



法人籌碼動態

11月11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	-17,990	-1,477	234	-187	-1,641	52
投信	-2,003	245	757	200	24	0
自營商	16,505	-951	-438	-14	133	-27

11月11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	-29	27	3,583	-2,372	30,755	1,226
投信	2	0	0	0	-60	0
自營商	-15	-25	-14,008	-3,649	4,427	3,622

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
南電	4.48	台積電	-51.34	台指期前十大 市場佔比	49.1%	49.0%
華航	3.85	長榮	-18.09			
中租-KY	3.28	萬海	-12.81			
AES-KY	3.10	陽明	-7.82	電子期前十大 市場佔比	65.6%	60.9%
長榮航	2.19	鴻海	-6.86			
旭隼	2.02	台達電	-5.14			
亞德客-KY	2.00	聯電	-3.69	金融期前十大 市場佔比	63.0%	88.5%
玉山金	1.66	祥碩	-3.20			
大成鋼	1.45	台塑	-3.15			
研華	1.40	華碩	-3.06	非金電期前十大 市場佔比	86.1%	89.5%
前十名合計	25.43	後十名合計	-115.16			

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

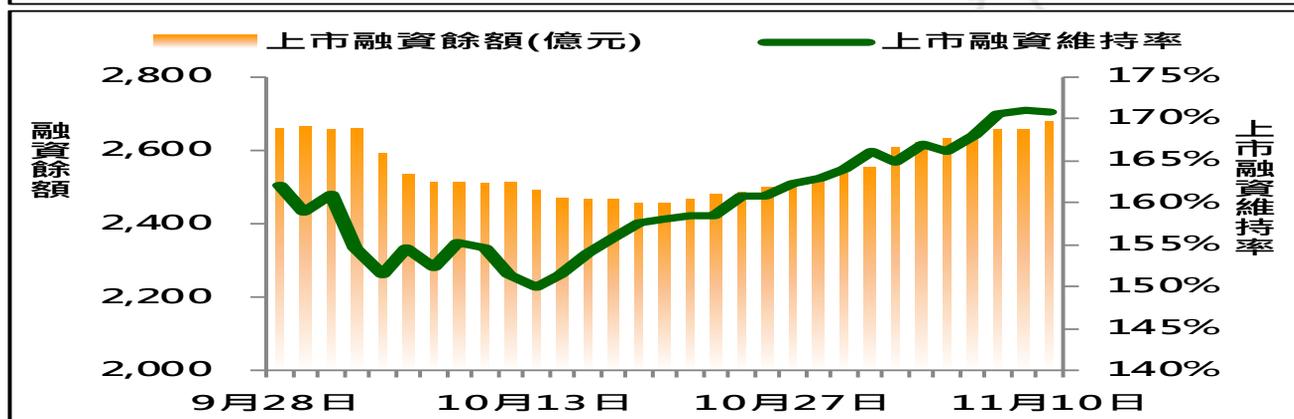
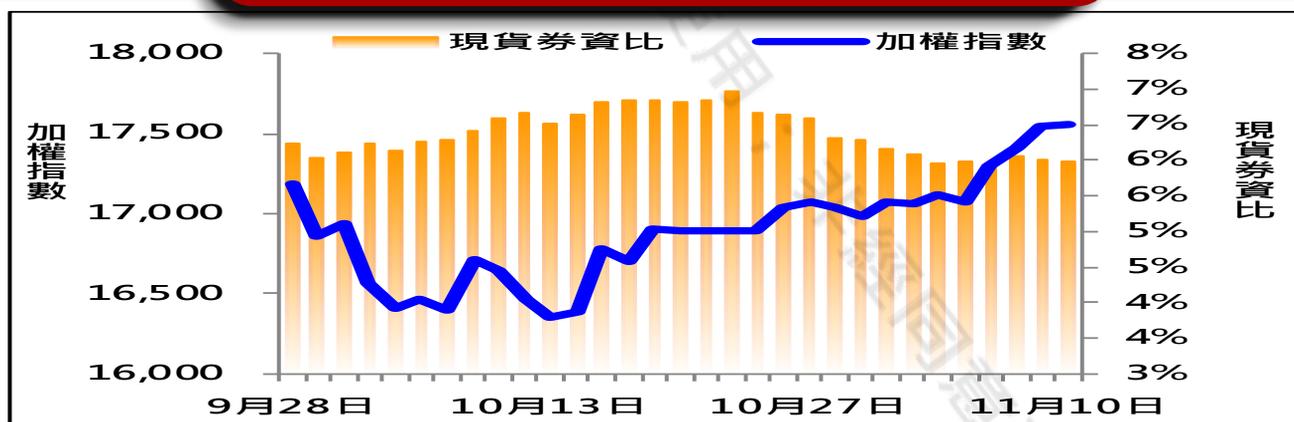


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月11日	-70.7	-17,990	-1,477	-5.8	16,505	-951

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
11月11日	3,583	30,755	-27,172	-14,008	4,427	-18,435

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。

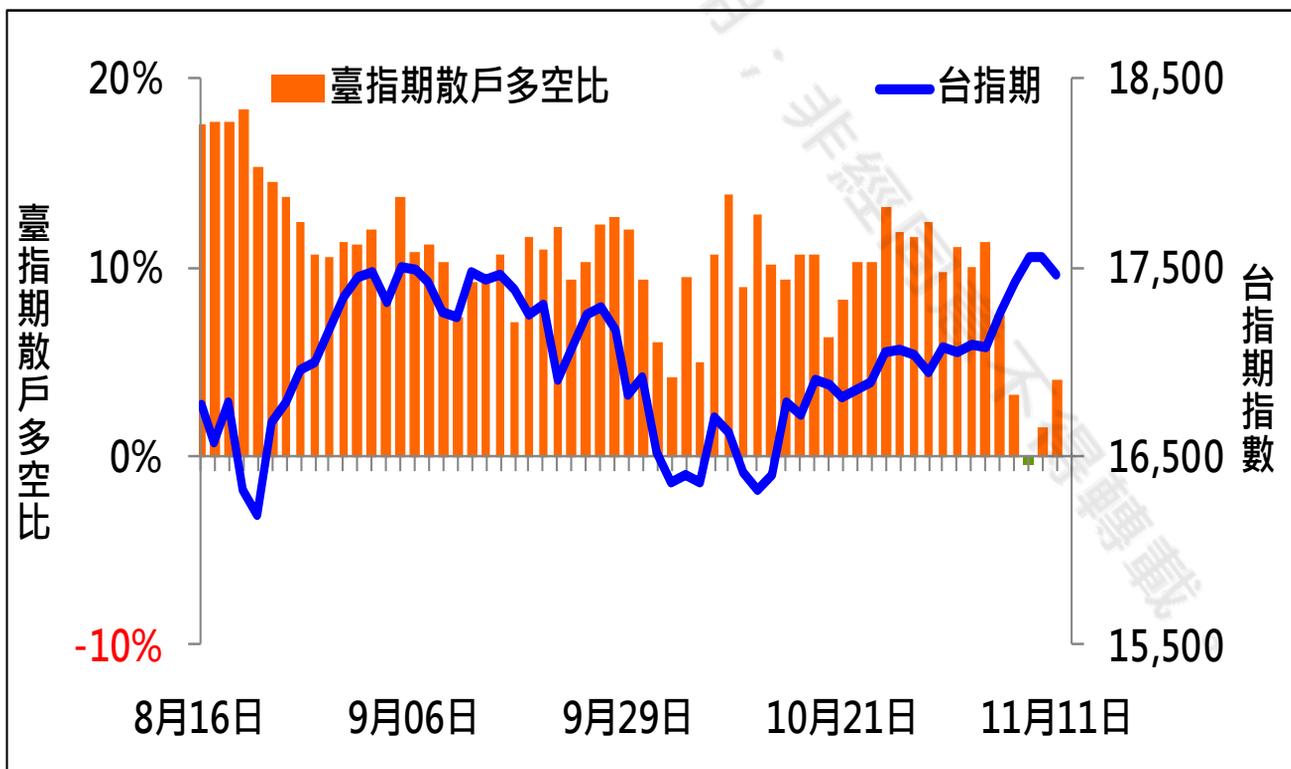
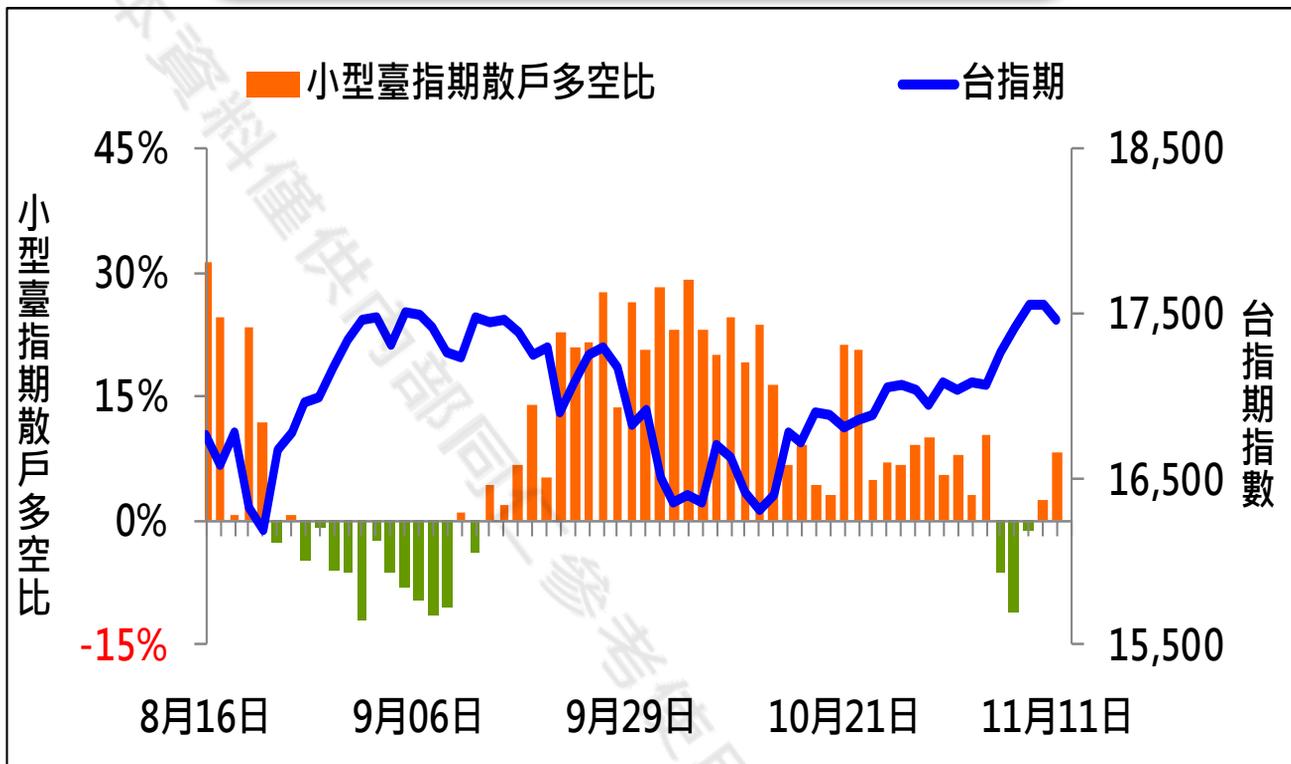
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



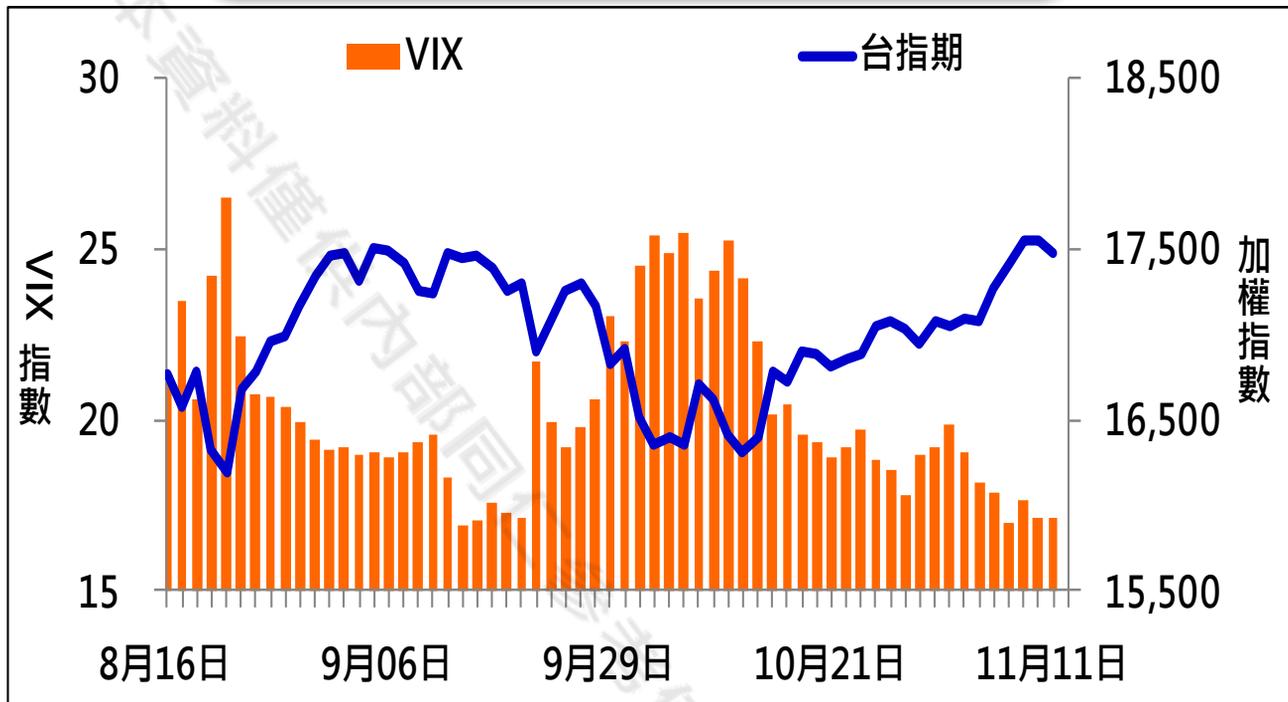
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

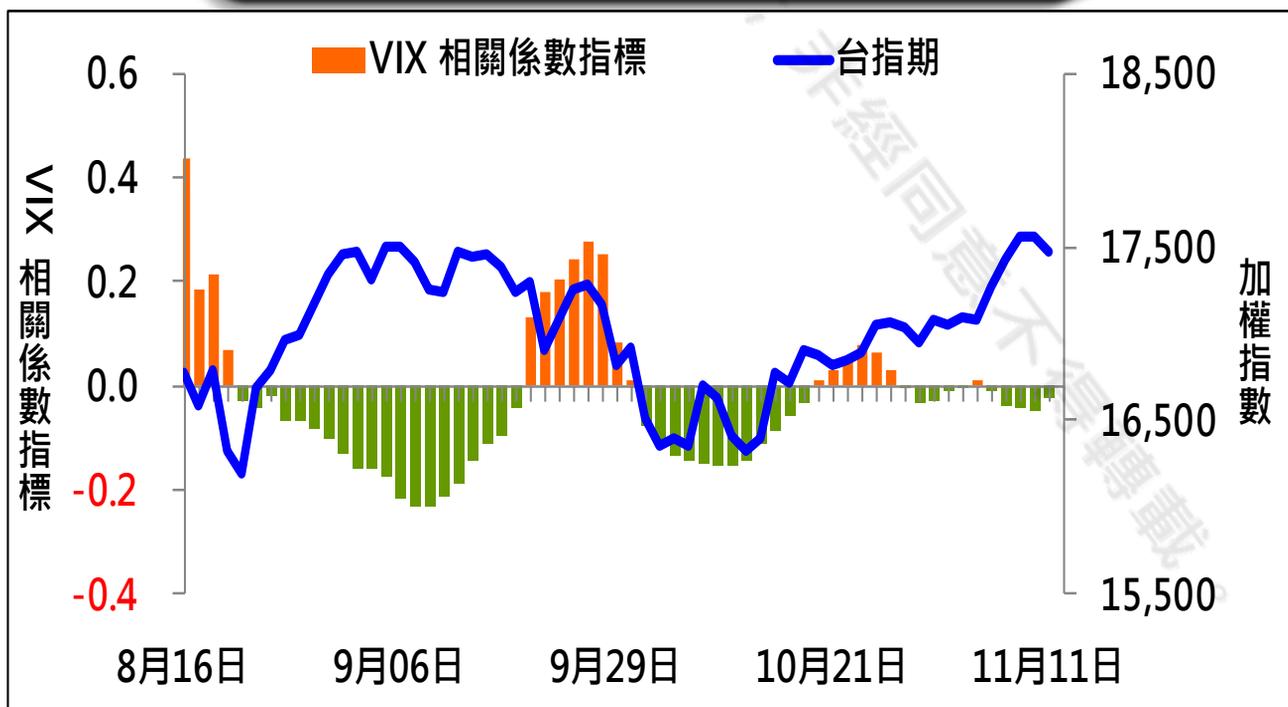
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

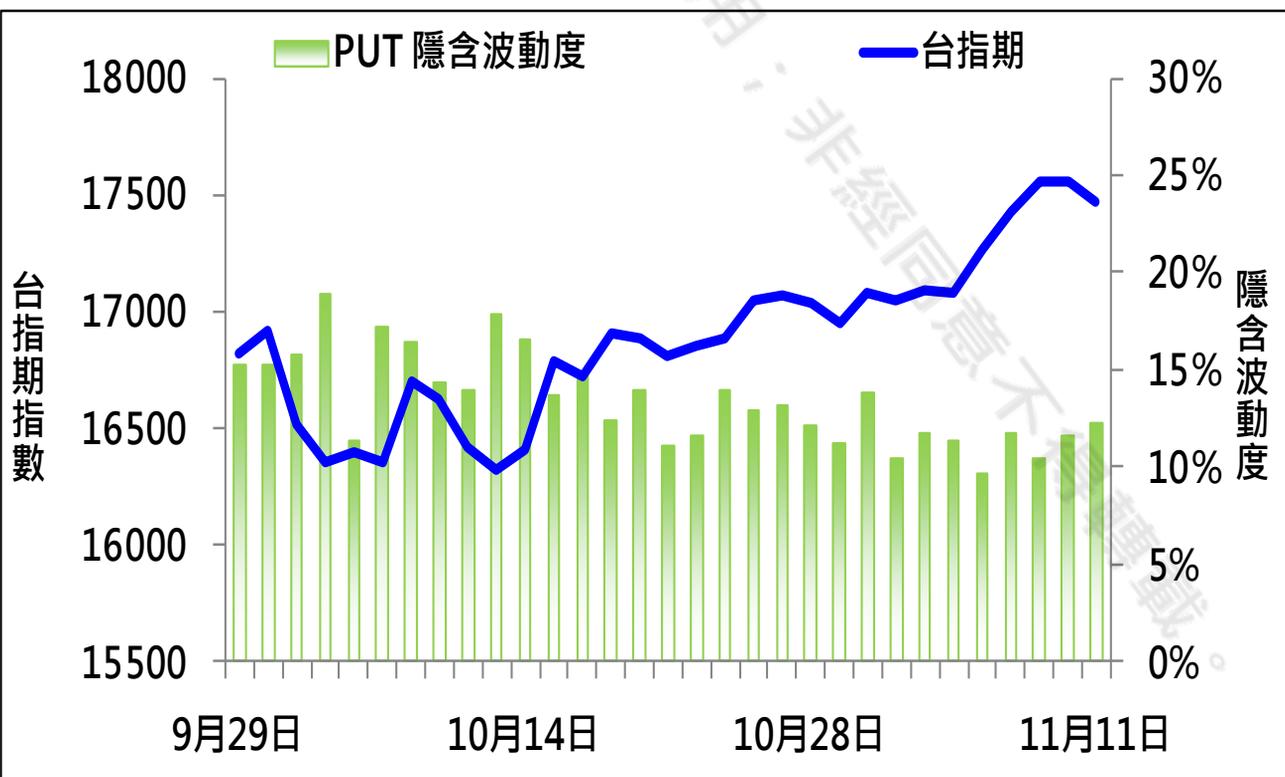
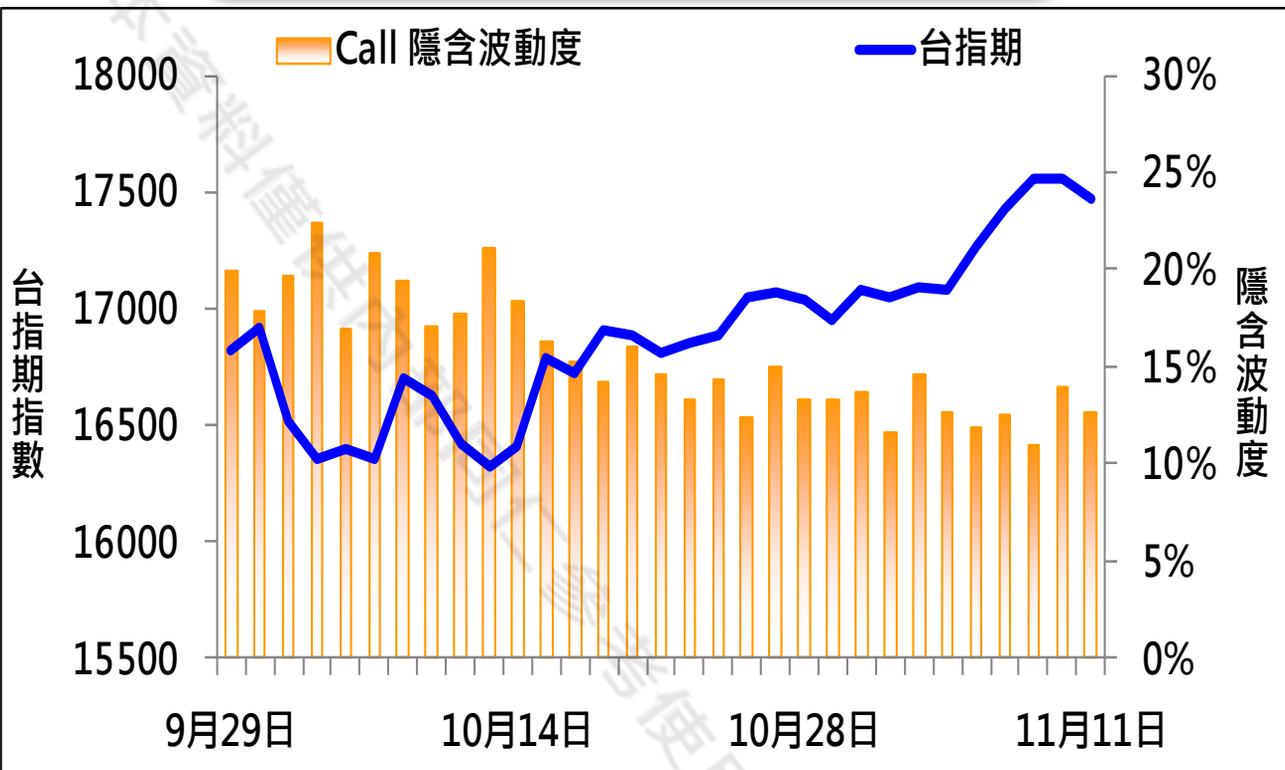
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/11/11

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111 月 履約價	Put	OI 增減
2	1,330	16,600	5,626	220
-3	1,428	16,700	5,300	74
-9	1,328	16,800	6,622	-300
-98	2,571	16,900	6,626	1,462
34	3,817	17,000	10,864	3,009
22	23	17,050	2,886	1,051
53	3,130	17,100	9,600	2,572
10	11	17,150	4,256	1,267
-60	2,455	17,200	11,796	4,699
94	102	17,250	4,316	2,936
96	3,973	17,300	9,816	2,694
265	293	17,350	3,887	2,031
283	6,335	17,400	6,520	2,384
1,987	2,493	17,450	3,316	2,436
2,264	9,407	17,500	5,543	1,824
2,450	3,584	17,550	2,742	1,474
4,300	17,651	17,600	1,875	694
3,351	4,489	17,650	575	377
※ 4,465	14,333	17,700	760	123
2,985	4,374	17,750	58	49
3,864	15,610	17,800	251	24
2,328	3,930	17,850	50	2
1,814	7,971	17,900	59	-28
893	1,513	17,950	34	32
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
34,663	154,567	1.1481	177,461	31,646

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：2021/11/11

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112月 履約價	Put	OI 增減
0	7	16,100	398	49
0	33	16,200	7,958	100
0	4	16,300	1,611	-11
0	30	16,400	5,674	99
0	25	16,500	2,767	218
-1	42	16,600	1,790	134
0	85	16,700	8,420	296
2	104	16,800	2,546	974 ※
2	166	16,900	1,700	545
-2	255	17,000	1,574	-15
27	922	17,100	497	161
75	1,456	17,200	755	25
-28	490	17,300	341	85
36	423	17,400	373	193
257	1,265	17,500	637	199
112	1,420	17,600	198	75
41	1,920	17,700	145	32
89	1,928	17,800	81	3
344	2,375	17,900	24	12
660	3,393	18,000	51	-17
269	2,118	18,100	5	-1
673	2,660	18,200	0	0
※ 1,903	3,596	18,300	1	0
75	1,999	18,400	2	-1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,218	41,748	1.3794	57,587	3,856
昨日 P/C	1.5123	今日增減變化		-0.1329

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。

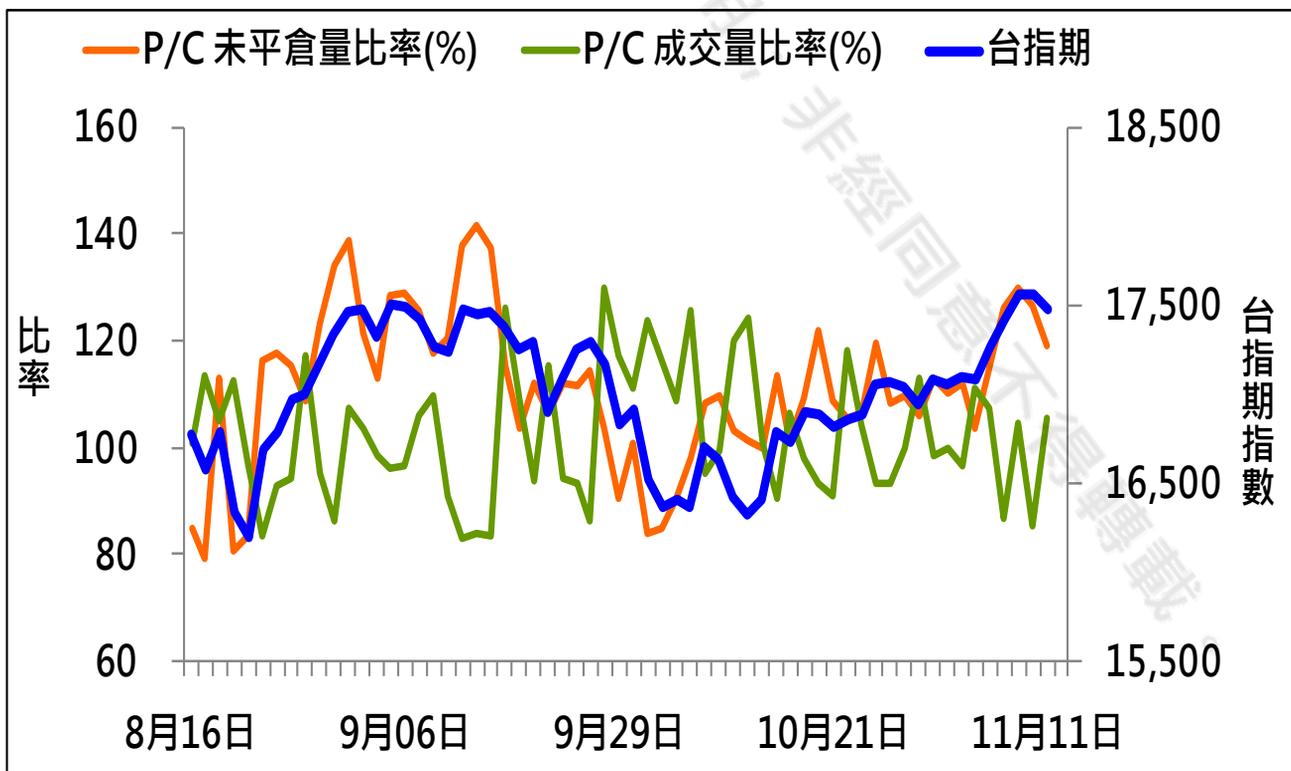
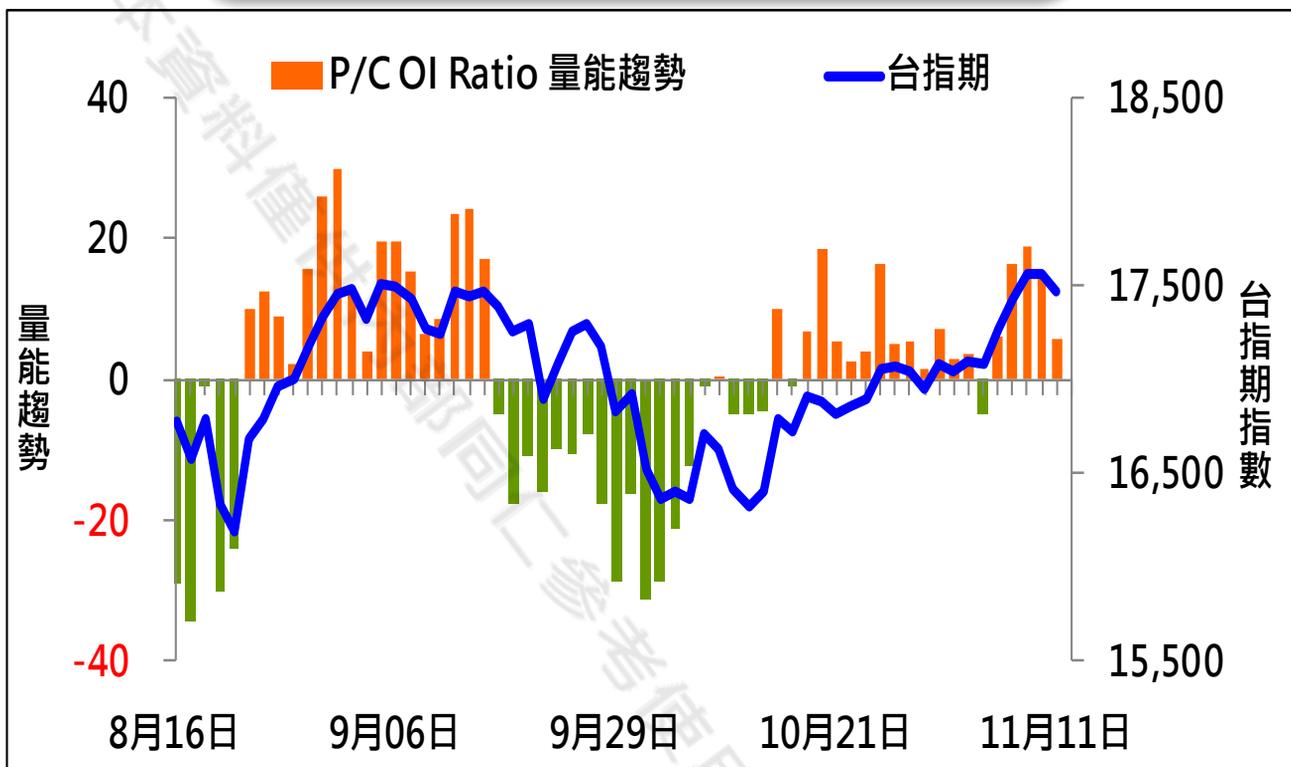
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

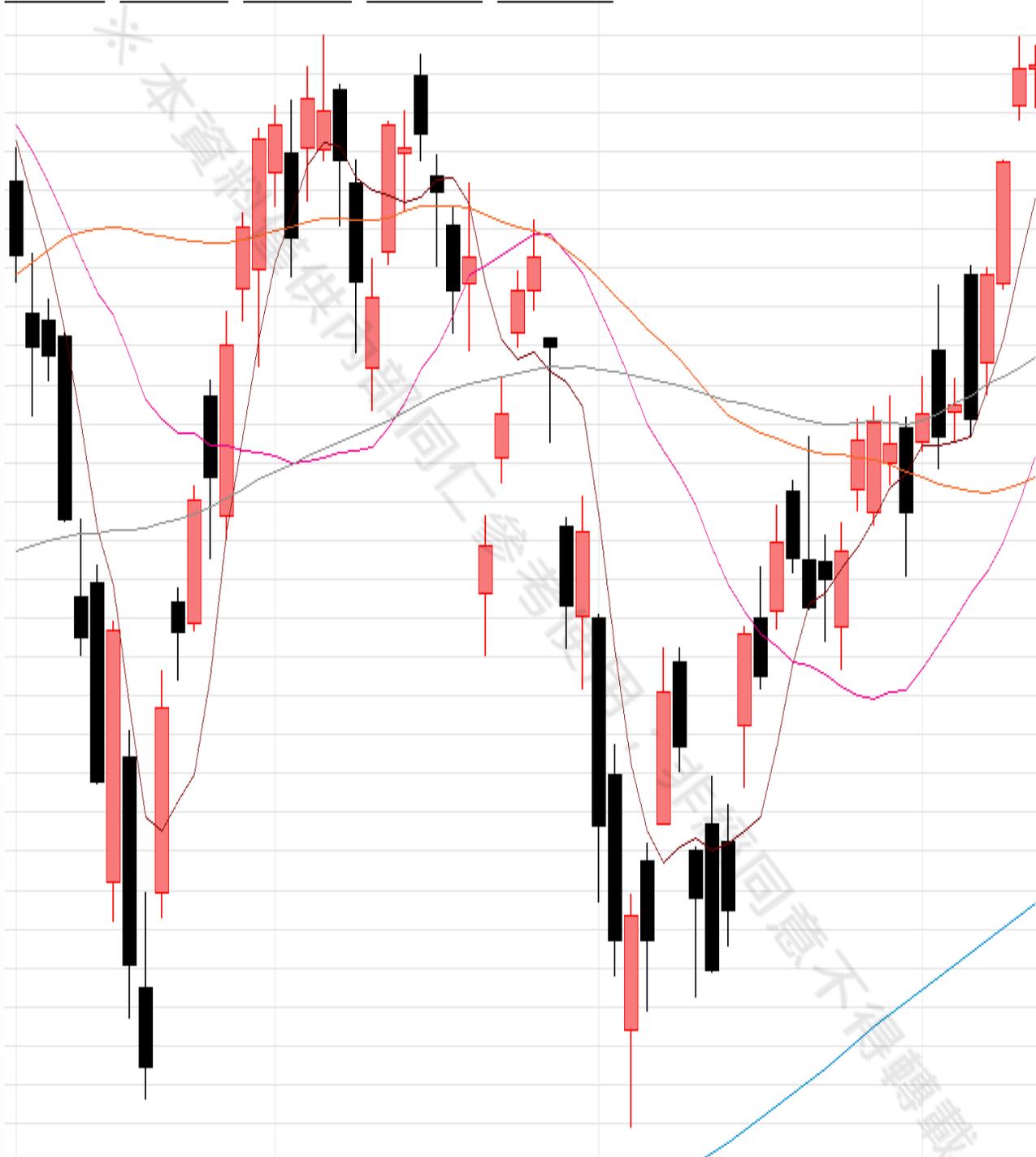
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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