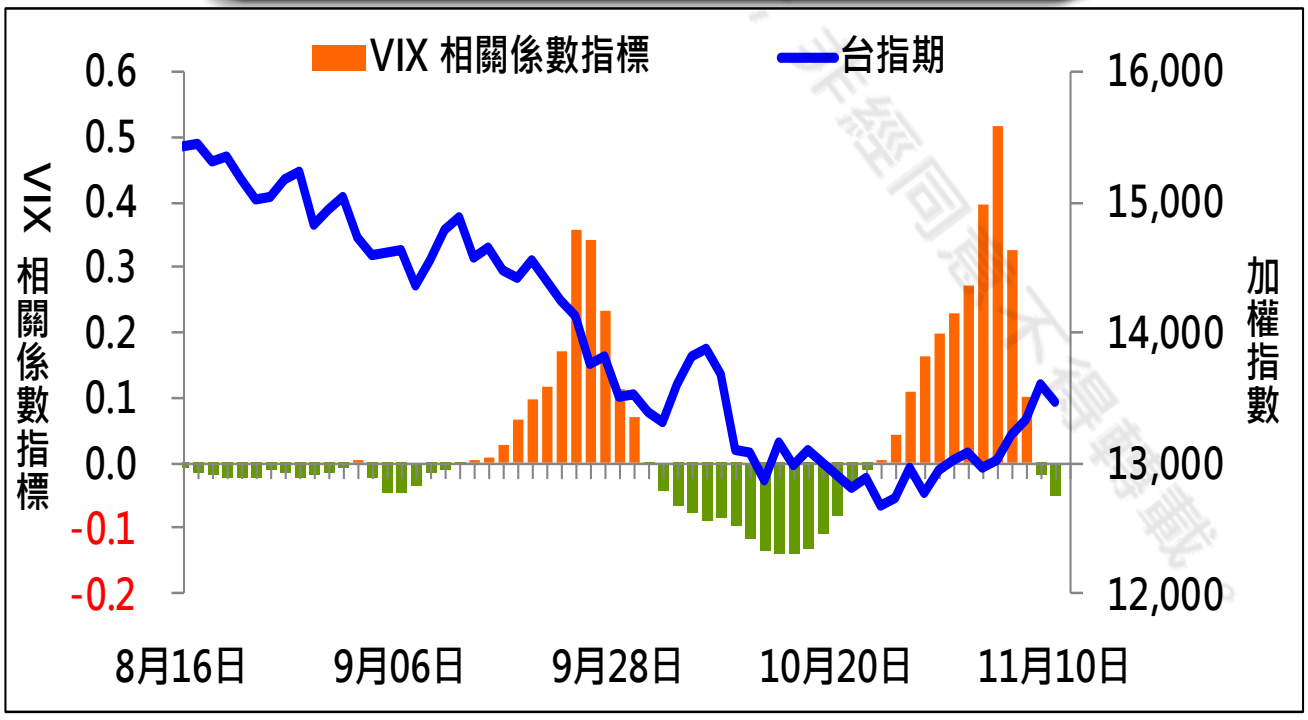
2022/11/10

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



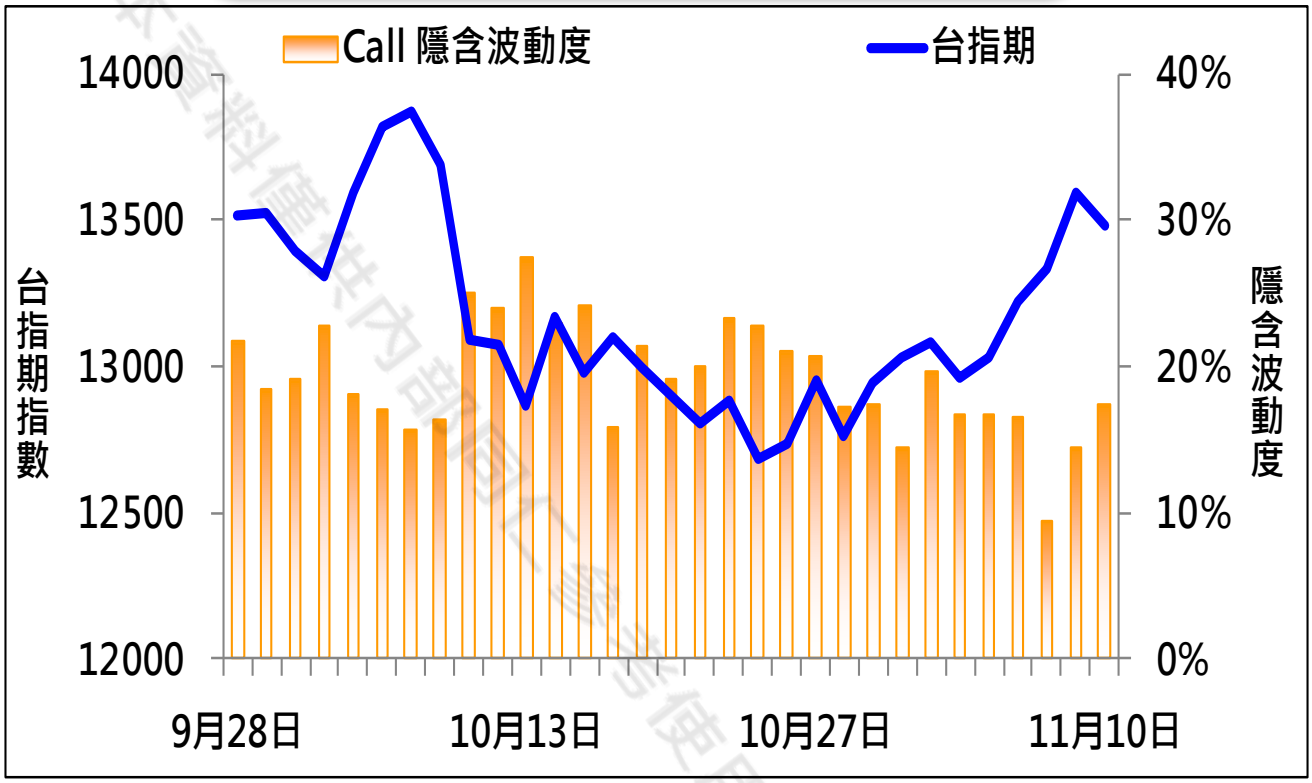
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

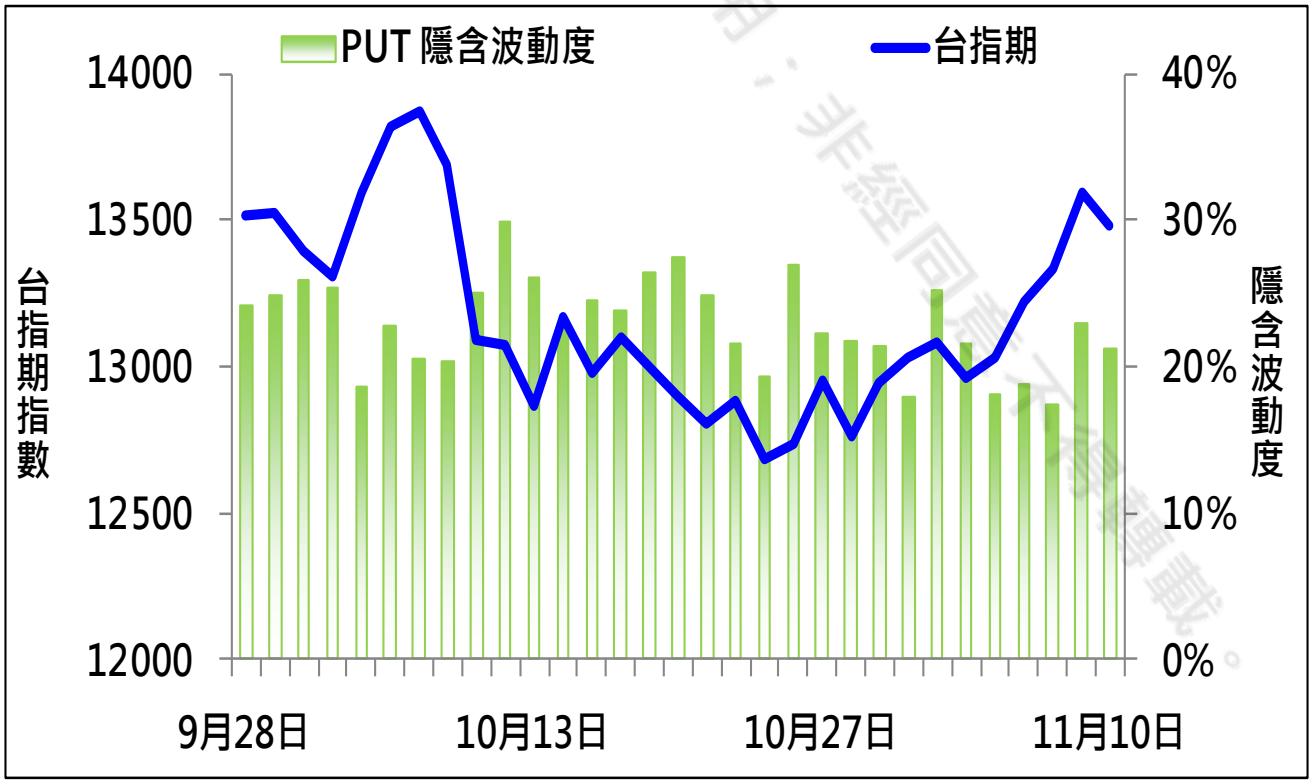
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

2022/11/10

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/11/10　　結算日：2022/11/16

OI 增減	Call	202211 月履約價	Put	OI 增減	
-85	1,677	12,900	8,257	1,128	
-1	0	12,950	3,998	2,253	※
-155	3,800	13,000	15,148	2,221	
8	9	13,050	2,826	1,646	
-513	3,839	13,100	9,628	1,720	
10	32	13,150	3,926	2,130	
-113	4,019	13,200	6,794	1,133	
34	54	13,250	3,295	2,232	
-531	4,116	13,300	5,614	1,448	
155	283	13,350	2,349	1,337	
-79	4,754	13,400	6,025	1,996	
776	976	13,450	3,424	1,990	
331	7,044	13,500	4,997	350	
1,314	1,835	13,550	1,370	465	
2,586	9,713	13,600	2,411	26	
3,303	4,779	13,650	365	146	
3,046	11,084	13,700	1,130	316	
1,757	1,757	13,750	42	42	
3,108	14,900	13,800	730	80	
2,192	2,192	13,850	6	6	
4,399	13,000	13,900	204	26	
3,212	3,212	13,950	2	2	
※ 6,294	19,157	14,000	131	8	
3,371	6,733	14,100	57	17	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
41,793	168,761	1.0420	175,850	20,696	
昨日 P/C	1.2220	今日增減變化		-0.1800	

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

2022/11/10

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2022/11/10　　結算日：2022/11/23

OI 增減	Call	202211W4 履約價	Put	OI 增減
0	0	13,000	610	422 ※
0	0	13,100	401	306
2	2	13,200	521	250
1	1	13,250	143	58
9	9	13,300	359	125
5	15	13,350	218	157
17	26	13,400	261	135
39	66	13,450	305	142
119	181	13,500	226	118
135	181	13,550	178	107
265	370	13,600	150	79
196	240	13,650	56	41
-91	373	13,700	35	17
120	120	13,750	1	1
431	609	13,800	38	38
297	513	13,900	19	-7
※ 741	1,236	14,000	0	0
170	583	14,100	0	0
523	719	14,200	0	0
130	234	14,300	0	0
184	294	14,400	0	0
100	381	14,500	0	0
29	389	14,600	0	0
288	770	14,700	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,411	8,014	0.8856	7,097	4,146
昨日 P/C	0.8190	今日增減變化		0.0665

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

2022/11/10

華南期貨 HUA NAN FUTURES

次月選擇權OI變化

日期：2022/11/10　　結算日：2022/12/21

OI 增減	Call	202212 月 履約價	Put	OI 增減
0	3	11,000	1,595	272
0	4	11,400	222	-45
0	4	11,800	503	52
0	7	12,200	1,252	-405
-4	217	12,600	1,052	136
-17	443	13,000	2,596	492
-2	397	13,200	617	97
7	739	13,400	266	24
43	949	13,500	281	73
72	1,038	13,600	117	16
64	1,244	13,800	142	6
605	3,749	14,000	375	-2
※ 1,514	2,965	14,200	57	0
119	965	14,600	92	0
193	984	15,000	96	-1
0	957	15,400	543	0
0	124	15,800	46	0
0	72	16,200	9	0
0	264	16,600	28	0
0	466	17,200	7	0
0	390	17,800	6	0
0	2,564	19,000	4	0
0	409	20,200	0	0
11	9,517	21,400	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,277	55,562	0.4698	26,102	3,121
昨日 P/C	0.4481	今日增減變化		0.0217

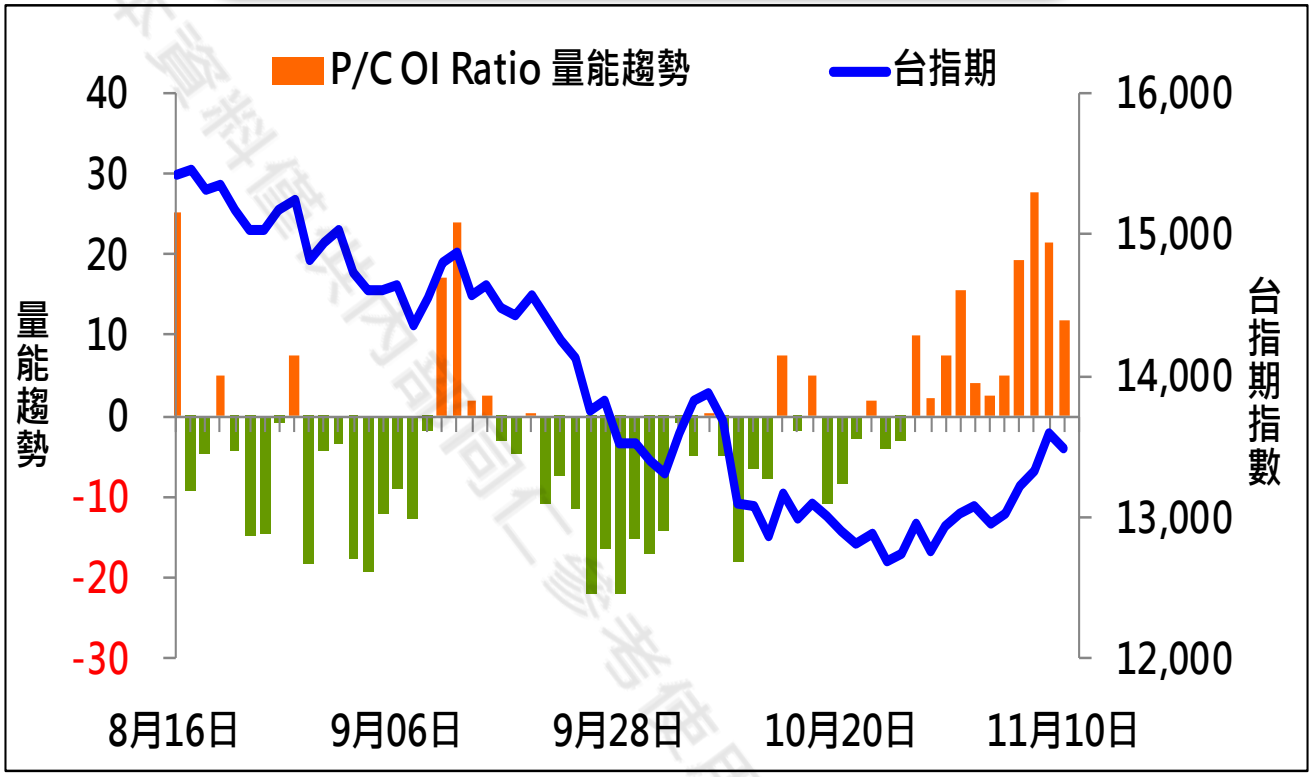
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

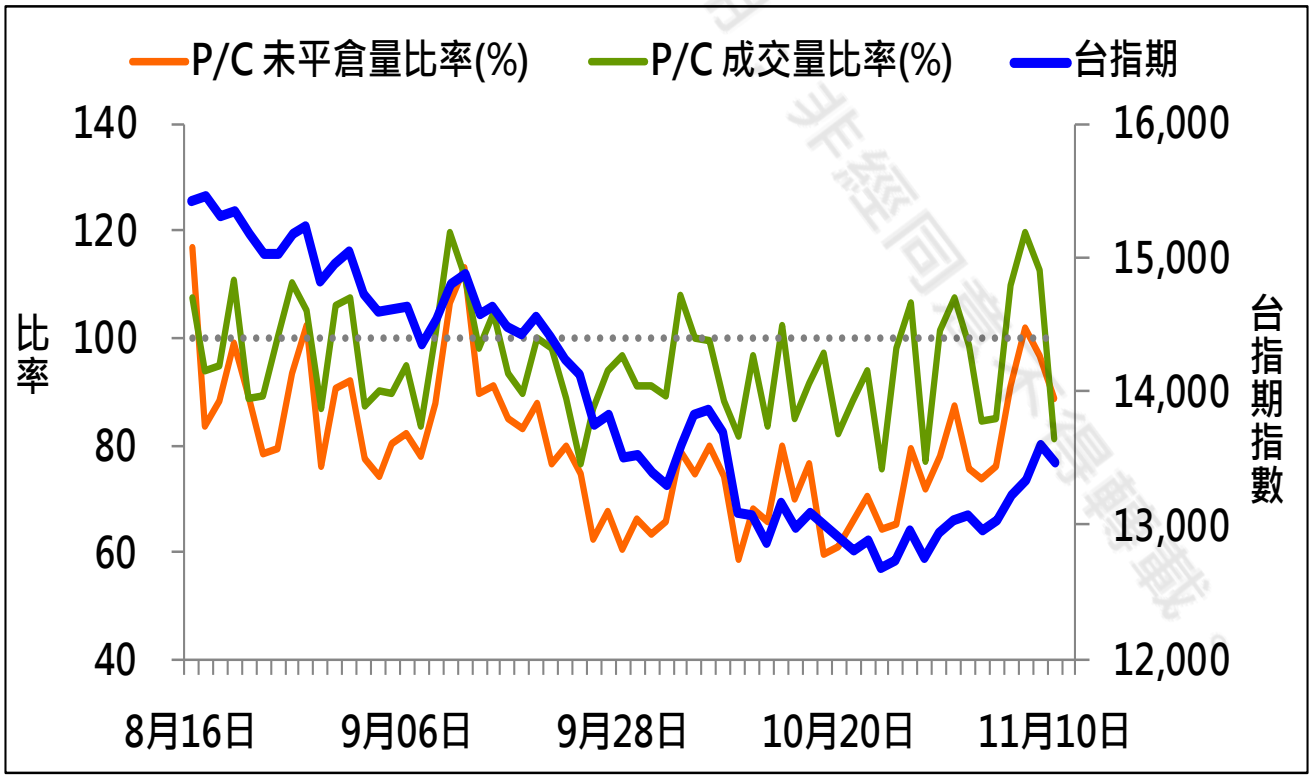
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

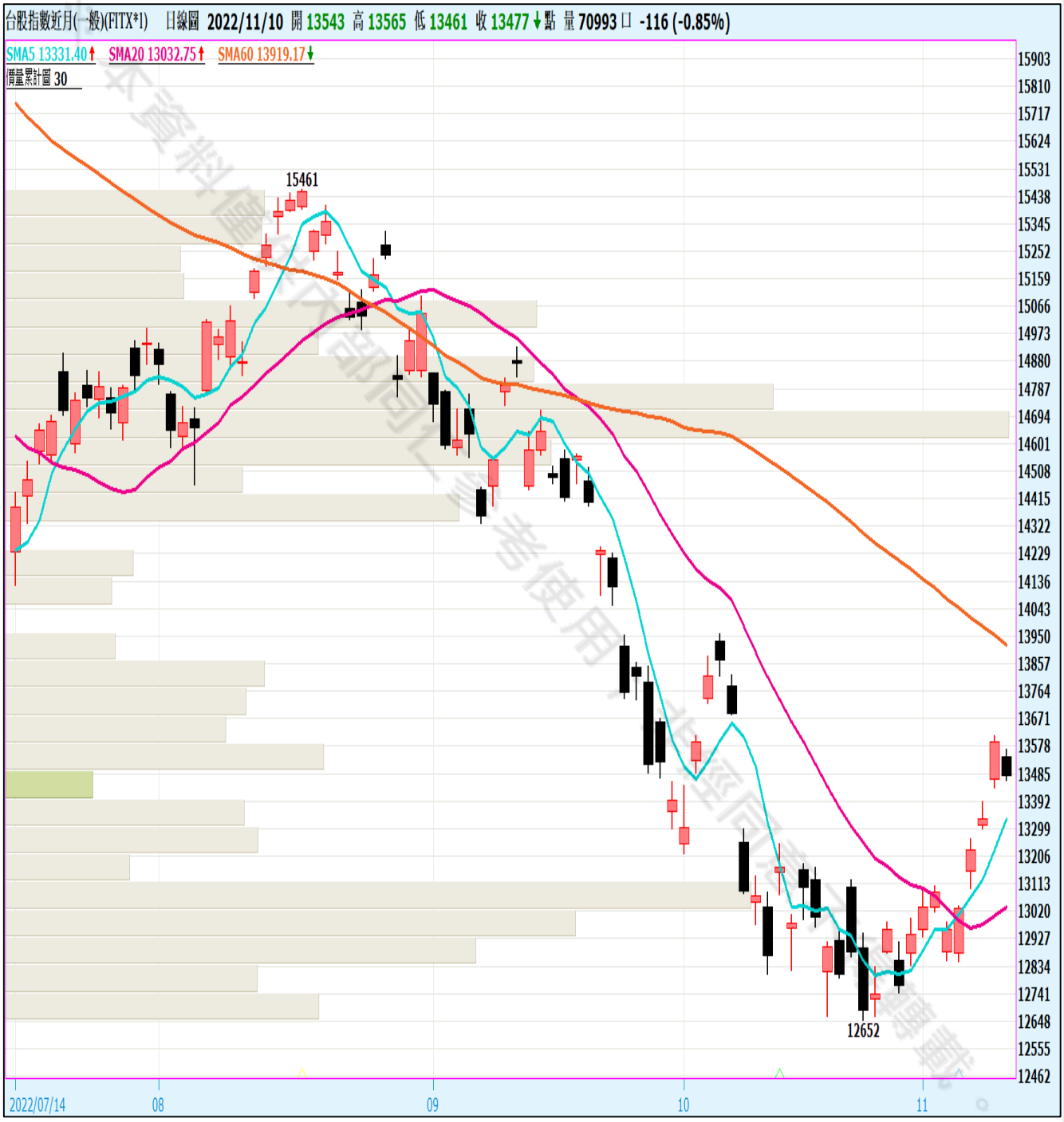




期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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