



法人籌碼動態

11月18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	-17,940	-2,390	667	61	-1,931	-404
投信	-1,243	104	150	-3	10	-14
自營商	13,408	-415	-161	-36	606	284

11月18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	-87	-34	151	490	16,267	4,031
投信	1	-1	0	0	-59	0
自營商	70	16	9,975	5,420	-4,781	-8,235

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
聯發科	28.83	富邦煤	-3.92	台指期前十大 市場佔比	48.9%	53.1%
台積電	25.64	台塑化	-3.14			
友達	4.44	欣興	-2.73			
國泰金	3.88	南電	-2.56			
長榮	3.44	聯電	-2.05	電子期前十大 市場佔比	68.6%	70.8%
群創	3.28	大立光	-1.55			
新光金	3.07	長榮航	-1.54			
兆豐金	2.24	緯穎	-1.50	金融期前十大 市場佔比	64.7%	89.9%
台塑	2.10	矽力-KY	-1.38			
和泰車	1.98	台達電	-1.28			
前十名合計	78.89	後十名合計	-21.64	非金電期前十大 市場佔比	92.4%	98.1%

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

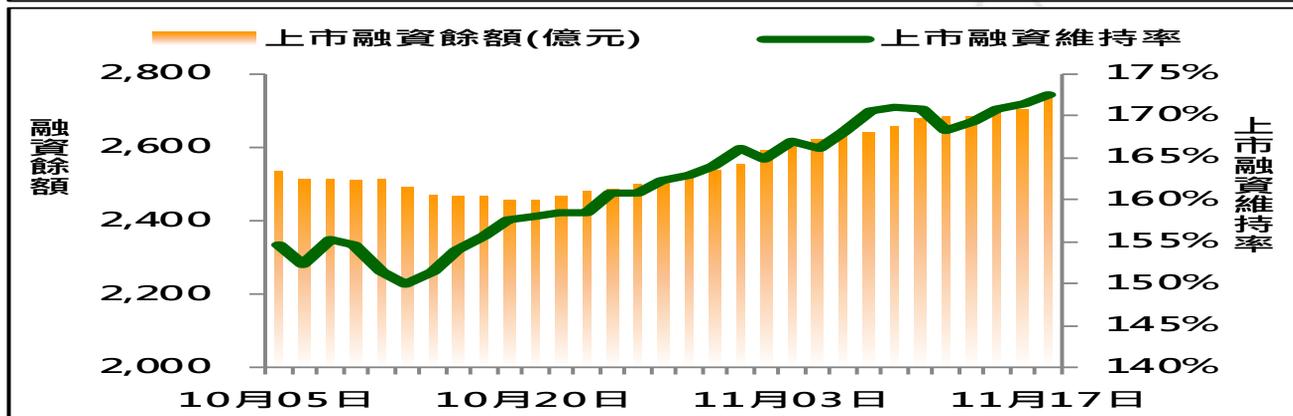
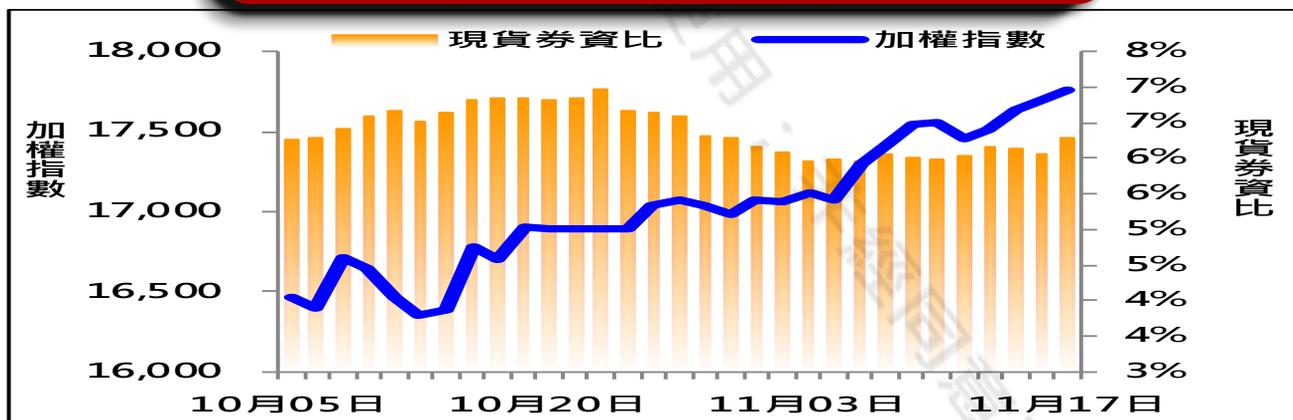


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月16日	77.0	-15,063	516	-12.9	13,527	-1,973
11月17日	-2.3	-15,550	-487	-6.6	13,823	296
11月18日	101.7	-17,940	-2,390	5.5	13,408	-415

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
11月16日	5,511	34,798	-29,287	4,195	-22,500	26,695
11月17日	-339	12,236	-12,575	4,555	3,454	1,101
11月18日	151	16,267	-16,116	9,975	-4,781	14,756

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。

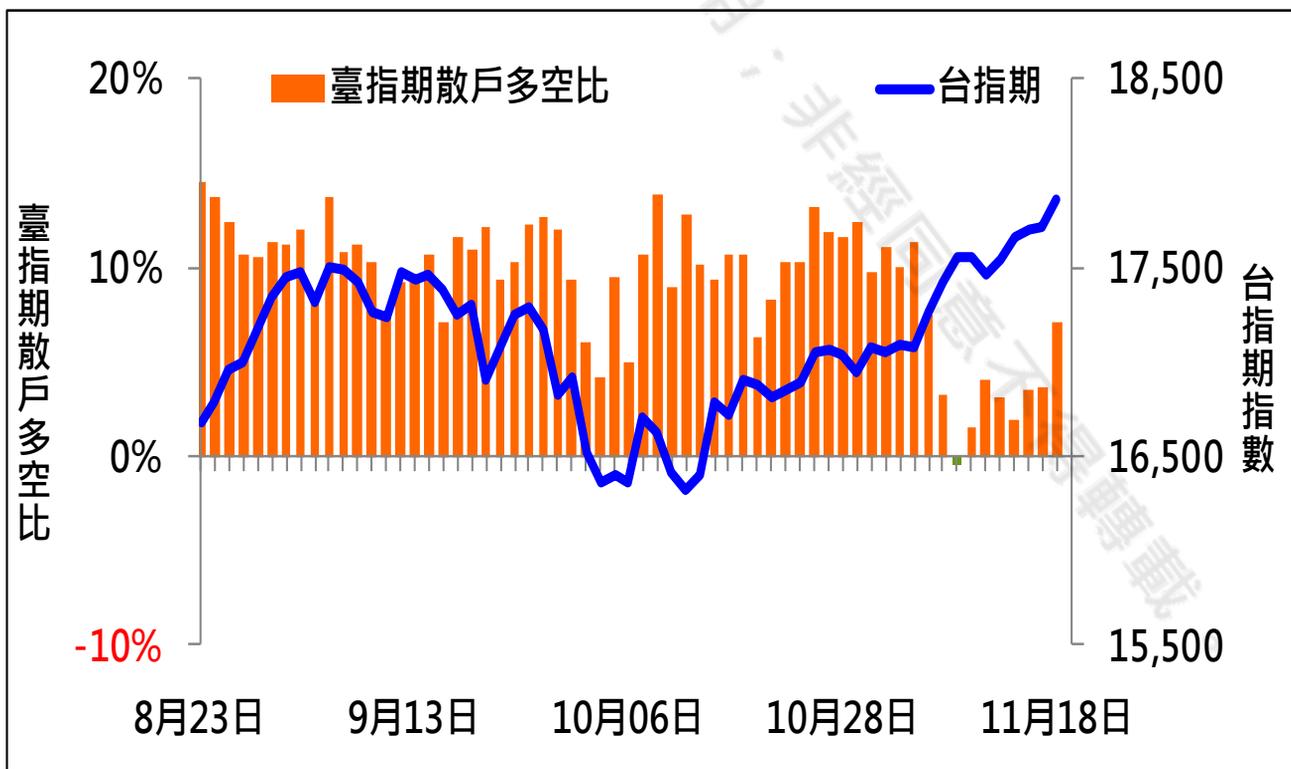
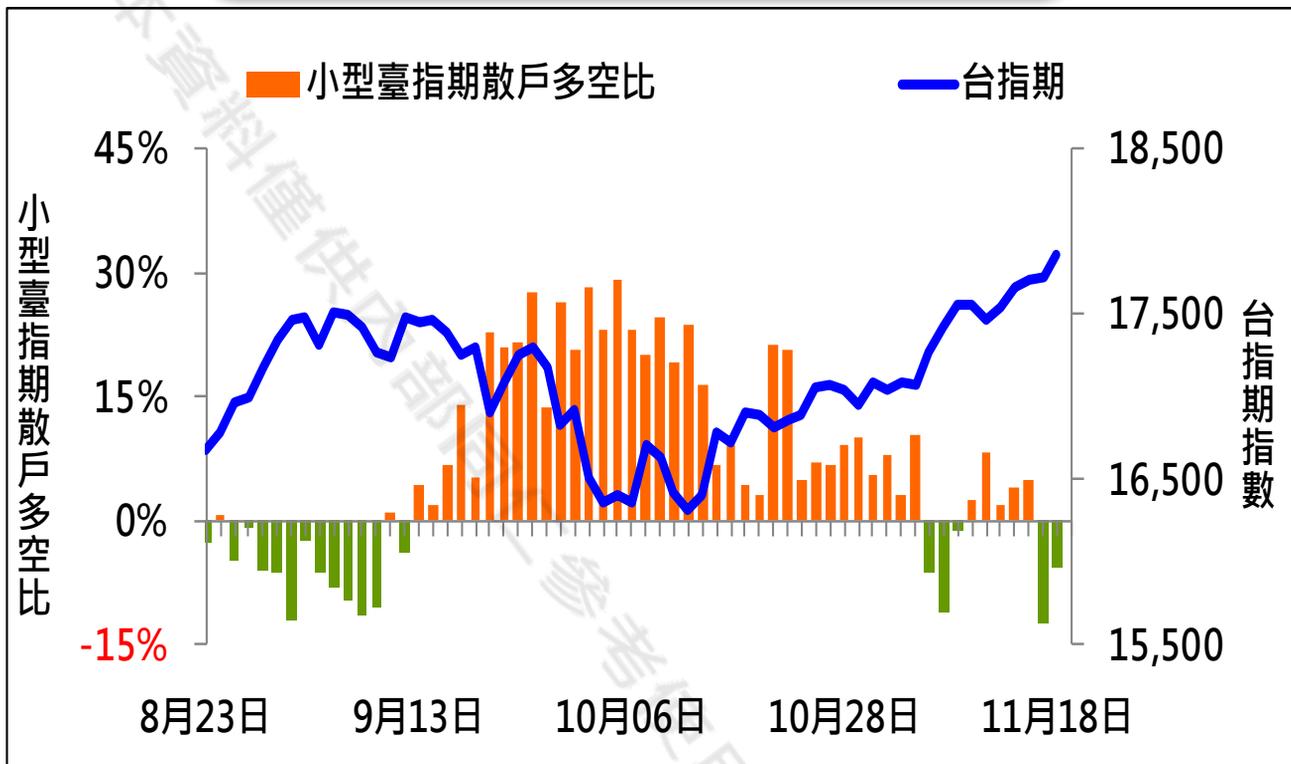
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

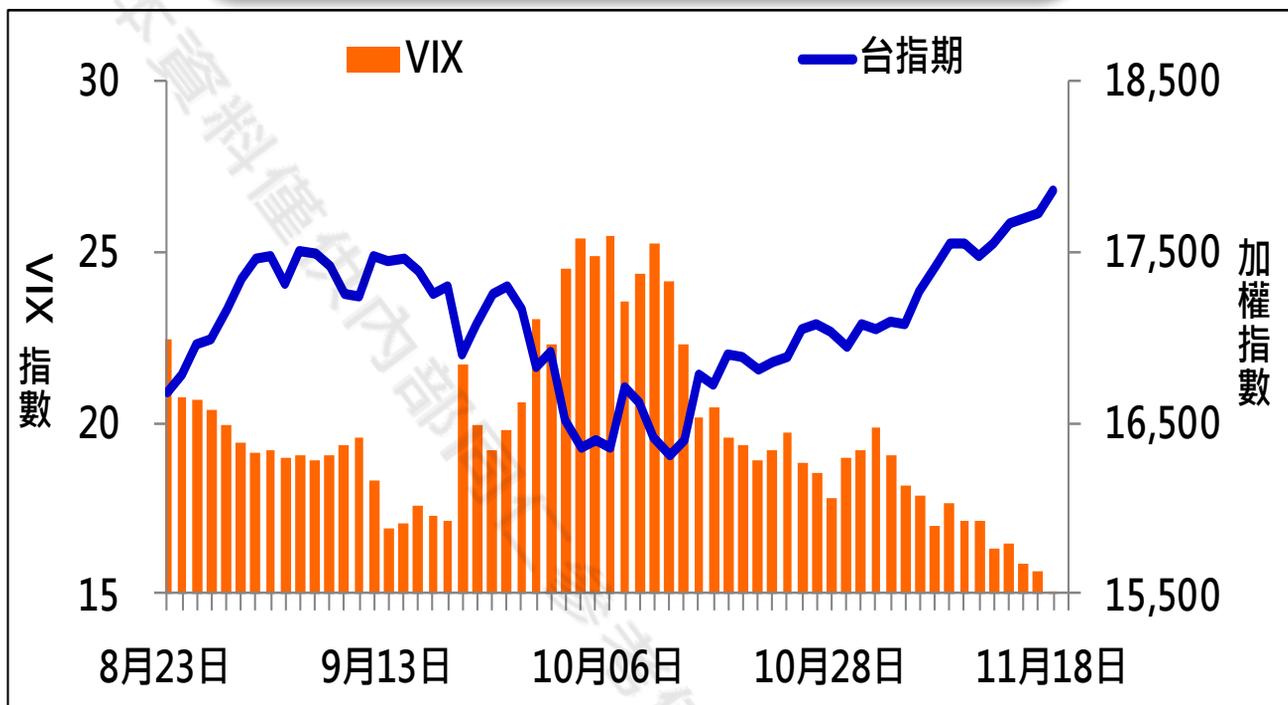
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

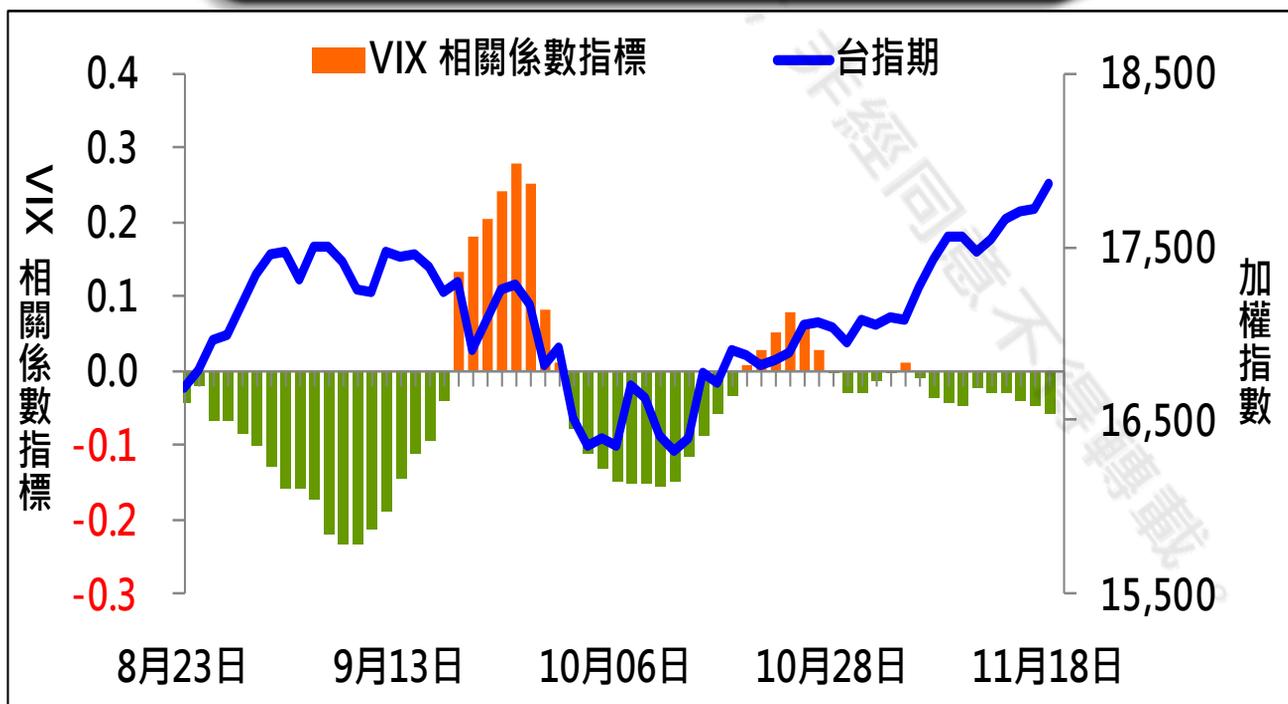
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



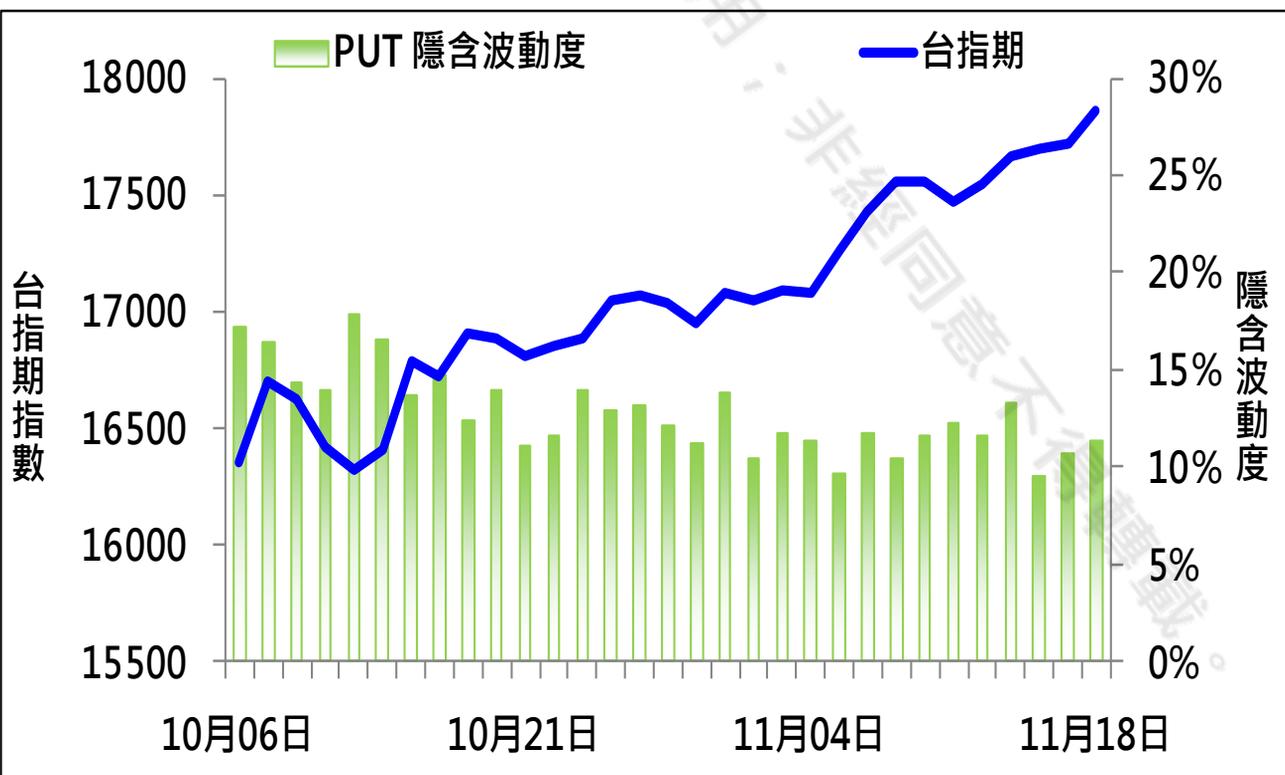
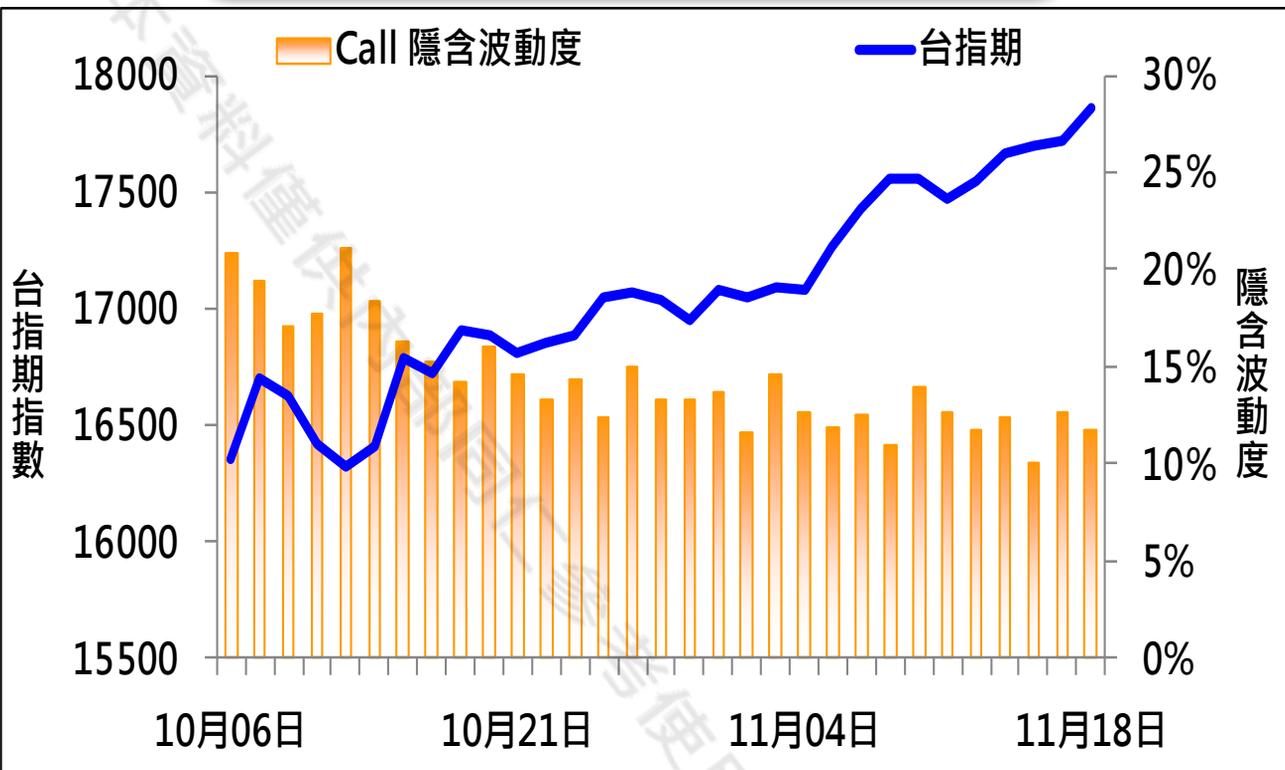
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



週選擇權OI變化

日期：2021/11/18

結算日：2021/11/24

OI 增減	Call	202111W4 履約價	Put	OI 增減
4	9	17,200	1,998	560
0	0	17,250	1,586	539
0	37	17,300	3,264	1,545
0	3	17,350	2,986	1,824
5	25	17,400	5,769	3,933
17	55	17,450	3,866	1,884
74	105	17,500	6,507	4,923
81	131	17,550	4,956	3,305
183	349	17,600	5,889	4,162
322	623	17,650	3,734	2,855
154	1,140	17,700	5,912	4,335
900	2,083	17,750	3,862	2,988
1,809	3,638	17,800	4,172	3,750
2,547	3,726	17,850	3,409	3,193
2,389	4,225	17,900	3,406	3,018
1,827	3,176	17,950	425	350
3,314	7,056	18,000	498	368
5,067	6,918	18,050	192	183
※ 6,061	8,042	18,100	70	62
3,361	4,487	18,150	33	25
1,998	2,621	18,200	21	-3
301	301	18,250	2	2
728	1,166	18,300	0	0
245	333	18,400	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
31,509	50,374	1.3791	69,470	46,373

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：2021/11/18

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112月 履約價	Put	OI 增減
0	30	16,400	6,601	524
0	25	16,500	2,837	198
0	42	16,600	2,205	17
0	65	16,700	10,236	752
-12	94	16,800	3,736	328
-1	182	16,900	4,471	1,835
40	446	17,000	5,276	1,431
446	2,252	17,100	2,939	393
567	2,233	17,200	4,472	2,495
0	474	17,300	1,830	863
-24	402	17,400	1,652	613
-69	1,352	17,500	1,447	526
335	2,090	17,600	924	224
371	2,941	17,700	2,093	1,540
※ 1,508	3,792	17,800	1,015	674
200	3,039	17,900	530	168
332	4,616	18,000	997	83
453	4,044	18,100	161	101
377	3,597	18,200	63	44
724	5,794	18,300	9	4
1,133	4,548	18,400	251	69
1,437	4,017	18,500	5	3
514	2,088	18,600	8	0
376	1,231	18,700	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
9,060	66,327	1.4612	96,920	14,994
昨日 P/C	1.4306	今日增減變化		0.0306

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。

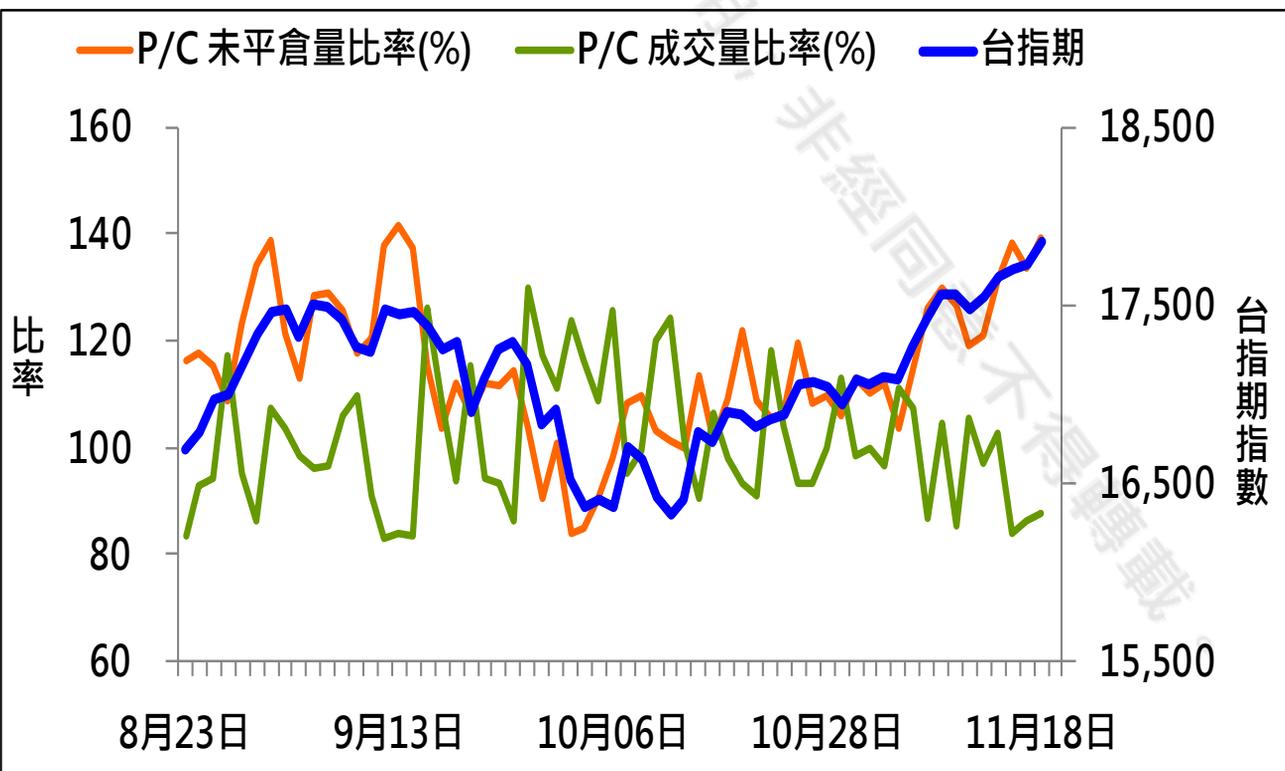
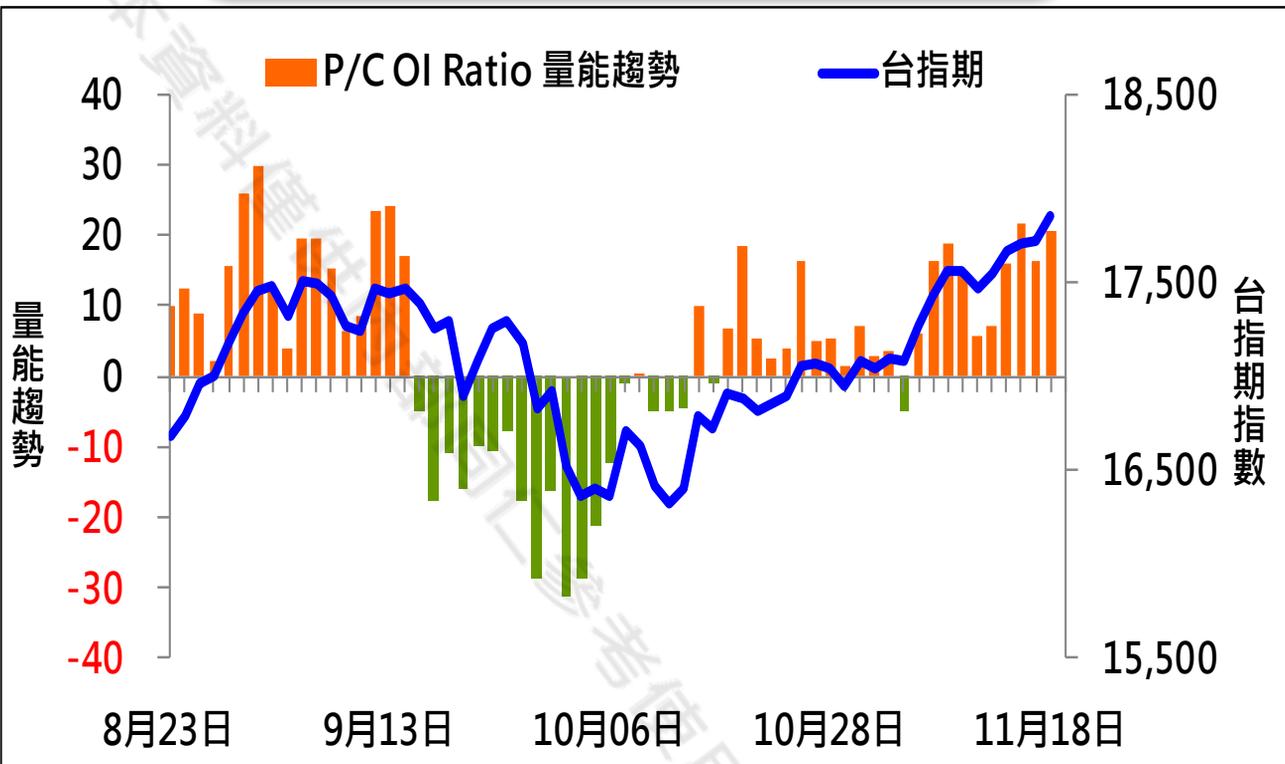
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

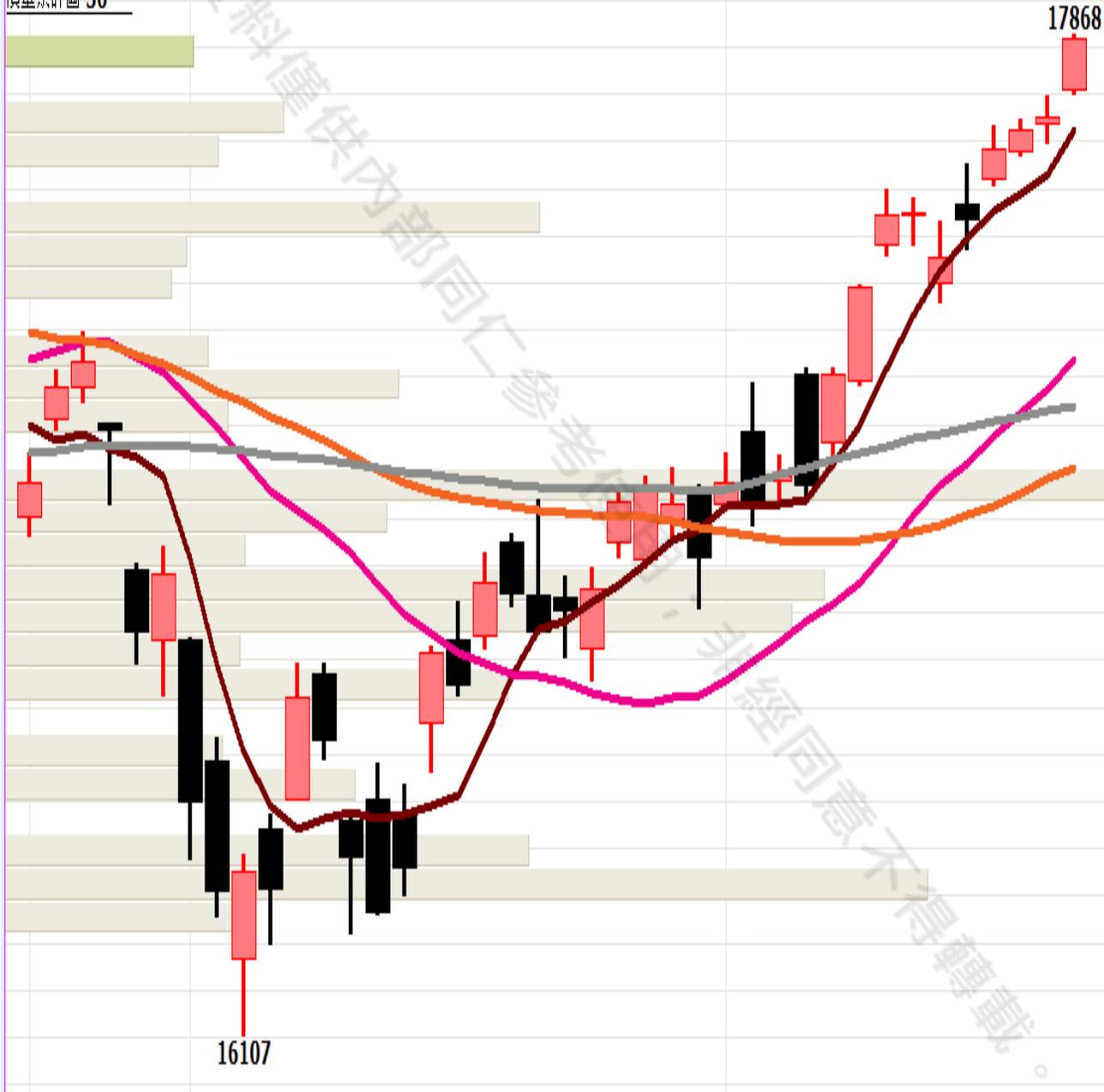


盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FITX*1) 日線圖 2021/11/18 開 17769 高 17868 低 17763 收 17859 s 點 量 87837 口 +136

SMA5 17697.60↑ SMA20 17294.50↑ SMA60 17103.88↑ SMA120 17212.67↑

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