台指期貨暨選擇權日報

2022/11/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

法人籌碼動態

11月29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	11,190	1,978	979	-108	-478	160
投信	-3,972	201	161	0	69	0
自營商	1,396	-1,145	-56	-27	136	3

11月29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	-31	-3	33,160	1,238	8,289	685
投信	0	0	100	0	79	0
自營商	22	9	-25,722	-383	10,736	-9,606

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
台積電	54.08	欣興	-2.13
富邦金	7.63	矽力*-KY	-1.40
國泰金	6.84	南亞科	-1.29
聯發科	5.13	南電	-1.24
中信金	4.17	台勝科	-1.18
台達電	4.17	瑞昱	-1.15
中鋼	4.05	美時	-1.00
中華電	3.73	金像電	-0.79
長榮航	3.52	華新	-0.60
和泰車	2.98	巨大	-0.48
前十名合計	96.30	後十名合計	-11.28

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	46.7%	45.0%
電子期前十大市場佔比	72.1%	64.8%
金融期前十大市場佔比	56.7%	59.2%
非金電期前十大市場佔比	100.0%	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

2022/11/29

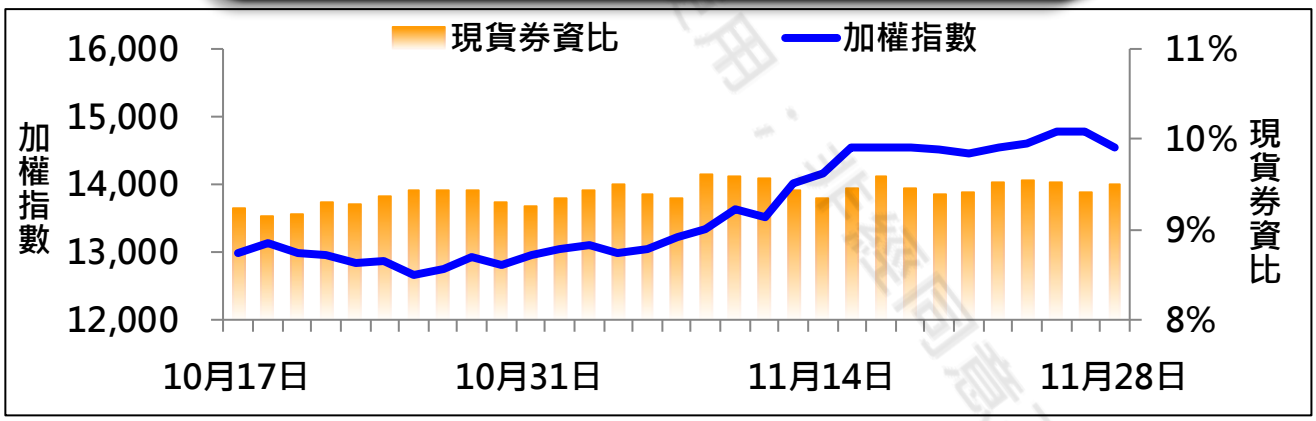
華南期貨 HUA NAN FUTURES

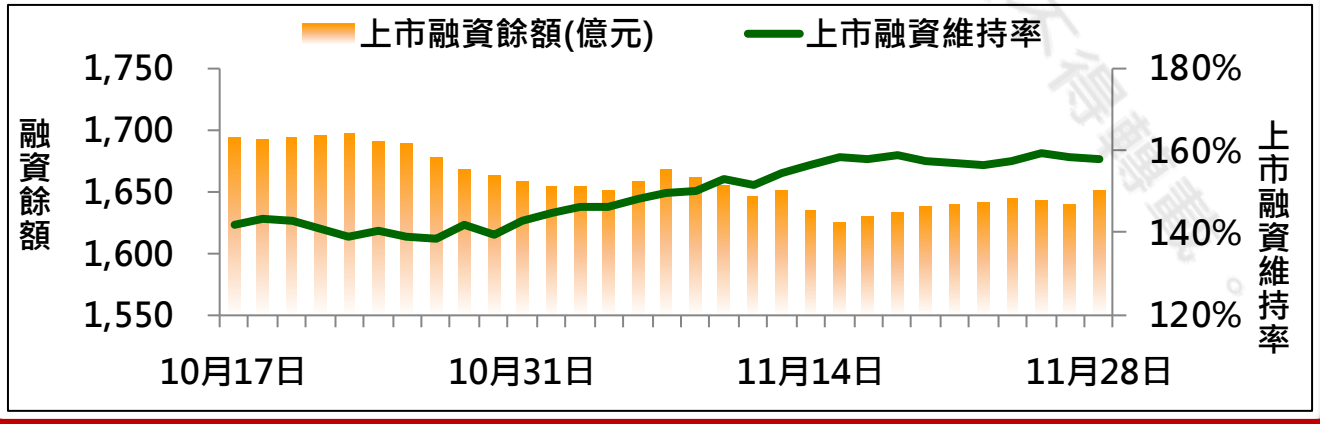
法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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23日	21.3	11,530	790	-4.5	1,577	1,151
11月24日	233.1	7,391	-4,139	-3.9	2,080	503
11月25日	-0.7	4,750	-2,641	-55.3	1,752	-328
11月28日	-107.7	9,212	4,462	-44.6	2,541	789
11月29日	83.6	11,190	1,978	16.8	1,396	-1,145

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23日	26,496	5,304	21,192	-19,213	22,737	-41,950
11月24日	29,271	7,293	21,978	-28,032	25,412	-53,444
11月25日	30,522	7,473	23,049	-27,721	22,683	-50,404
11月28日	31,922	7,604	24,318	-25,339	20,342	-45,681
11月29日	33,160	8,289	24,871	-25,722	10,736	-36,458

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

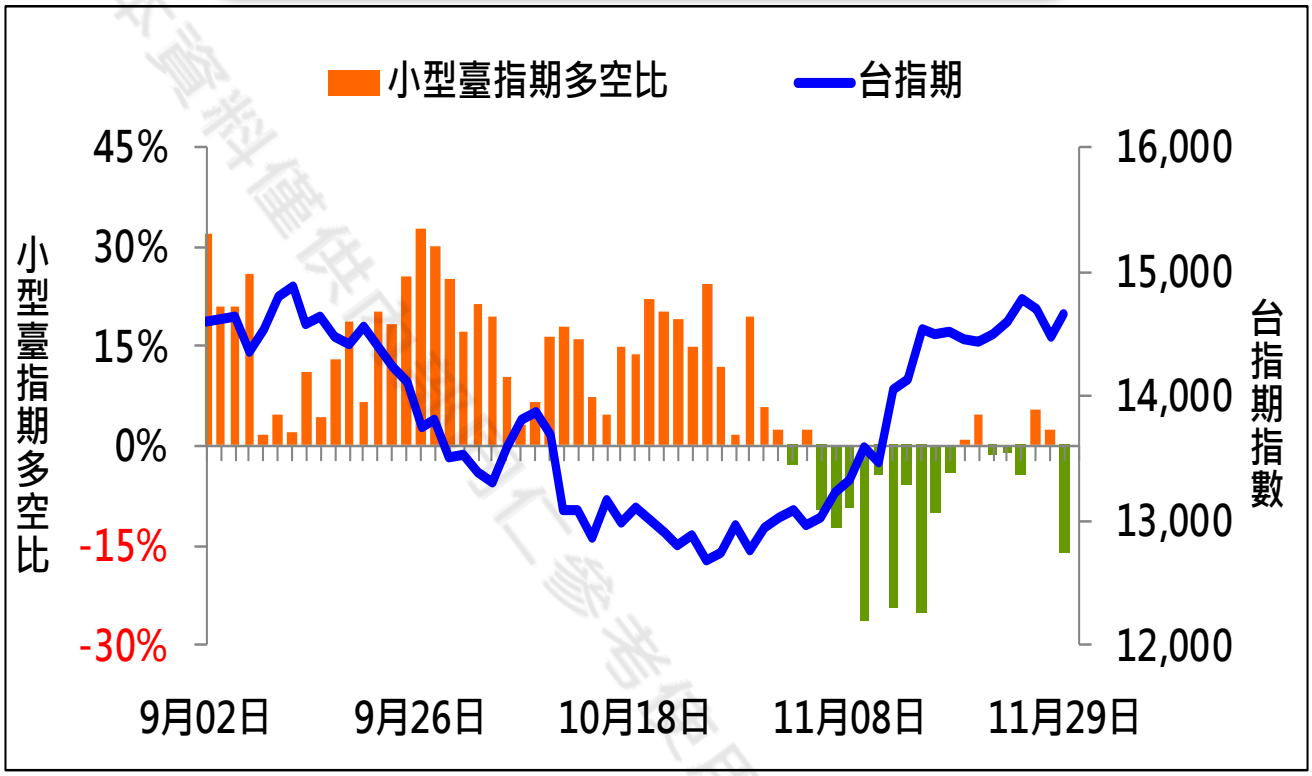
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

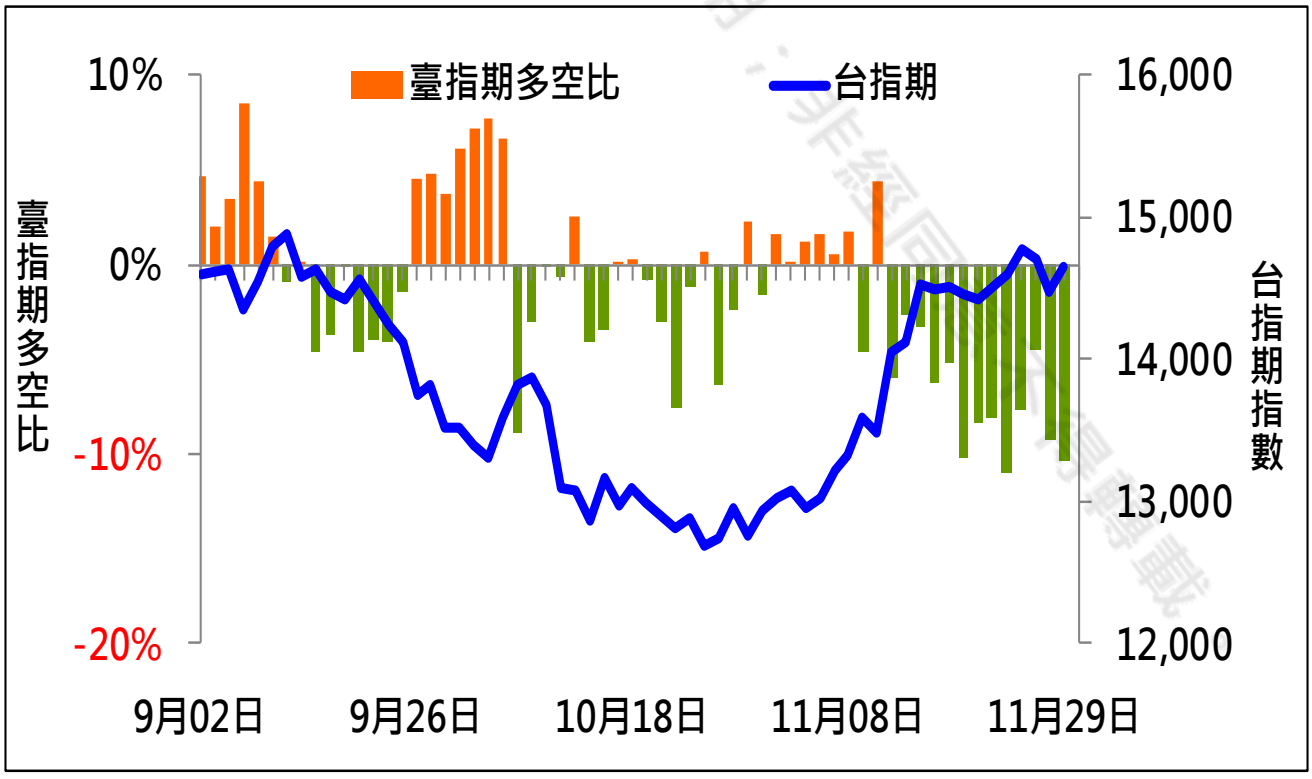
台指期貨暨選擇權日報

2022/11/29

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

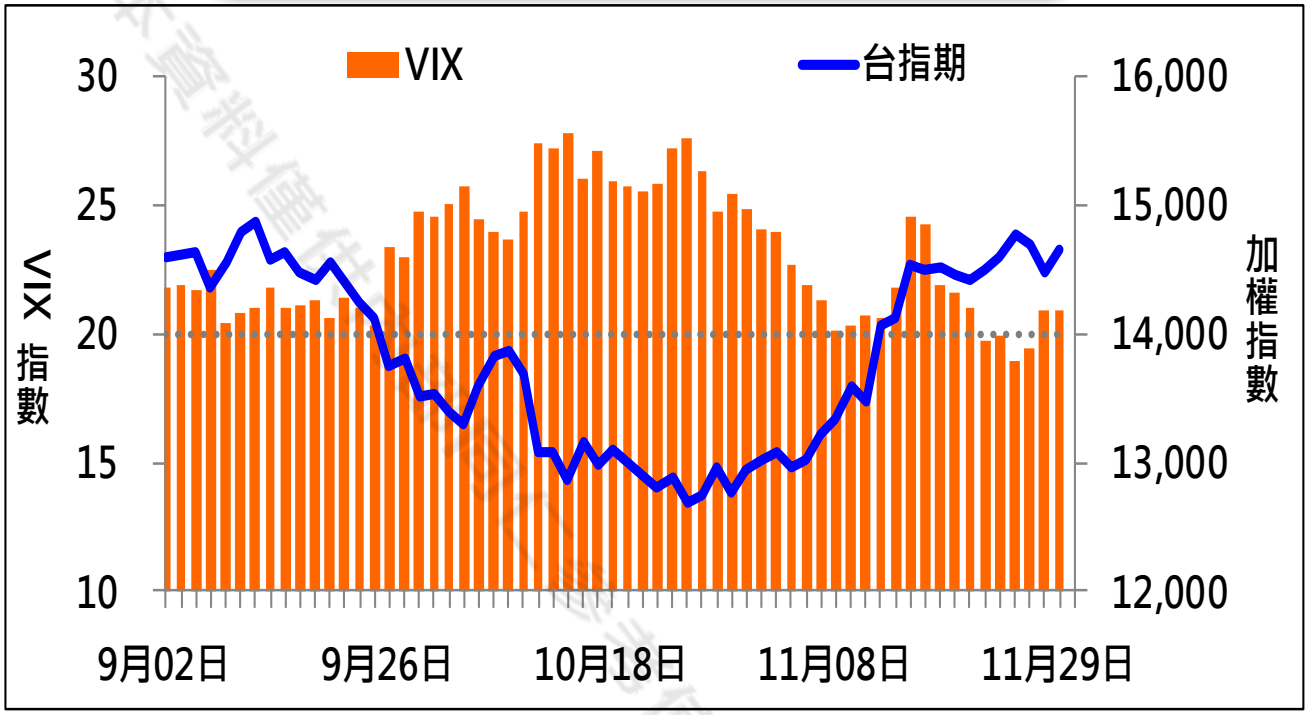
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

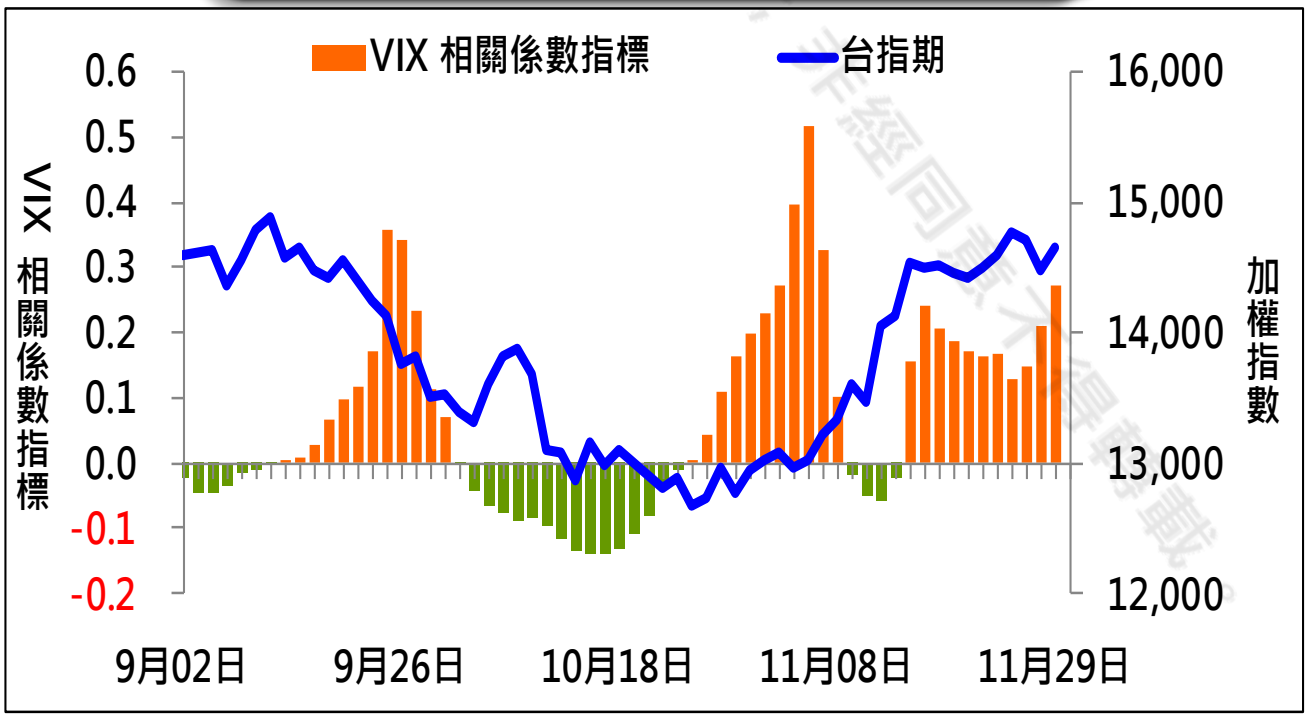
2022/11/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標

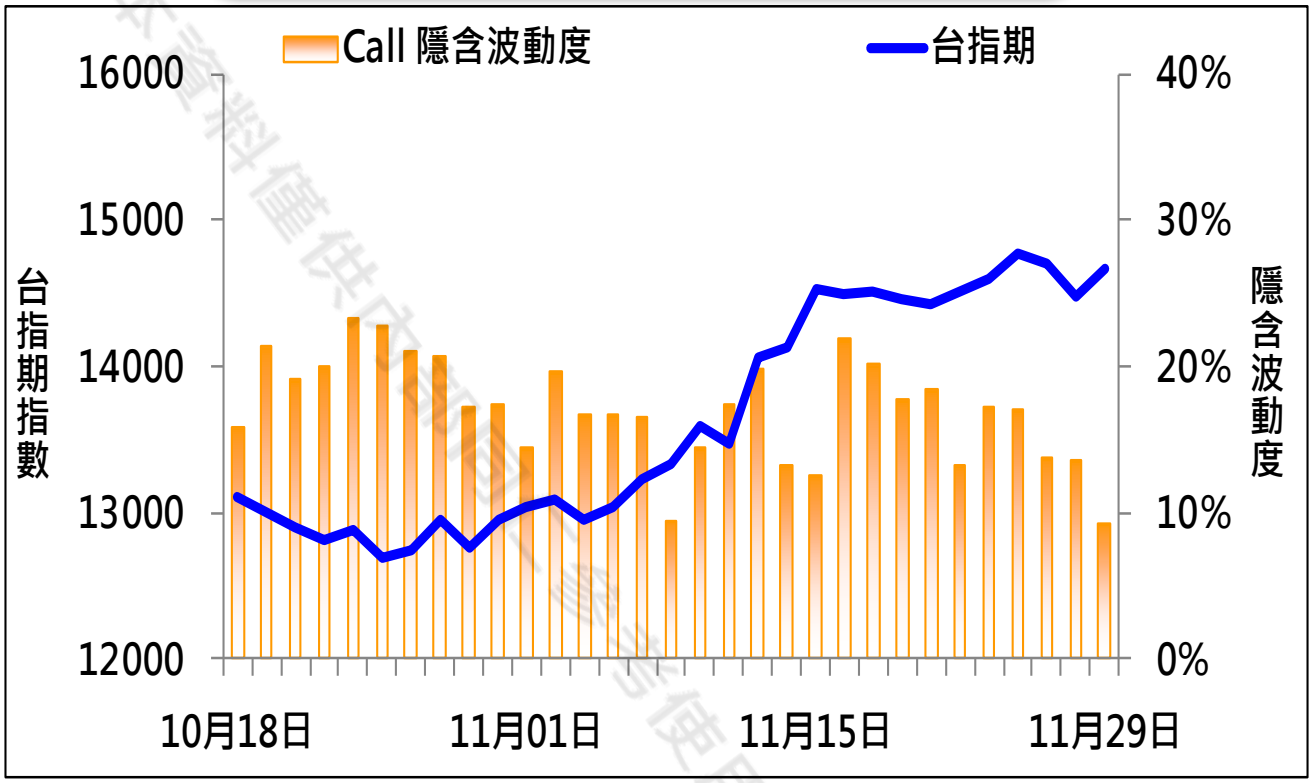


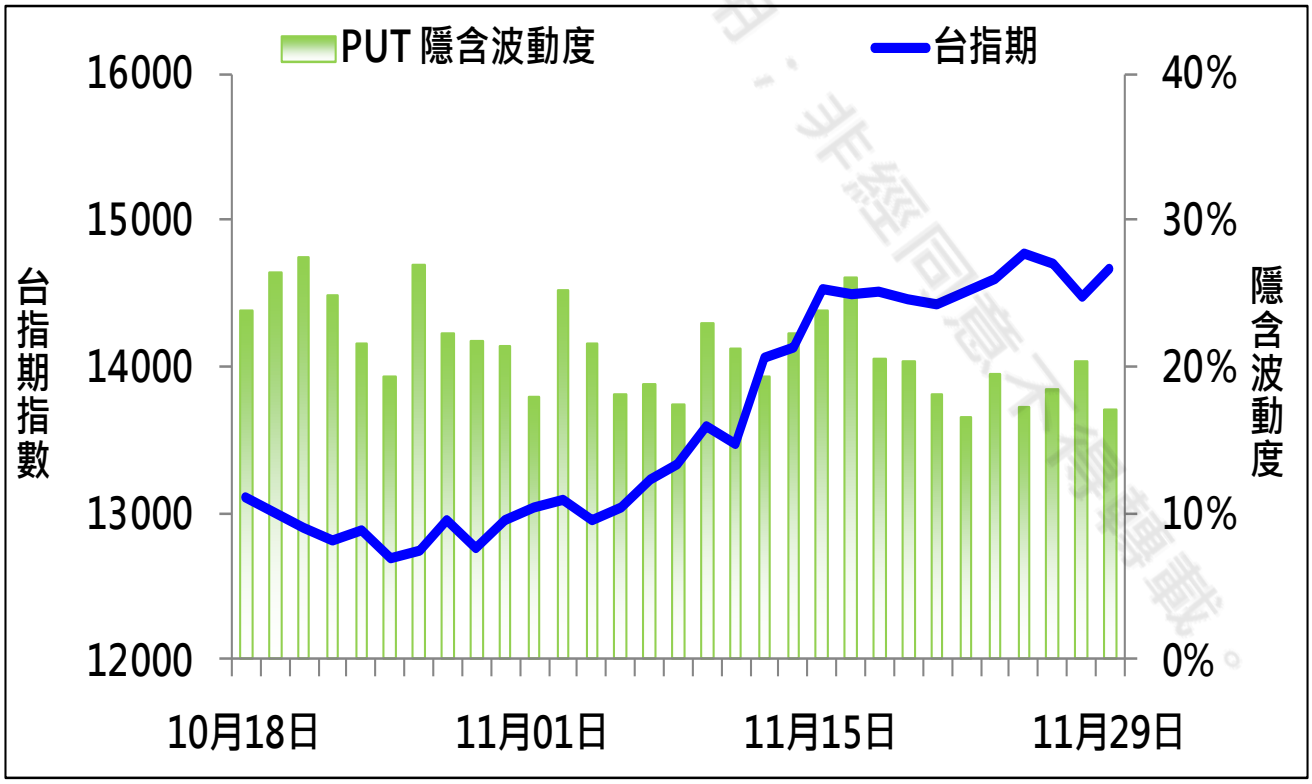
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

2022/11/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

週選擇權OI變化

日期：2022/11/29　　結算日：2022/11/30

	OI 增減	Call	202211W5 履約價	Put	OI 增減	
	0	21	14,000	4,464	-2,200	
	-4	40	14,100	4,033	-250	
	21	129	14,200	7,464	880	
	-1	197	14,300	8,778	2,092	
	124	424	14,350	6,643	-123	
	232	1,421	14,400	9,974	1,434	
	575	1,122	14,450	11,867	5,250	※
	887	4,259	14,500	13,294	4,099	
	-2,070	4,392	14,550	9,077	3,172	
	-1,002	4,698	14,600	10,726	4,573	
	402	5,435	14,650	7,895	4,980	
※	2,266	9,761	14,700	6,562	4,122	
	1,346	9,237	14,750	3,219	1,521	
	1,809	13,770	14,800	2,318	297	
	-1,105	8,119	14,850	446	-67	
	-1,644	7,675	14,900	263	-3	
	-305	5,004	14,950	168	43	
	-3,217	7,820	15,000	250	12	
	-757	2,381	15,050	40	0	
	-1,097	7,519	15,100	37	7	
	-137	2,174	15,150	1	1	
	-809	7,017	15,200	25	0	

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
-5,347	118,999	1.1090	131,969	29,691
昨日 P/C	0.8225	今日增減變化		0.2865

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

2022/11/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

雙週選擇權OI變化

日期：2022/11/29　　結算日：2022/12/7

OI 增減	Call	202212W1 履約價	Put	OI 增減
0	2	13,900	949	491
15	40	14,000	1,922	315
3	16	14,100	1,559	509
5	16	14,150	999	439
8	22	14,200	1,549	687
2	11	14,250	1,034	439
8	37	14,300	1,547	672
-3	92	14,350	677	393
32	103	14,400	975	468
10	63	14,450	715	452
31	134	14,500	759	468
92	157	14,550	306	151
169	334	14,600	327	101
304	725	14,650	339	87
413	601	14,700	193	114
-17	578	14,750	98	24
257	694	14,800	93	-6
340	679	14,850	101	0
430	1,049	14,900	42	-1
363	1,281	14,950	27	1
319	1,721	15,000	41	-2
345	850	15,050	0	0
436	1,396	15,100	1	0
471	1,263	15,200	0	0

增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,435	15,695	1.1202	17,582	7,372
昨日 P/C	0.9067	今日增減變化		0.2135

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

2022/11/29

華南期貨 HUA NAN FUTURES

近月選擇權OI變化

日期：2022/11/29　　結算日：2022/12/21

OI 增減	Call	202212 月 履約價	Put	OI 增減
-25	3,425	14,000	7,191	470
-17	1,823	14,100	3,041	-22
-2	2,197	14,200	6,116	518
95	1,860	14,300	3,033	-120
83	1,622	14,400	2,543	330
-142	3,398	14,500	2,534	181
366	3,086	14,600	2,268	261
29	2,843	14,700	995	109
340	3,611	14,800	1,037	-9
474	3,337	14,900	497	38
437	6,007	15,000	489	31
※ 652	3,595	15,100	178	5
297	5,629	15,200	177	23
298	4,100	15,400	520	2
-58	3,228	15,600	56	2
-42	3,330	15,800	407	0
45	3,766	16,000	24	-2
123	1,224	16,200	30	0
-4	1,483	16,400	117	0
0	547	17,400	91	0
0	810	18,400	192	0
0	1,200	19,400	4	0
0	432	20,400	0	0
69	9,639	21,400	0	0

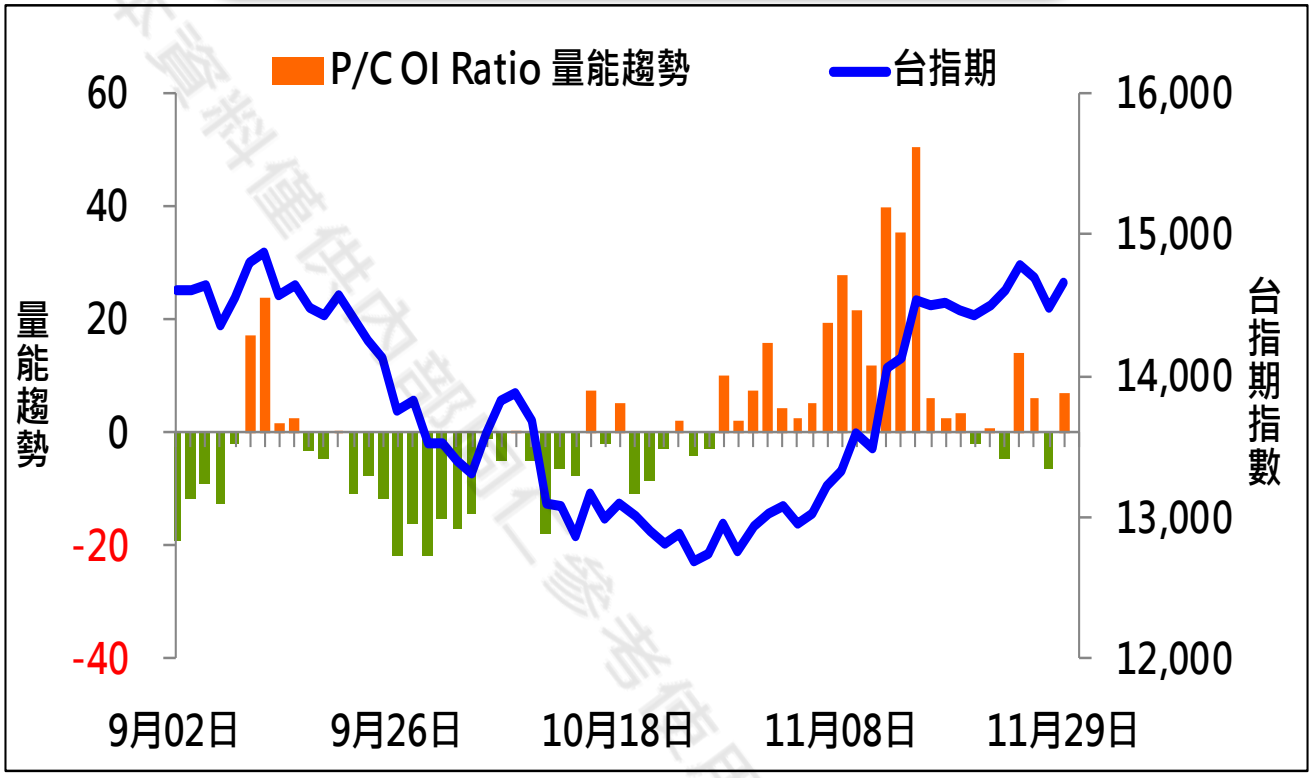
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,905	114,160	0.9638	110,029	3,716
昨日 P/C	0.9642	今日增減變化		-0.0004

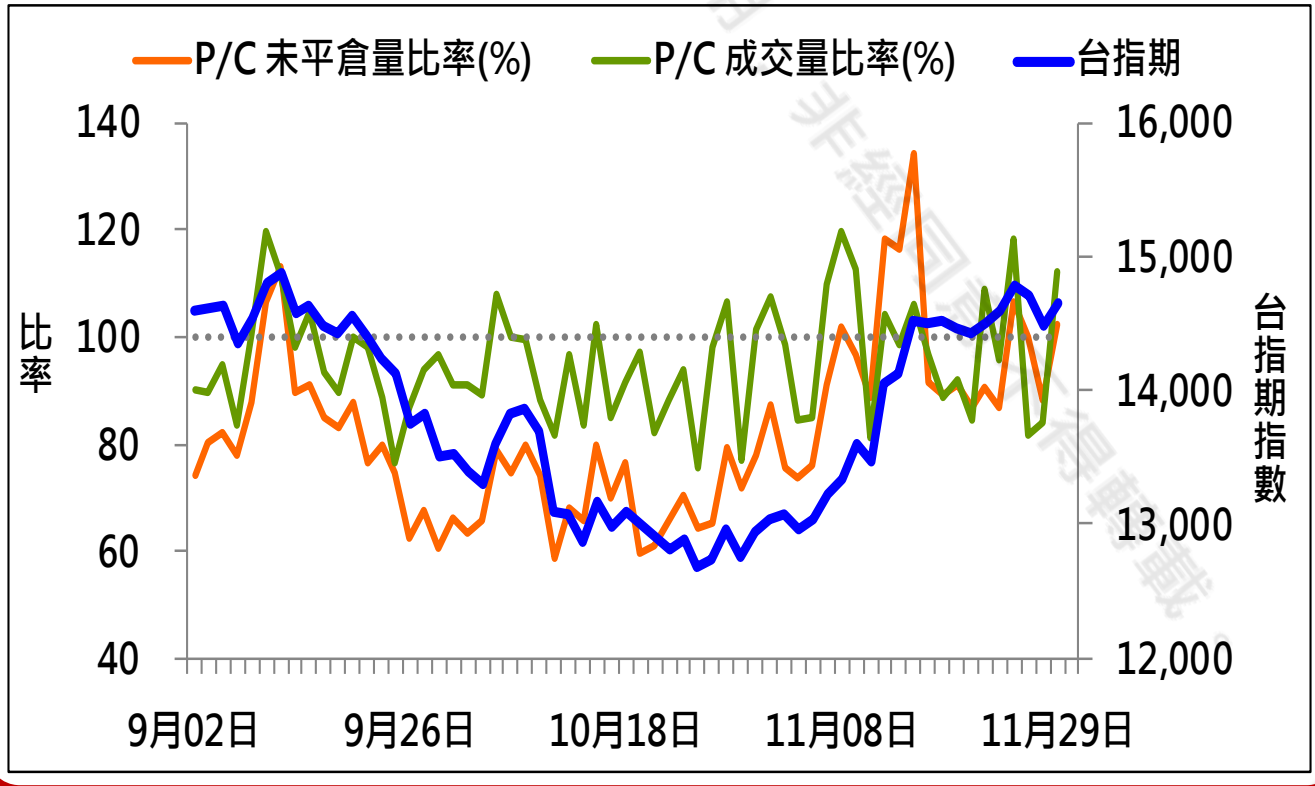
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

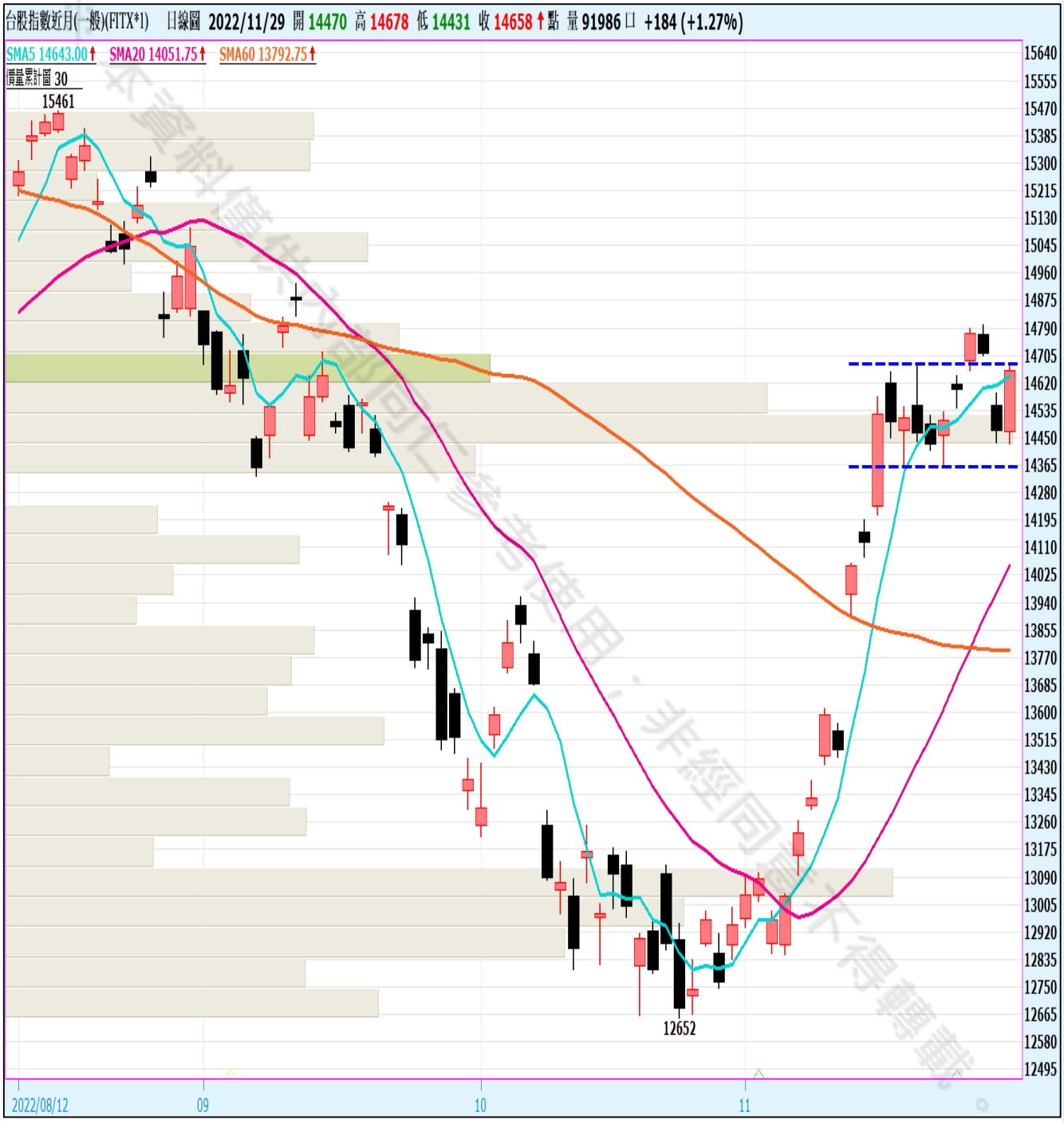
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

台指期貨暨選擇權日報

2022/11/29

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