台指期貨暨選擇權日報

2022/11/22

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

11月22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	10,740	-685	1,441	0	-684	85
投信	-4,864	575	167	0	69	0
自營商	426	12	21	9	94	-16

11月22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	2	16	25,473	-1,110	5,286	-931
投信	0	0	-100	0	79	0
自營商	16	-6	-17,068	-6,251	21,247	2,949

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台積電	74.87	聯發科	-3.59
南亞	4.83	力積電	-1.27
鴻海	2.22	中華電	-1.24
開發金	2.07	光寶科	-1.21
長榮	2.04	英業達	-1.15
元大金	2.01	微星	-1.08
巨大	1.93	北極星藥業-KY	-0.84
台塑化	1.83	中租-KY	-0.83
聯電	1.80	統一超	-0.83
富邦金	1.80	友達	-0.74
前十名合計	95.39	後十名合計	-12.79

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	48.2%	47.4%
電子期前十大市場佔比	71.7%	72.9%
金融期前十大市場佔比	54.8%	65.5%
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

2022/11/22

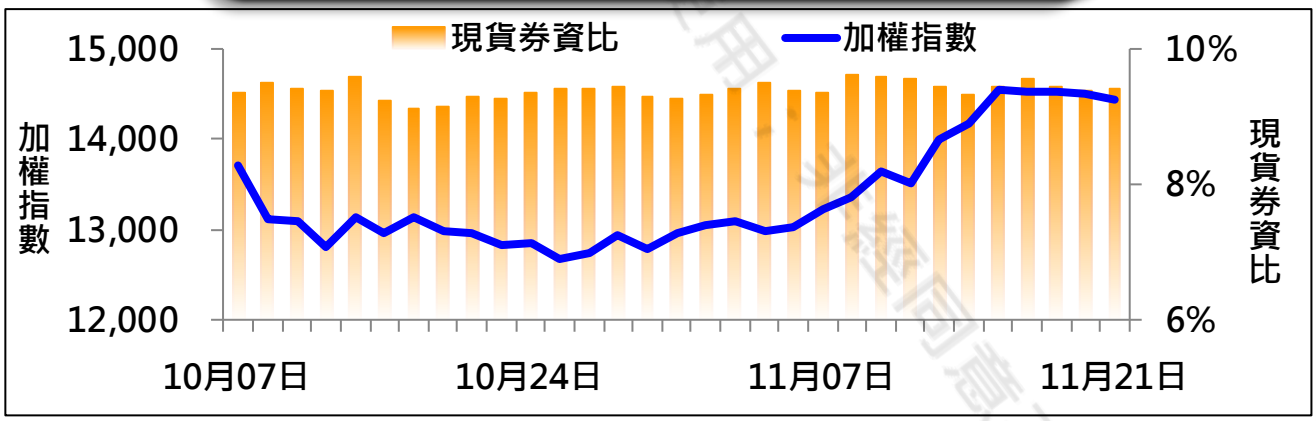
華南期貨 HUA NAN FUTURES

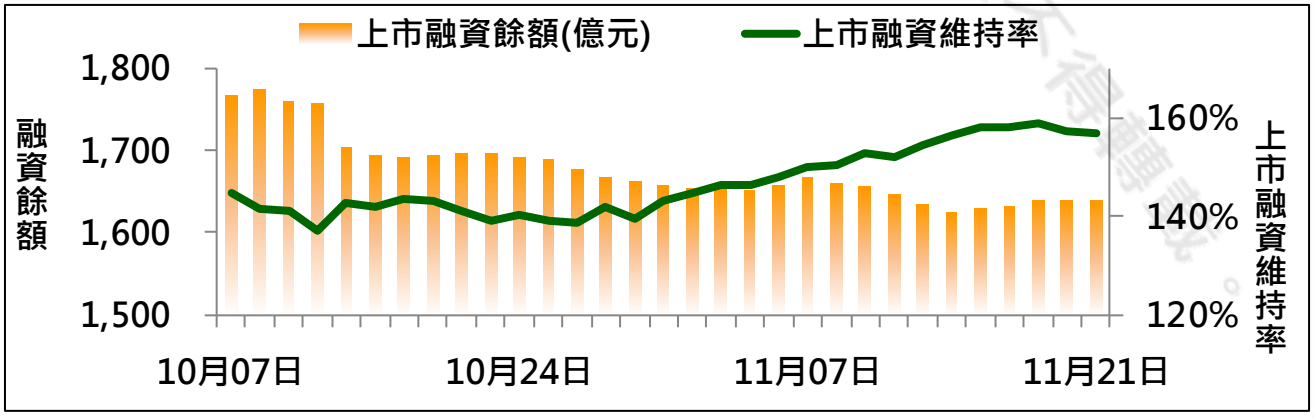
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月22日	5.9	10,740	-685	-10.8	426	12

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
11月22日	25,473	5,286	20,187	-17,068	21,247	-38,315

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

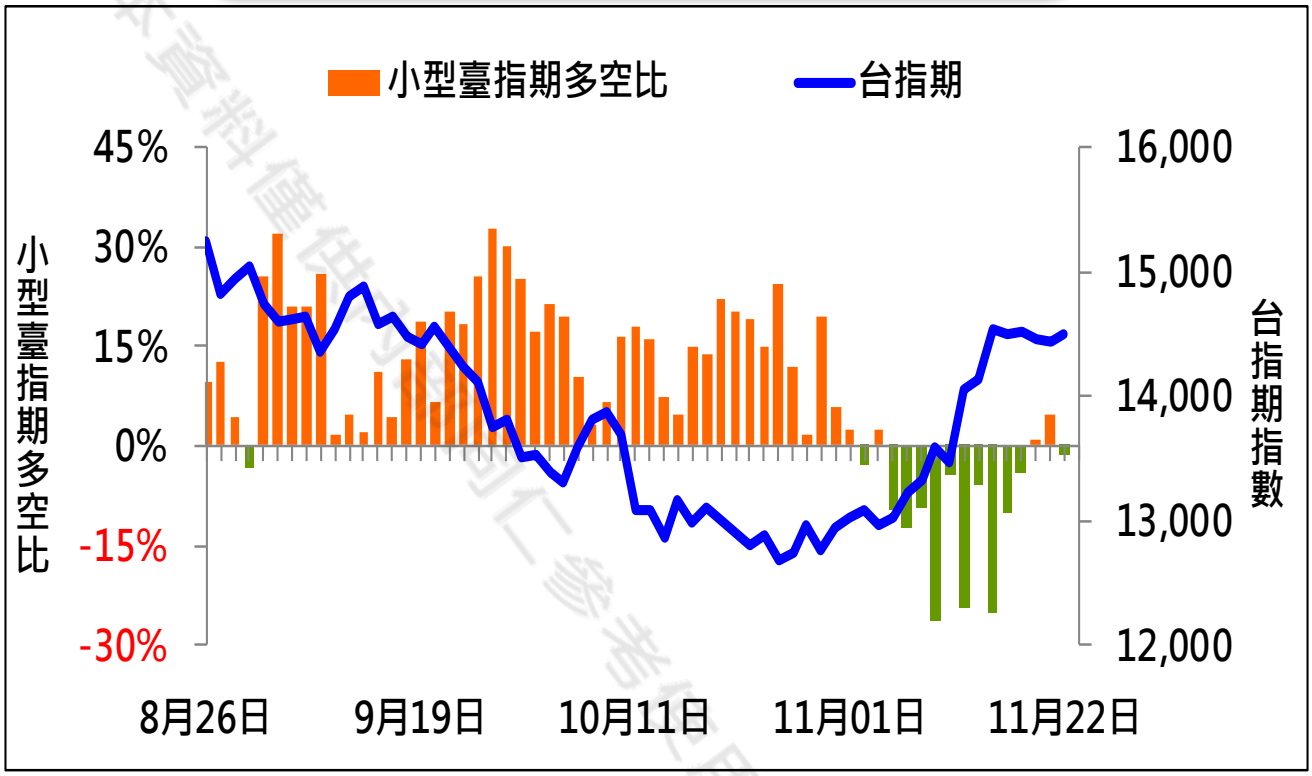
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

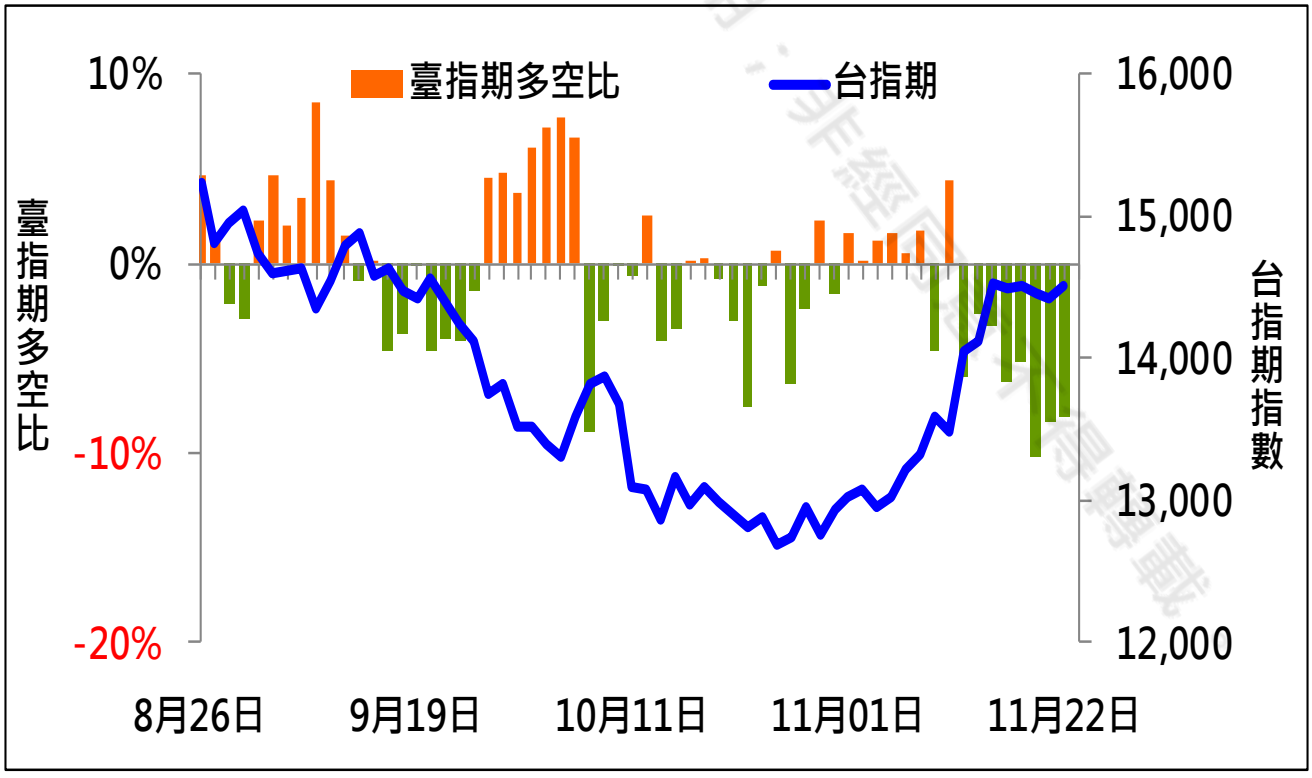
台指期貨暨選擇權日報

2022/11/22

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

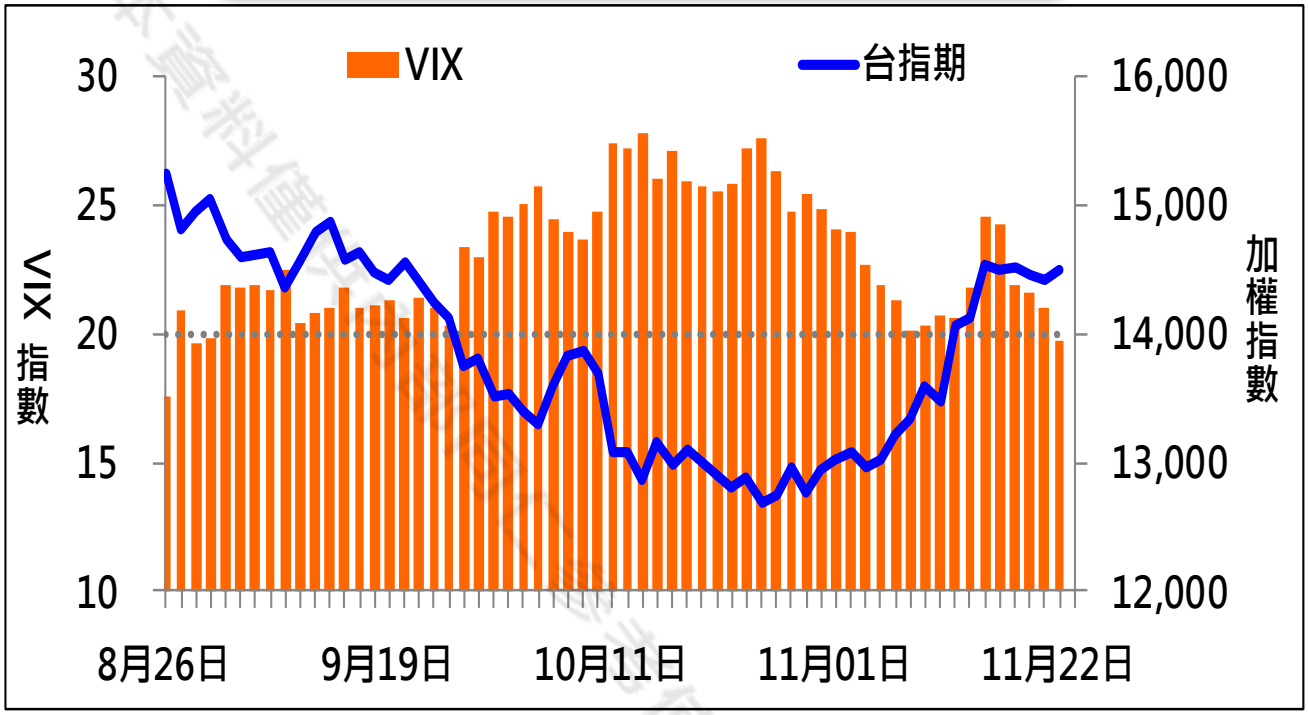
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

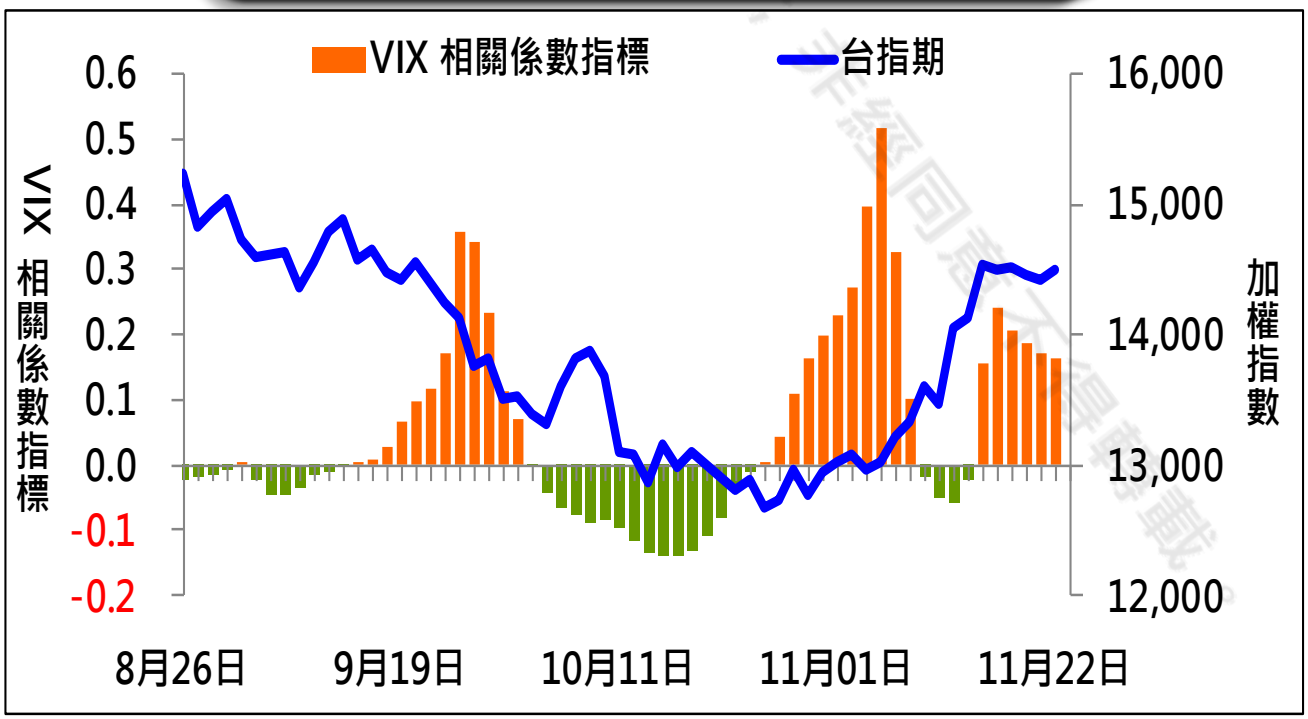
2022/11/22

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



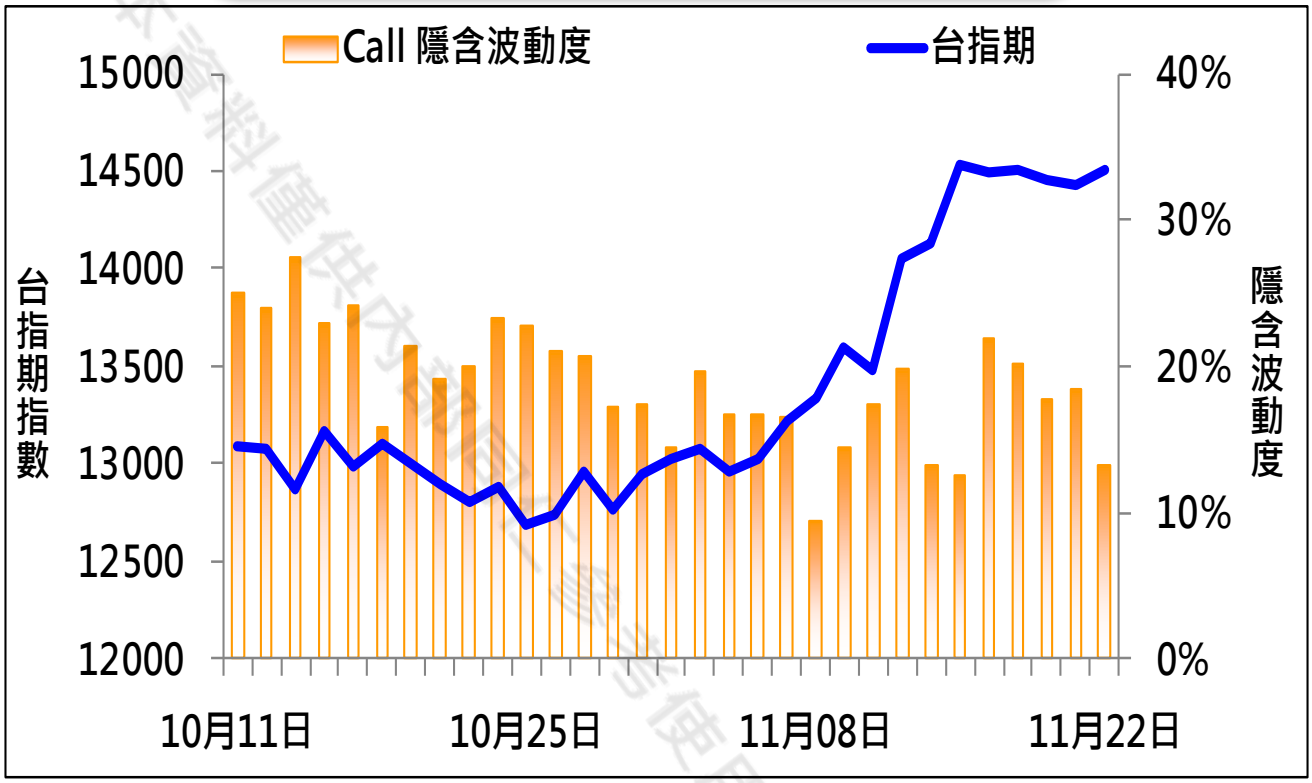
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

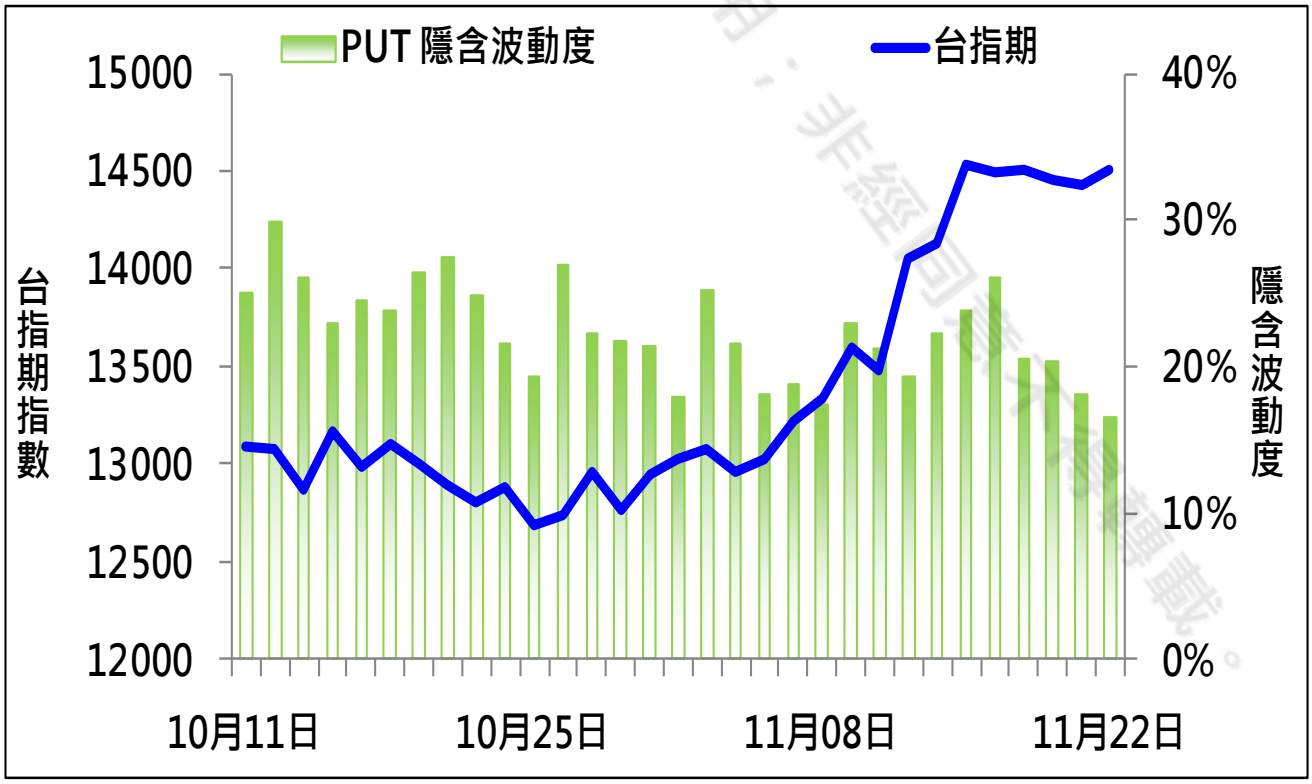
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL：02-27180000 FAX：02-25463700

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

2022/11/22

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/11/22　　結算日：2022/11/23

	OI 增減	Call	202211W4 履約價	Put	OI 增減	
	-2	284	13,950	3,300	-399	
	4	153	14,050	4,028	-649	
	-20	382	14,100	7,051	-1,834	
	10	194	14,150	4,721	-413	
	-86	674	14,200	7,940	-704	
	140	302	14,250	7,782	2,026	
	-121	534	14,300	9,949	3,433	
	274	898	14,350	5,685	1,332	
	811	3,070	14,400	8,862	3,093	
	1,614	3,784	14,450	7,852	4,756	※
	873	7,097	14,500	8,283	3,306	
	1,710	6,114	14,550	3,392	579	
	2,615	11,359	14,600	2,654	493	
※	2,787	9,505	14,650	1,144	-12	
	1,778	10,703	14,700	1,035	-473	
	-1,175	6,907	14,750	321	-30	
	-1,131	8,948	14,800	307	88	
	598	6,991	14,850	160	-8	
	-1,044	6,838	14,900	60	11	
	-444	3,764	14,950	78	-1	
	-1,819	8,688	15,000	204	-3	
	-1,770	7,856	15,100	192	-1	
	-201	7,733	15,200	38	0	
	-311	5,659	15,300	5	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,789	135,507	0.9595	130,015	10,272
昨日 P/C	0.9160	今日增減變化		0.0434

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

2022/11/22

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2022/11/22　　結算日：2022/11/30

OI 增減	Call	202211W5 履約價	Put	OI 增減	
0	1	13,700	2,172	56	
0	12	13,800	958	214	
0	7	13,900	1,275	165	
8	26	14,000	1,727	420	
6	6	14,050	428	428	※
25	50	14,100	1,443	224	
2	46	14,150	804	58	
17	39	14,200	1,047	234	
11	14	14,250	977	149	
26	129	14,300	759	175	
22	61	14,350	611	133	
142	1,104	14,400	743	156	
141	296	14,450	700	273	
148	627	14,500	642	118	
95	692	14,550	307	69	
431	1,402	14,600	114	46	
146	1,073	14,650	68	16	
290	983	14,700	214	35	
237	823	14,750	25	6	
179	1,176	14,800	4	0	
123	938	14,850	3	3	
※ 983	1,496	14,900	9	6	
222	1,438	14,950	1	0	
582	2,185	15,000	4	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,977	20,853	0.8496	17,716	3,194
昨日 P/C	0.8605	今日增減變化		-0.0109

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

2022/11/22

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/11/22　　結算日：2022/12/21

OI 增減	Call	202212 月 履約價	Put	OI 增減
1	410	13,000	4,556	-325
0	232	13,300	5,005	66
-2	931	13,600	2,411	-29
-3	1,614	13,900	1,686	217
19	1,913	14,100	2,052	145
11	2,127	14,200	2,705	119
34	1,758	14,300	2,047	54
339	1,807	14,400	1,612	15
152	3,893	14,500	2,061	141
103	2,509	14,600	1,098	456
165	1,699	14,700	670	216
384	2,703	14,800	544	130
96	2,630	14,900	200	-3
※ 1,182	5,659	15,000	121	5
-414	2,199	15,100	37	9
-99	3,833	15,200	139	-2
-194	6,860	15,300	40	2
-12	3,474	15,400	519	2
-81	1,468	16,400	117	0
0	498	17,400	91	0
0	810	18,400	192	0
0	1,190	19,400	4	0
0	432	20,400	0	0
13	9,567	21,400	0	0

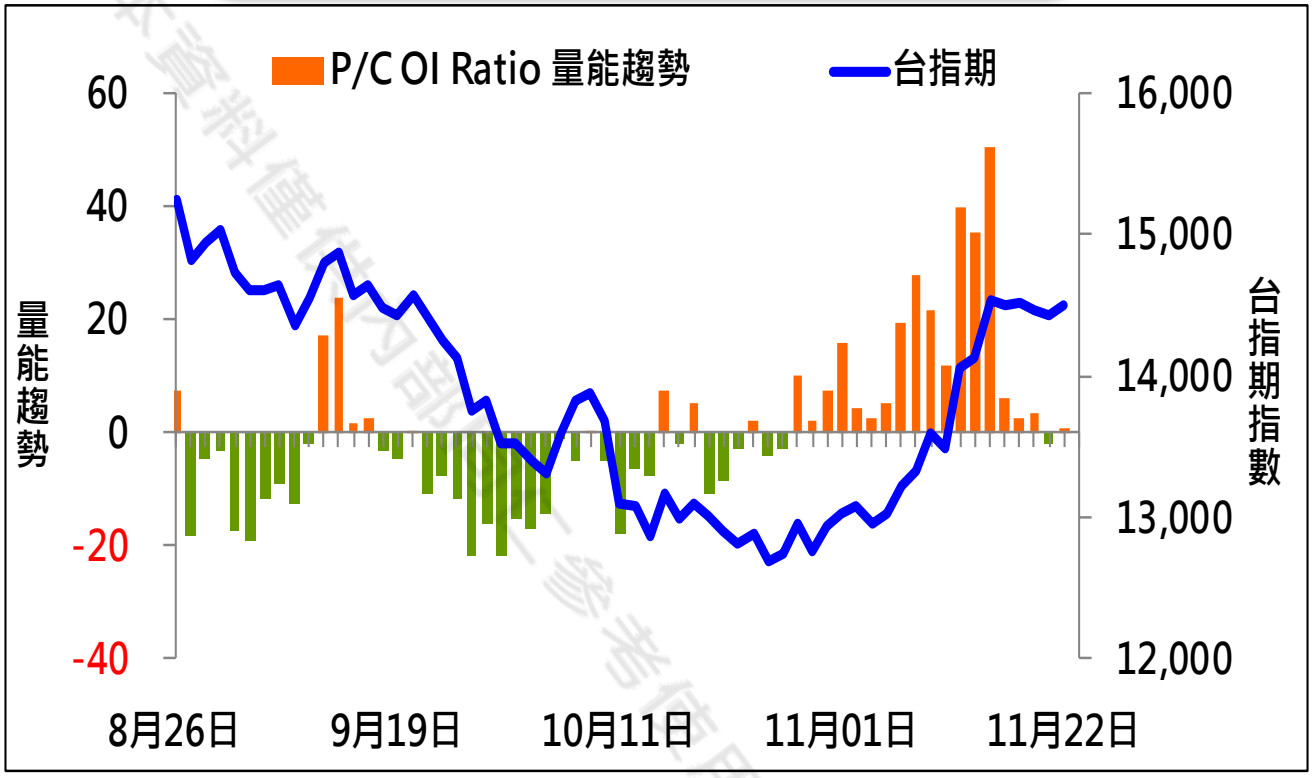
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
2,031	99,568	0.8489	84,521	5,516
昨日 P/C	0.8100	今日增減變化		0.0389

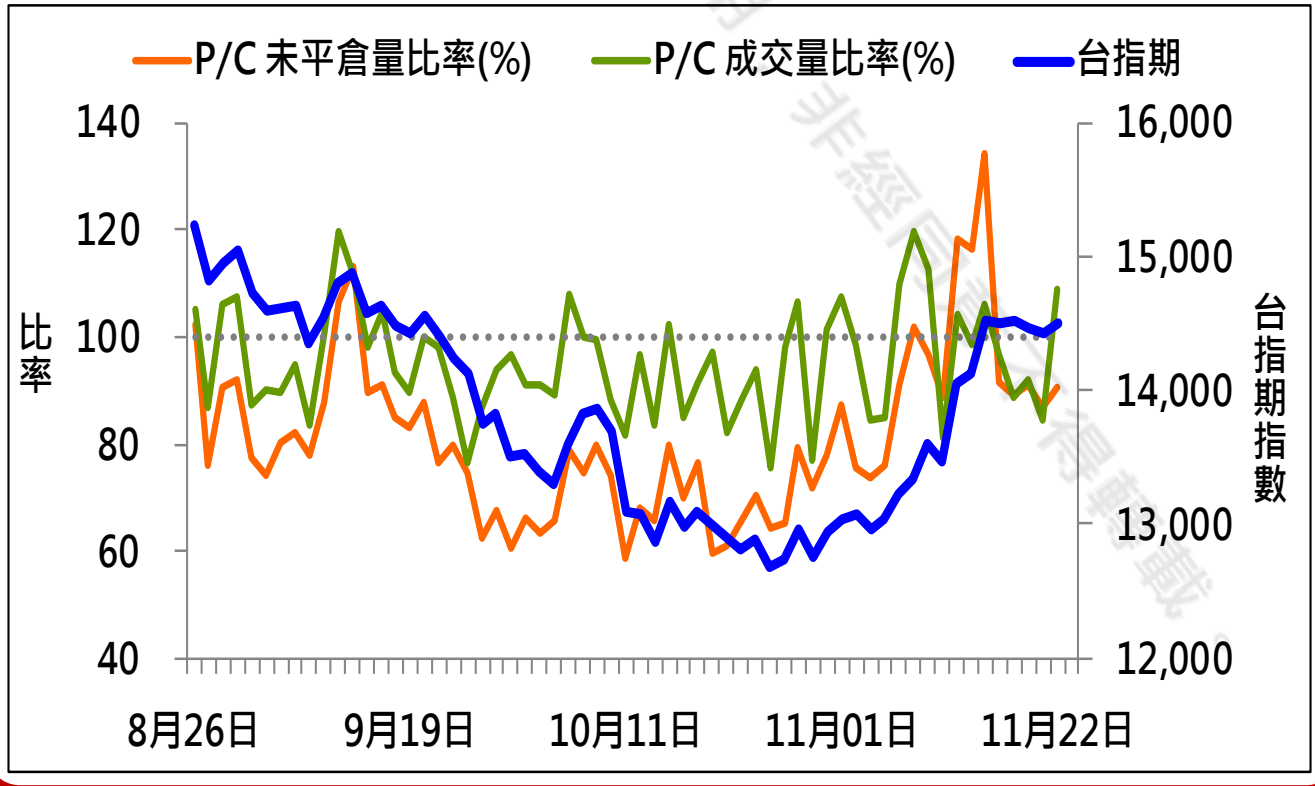
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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