台指期貨暨選擇權日報

2022/11/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

11月16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	9,139	7,133	1,151	72	-613	-254
投信	-5,607	-1,456	169	-8	69	0
自營商	1,882	-3,440	126	89	147	13

11月16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	-38	-38	27,548	-11,713	4,704	-7,539
投信	0	0	0	-100	-121	-785
自營商	50	59	-16,412	18,504	1,705	15,427

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台積電	58.23	台塑化	-8.25
矽力*-KY	3.66	聯電	-5.41
聯發科	3.59	南亞	-4.58
創意	1.98	中租-KY	-4.17
聯詠	1.17	富邦金	-4.04
瑞昱	1.15	台達電	-3.75
日月光投控	1.12	國泰金	-3.30
微星	1.08	統一	-2.73
技嘉	1.02	台塑	-2.45
緯穎	0.95	台泥	-2.24
前十名合計	73.97	後十名合計	-40.93

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	53.6%	51.8%
電子期前十大市場佔比	73.3%	79.4%
金融期前十大市場佔比	65.6%	70.5%
非金電期前十大市場佔比	97.7%	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

2022/11/16

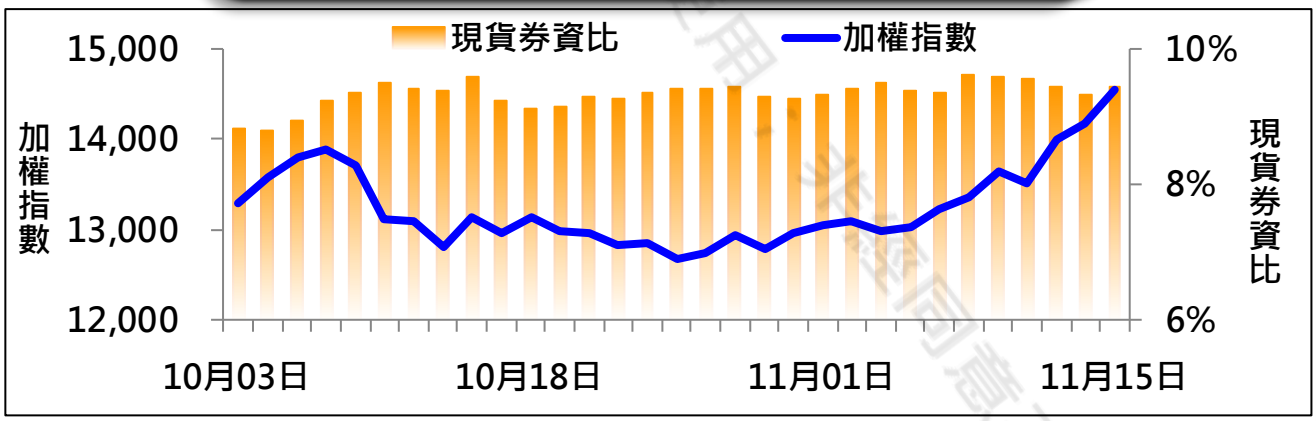
華南期貨 HUA NAN FUTURES

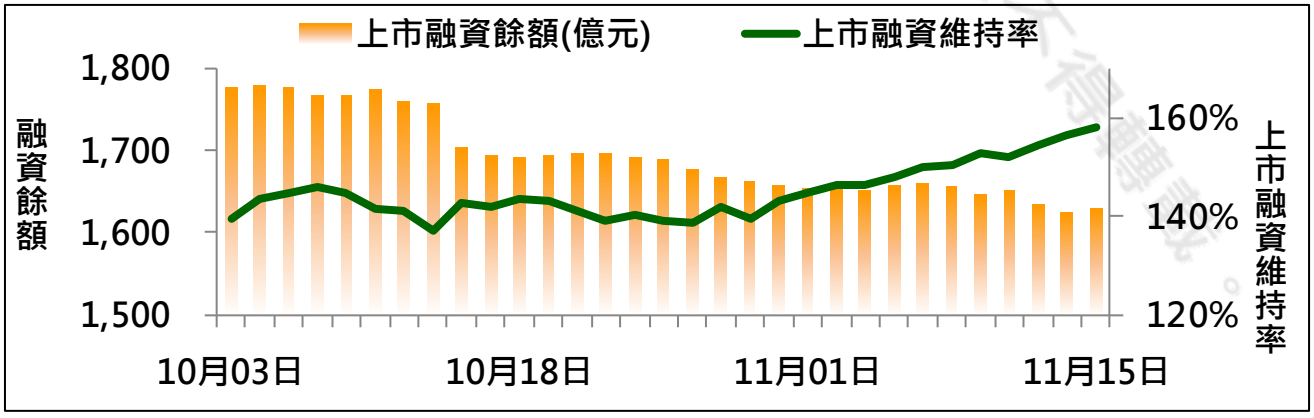
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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10日	-16.8	-278	-9,284	-44.0	2,608	1,663
11月11日	488.5	8,911	9,189	-36.6	-2	-2,610
11月14日	377.7	4,805	-4,106	-50.5	1,322	1,324
11月15日	347.9	2,006	-2,799	-62.0	5,322	4,000
11月16日	115.9	9,139	7,133	-66.7	1,882	-3,440

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10日	35,651	14,760	20,891	-29,555	18,059	-47,614
11月11日	38,381	15,550	22,831	-25,561	-2,382	-23,179
11月14日	40,265	13,948	26,317	-31,991	-1,230	-30,761
11月15日	39,261	12,243	27,018	-34,916	-13,722	-21,194
11月16日	27,548	4,704	22,844	-16,412	1,705	-18,117

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

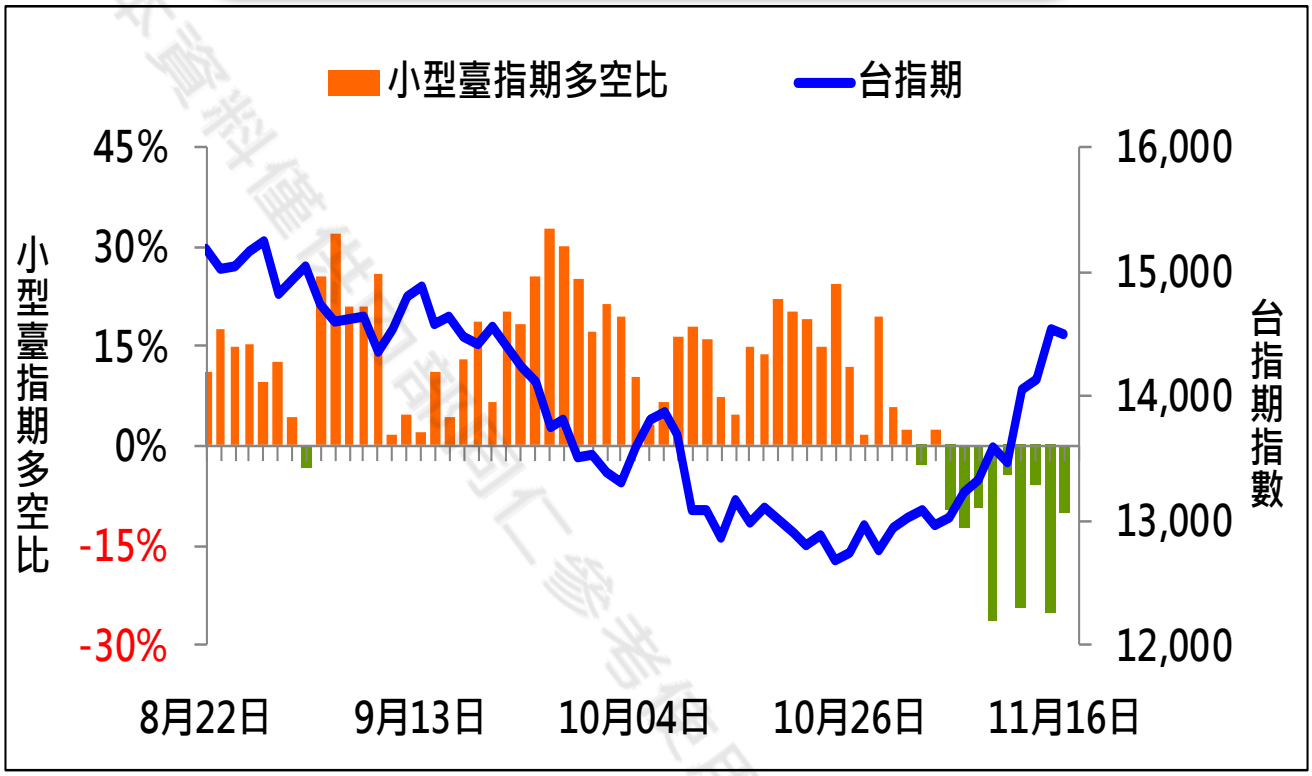
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

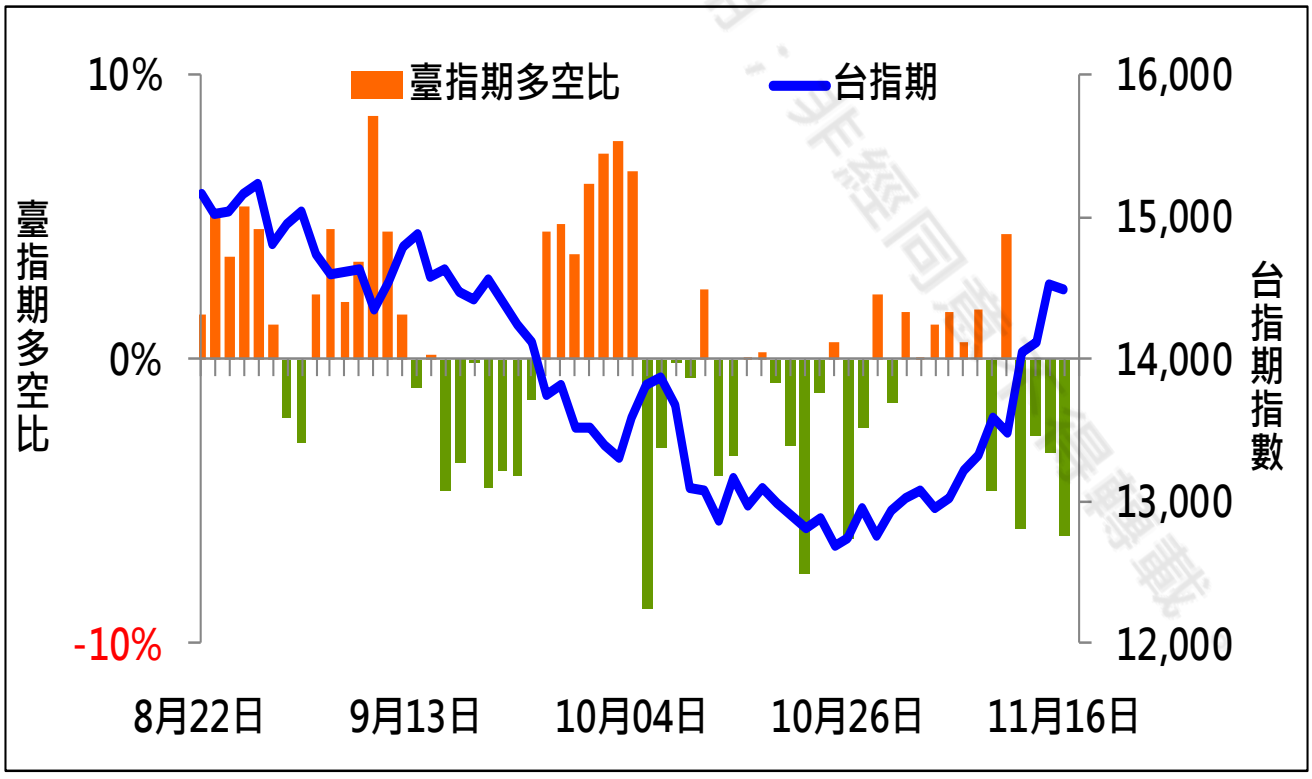
台指期貨暨選擇權日報

2022/11/16

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

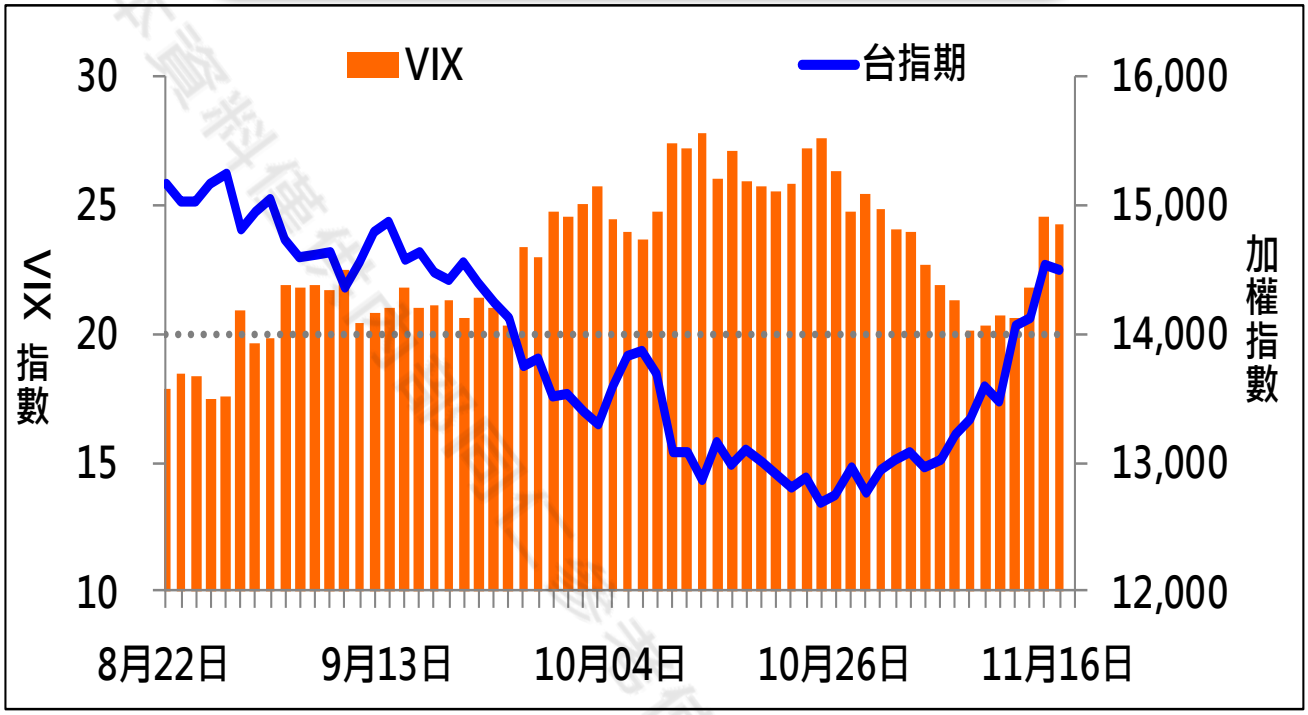
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

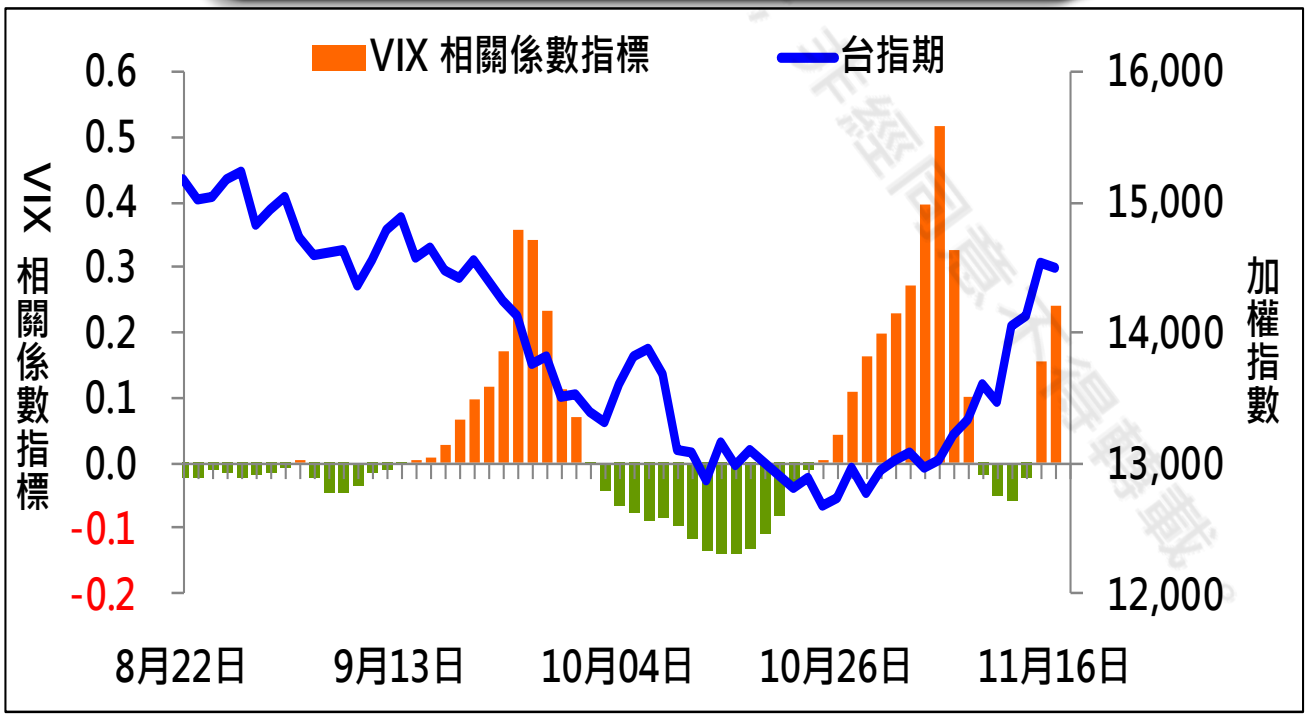
2022/11/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

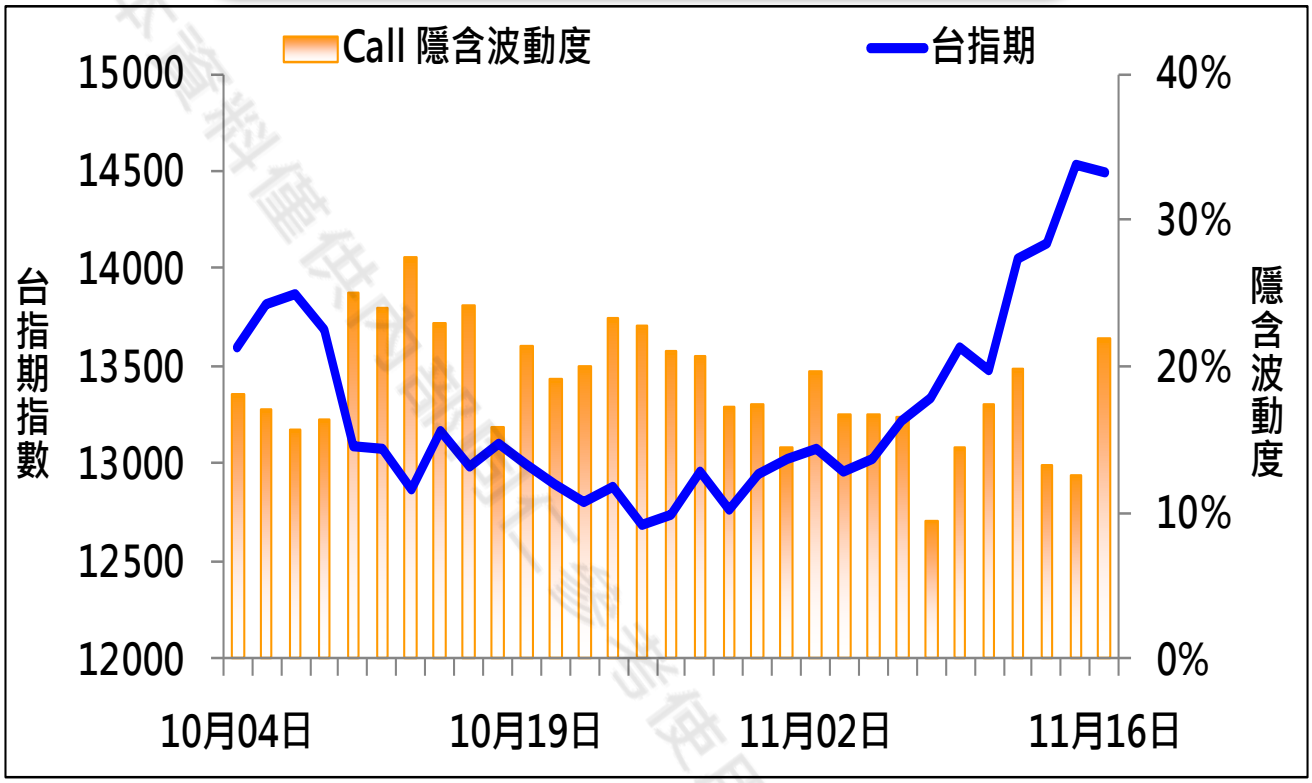


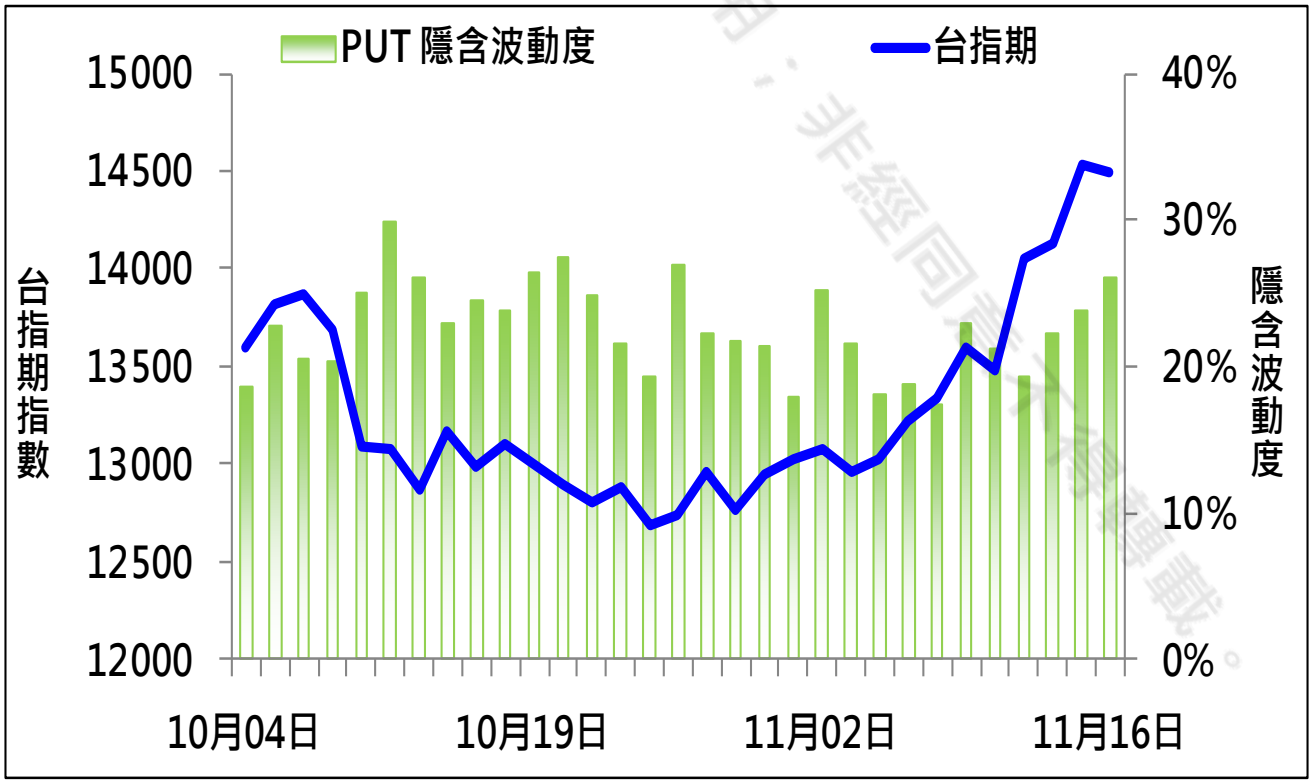
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2022/11/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/11/16　　結算日：2022/11/23

OI 增減	Call	202211W4 履約價	Put	OI 增減	
-38	786	14,000	3,157	1,205	
-9	143	14,050	940	86	
-69	470	14,100	2,287	549	
4	182	14,150	1,853	115	
-123	859	14,200	2,748	1,403	
-131	151	14,250	2,706	1,492	
-237	352	14,300	2,965	1,118	
-57	305	14,350	2,730	1,803	※
-174	1,001	14,400	1,986	1,275	
-10	670	14,450	1,732	781	
-241	2,556	14,500	2,243	1,676	
691	1,717	14,550	977	755	
935	2,168	14,600	1,457	1,144	
912	912	14,650	335	335	
606	1,777	14,700	262	224	
638	638	14,750	70	70	
826	2,497	14,800	203	156	
942	942	14,850	24	24	
1,391	2,269	14,900	84	84	
585	585	14,950	3	3	
※ 2,549	5,379	15,000	134	-70	
2,050	2,575	15,100	213	-243	
1,990	2,587	15,200	55	35	
2,107	2,394	15,300	6	-32	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
24,714	46,741	1.2224	57,137	20,126
昨日 P/C	1.6803	今日增減變化		-0.4578

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

2022/11/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2022/11/16　　結算日：2022/11/30

	OI 增減	Call	202211W5 履約價	Put	OI 增減	
	0	0	13,000	72	72	
	0	0	13,100	96	96	※
	0	0	13,200	46	46	
	0	0	13,300	0	0	
	0	0	13,400	28	28	
	0	0	13,500	11	11	
	0	0	13,600	37	37	
	0	0	13,700	39	39	
	0	0	13,800	11	11	
	0	0	13,900	12	12	
	0	0	14,000	53	53	
	0	0	14,100	56	56	
	0	0	14,200	70	70	
	0	0	14,300	62	62	
	0	0	14,400	54	54	
	0	0	14,450	0	0	
	4	4	14,500	2	2	
	87	87	14,550	1	1	
	108	108	14,600	12	12	
	13	13	14,800	0	0	
※	258	258	15,000	2	2	
	32	32	15,200	0	0	
	30	30	15,400	0	0	
	126	126	15,600	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
991	991	0.8345	827	827

昨日 P/C	0.0000	今日增減變化	0.8345

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

2022/11/16

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/11/16　　結算日：2022/12/21

	OI 增減	Call	202212 月 履約價	Put	OI 增減	
	-14	408	13,000	4,795	627	
	-13	308	13,200	1,278	71	
	-8	665	13,400	1,274	188	
	-13	907	13,600	1,100	196	
	-19	998	13,800	1,316	185	
	-356	4,079	14,000	3,803	528	
	-31	1,847	14,100	1,832	1,010	※
	-103	1,985	14,200	1,504	630	
	-194	1,698	14,300	1,037	579	
	-65	1,274	14,400	1,063	478	
	-80	2,923	14,500	685	269	
	-187	2,056	14,600	342	177	
	-60	1,735	14,800	207	99	
	543	2,945	15,000	80	-5	
	594	2,622	15,200	134	37	
	735	2,226	15,400	542	-1	
※	1,224	1,539	15,800	404	104	
	229	477	16,200	30	21	
	262	871	16,400	117	0	
	6	485	17,400	91	0	
	268	763	18,400	192	0	
	30	1,051	19,400	4	0	
	0	432	20,400	0	0	
	-100	9,541	21,400	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
8,426	76,462	0.7554	57,757	9,271
昨日 P/C	0.7127	今日增減變化		0.0427

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

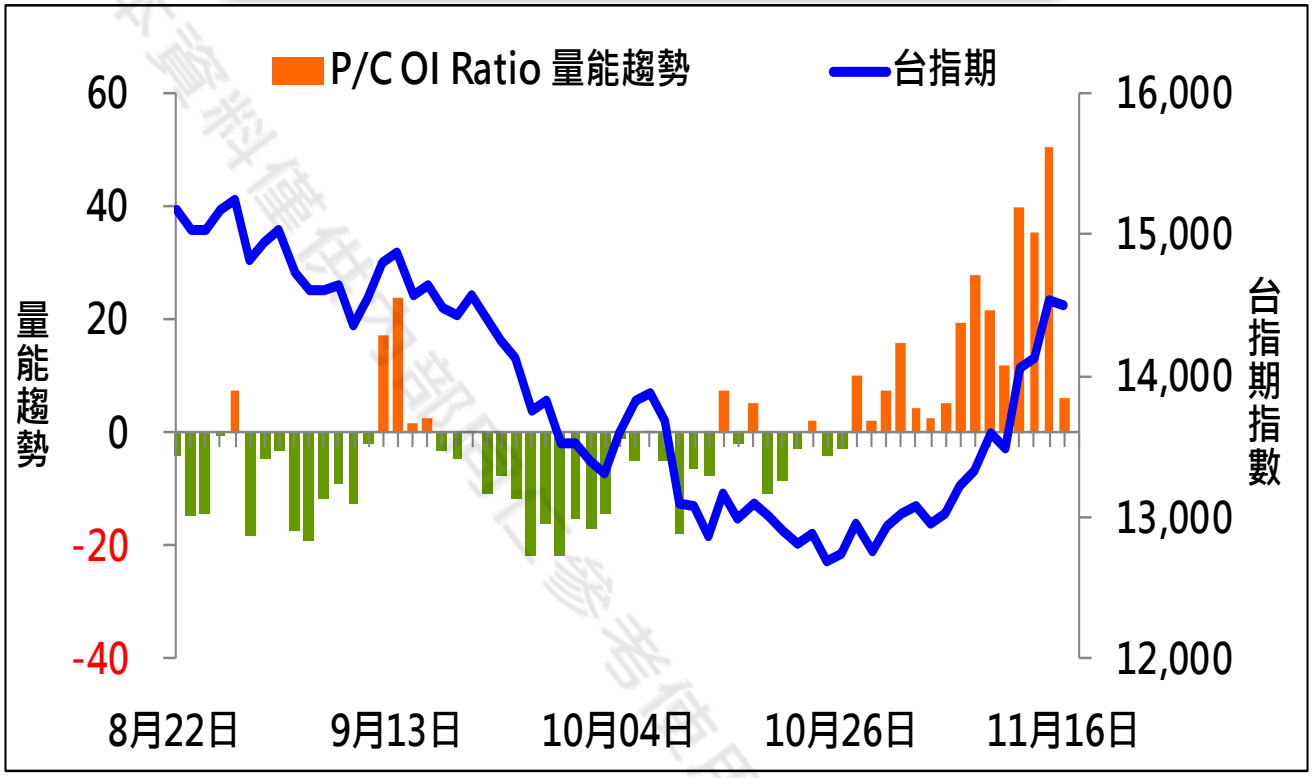
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

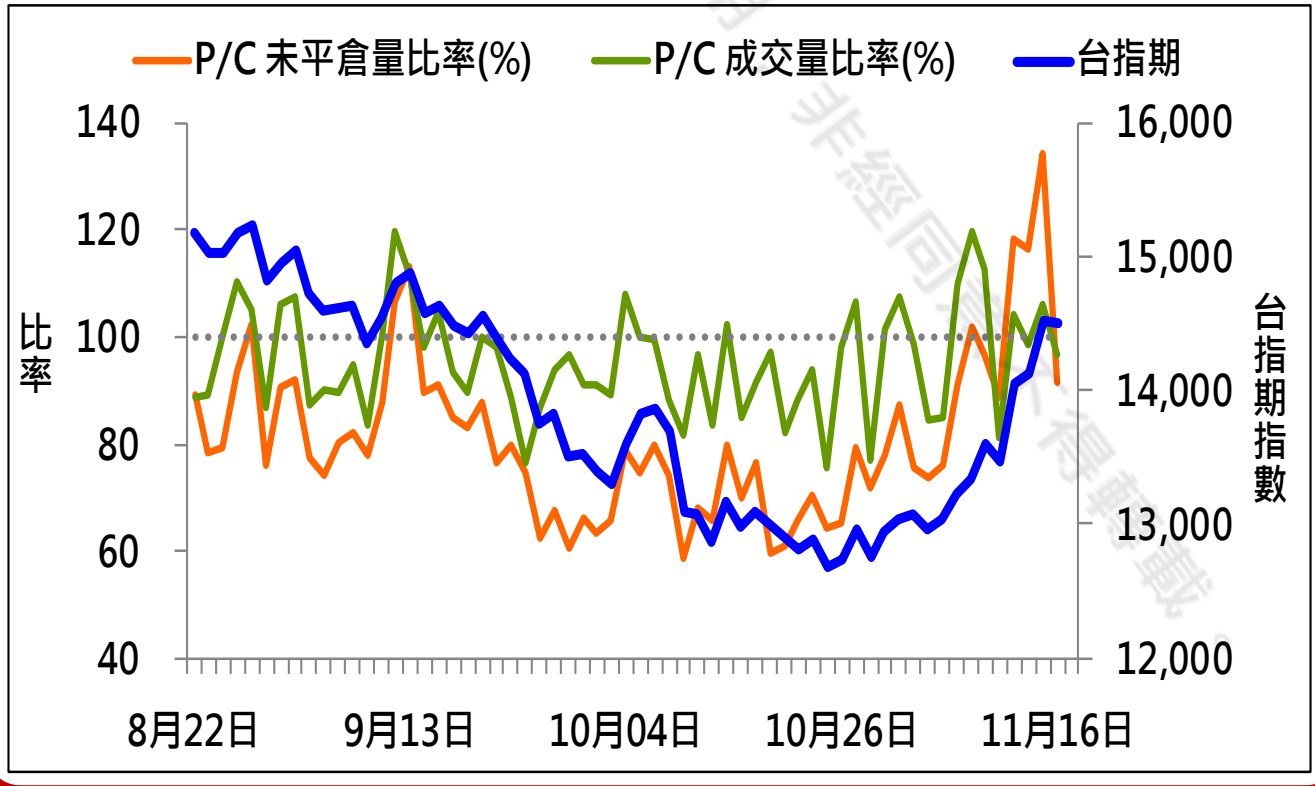
台指期貨暨選擇權日報

2022/11/16

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

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