台指期貨暨選擇權日報

2022/11/21

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

11月21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	11,425	-1,166	1,441	147	-769	-115
投信	-5,439	165	167	0	69	0
自營商	414	-312	12	-35	110	10

11月21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	-14	16	26,583	842	6,217	-80
投信	0	0	-100	0	79	0
自營商	22	-14	-10,817	-5,095	18,298	6,005

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
中鋼	3.04	台積電	-41.62
南亞	1.78	南亞科	-2.29
裕隆	1.57	矽力*-KY	-2.26
兆豐金	1.57	鴻海	-2.23
台化	1.51	台灣大	-2.15
北極星藥業-KY	1.47	萬海	-2.07
欣興	1.42	長榮	-2.04
和泰車	1.23	陽明	-1.79
合庫金	1.12	億豐	-1.32
國泰金	0.94	遠東新	-1.29
前十名合計	15.65	後十名合計	-59.05

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	49.1%	47.8%
電子期前十大市場佔比	72.7%	74.6%
金融期前十大市場佔比	58.6%	67.1%
非金電期前十大市場佔比	98.4%	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

2022/11/21

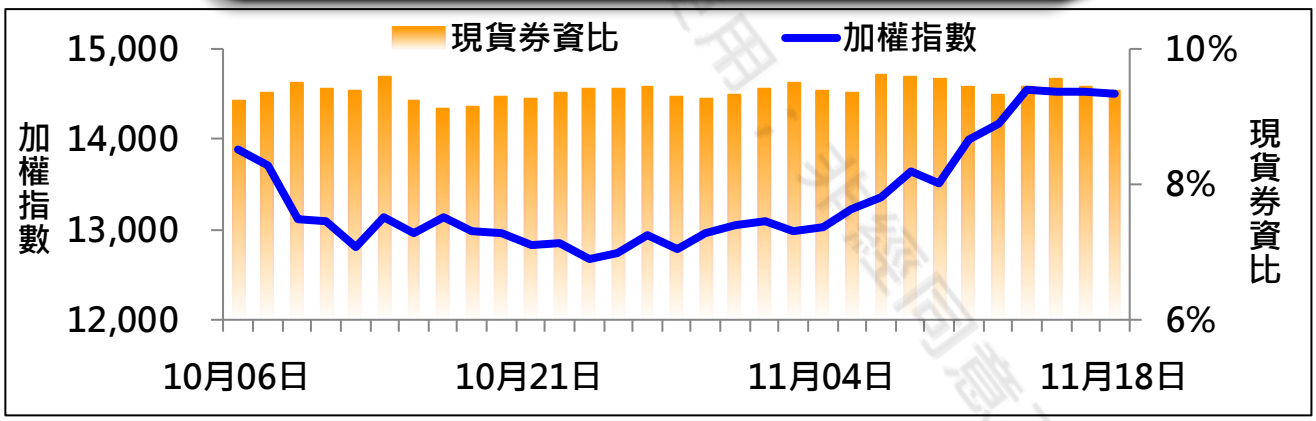
華南期貨 HUA NAN FUTURES

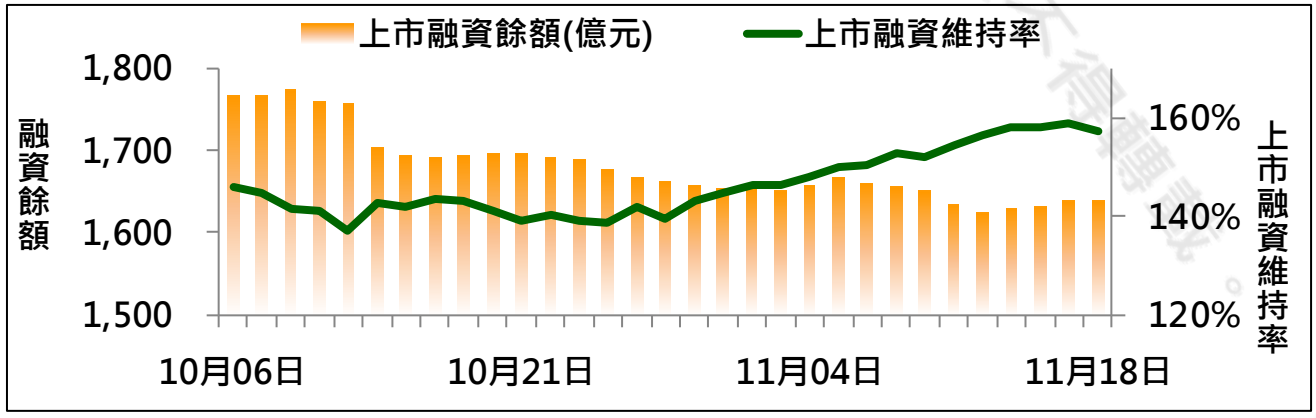
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月17日	-33.3	7,878	-1,261	16.9	1,562	-320
11月18日	-23.7	12,591	4,713	-23.7	726	-836
11月21日	-17.6	11,425	-1,166	-19.2	414	-312

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
11月17日	28,007	7,057	20,950	-19,762	13,553	-33,315
11月18日	25,741	6,297	19,444	-5,722	12,293	-18,015
11月21日	26,583	6,217	20,366	-10,817	18,298	-29,115

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

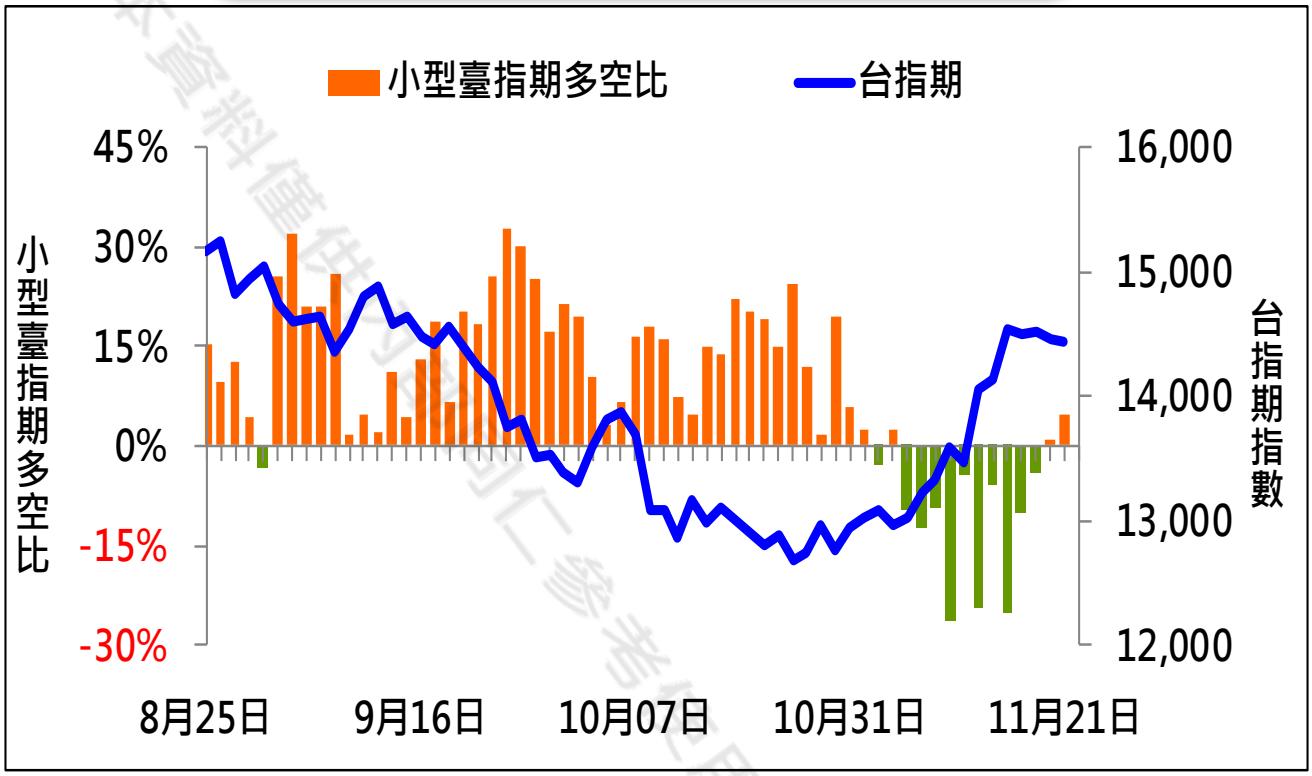
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

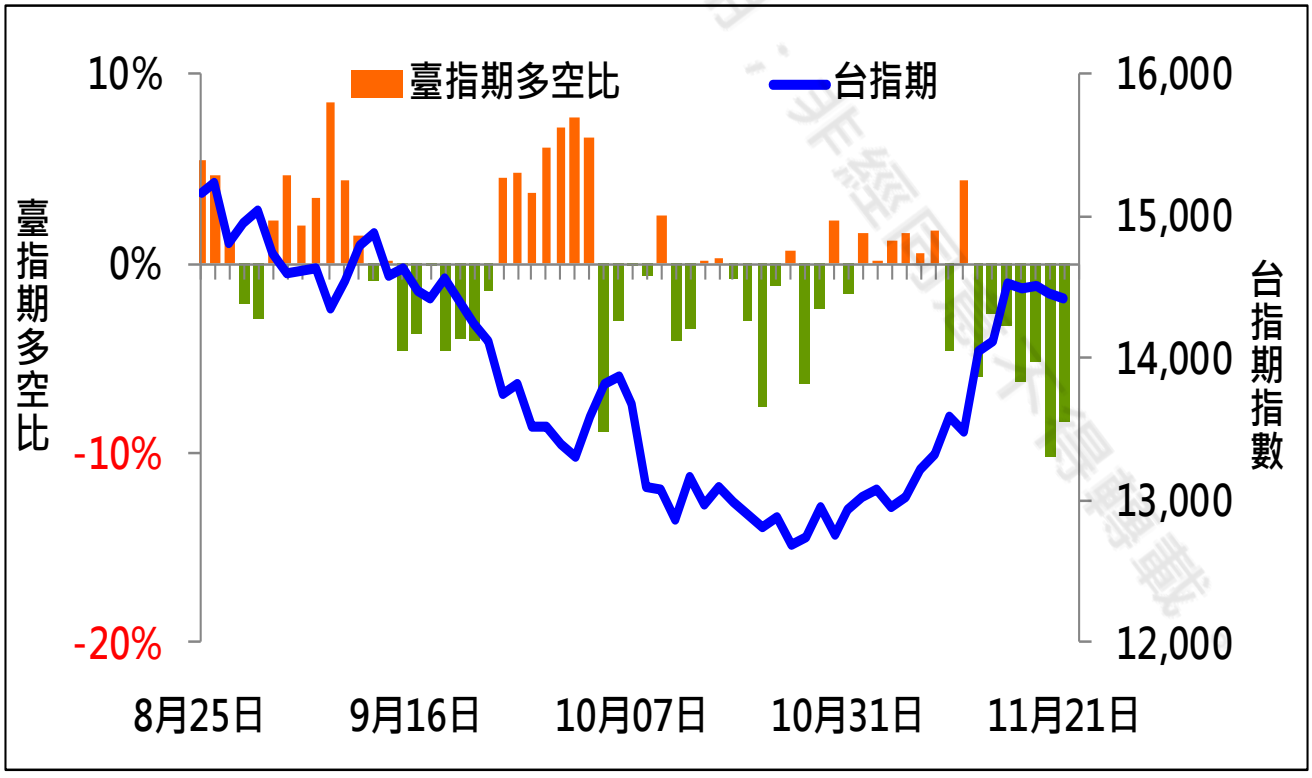
台指期貨暨選擇權日報

2022/11/21

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

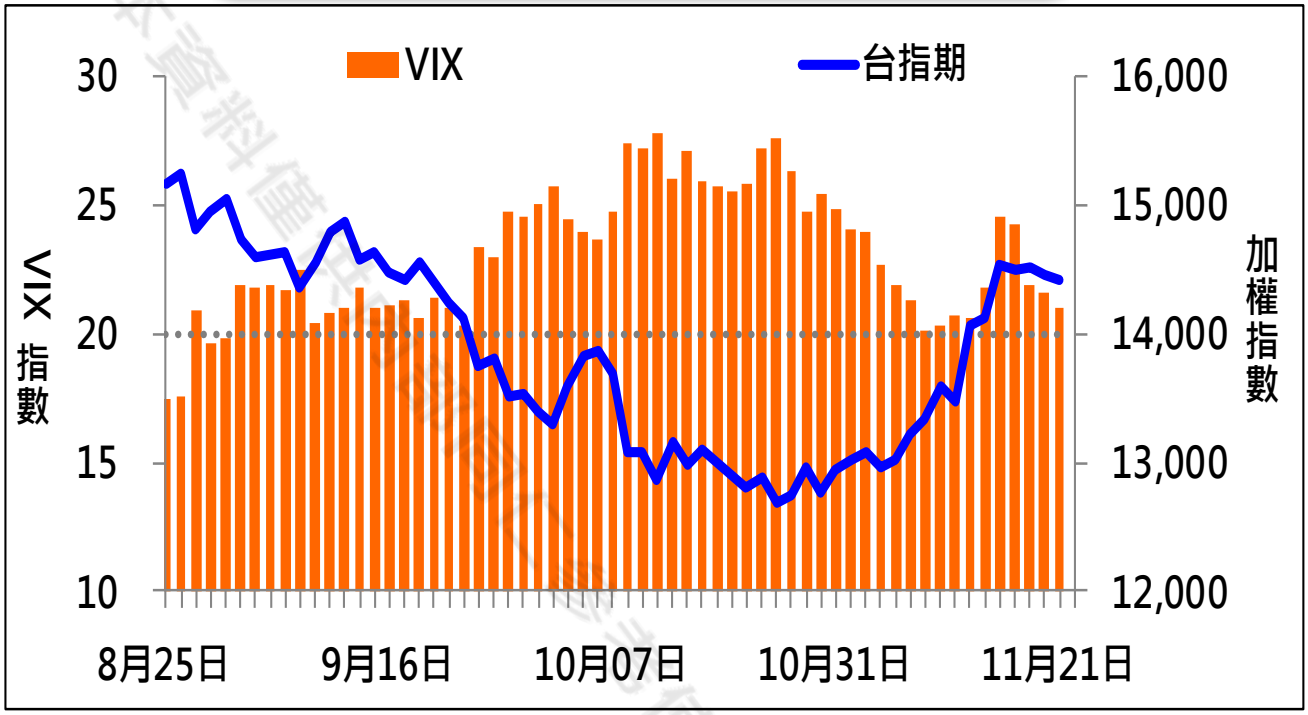
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

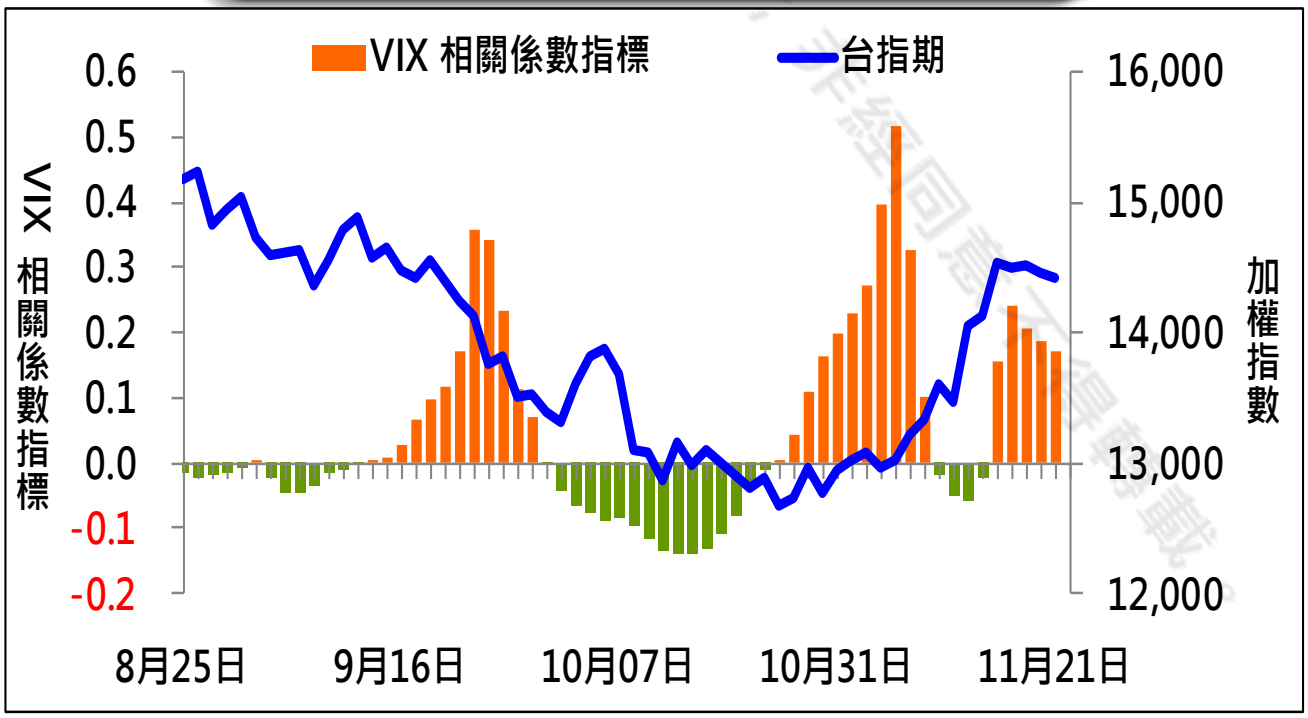
2022/11/21

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

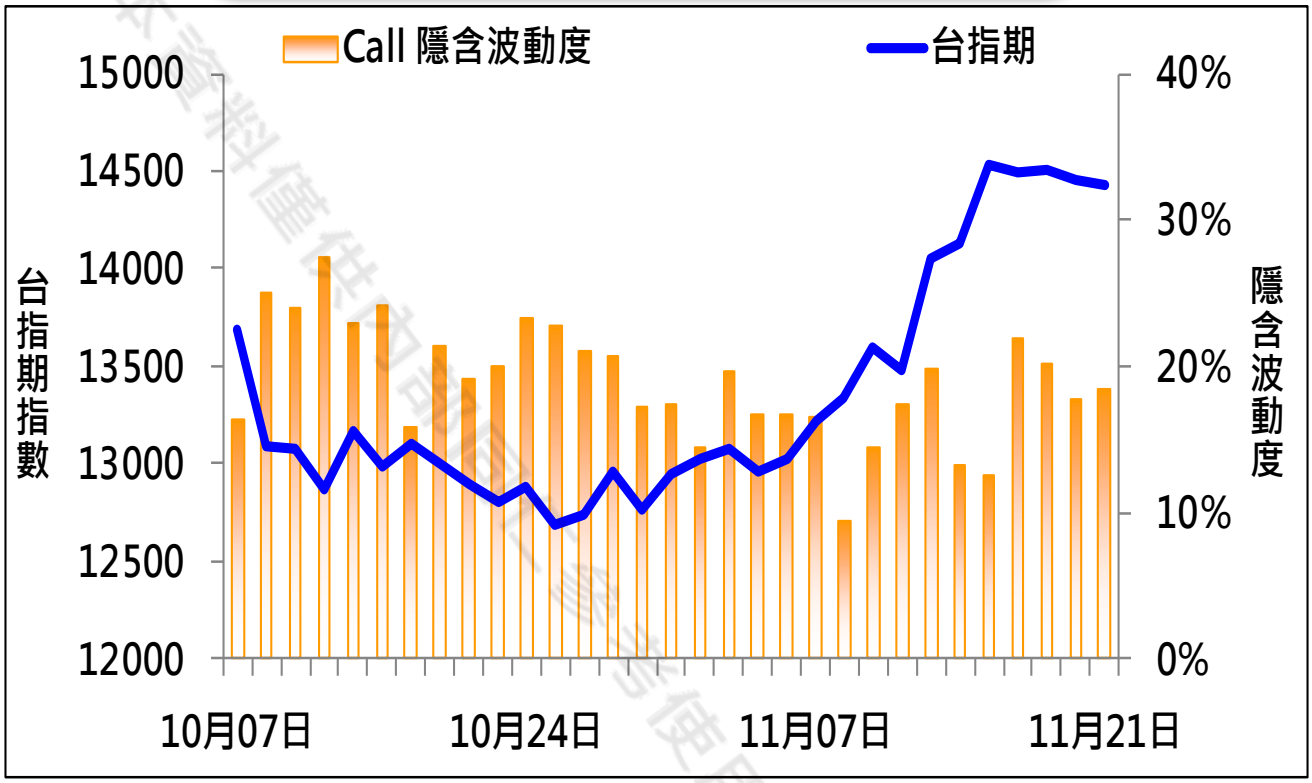


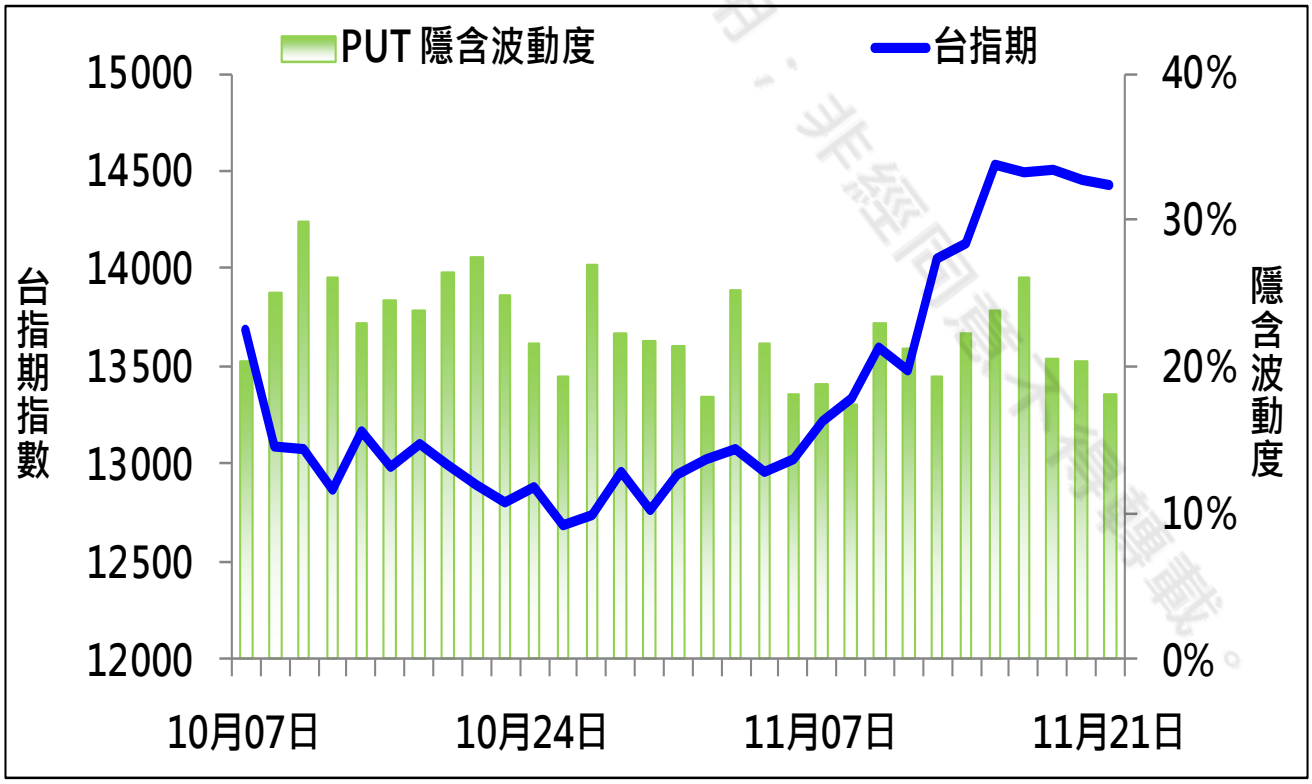
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2022/11/21

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/11/21　　結算日：2022/11/23

OI 增減	Call	202211W4 履約價	Put	OI 增減	
-45	262	13,850	2,769	57	
-2	286	13,950	3,699	644	
-18	670	14,000	9,857	451	
0	149	14,050	4,677	495	
-26	402	14,100	8,885	1,731	※
0	184	14,150	5,134	1,462	
-62	760	14,200	8,644	1,312	
-46	162	14,250	5,756	1,160	
158	655	14,300	6,516	1,122	
129	624	14,350	4,353	79	
499	2,259	14,400	5,769	1,035	
709	2,170	14,450	3,096	751	
1,989	6,224	14,500	4,977	487	
996	4,404	14,550	2,813	-686	
2,598	8,744	14,600	2,161	-324	
2,759	6,718	14,650	1,156	143	
1,283	8,925	14,700	1,508	-3	
※ 2,858	8,082	14,750	351	151	
2,288	10,079	14,800	219	-4	
2,273	6,393	14,850	168	1	
1,421	7,882	14,900	49	-39	
240	4,208	14,950	79	7	
-1,441	10,507	15,000	207	2	
416	9,626	15,100	193	-19	
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計	
19,576	130,718	0.9160	119,743	9,611	
昨日 P/C	0.9909	今日增減變化		-0.0749	

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

2022/11/21

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2022/11/21　　結算日：2022/11/30

OI 增減	Call	202211W5 履約價	Put	OI 增減	
0	1	13,700	2,116	991	※
-1	12	13,800	744	156	
-1	7	13,900	1,110	169	
2	18	14,000	1,307	379	
0	25	14,100	1,219	48	
42	44	14,150	746	9	
0	22	14,200	813	154	
1	3	14,250	828	36	
19	103	14,300	584	93	
7	39	14,350	478	66	
31	962	14,400	587	149	
1	155	14,450	427	202	
210	479	14,500	524	98	
141	597	14,550	238	65	
506	971	14,600	68	-2	
518	927	14,650	52	19	
241	693	14,700	179	61	
338	586	14,750	19	-1	
382	997	14,800	4	2	
590	815	14,850	0	0	
237	513	14,900	3	1	
347	1,216	14,950	1	0	
※ 641	1,603	15,000	4	0	
331	842	15,100	0	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,884	16,876	0.8605	14,522	3,196
昨日 P/C	0.9445	今日增減變化		-0.0840

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

2022/11/21

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/11/21　　結算日：2022/12/21

OI 增減	Call	202212 月 履約價	Put	OI 增減
0	409	13,000	4,881	133
-1	232	13,300	4,939	116
23	933	13,600	2,440	62
-9	4,019	14,000	4,157	264
-93	1,894	14,100	1,907	79
10	2,116	14,200	2,586	259
3	1,724	14,300	1,993	102
98	1,468	14,400	1,597	-192
102	3,741	14,500	1,920	-50
95	2,406	14,600	642	-70
-441	1,534	14,700	454	124
377	2,319	14,800	414	-4
335	2,534	14,900	203	50
218	4,477	15,000	116	9
-56	2,613	15,100	28	0
95	3,932	15,200	141	0
※ 2,539	7,054	15,300	38	0
605	3,486	15,400	517	0
28	1,549	16,400	117	0
0	498	17,400	91	0
0	810	18,400	192	0
10	1,190	19,400	4	0
0	432	20,400	0	0
1	9,554	21,400	0	0

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,911	97,537	0.8100	79,005	2,452
昨日 P/C	0.8265	今日增減變化		-0.0165

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

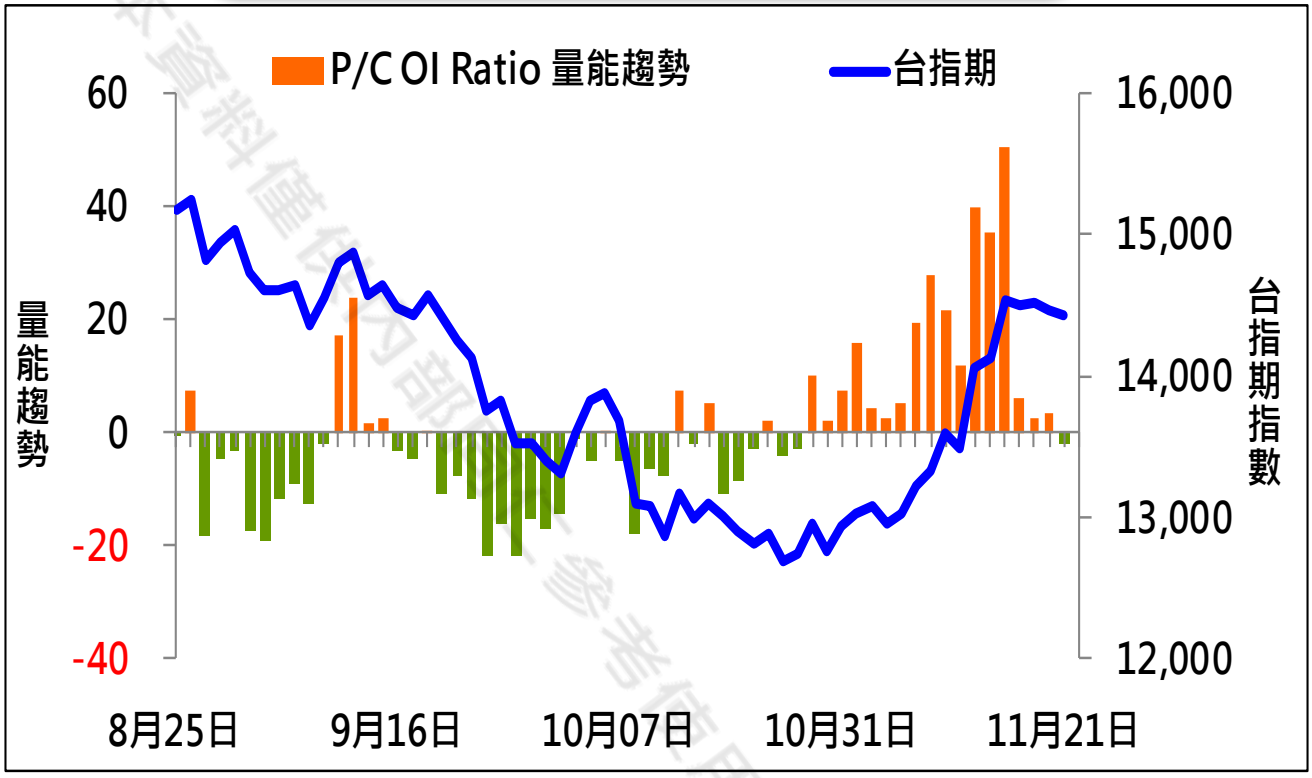
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

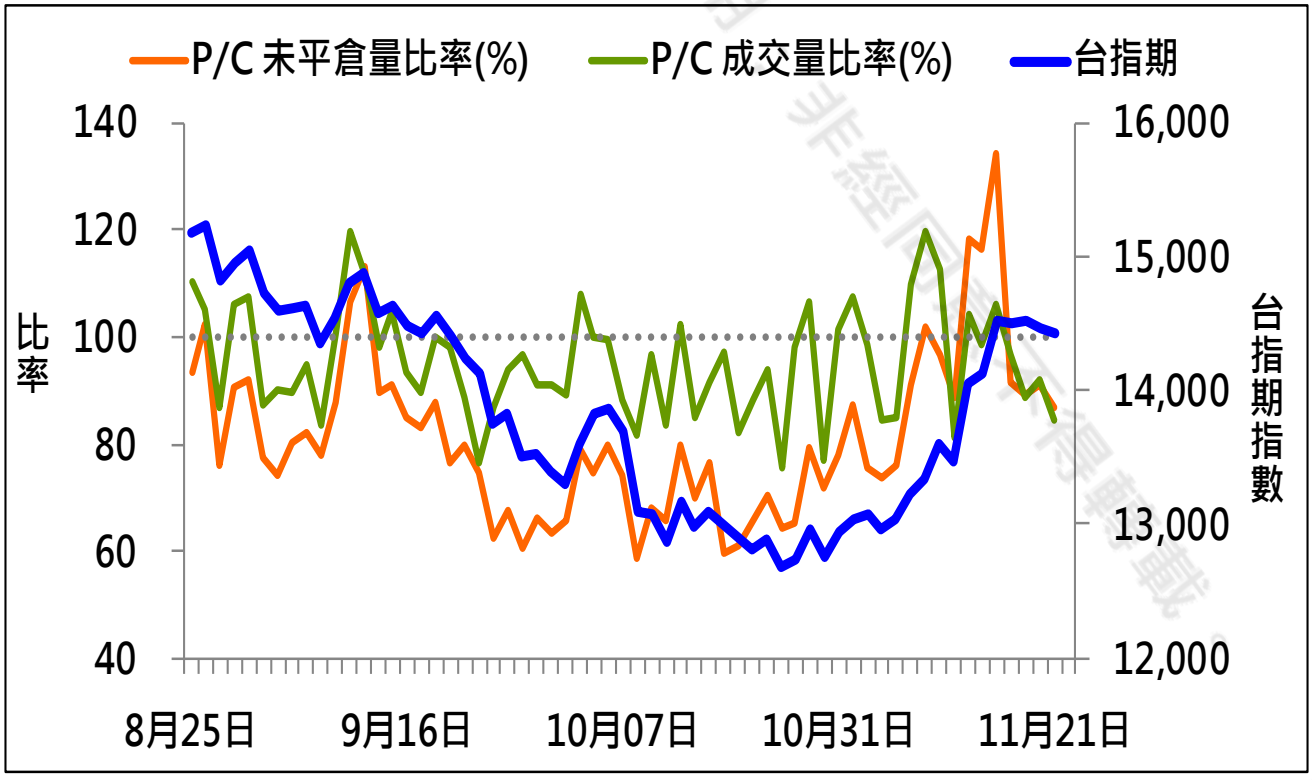
台指期貨暨選擇權日報

2022/11/21

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。

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