



## 法人籌碼動態

11月10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	-16,513	-2,931	421	-148	-1,693	31
投信	-2,248	200	557	277	24	0
自營商	17,456	997	-424	-198	160	-24

11月10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	-56	37	5,955	-3,587	29,529	4,207
投信	2	0	0	0	-60	0
自營商	10	-48	-10,359	-11,245	805	18,398

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	8.54	聯發科	-10.48	台指期前十大 市場佔比	49.9%	48.8%
鴻海	4.57	中租-KY	-4.79			
欣興	3.47	萬海	-4.75			
台塑化	3.14	長榮	-3.44	電子期前十大 市場佔比	63.3%	61.8%
南電	2.77	群創	-2.95			
儒鴻	2.53	中鋼	-2.08			
宏達電	2.18	聯詠	-1.80	金融期前十大 市場佔比	62.3%	90.9%
廣達	2.16	友達	-1.74			
台勝科	2.11	南亞	-1.57			
華航	2.05	研華	-1.53	非金電期前十大 市場佔比	85.9%	92.3%
前十名合計	33.53	後十名合計	-35.14			

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

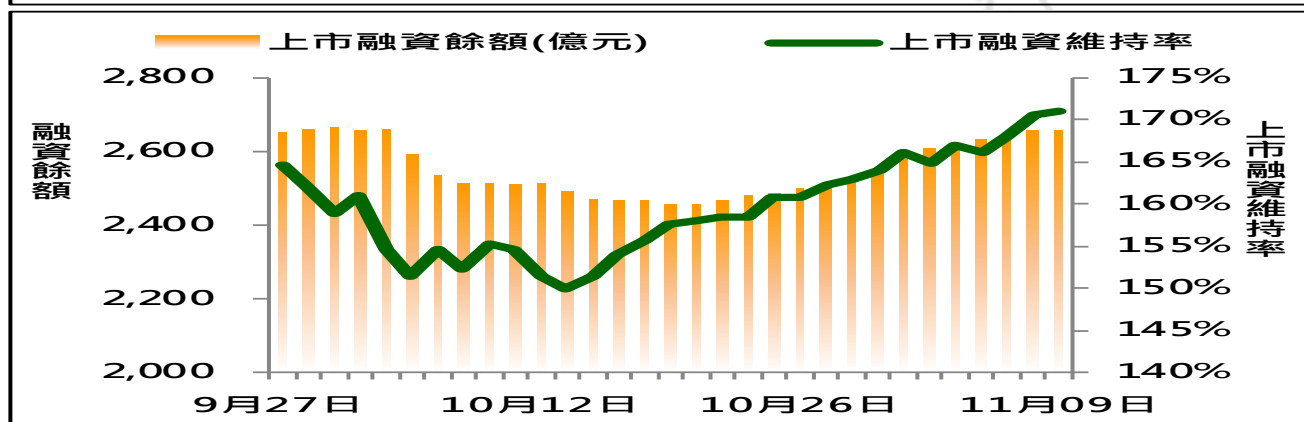
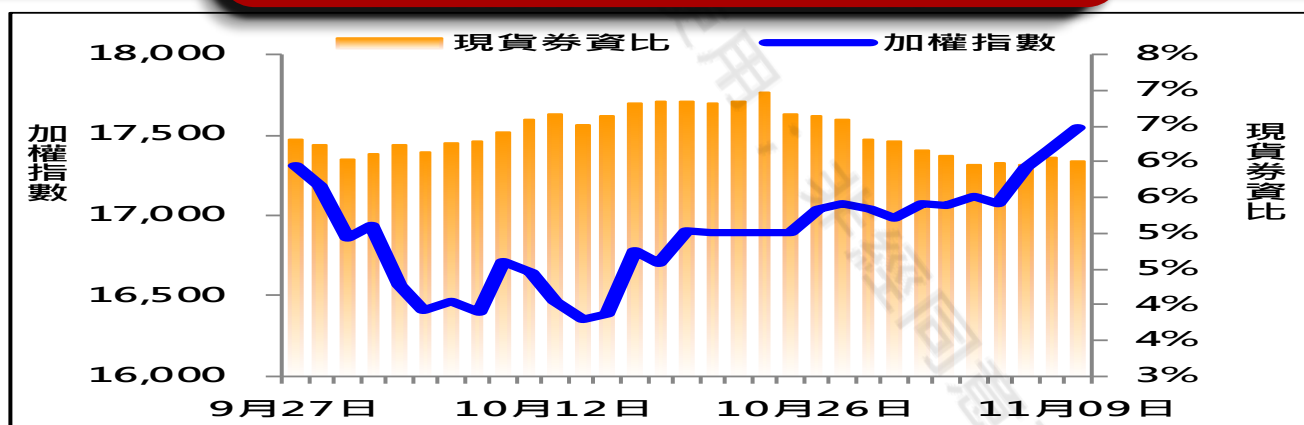


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
11月04日	-74.3	-23,097	-1,563	1.7	17,077	65
11月05日	265.5	-21,396	1,701	12.7	17,899	822
11月08日	67.5	-17,455	3,941	13.3	17,318	-581
11月09日	196.0	-13,582	3,873	3.7	16,459	-859
11月10日	0.2	-16,513	-2,931	5.3	17,456	997

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04日	-138	17,984	-18,122	-6,687	9,636	-16,323
11月05日	2,957	19,985	-17,028	-5,998	5,622	-11,620
11月08日	4,540	23,058	-18,518	-999	-2,069	1,070
11月09日	9,542	25,322	-15,780	886	-17,593	18,479
11月10日	5,955	29,529	-23,574	-10,359	805	-11,164

## 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。

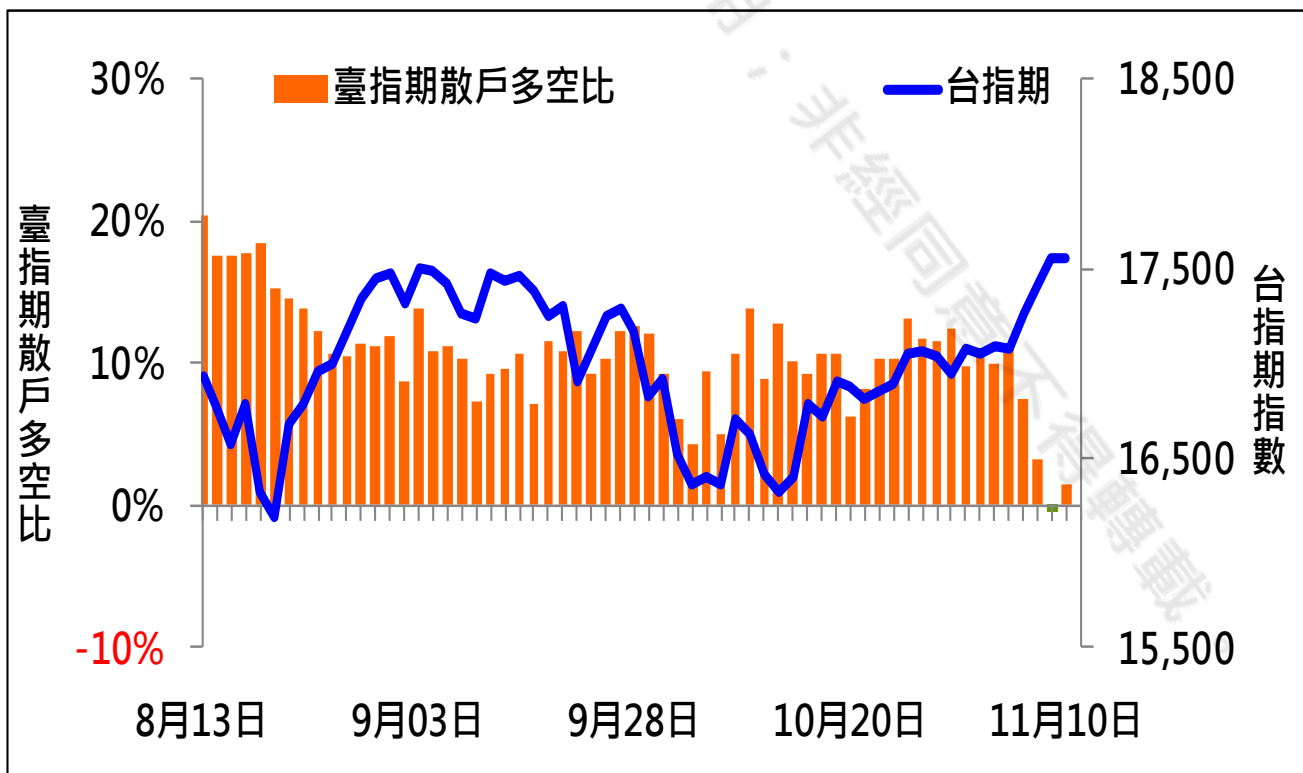
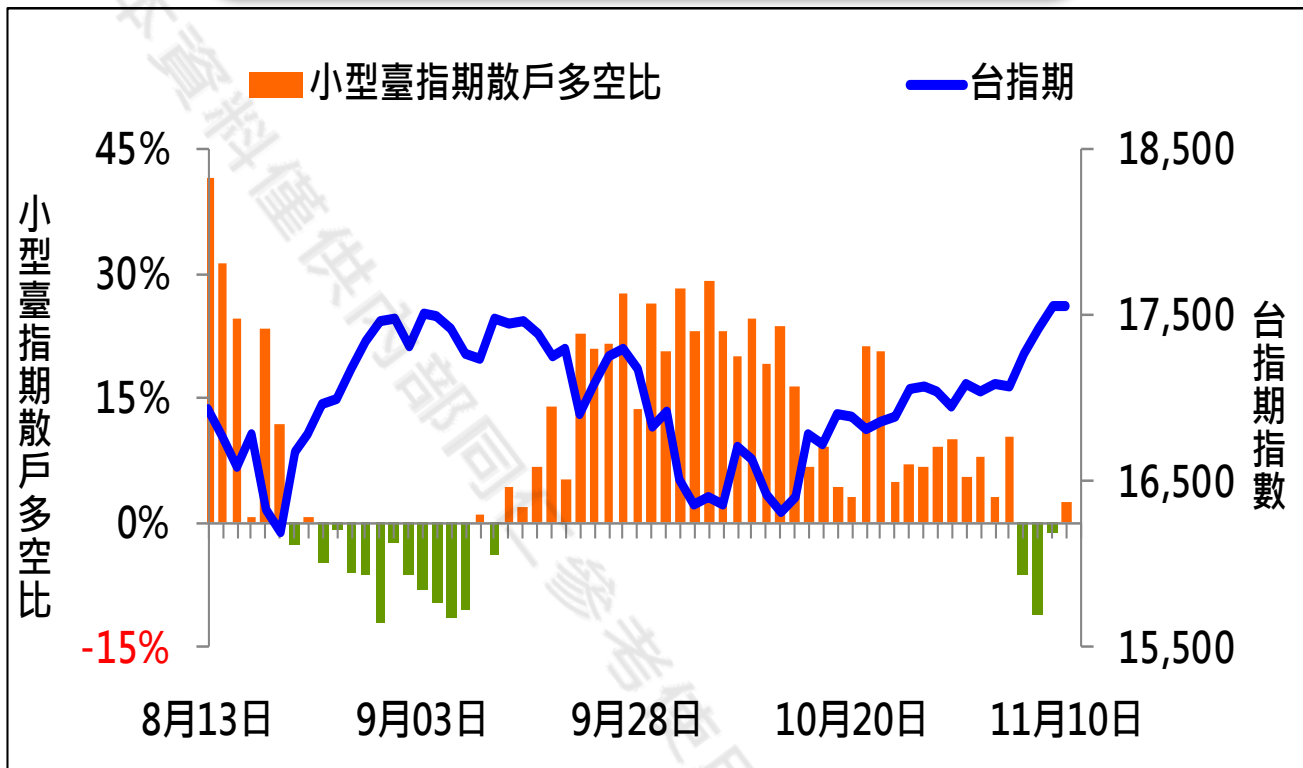
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

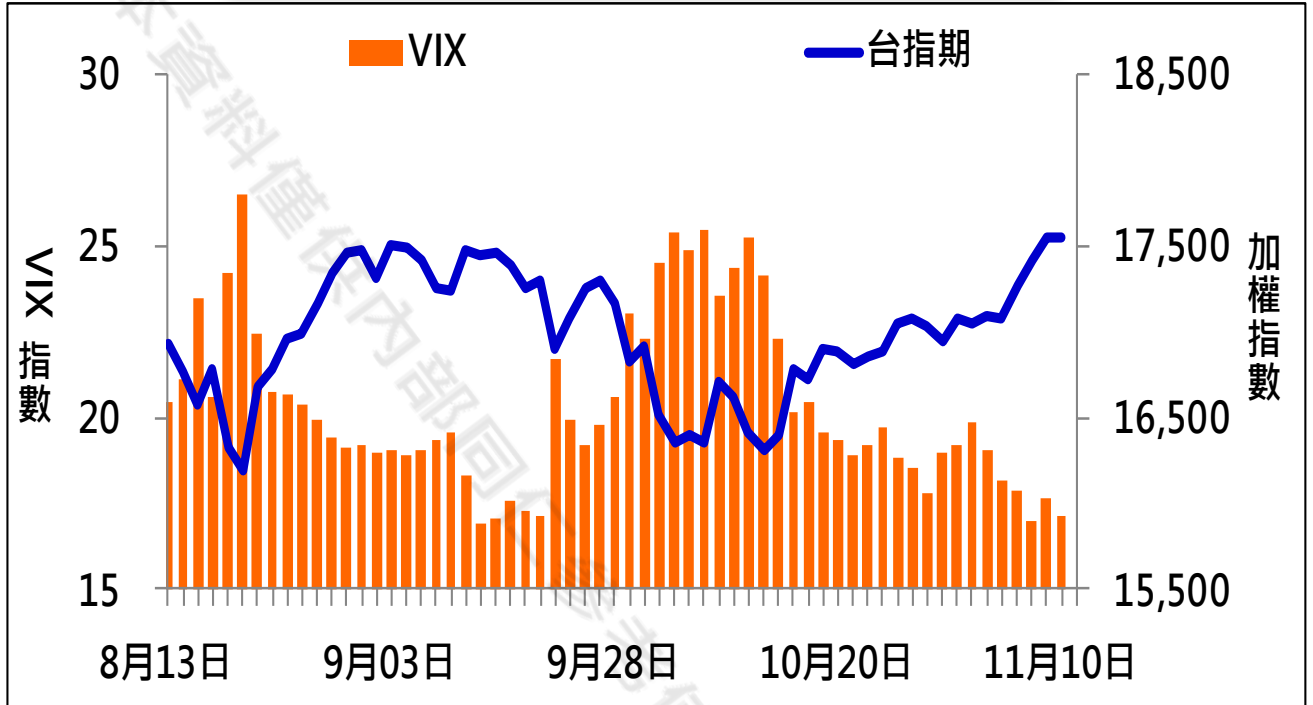
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

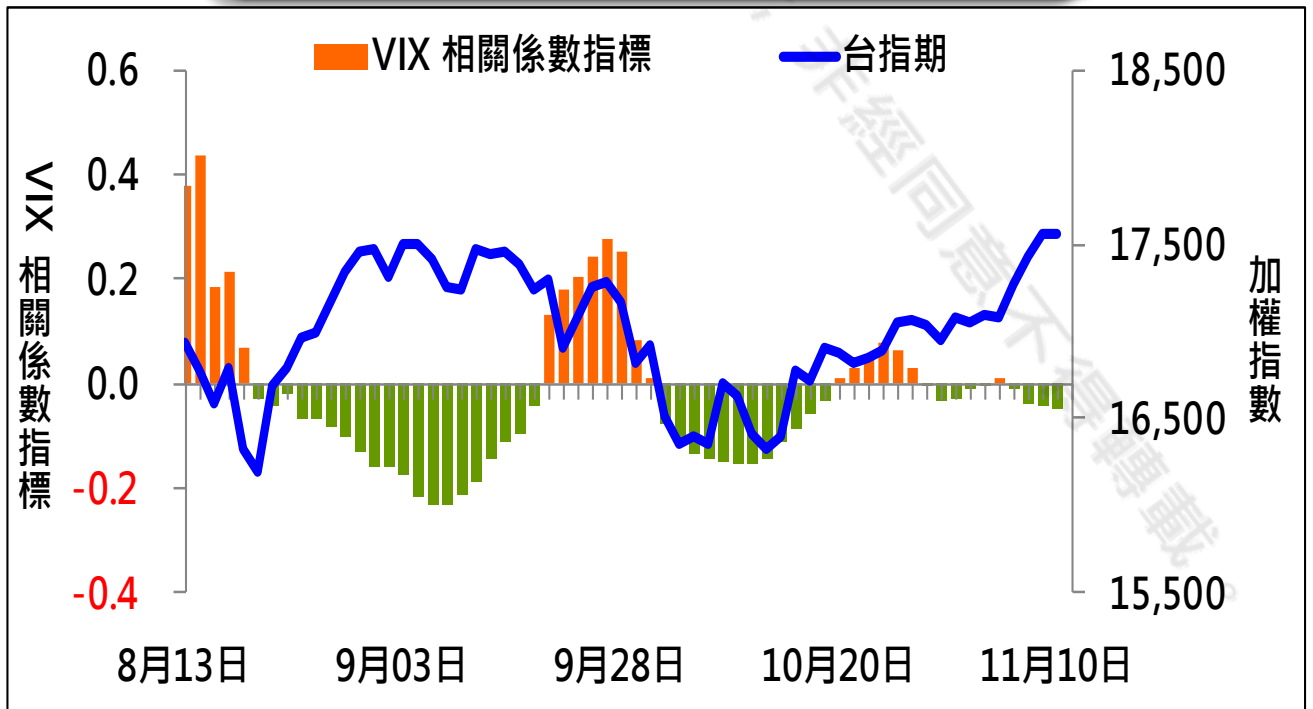
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



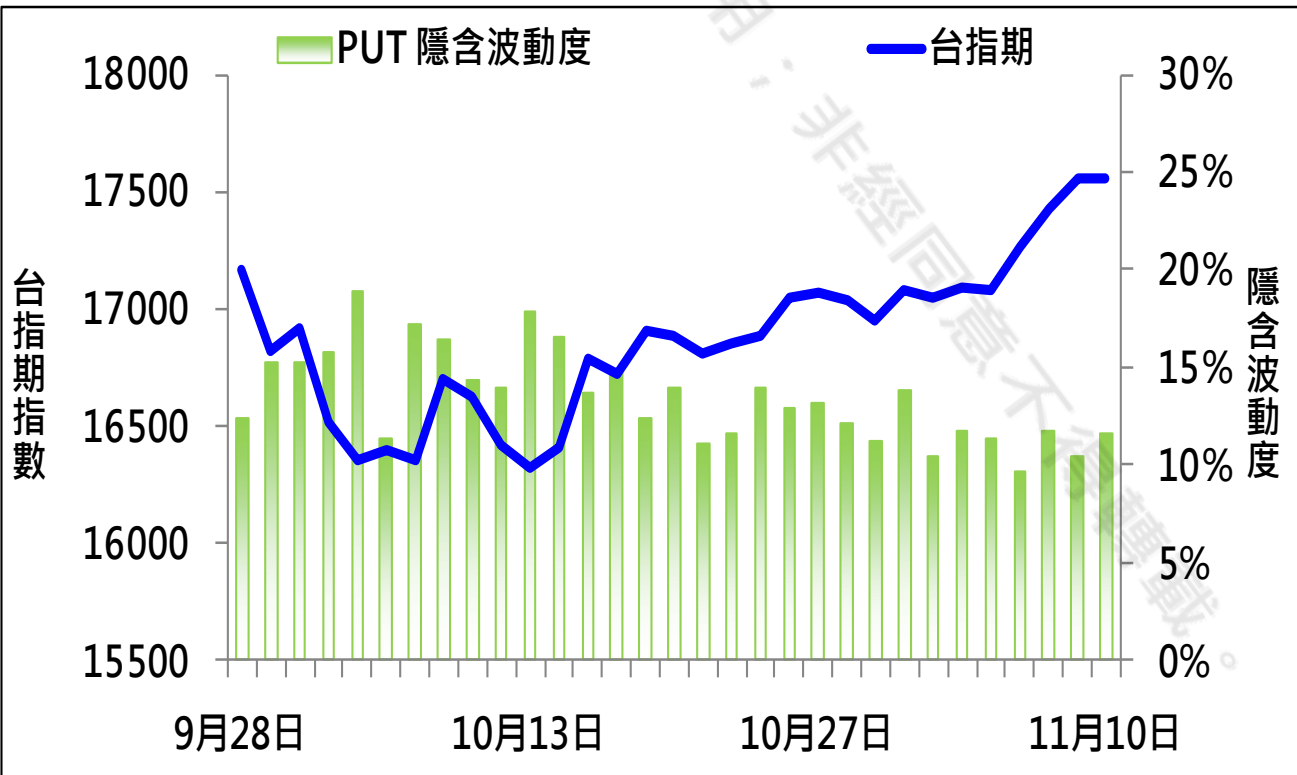
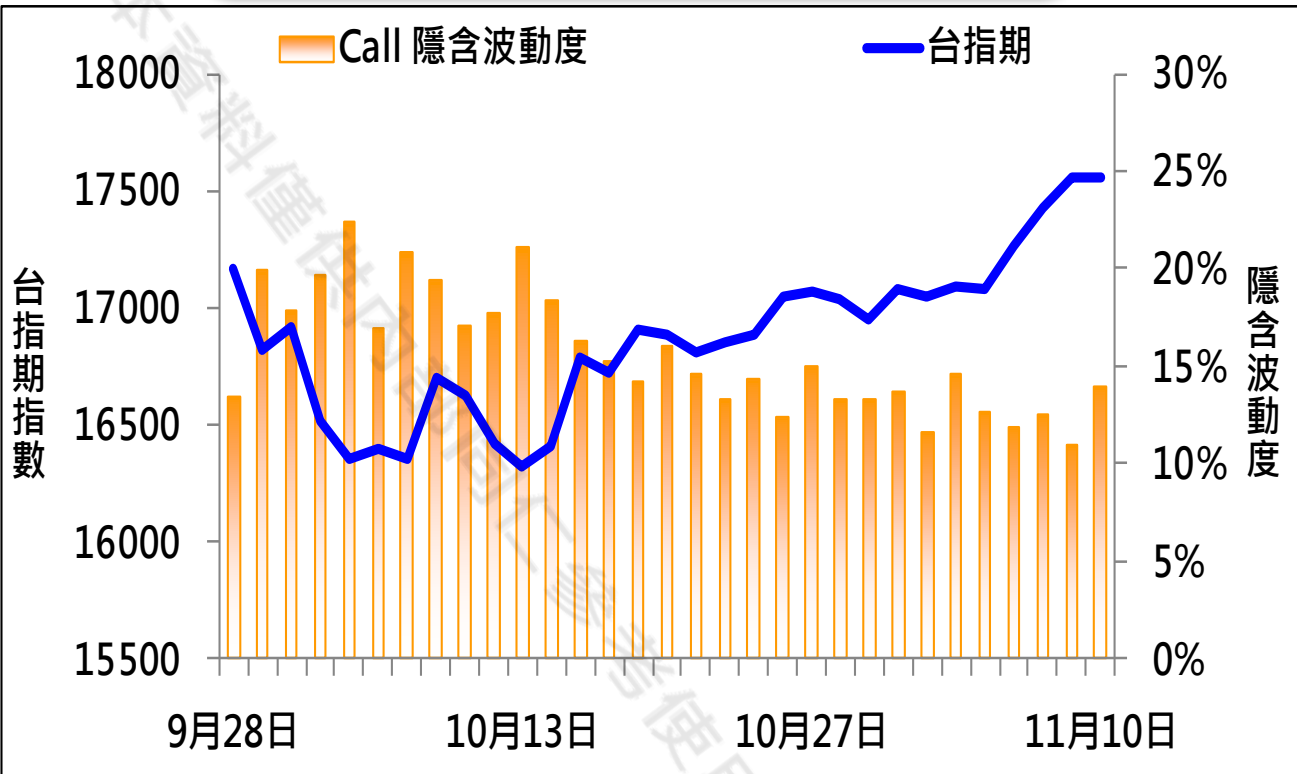
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/10

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111 月 履約價	Put	OI 增減
-6	1,337	16,800	6,922	1,163
-21	2,669	16,900	5,164	1,502
-37	3,783	17,000	7,855	1,660
1	1	17,050	1,835	1,835
-118	3,077	17,100	7,028	3,005
1	1	17,150	2,989	2,989
-16	2,515	17,200	7,097	1,343
8	8	17,250	1,380	1,380
-123	3,877	17,300	7,122	2,144
28	28	17,350	1,856	1,856
-379	6,052	17,400	4,136	1,559
506	506	17,450	880	880
454	7,143	17,500	3,719	2,213
1,134	1,134	17,550	1,268	1,268
921	13,351	17,600	1,181	551
1,138	1,138	17,650	198	198
723	9,868	17,700	637	363
1,389	1,389	17,750	9	9
※ 2,748	11,746	17,800	227	151
1,602	1,602	17,850	48	48
1,806	6,157	17,900	87	-2
620	620	17,950	2	2
1,521	13,636	18,000	33	-7
1,048	1,048	18,050	1	1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
17,994	119,904	1.2161	145,815	26,762

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：2021/11/10

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112月 履約價	Put	OI 增減
0	33	16,200	7,858	-137
0	4	16,300	1,622	175
0	30	16,400	5,575	48
0	25	16,500	2,549	365
1	43	16,600	1,656	55
0	85	16,700	8,124	536
0	102	16,800	1,572	235
0	164	16,900	1,155	81
-22	257	17,000	1,589	927 ※
2	895	17,100	336	48
-19	1,381	17,200	730	196
-22	518	17,300	256	41
-4	387	17,400	180	62
105	1,008	17,500	438	251
116	1,308	17,600	123	21
142	1,879	17,700	113	30
49	1,839	17,800	78	42
7	2,031	17,900	12	4
251	2,733	18,000	68	35
※	606	18,100	6	4
376	1,987	18,200	0	0
260	1,693	18,300	1	0
211	1,924	18,400	3	2
219	1,029	18,500	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
2,887	35,530	1.5123	53,731	2,822
昨日 P/C	1.5596	今日增減變化		-0.0473

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。

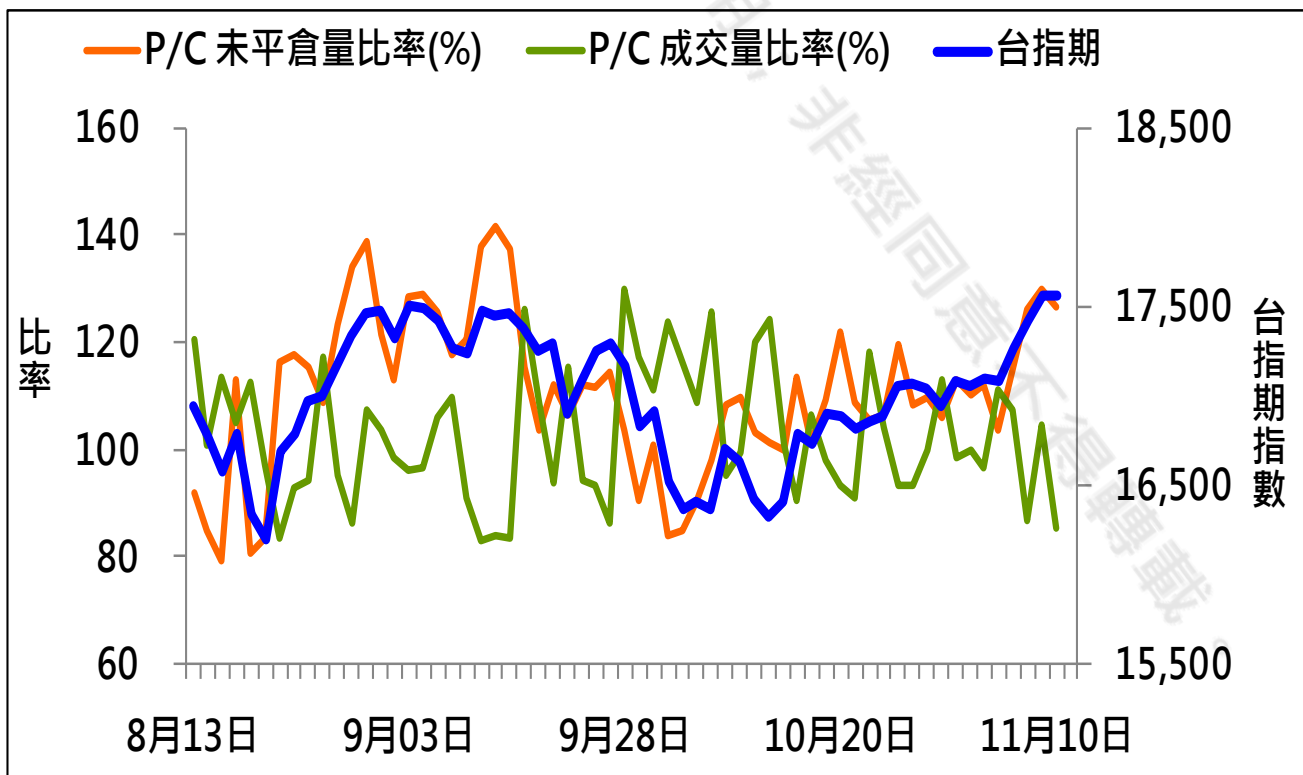
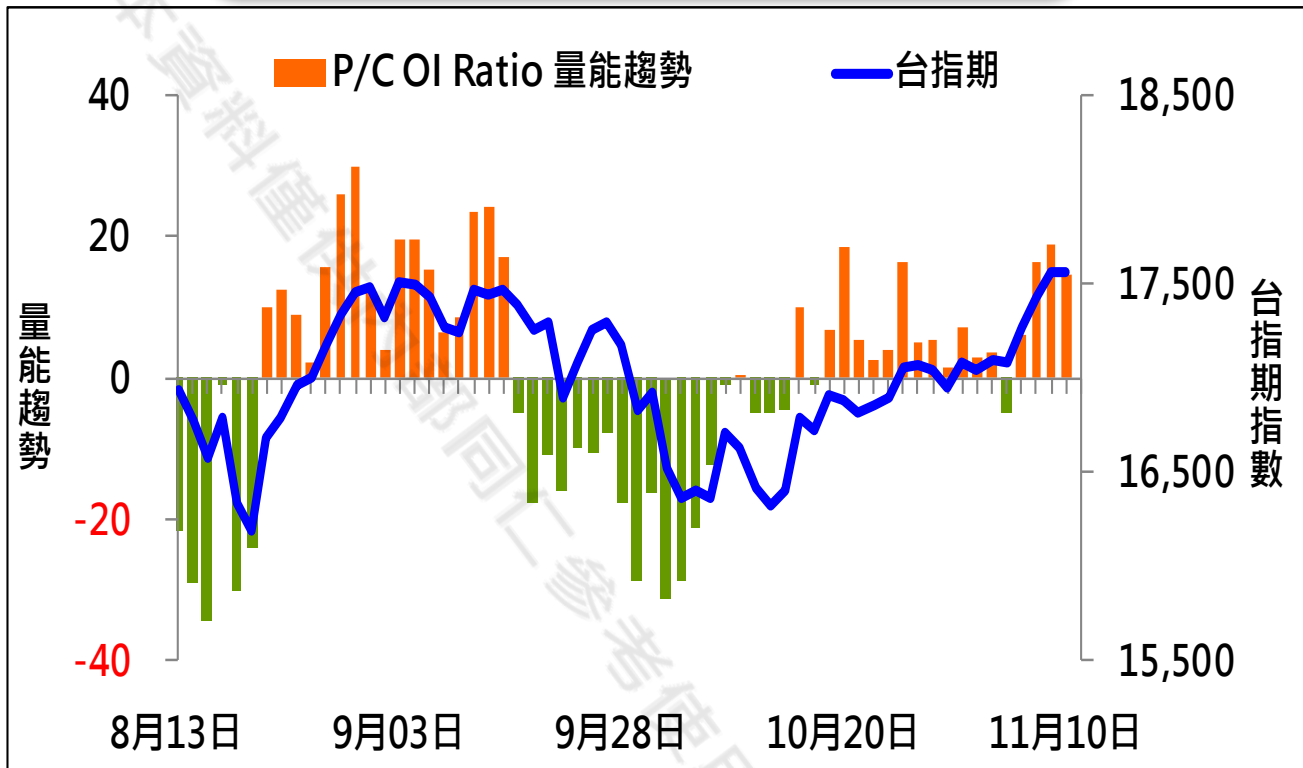
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

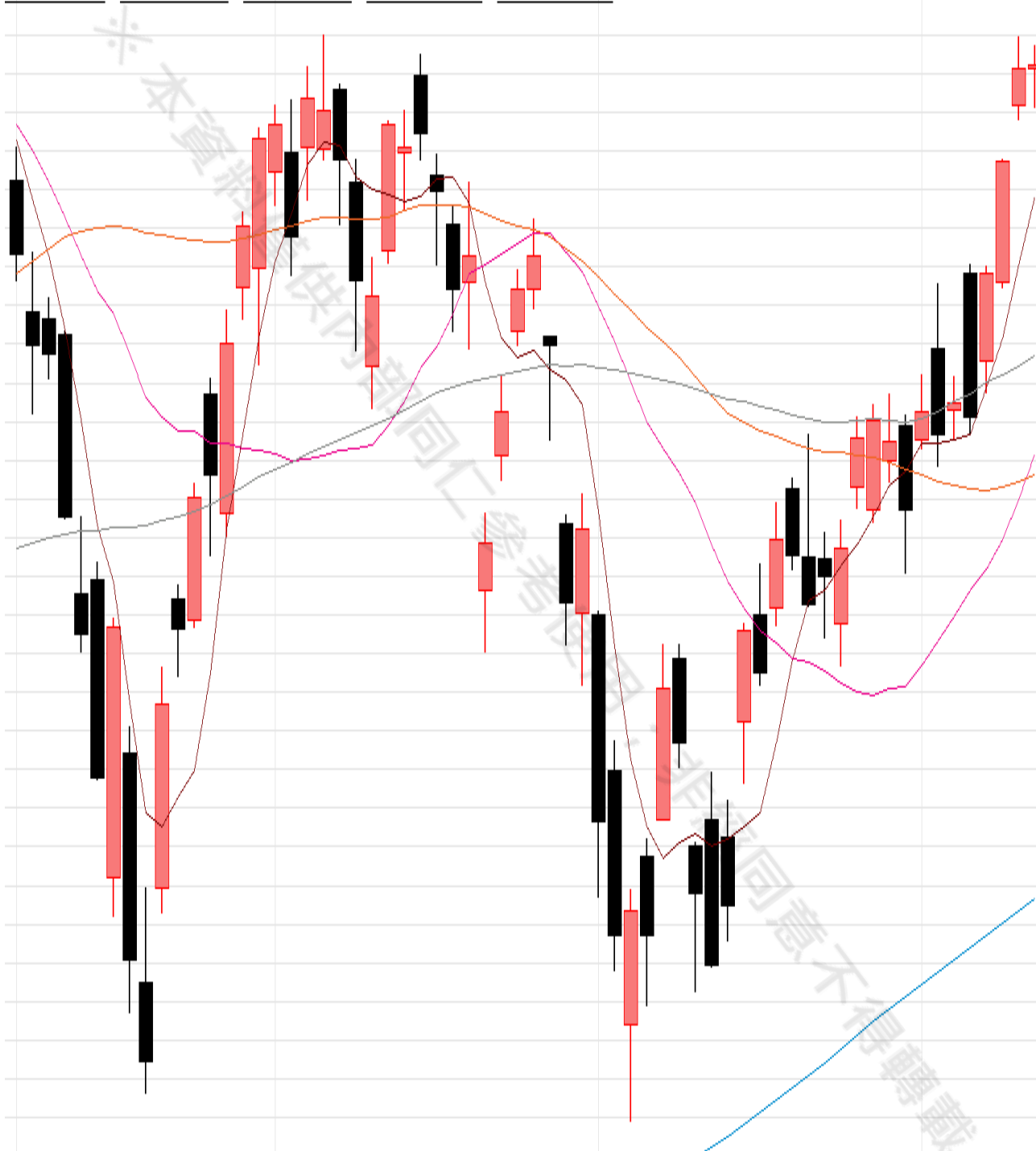
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所





## 盤後重點觀察

SMA5 17374.00↑ SMA20 17021.60↑ SMA60 16993.40↑ SMA120 17155.87↑ SMA240 16410.85↑



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