



## 法人籌碼動態

11月15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	-15,579	1,392	225	-17	-1,704	-69
投信	-1,653	297	743	-14	24	0
自營商	15,500	-723	-395	45	157	24

11月15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	35	23	3,951	-1,142	36,924	3,456
投信	2	0	0	0	-60	0
自營商	-91	-37	-3,534	8,145	-6,977	-7,179

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	34.17	鴻海	-4.57	台指期前十大 市場佔比	48.8%	49.0%
聯發科	22.01	中鋼	-3.12			
國泰金	3.88	欣興	-2.97			
廣達	3.82	南電	-2.55	電子期前十大 市場佔比	64.7%	61.1%
聯詠	3.71	中租-KY	-1.77			
AES-KY	3.52	佳世達	-1.52			
聯電	3.27	萬海	-1.46	金融期前十大 市場佔比	64.2%	91.8%
瑞昱	3.20	富邦媒	-1.38			
富邦金	2.65	智邦	-1.38			
祥碩	2.17	陽明	-1.30	非金電期前十大 市場佔比	84.5%	94.3%
前十名合計	82.39	後十名合計	-22.03			

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

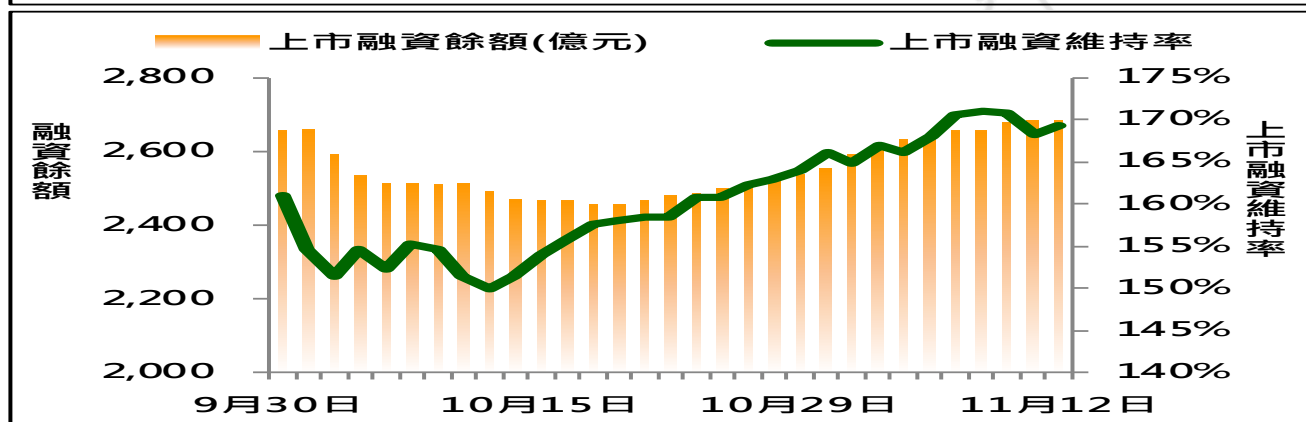
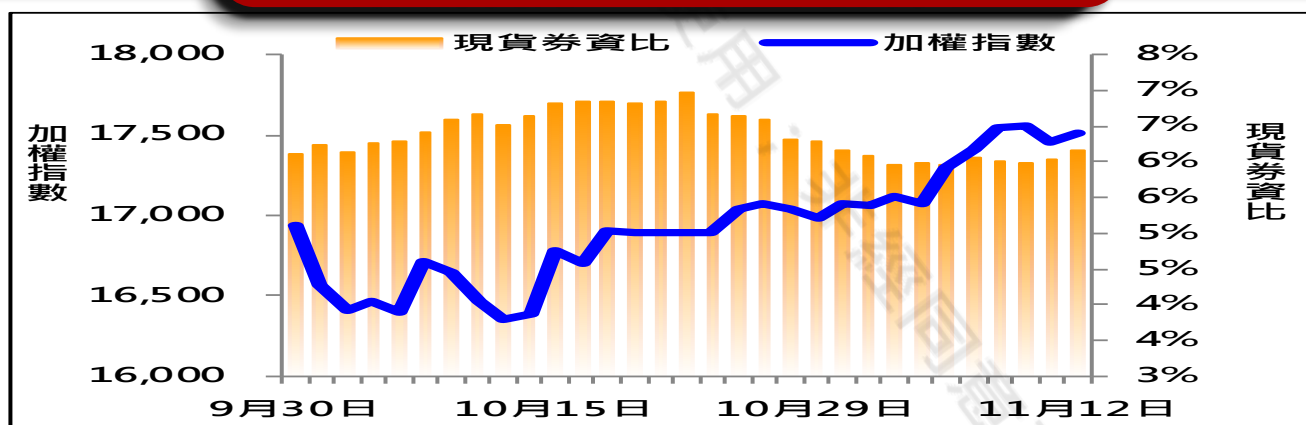


## 法人現貨、期貨 & 選擇權籌碼變化

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
11月12日	79.3	-16,971	1,019	-4.8	16,223	-282
11月15日	54.4	-15,579	1,392	-0.1	15,500	-723

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
11月12日	5,093	33,468	-28,375	-11,679	202	-11,881
11月15日	3,951	36,924	-32,973	-3,534	-6,977	3,443

## 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。

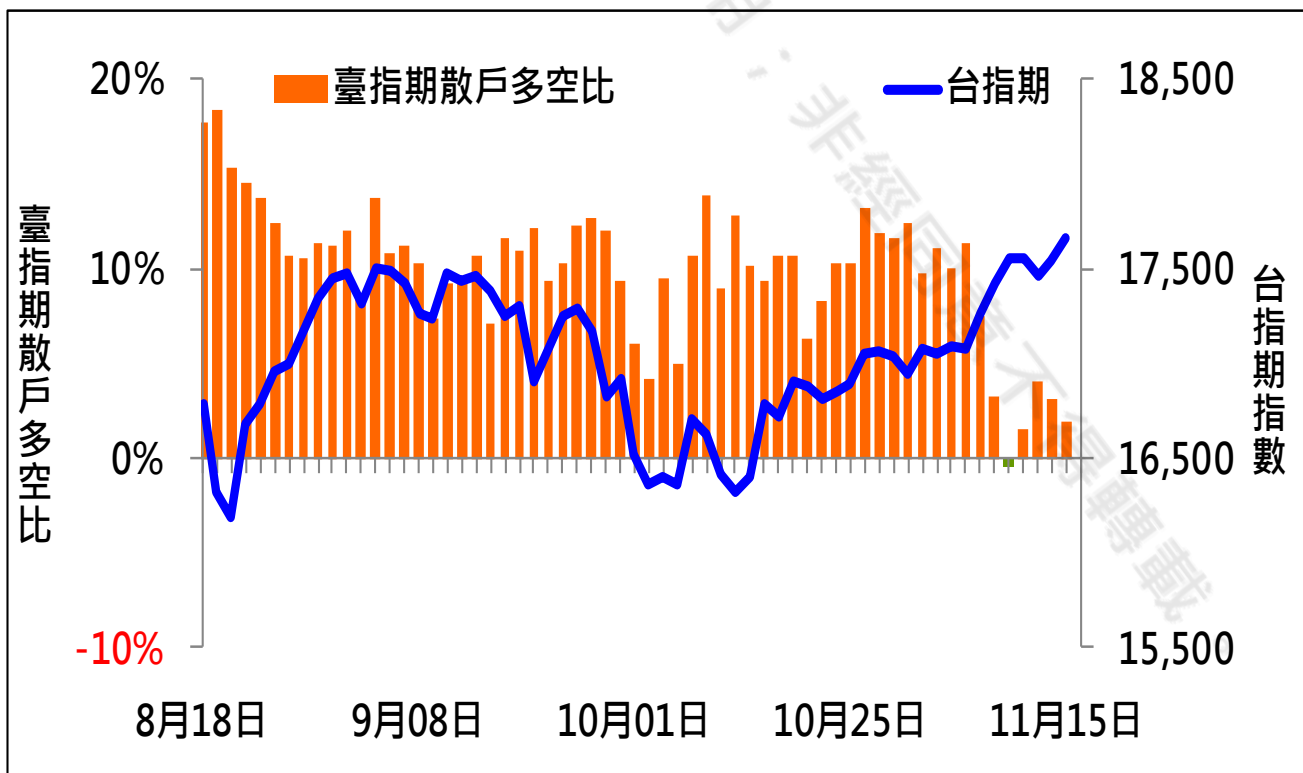
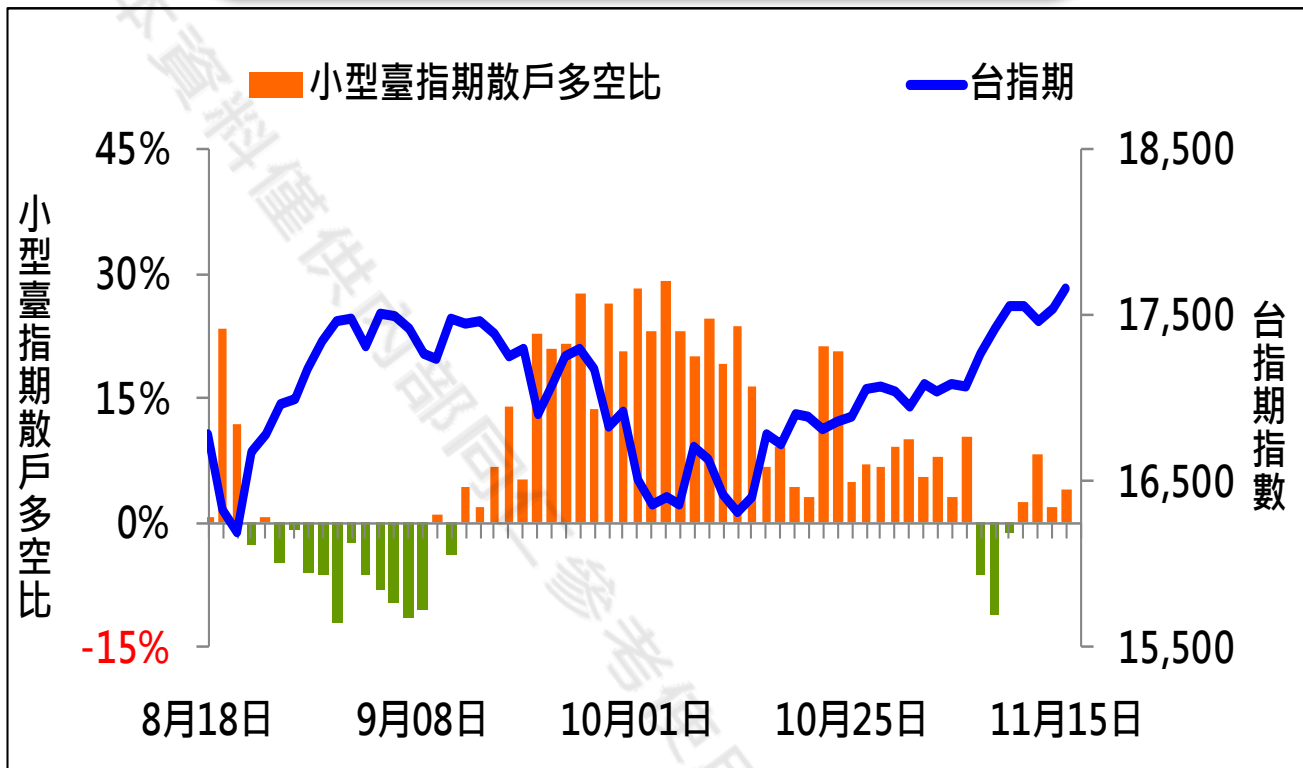
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

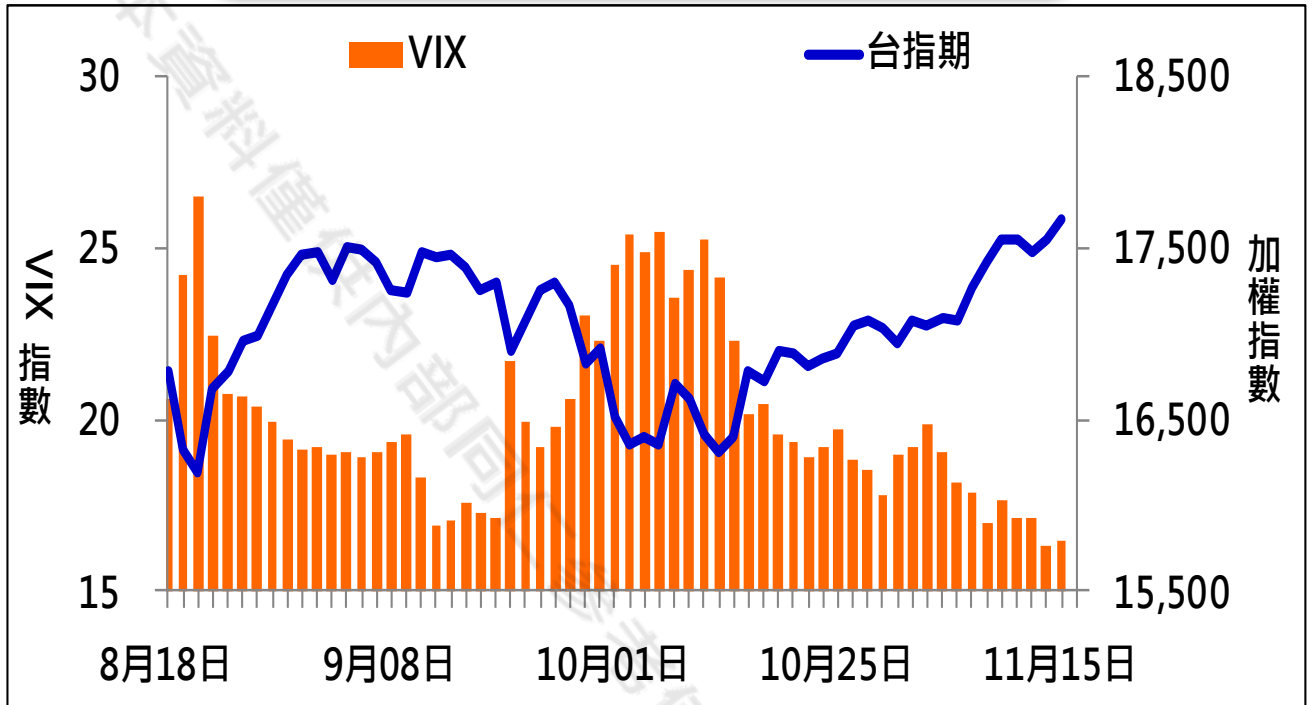
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

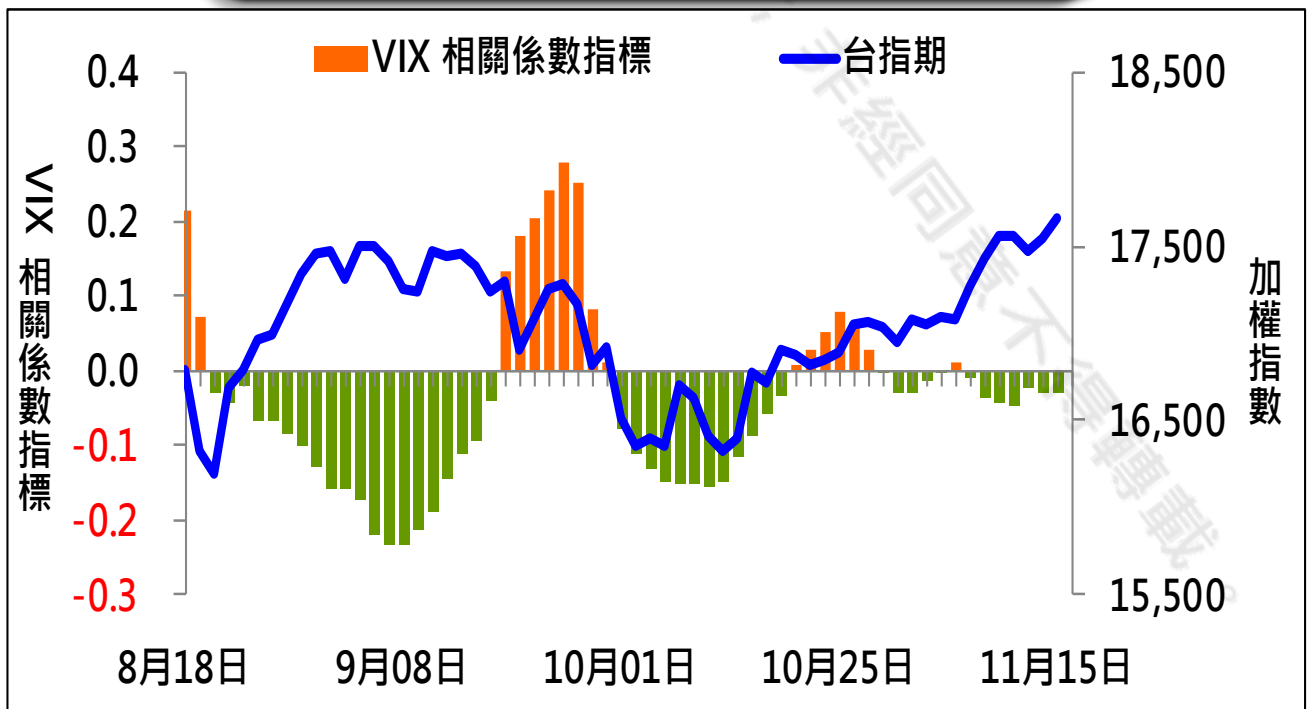
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



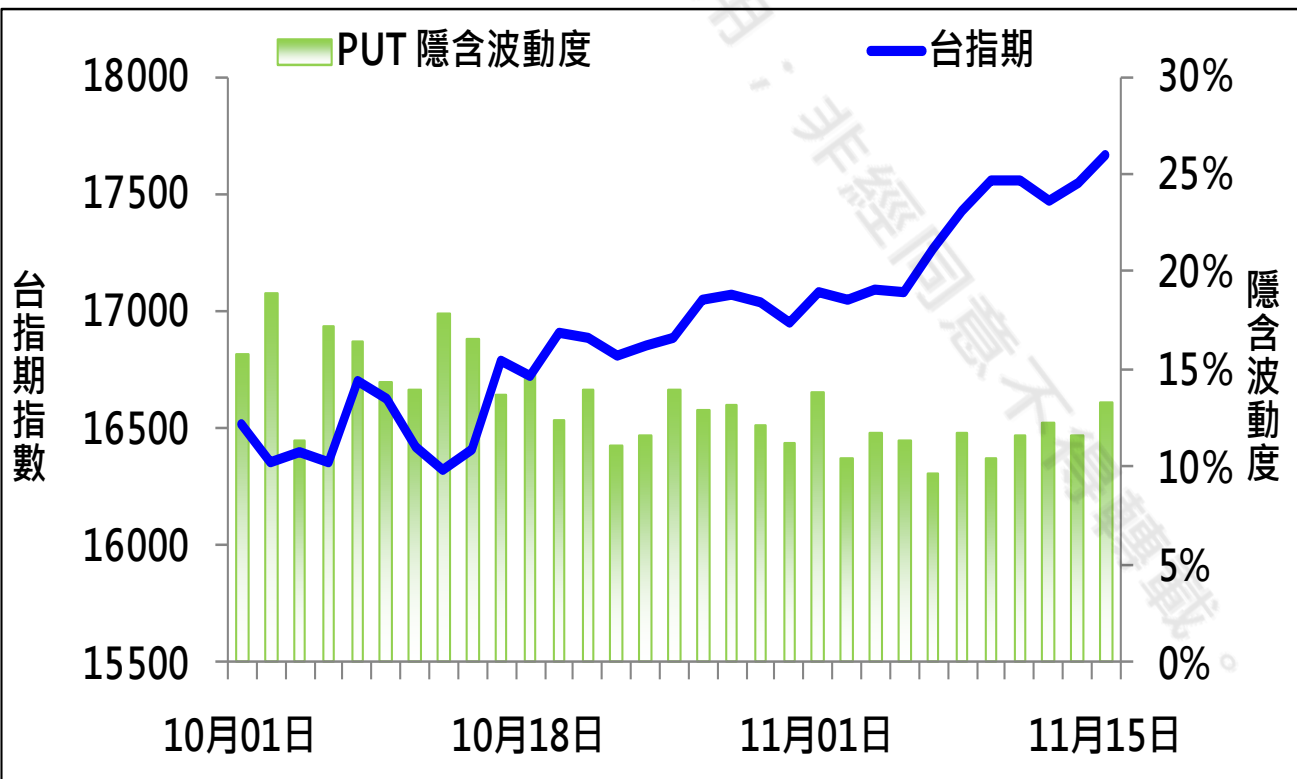
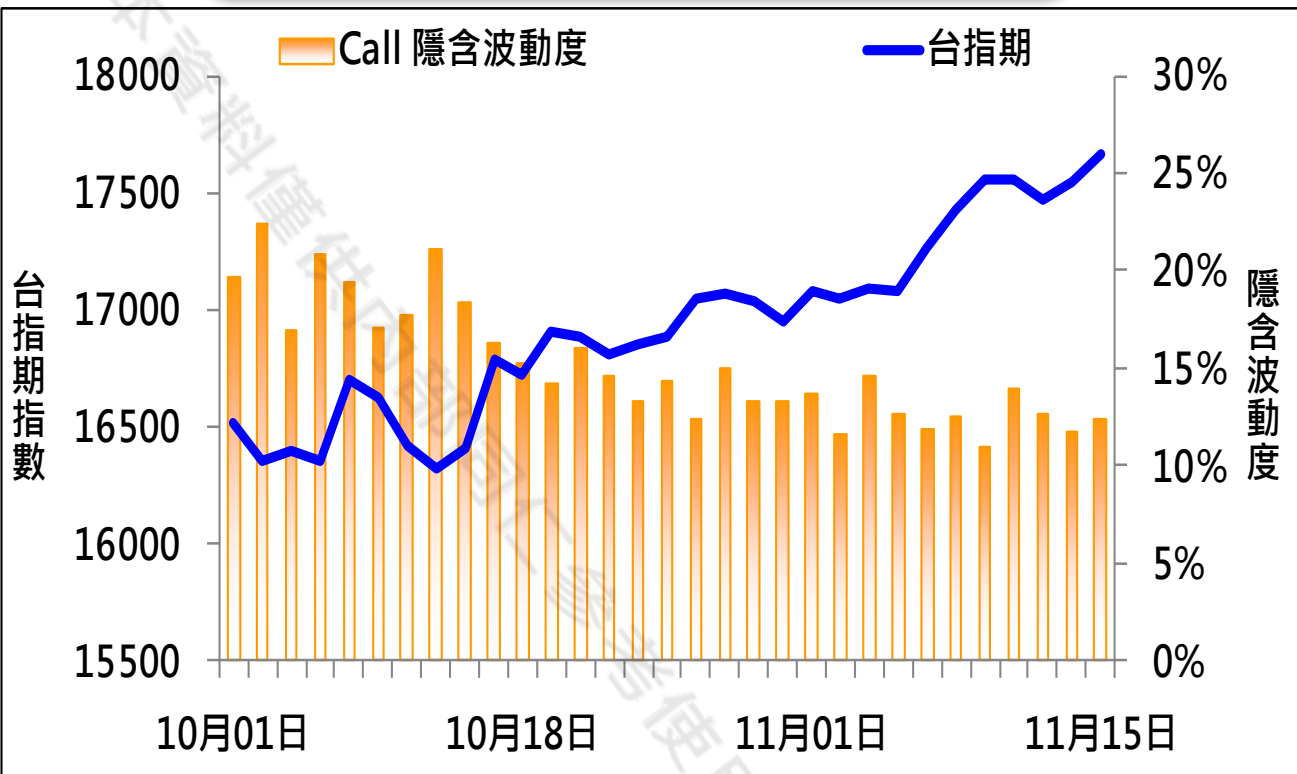
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/15

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
-62	3,713	17,000	9,811	-81
23	45	17,050	3,265	-290
-87	3,015	17,100	8,351	-602
0	37	17,150	4,589	14
-52	2,408	17,200	9,698	-728
16	141	17,250	5,844	-376
-185	3,660	17,300	11,551	-967
-68	362	17,350	7,751	670
-1,049	4,858	17,400	13,376	3,334
-520	1,846	17,450	10,432	5,342
-1,726	7,659	17,500	14,097	6,662
423	4,902	17,550	8,587	4,614
-1,913	16,453	17,600	8,324	4,549
2,030	8,082	17,650	3,981	2,641
-1,083	15,902	17,700	9,039	8,153
2,357	8,856	17,750	792	513
271	16,840	17,800	731	447
1,403	8,516	17,850	175	75
※ 3,606	12,053	17,900	154	40
1,614	4,030	17,950	23	-4
366	15,565	18,000	55	15
398	2,162	18,050	25	23
-216	6,735	18,100	27	20
229	3,606	18,200	8	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,478	174,502	1.3031	227,400	32,728

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：2021/11/15

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112月 履約價	Put	OI 增減
0	33	16,200	7,956	-56
0	4	16,300	1,683	93
0	30	16,400	5,803	114
0	25	16,500	2,289	-384
0	42	16,600	1,789	59
-20	65	16,700	8,880	184
-26	79	16,800	2,765	-35
7	175	16,900	2,455	184
-8	251	17,000	2,828	992
13	909	17,100	1,469	218
-2	1,456	17,200	1,236	404
-4	481	17,300	501	121
-14	410	17,400	439	46
39	1,329	17,500	708	91
259	1,558	17,600	377	95
57	2,339	17,700	262	39
423	2,282	17,800	139	45
177	2,507	17,900	193	77
199	3,820	18,000	866	9
-182	2,580	18,100	16	4
-163	2,931	18,200	3	3
554	4,399	18,300	1	1
※	695	18,400	3	0
	477	18,500	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,142	49,368	1.3842	68,335	4,149
昨日 P/C	1.4192	今日增減變化		-0.0350

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。

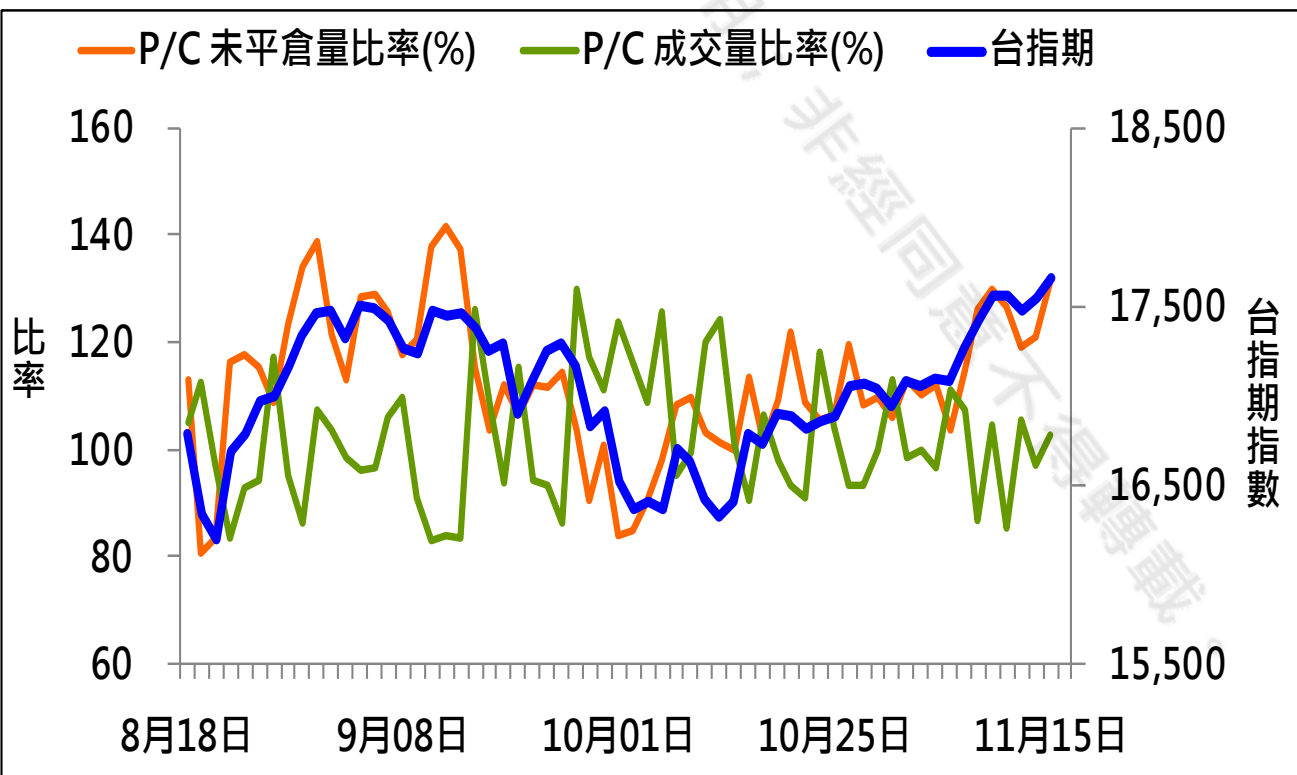
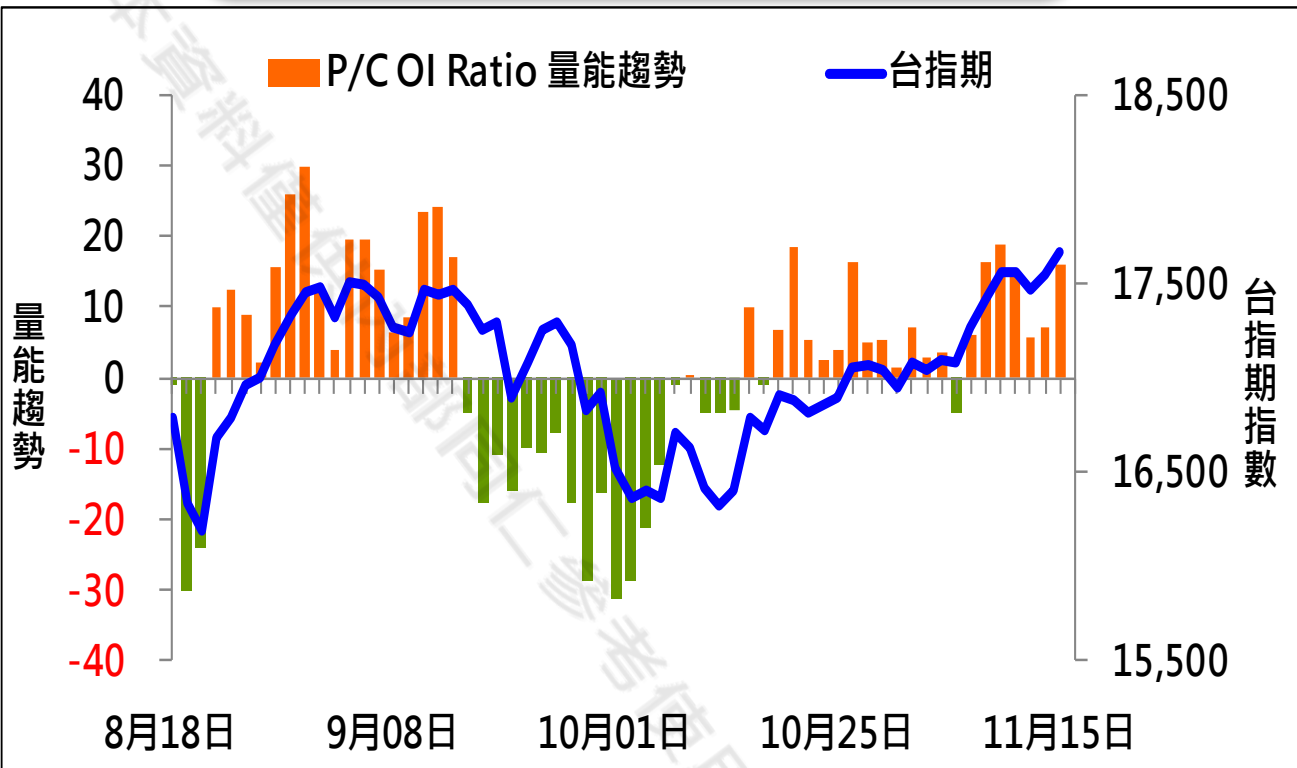
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



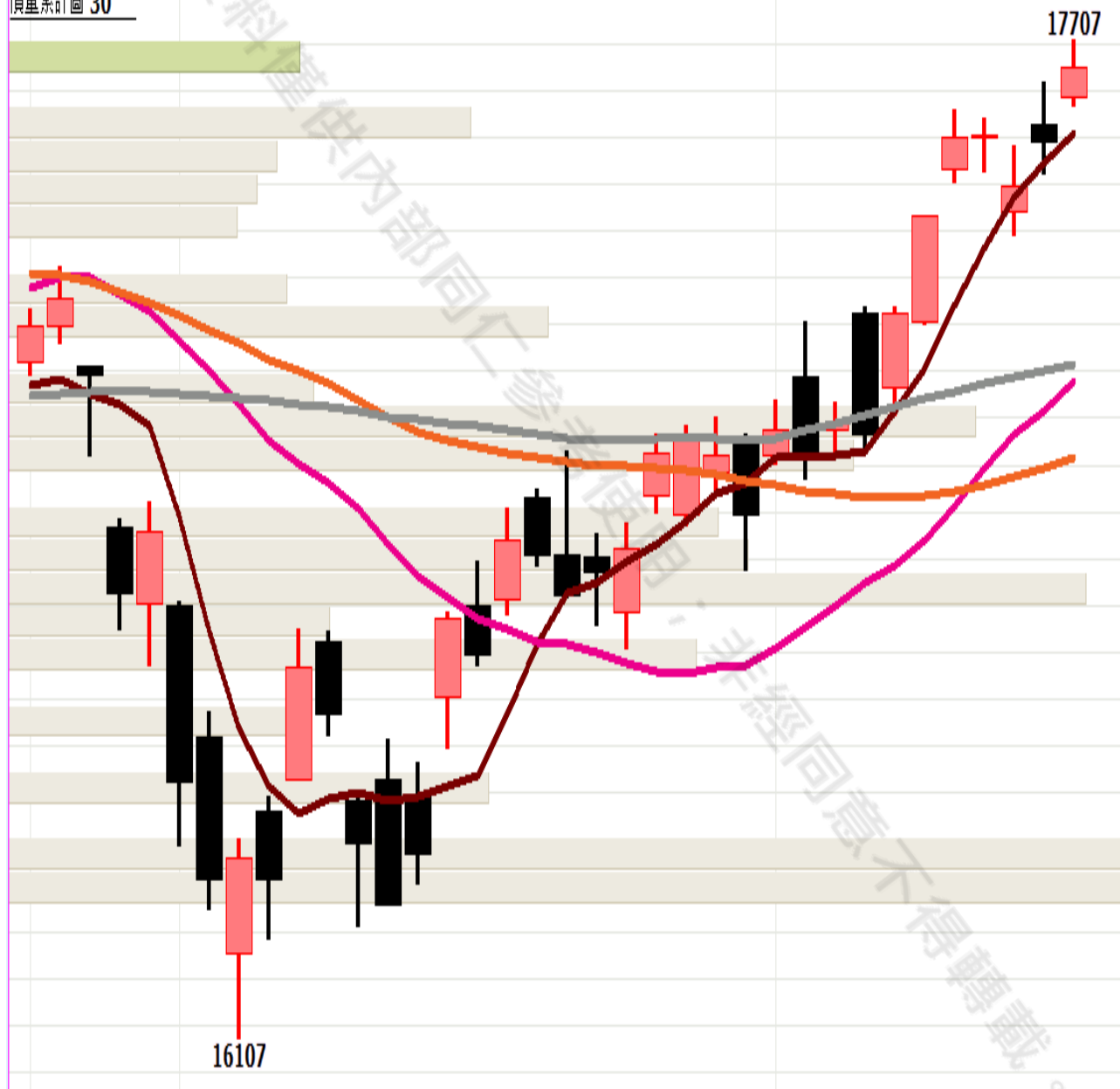


## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX\*1) 日線圖 2021/11/15 開 17615 高 17707 低 17603 收 17664 s點 量 98946 口 +120

SMA5 17557.20↑ SMA20 17160.50↑ SMA60 17035.80↑ SMA120 17185.42↑

價量累計圖 30



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