



## 法人籌碼動態

12月30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	-25,156	-2,065	15	-46	-2,108	-69
投信	1,654	28	160	0	13	0
自營商	15,634	501	164	-37	397	21

12月30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	-47	2	4,140	66	25,962	1,314
投信	1	0	0	0	-49	0
自營商	49	-1	-3,389	-3,091	1,902	2,752

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
華邦電	3.05	台積電	-8.45	台指期前十大 市場佔比	48.3%	55.2%
大立光	2.62	鴻海	-4.52			
聯發科	2.61	陽明	-3.37			
南亞科	1.51	台塑	-3.11	電子期前十大 市場佔比	58.1%	67.4%
華航	1.48	矽力-KY	-2.60			
長榮航	1.17	長榮	-2.59			
聯詠	0.99	台達電	-2.54	金融期前十大 市場佔比	55.6%	91.7%
國巨	0.89	國泰金	-2.40			
順德	0.74	富邦媒	-2.37			
日月光投控	0.72	萬海	-1.99	非金電期前十大 市場佔比	97.2%	98.2%
前十名合計	15.78	後十名合計	-33.94			

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

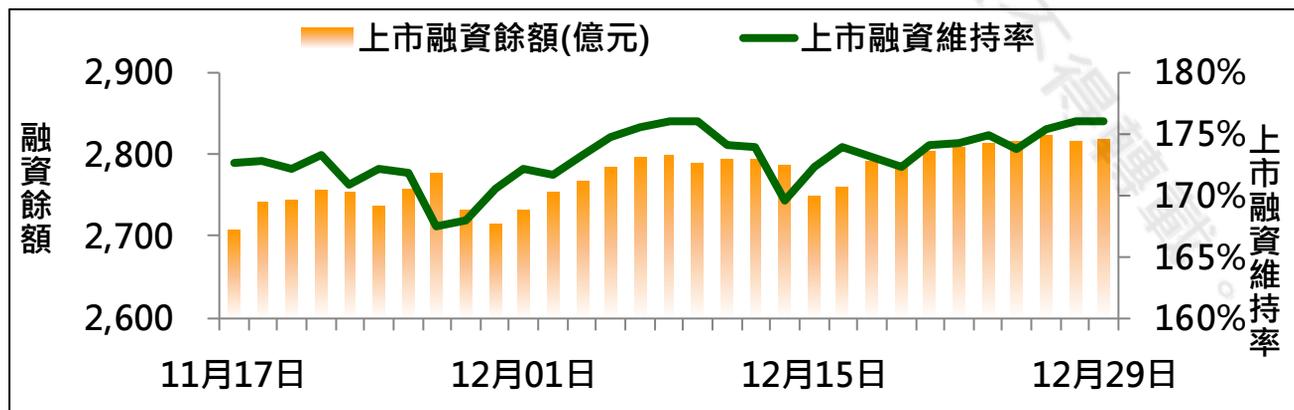
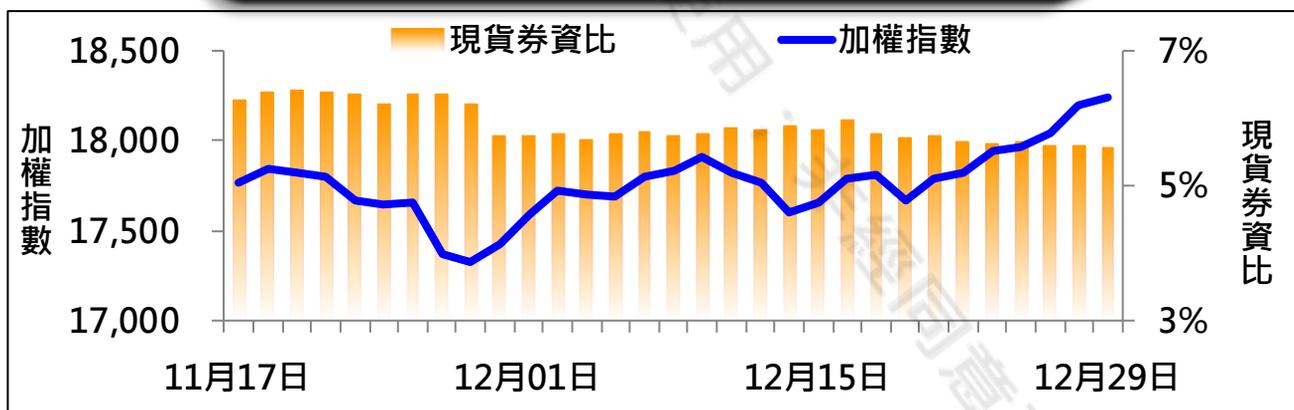


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
12月24日	86.0	-24,656	-790	9.4	15,414	-607
12月27日	111.7	-23,460	1,196	13.8	15,147	-267
12月28日	215.5	-22,593	867	17.3	14,488	-659
12月29日	132.1	-23,091	-498	8.7	15,133	645
12月30日	27.4	-25,156	-2,065	2.8	15,634	501

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
12月24日	5,047	27,247	-22,200	2,033	1,008	1,025
12月27日	3,903	28,682	-24,779	6,772	-6,088	12,860
12月28日	6,008	29,662	-23,654	7,648	-11,503	19,151
12月29日	4,074	24,648	-20,574	-298	-850	552
12月30日	4,140	25,962	-21,822	-3,389	1,902	-5,291

## 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。

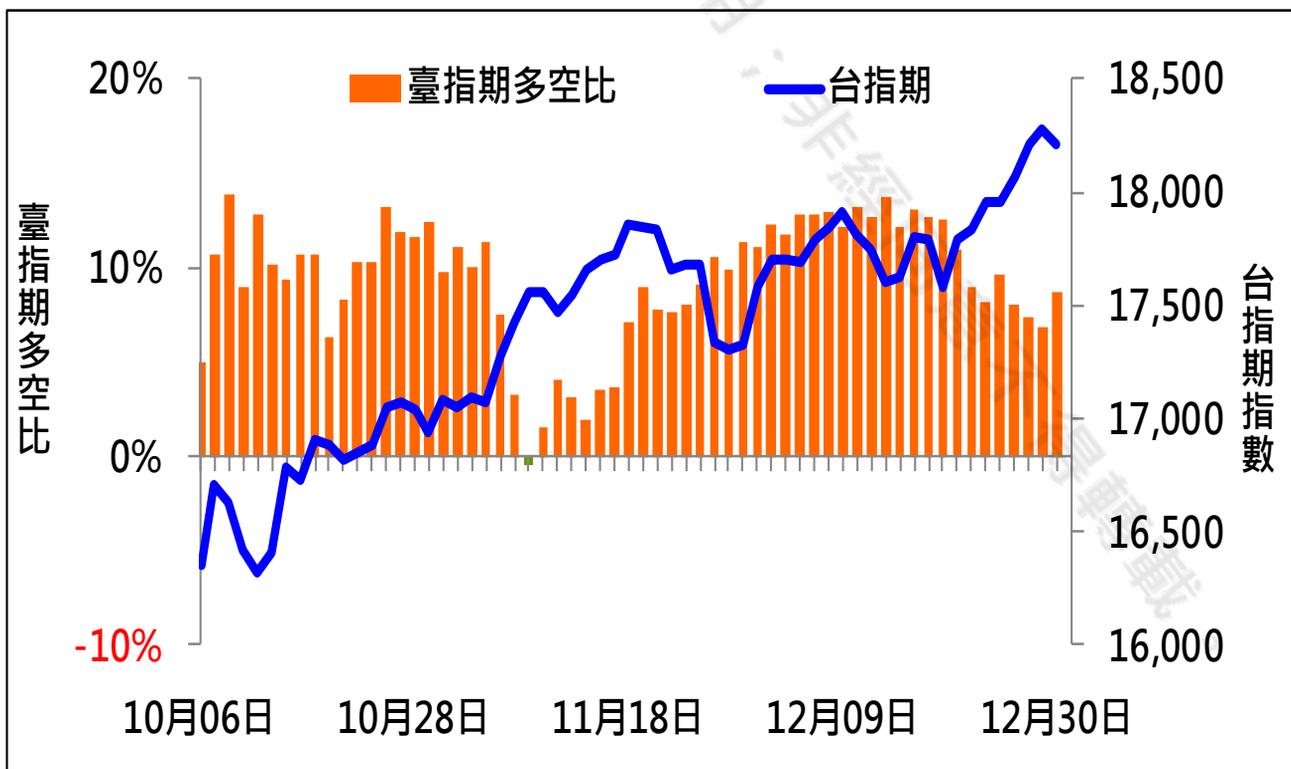
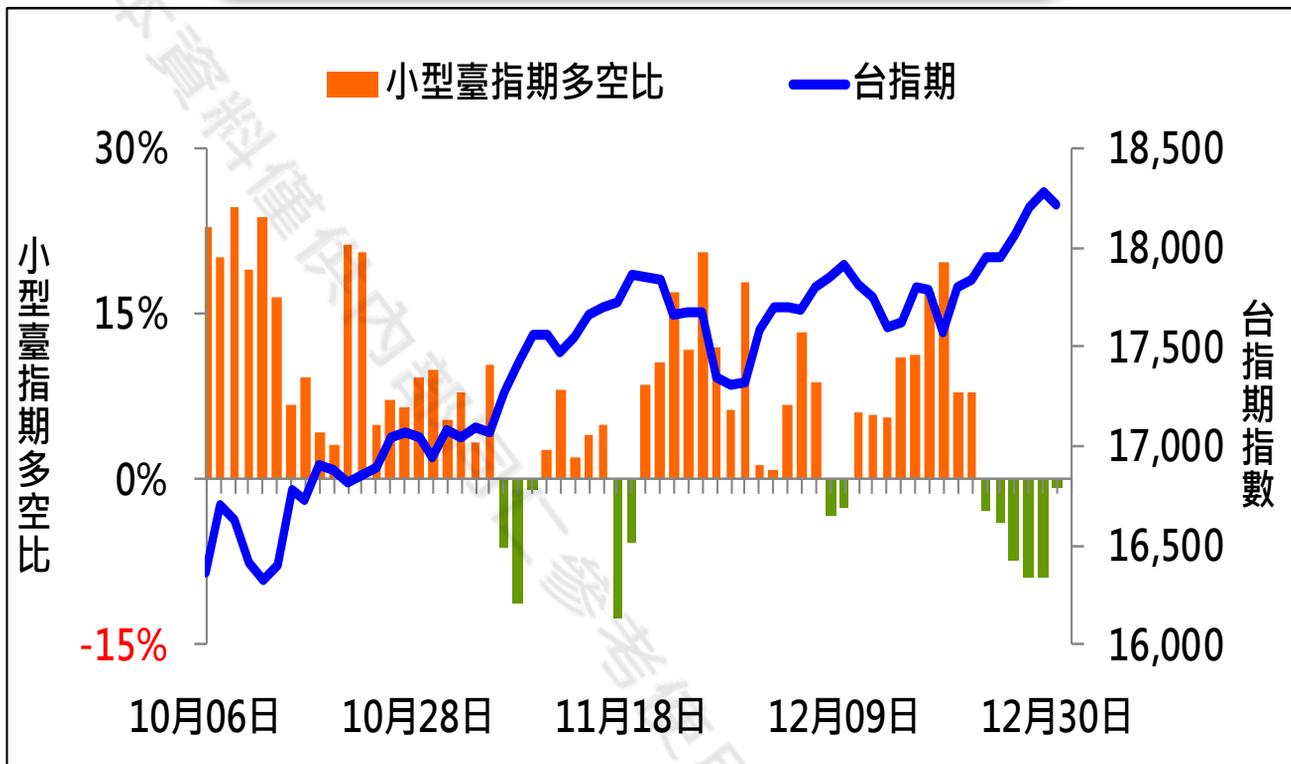
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

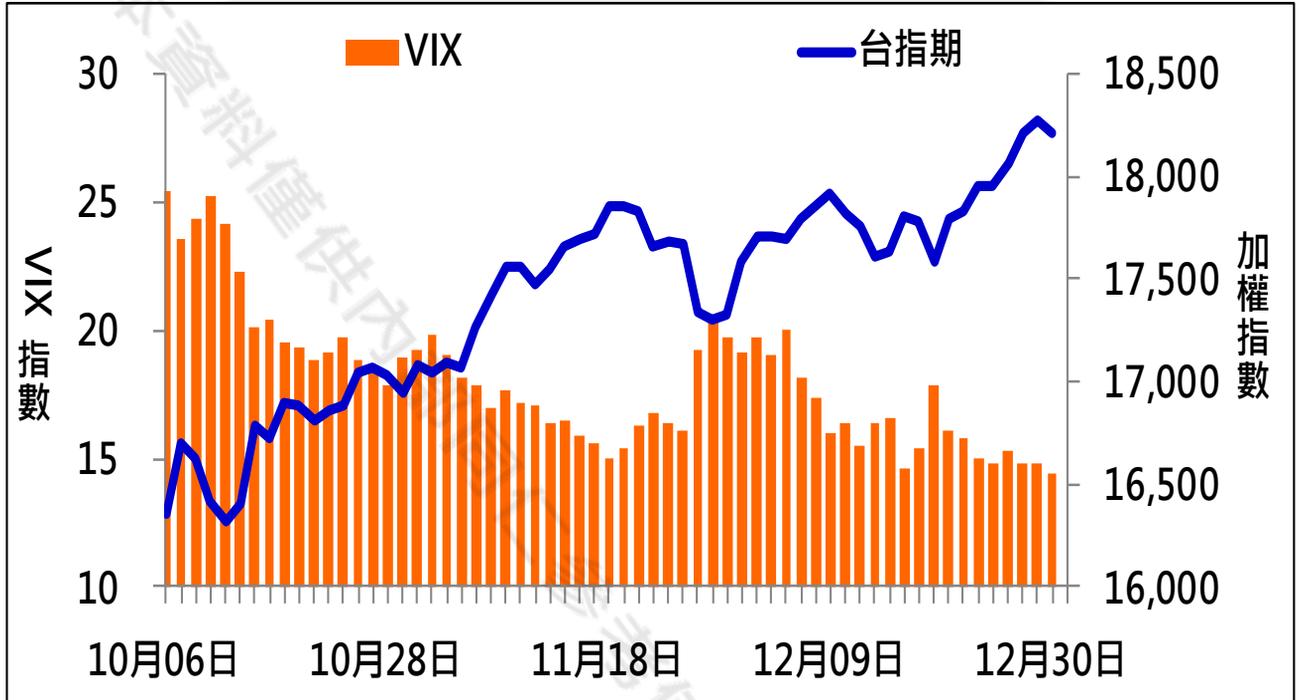
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

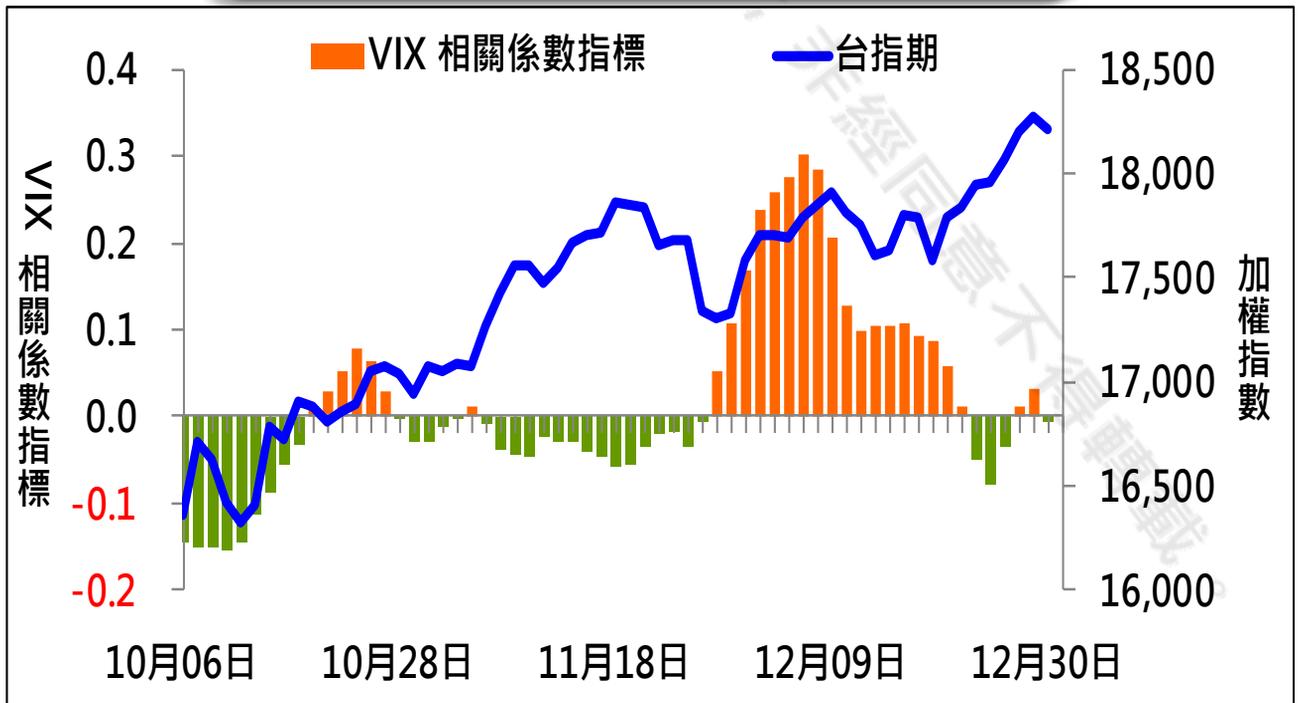
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



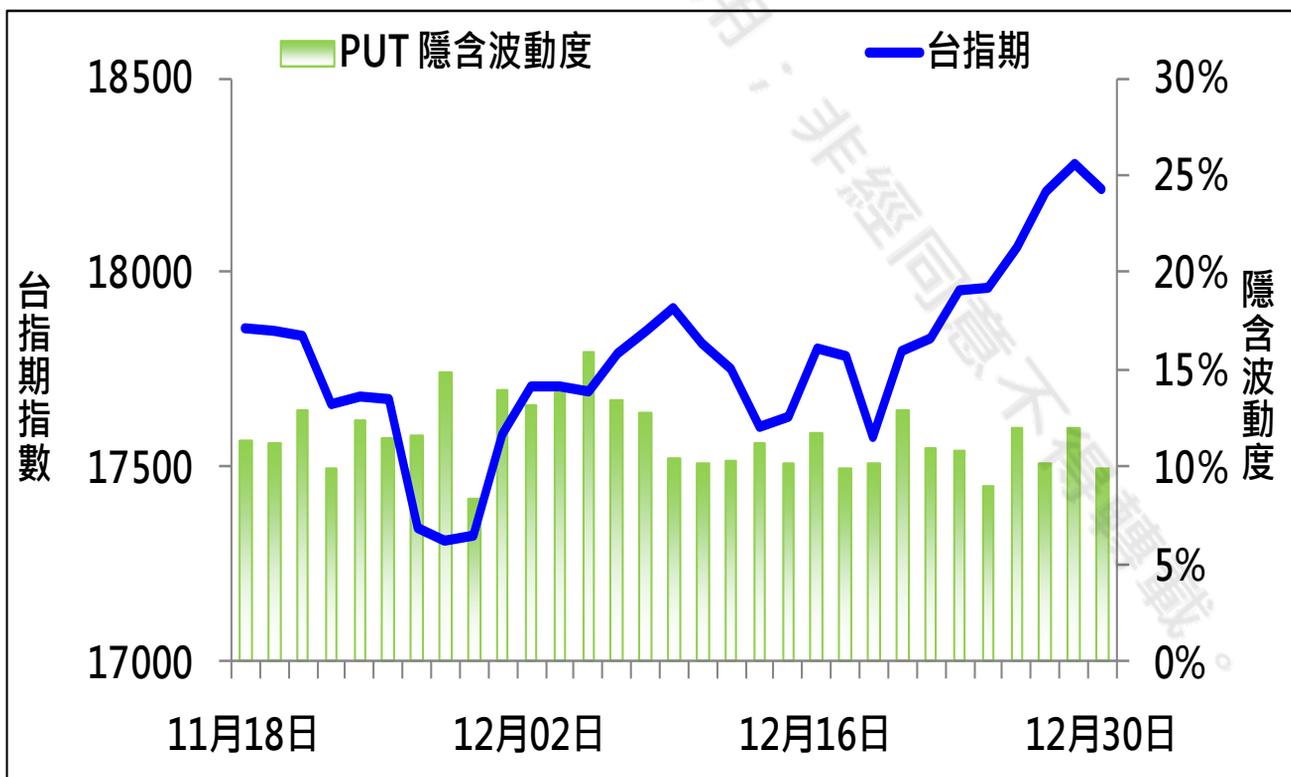
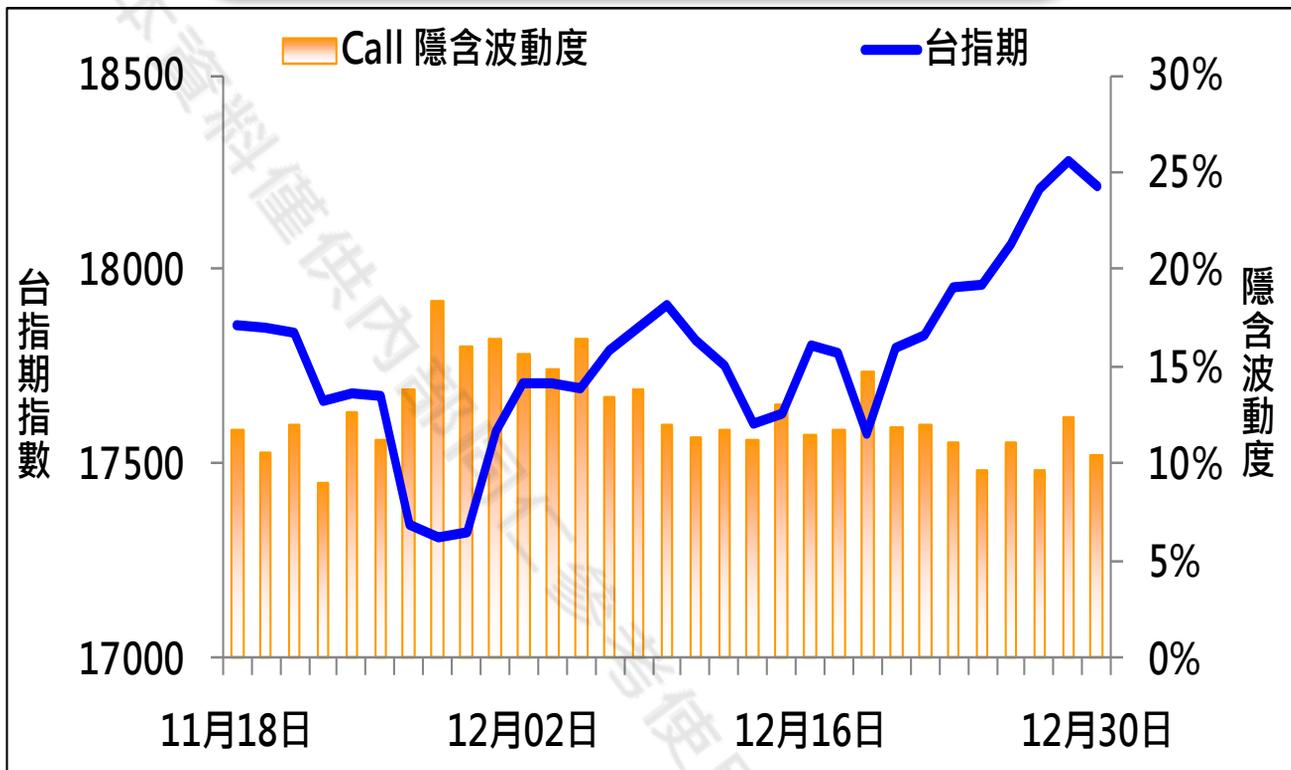
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/12/30

結算日：2022/1/5

OI 增減	Call	202201W1 履約價	Put	OI 增減
0	0	17,600	1,987	1,026
49	50	17,700	2,217	1,312
5	7	17,750	2,233	1,192
7	16	17,800	3,455	1,098
0	0	17,850	6,359	5,520 ※
-2	25	17,900	3,469	1,771
3	29	17,950	4,854	2,839
57	105	18,000	5,172	2,874
139	175	18,050	4,351	3,513
388	524	18,100	3,059	923
554	767	18,150	2,282	1,619
1,146	1,712	18,200	2,709	1,141
991	2,481	18,250	2,523	864
2,658	4,938	18,300	1,919	-319
2,478	4,143	18,350	331	-41
3,107	5,066	18,400	347	167
2,234	3,441	18,450	175	119
※ 4,118	5,996	18,500	101	35
3,242	4,326	18,550	19	11
3,076	5,191	18,600	23	7
2,495	3,398	18,650	1	0
972	1,843	18,700	0	0
584	584	18,750	0	0
1,084	2,018	18,800	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
30,046	48,409	1.2084	58,498	30,530

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：2021/12/30

結算日：2022/1/19

OI 增減	Call	202201月 履約價	Put	OI 增減
0	69	16,900	2,605	2
-1	556	17,000	5,965	2
0	1,586	17,100	4,172	136
0	539	17,200	4,460	-54
8	353	17,300	5,815	828
0	1,113	17,400	3,782	214
6	625	17,500	4,661	277
-11	2,151	17,600	6,670	287
-109	2,372	17,700	4,669	197
-49	2,910	17,800	5,107	394
-54	3,159	17,900	4,457	1,038
-13	4,820	18,000	3,896	625
-108	4,502	18,100	1,366	270
-104	6,404	18,200	1,076	292
-106	8,240	18,300	471	28
-63	7,188	18,400	609	61
414	7,872	18,500	172	-4
872	7,158	18,600	43	4
※ 1,255	5,861	18,700	50	10
370	3,658	18,800	302	19
608	3,784	18,900	18	-1
330	7,375	19,000	1	0
860	2,268	19,100	0	0
966	1,874	19,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,098	95,840	1.1644	111,594	6,181
昨日 P/C	1.1617	今日增減變化		0.0027

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。

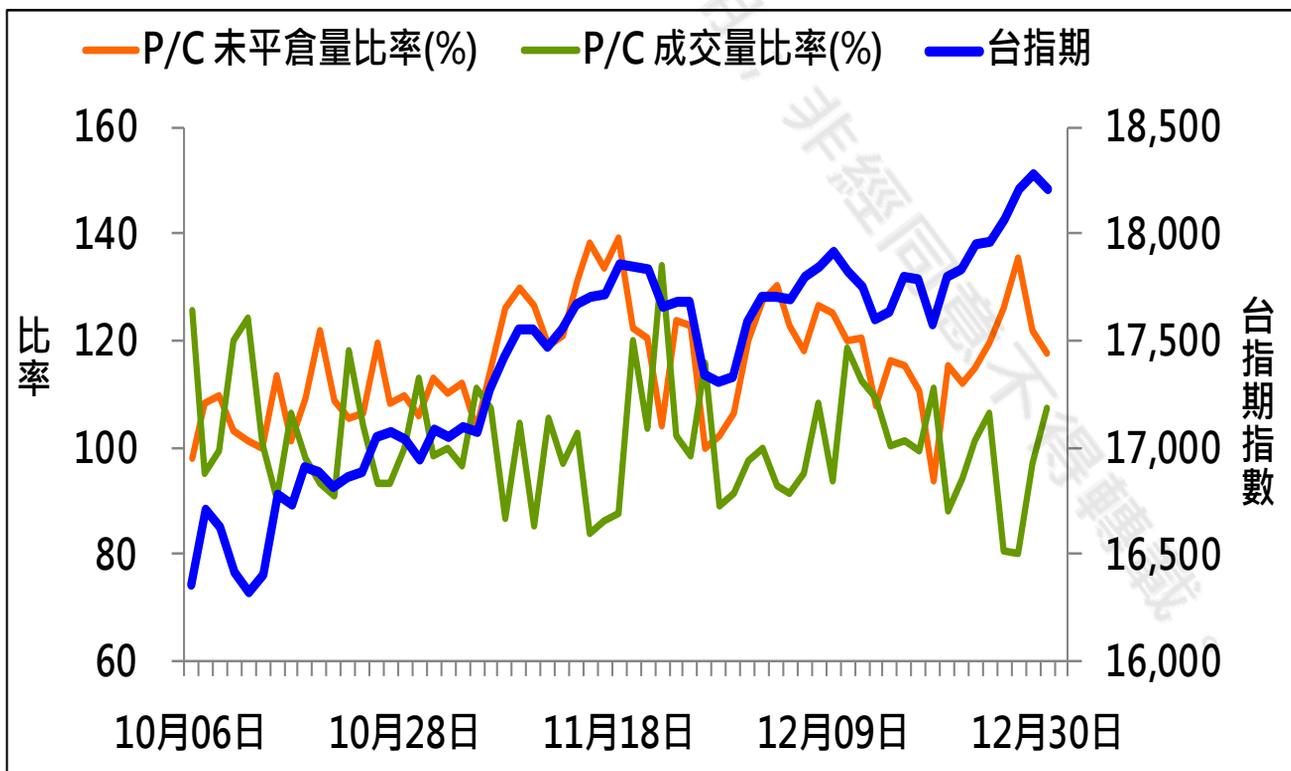
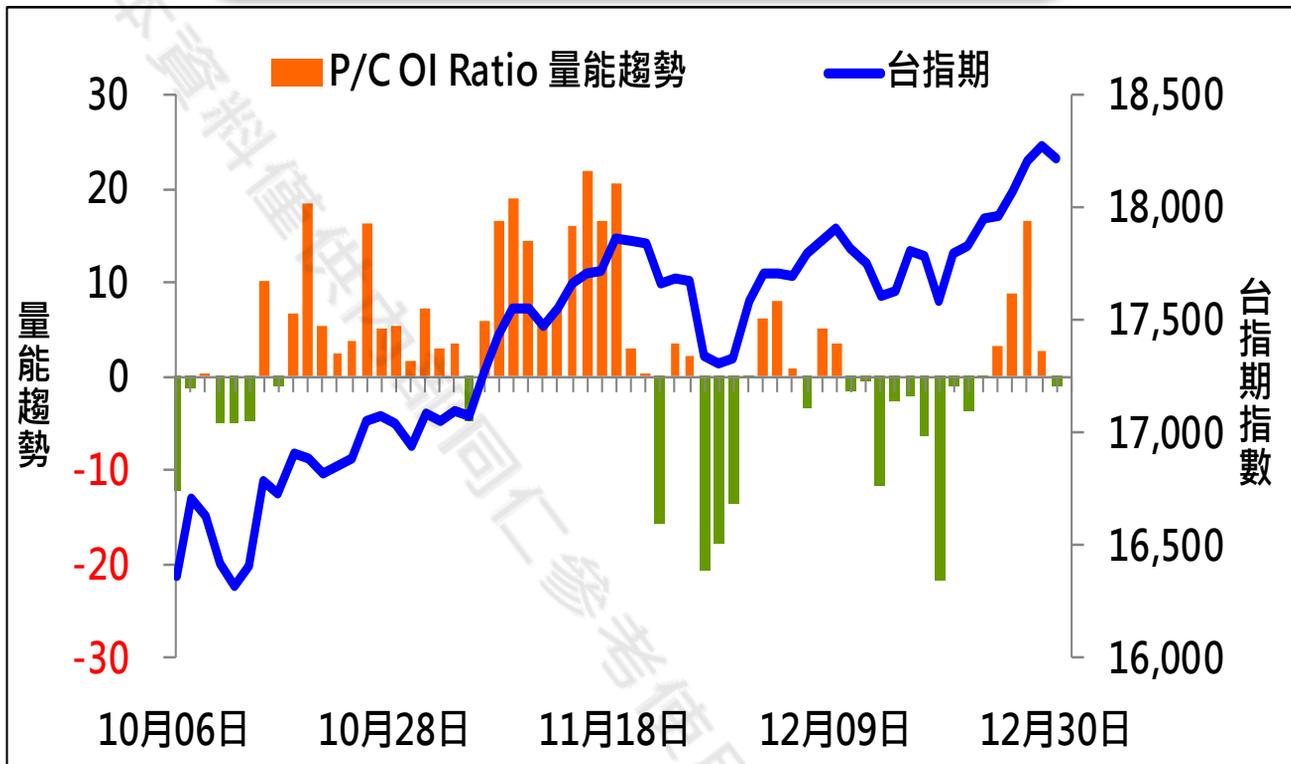
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



圖片來源：嘉實資訊

期權交易財務槓桿高，交易者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，交易者須自行判斷與負責，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