



## 法人籌碼動態

05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	-2,540	2,979	-226	99	-668	-259
投信	-10,030	292	136	0	14	0
自營商	12,636	-1,747	-199	4	-155	144
05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	53	3	12,874	1,770	36,279	428
投信	1	0	0	0	965	0
自營商	-43	-37	6,590	9,160	-7,528	-1,975

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台積電	76.70	長榮	-10.43	台指期前十大 市場佔比	49.2%	48.0%
矽力-KY	7.60	聯發科	-9.46			
研華	3.05	廣達	-7.24			
台塑化	2.50	國泰金	-5.32	電子期前十大 市場佔比	51.0%	59.5%
聯電	2.46	陽明	-5.16			
鴻海	2.28	富邦金	-4.85			
旭隼	2.15	萬海	-4.41	金融期前十大 市場佔比	50.7%	54.2%
瑞昱	1.76	南亞	-2.09			
台達電	1.71	玉山金	-1.54			
華新	1.69	聯詠	-1.50	非金電期前十大 市場佔比	96.1%	93.5%
前十名合計	101.91	後十名合計	-51.99			

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



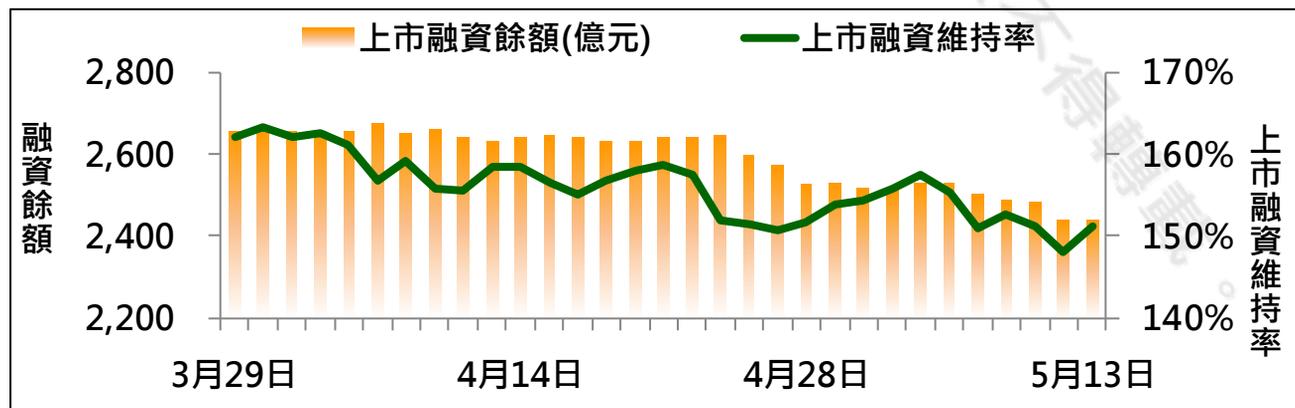
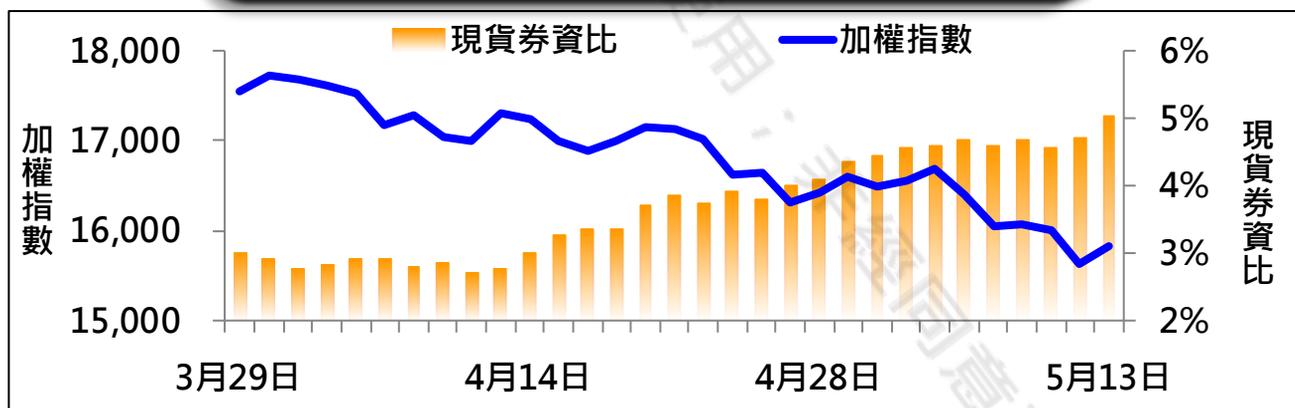
## 法人現貨、期貨 & 選擇權籌碼變化

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)
05月10日	-16.1	-12,886	-4,721	11.2	15,899	1,596
05月11日	-150.8	-9,158	3,728	-7.5	15,859	-40
05月12日	-103.2	-6,639	2,519	-60.0	15,187	-672
05月13日	28.0	-5,519	1,120	31.9	14,383	-804
05月16日	-16.7	-2,540	2,979	-8.7	12,636	-1,747

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
05月10日	11,089	35,138	-24,049	-10,596	15,123	-25,719
05月11日	5,853	33,583	-27,730	-5,895	4,198	-10,093
05月12日	8,142	33,343	-25,201	-4,879	-3,031	-1,848
05月13日	11,104	35,851	-24,747	-2,570	-5,553	2,983
05月16日	12,874	36,279	-23,405	6,590	-7,528	14,118

## 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。

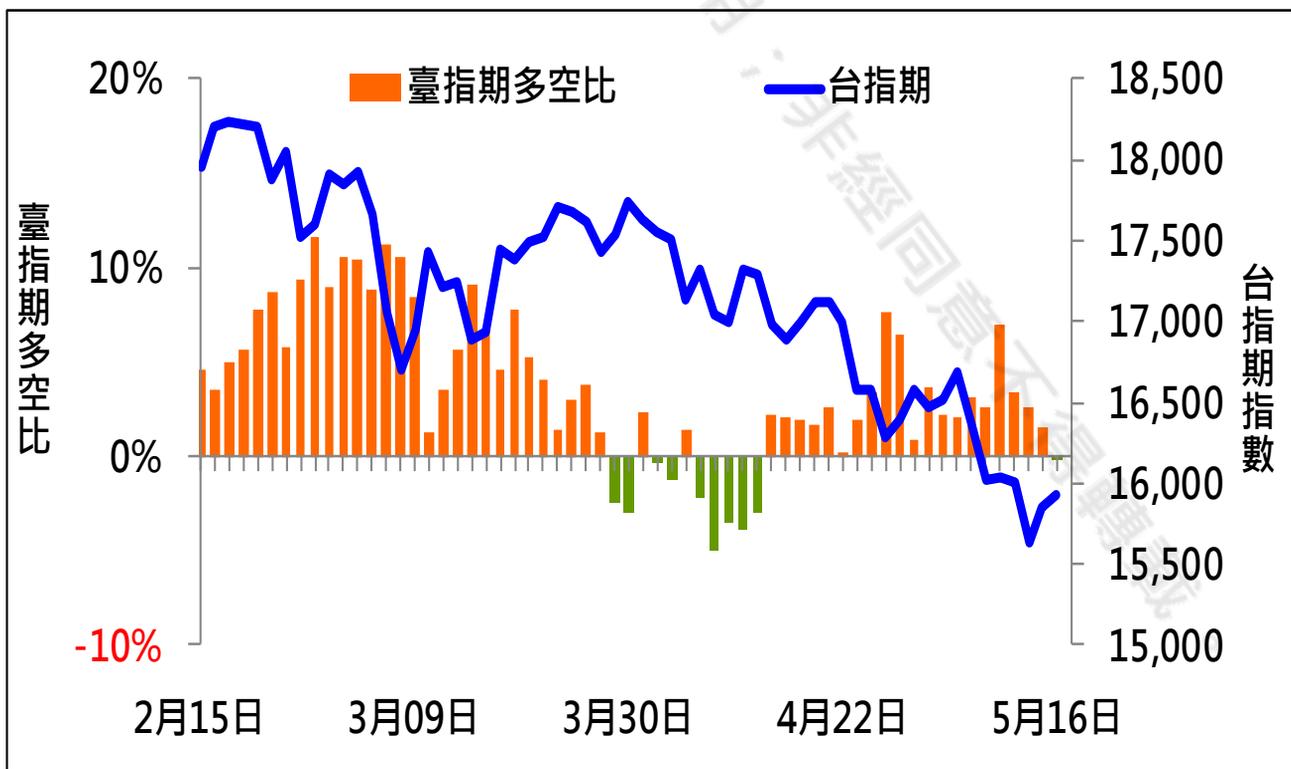
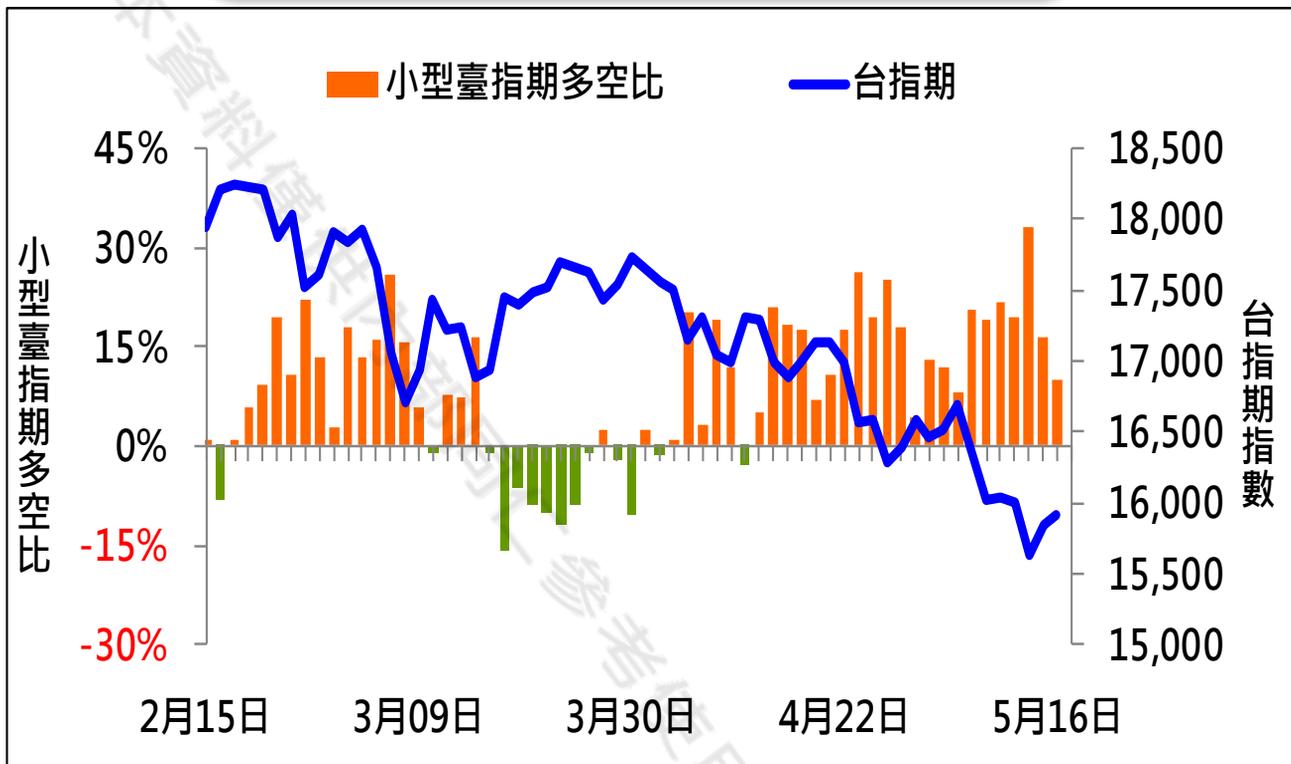
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



## 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。

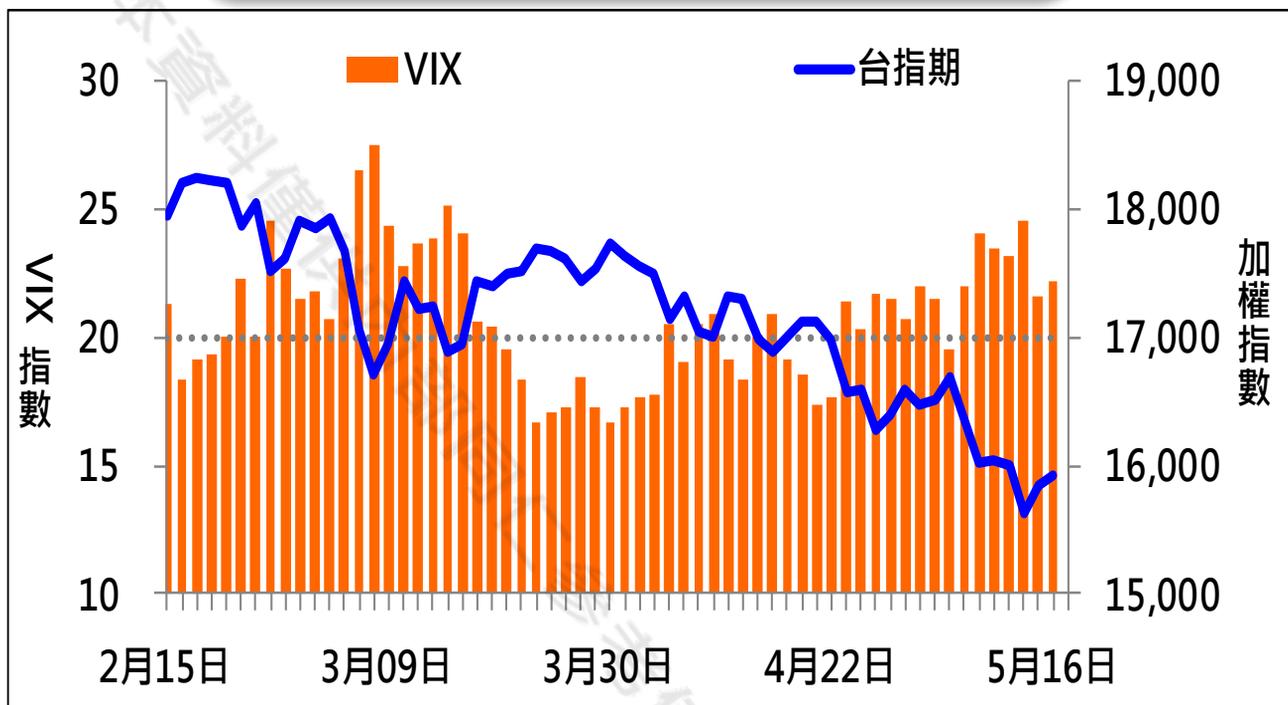
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

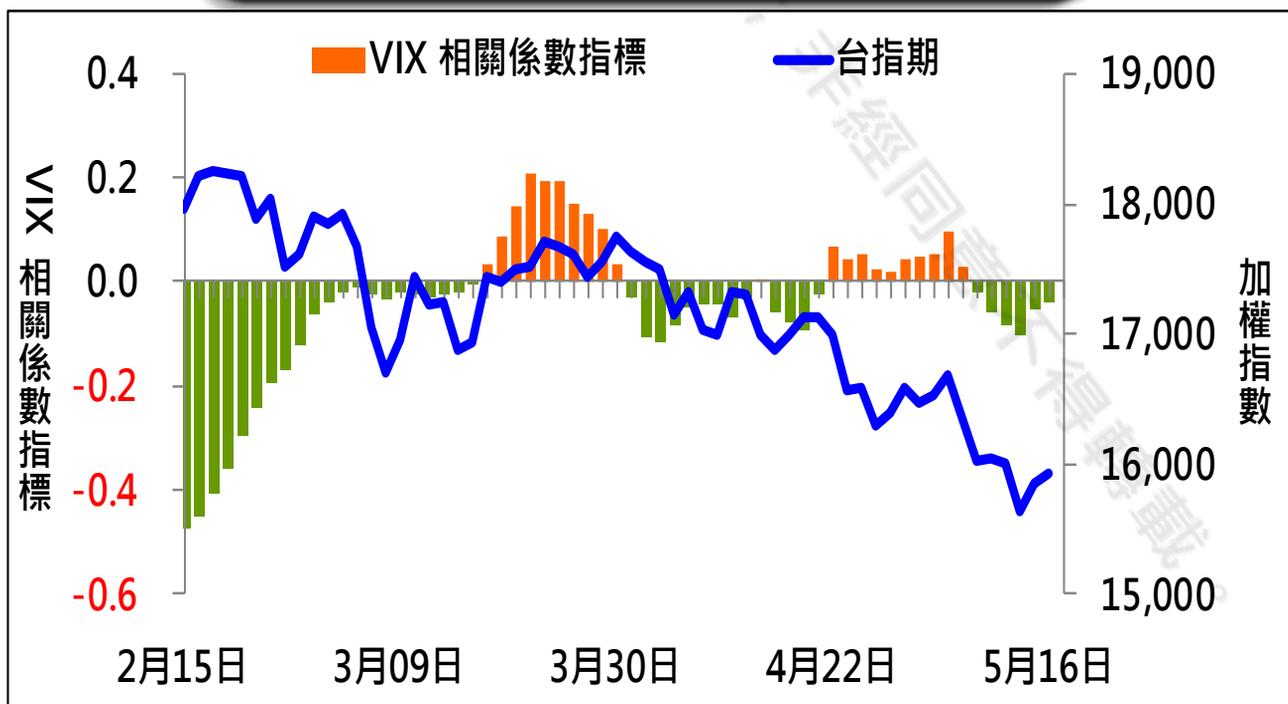
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



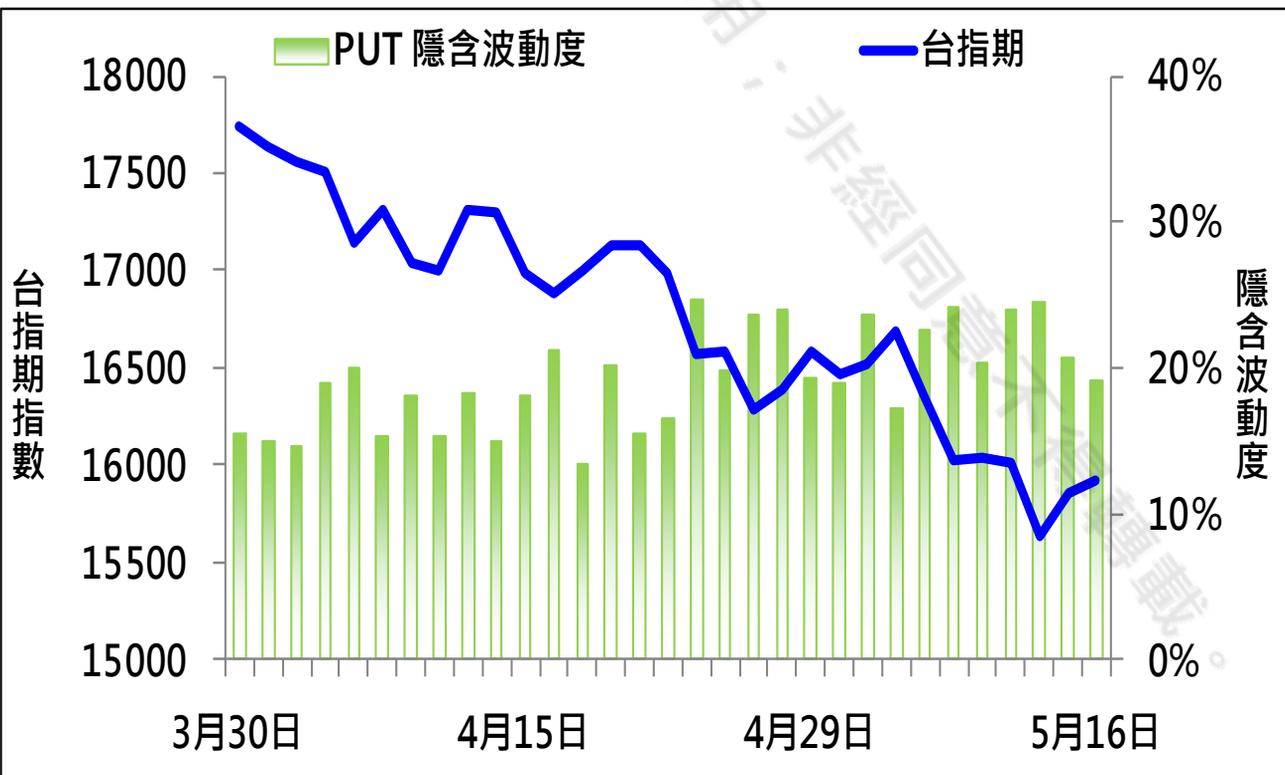
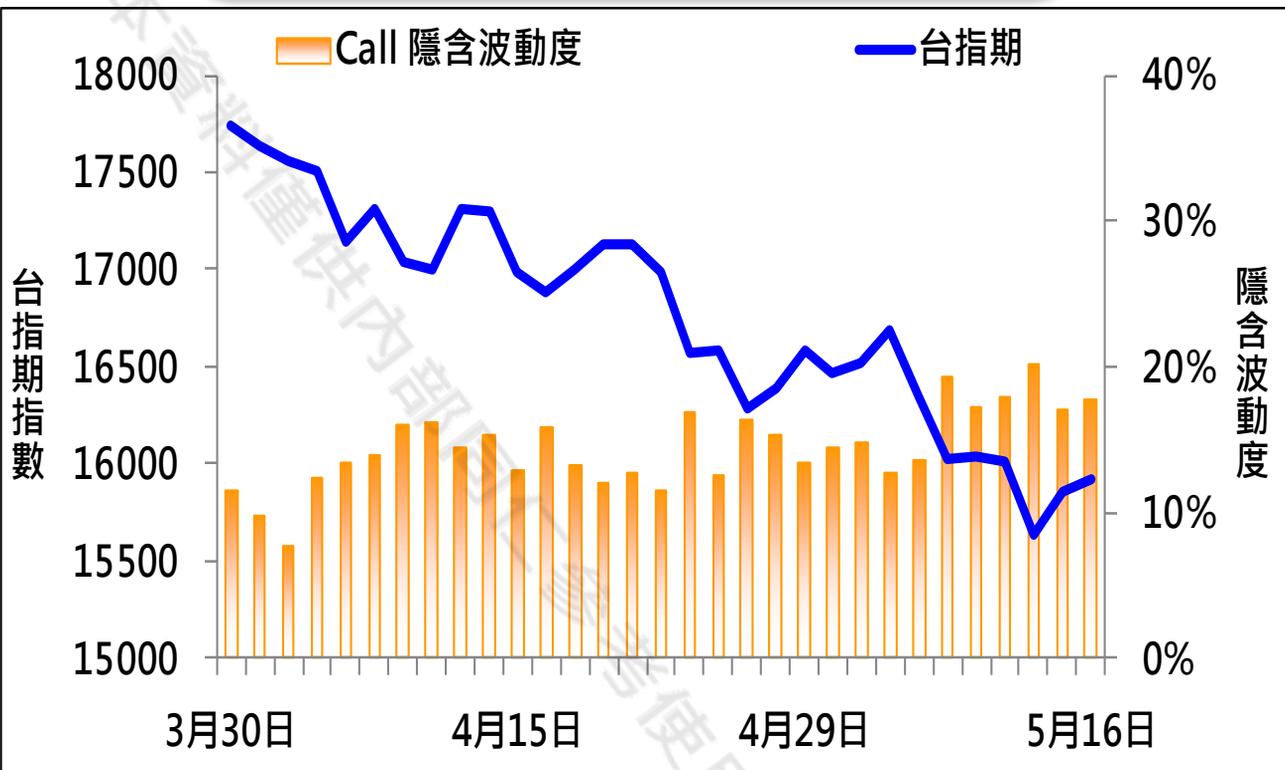
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



## 近月選擇權OI變化

日期：2022/5/16

結算日：2022/5/18

OI 增減	Call	202205月 履約價	Put	OI 增減
0	19	15,100	7,875	-1,153
0	3	15,150	1,501	536
0	1	15,250	1,758	47
0	2	15,350	2,208	795
1	4	15,450	2,861	1,347
-78	731	15,500	15,723	2,263
-15	331	15,550	5,776	1,049
-431	1,057	15,600	10,358	2,136
-53	908	15,650	5,903	2,478
-121	2,056	15,700	10,270	3,435
-207	1,267	15,750	5,392	3,088
-281	3,940	15,800	10,024	3,529
-43	2,181	15,850	3,283	1,300
526	5,435	15,900	8,810	2,540
805	4,674	15,950	2,275	1,331
611	13,110	16,000	6,826	690
609	6,417	16,050	1,828	1,269
3,008	11,459	16,100	2,721	148
3,254	9,181	16,150	387	195
5,499	16,352	16,200	4,798	113
3,569	10,265	16,250	138	62
※ 6,417	16,974	16,300	2,632	37
999	6,571	16,350	95	63
3,167	13,003	16,400	3,096	-48
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
22,200	241,669	0.8778	212,127	22,594
昨日 P/C	0.8636	今日增減變化		0.0142

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



## 次月選擇權OI變化

日期：2022/5/16

結算日：2022/6/15

OI 增減	Call	202206 月 履約價	Put	OI 增減
0	3	13,000	4,646	262
0	5	14,500	2,120	499
0	0	14,600	2,255	82
0	0	14,700	699	131
0	6	14,800	2,413	568
0	0	14,900	671	51
1	24	15,000	3,706	359
0	10	15,100	950	102
0	8	15,200	1,402	268
-1	1	15,300	850	189
0	36	15,400	1,629	118
8	225	15,500	2,466	1,275
-14	433	15,600	1,996	60
-2	364	15,700	769	138
16	853	15,800	1,406	379
62	444	15,900	1,028	83
65	929	16,000	1,809	192
114	870	16,100	780	23
229	977	16,200	974	-4
162	1,338	16,300	359	12
991	2,443	16,400	486	4
761	2,914	16,500	301	15
150	1,975	16,600	291	3
-256	1,360	16,700	67	0
65	1,445	16,800	482	1
22	1,152	16,900	80	-1
384	2,428	17,000	291	-1
85	830	17,100	106	-1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,382	40,707	1.1214	45,650	5,489
昨日 P/C	0.9898	今日增減變化		0.1316

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。

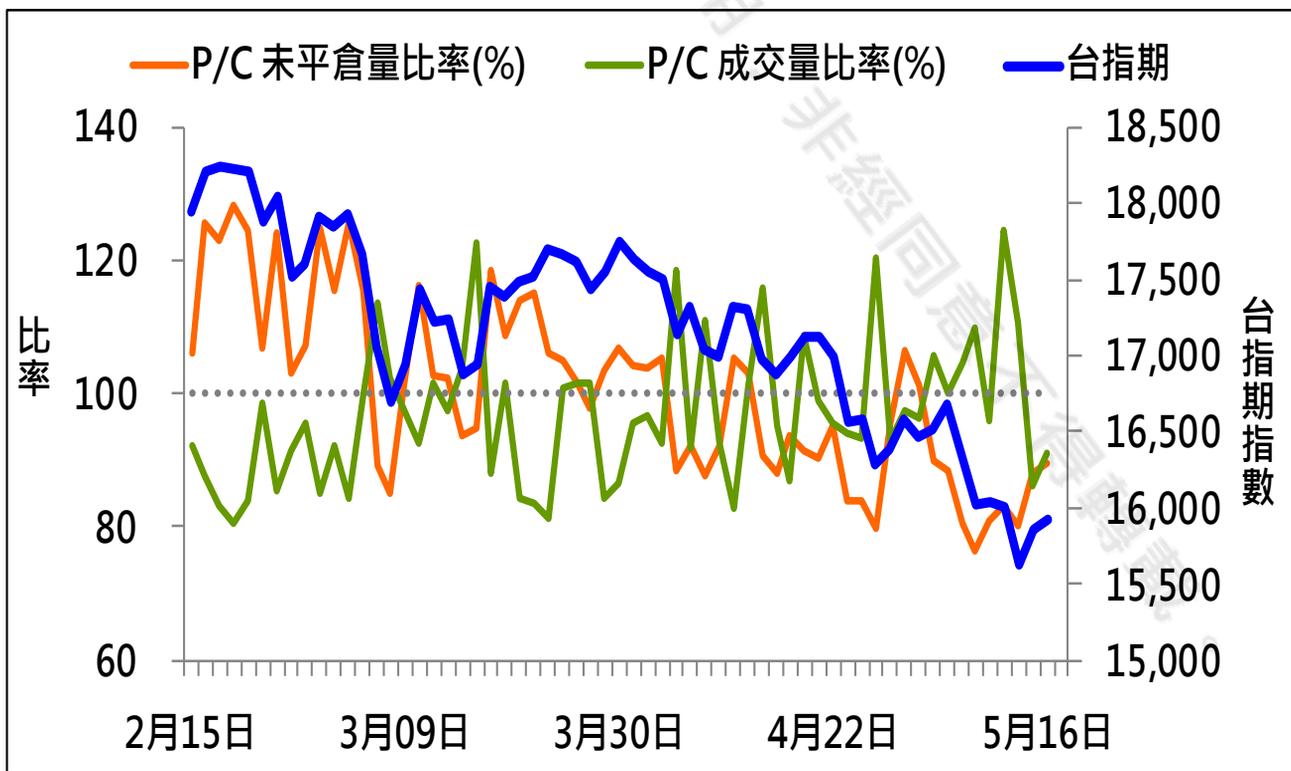
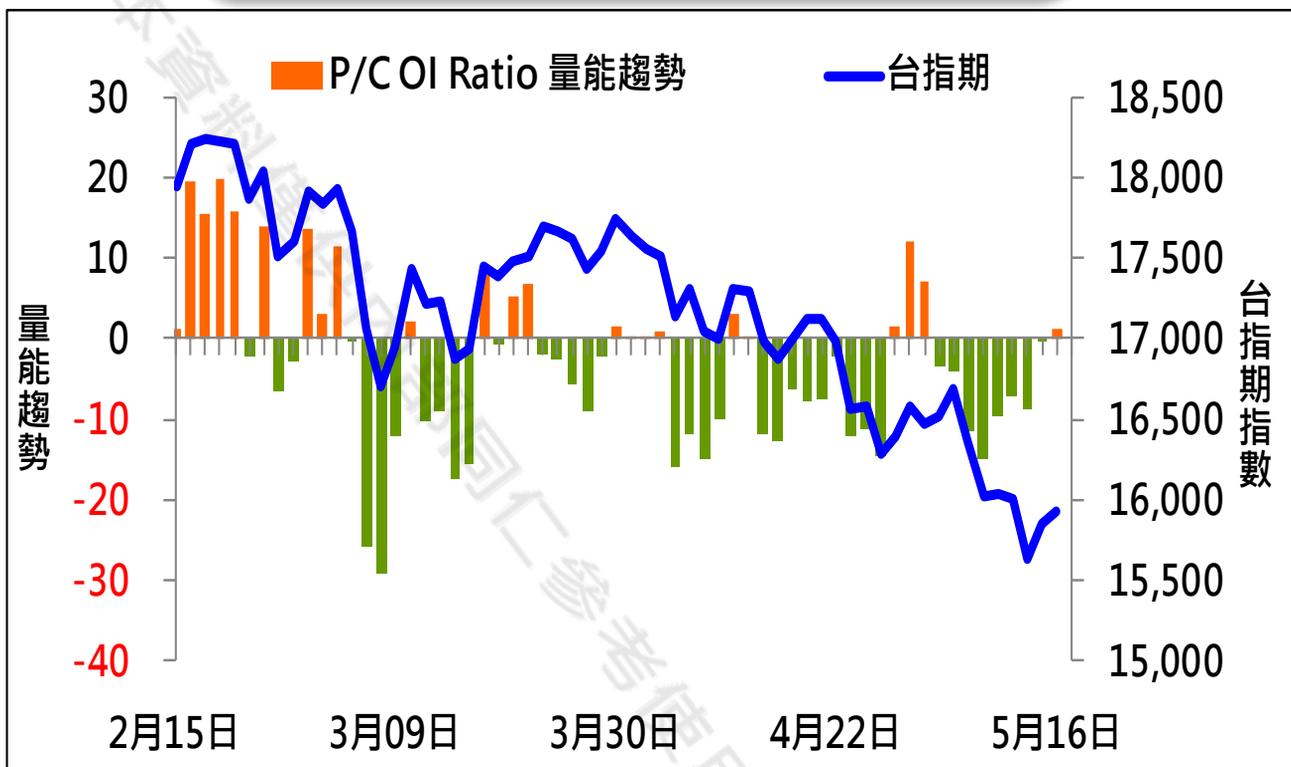
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

台股指數近月(一般)(FITX\*1) 日線圖 2022/05/16 收 15921 s 點 量 120112 □



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