

法人籌碼動態

11月27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	-1,356	2,884	-222	-4	-153	-33
投信	7,176	-525	170	0	8	0
自營商	-2,978	-1,521	-27	-51	-111	7
11月27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	-73	-2	34,598	1,774	32,071	2,918
投信	0	0	0	0	-31	0
自營商	87	5	-961	8,684	20,061	-10,150

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
中華電	2.48	台積電	-58.09	台指期前十大 市場佔比	51.7%	48.9%
瑞昱	1.64	廣達	-8.65			
中鋼	1.26	聯發科	-7.17			
大立光	1.07	台塑化	-5.18			
文晔	0.82	緯穎	-3.36	電子期前十大 市場佔比	58.9%	57.5%
華通	0.80	聯電	-3.20			
正新	0.78	緯創	-3.06			
聯詠	0.58	奇鋹	-3.01	金融期前十大 市場佔比	62.3%	78.1%
美時	0.55	國泰金	-2.85			
遠東新	0.51	台光電	-2.56	非金電期前十大 市場佔比	96.0%	89.5%
前十名合計	10.50	後十名合計	-97.12			

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 (112)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

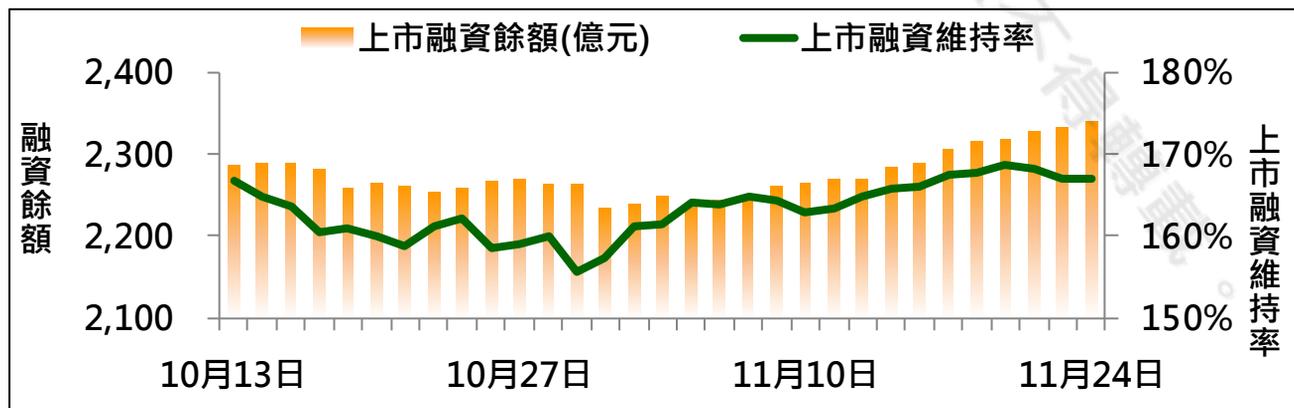
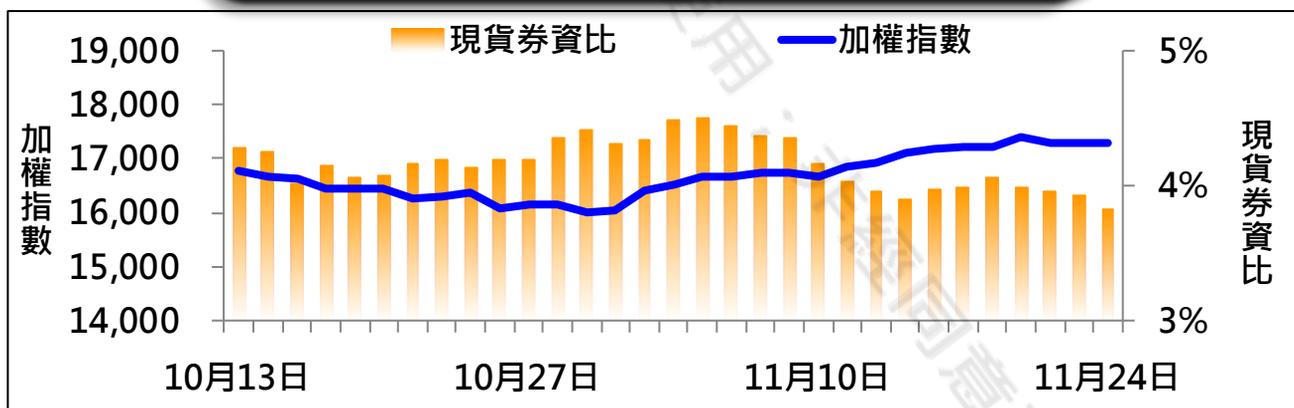
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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21日	421.8	2,450	573	-12.9	-4,854	-288
11月22日	-74.0	-6,348	-8,798	-19.3	-2,589	2,265
11月23日	13.7	-2,439	3,909	-40.6	-2,594	-5
11月24日	34.4	-4,240	-1,801	-12.5	-1,457	1,137
11月27日	-18.3	-1,356	2,884	-58.2	-2,978	-1,521

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21日	32,919	25,178	7,741	19,337	27,113	-7,776
11月22日	29,059	23,479	5,580	-7,189	23,005	-30,194
11月23日	30,953	25,090	5,863	-2,809	28,189	-30,998
11月24日	32,824	29,153	3,671	-9,645	30,211	-39,856
11月27日	34,598	32,071	2,527	-961	20,061	-21,022

現貨券資比 & 上市融資維持率



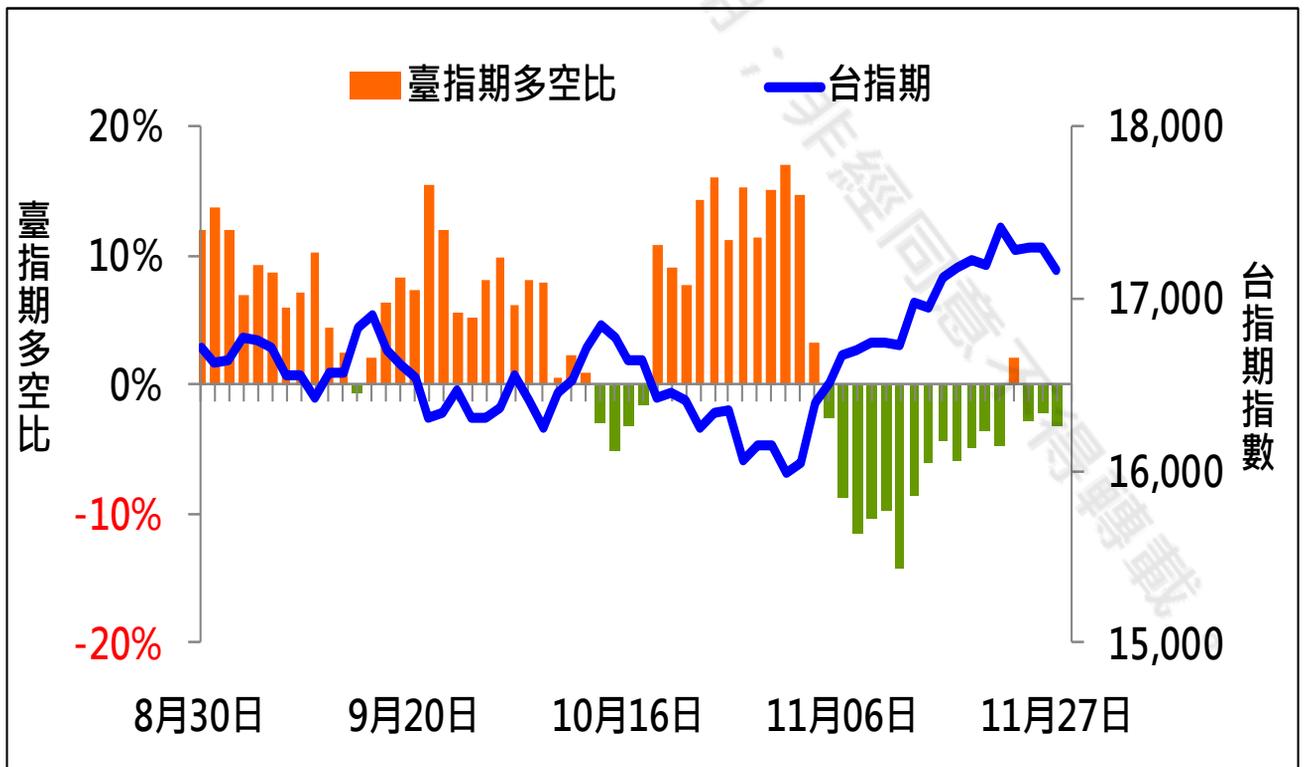
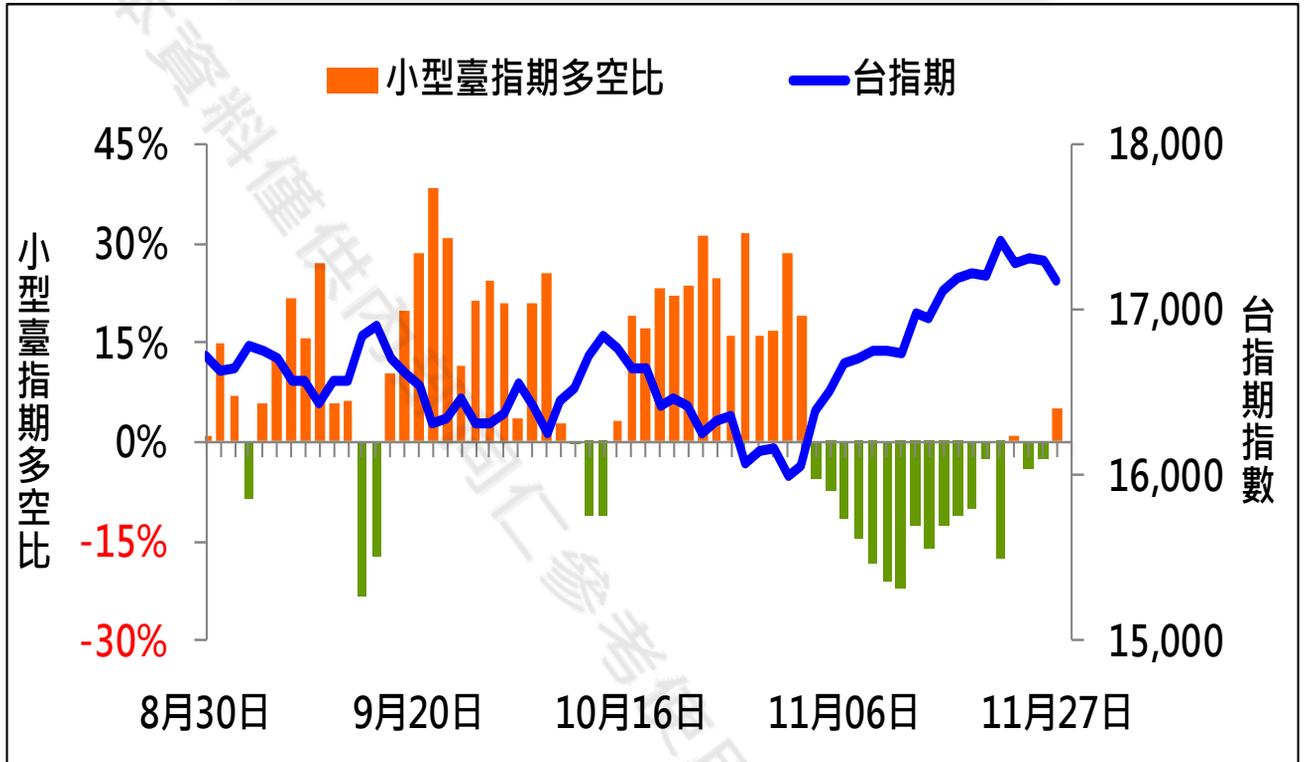
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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

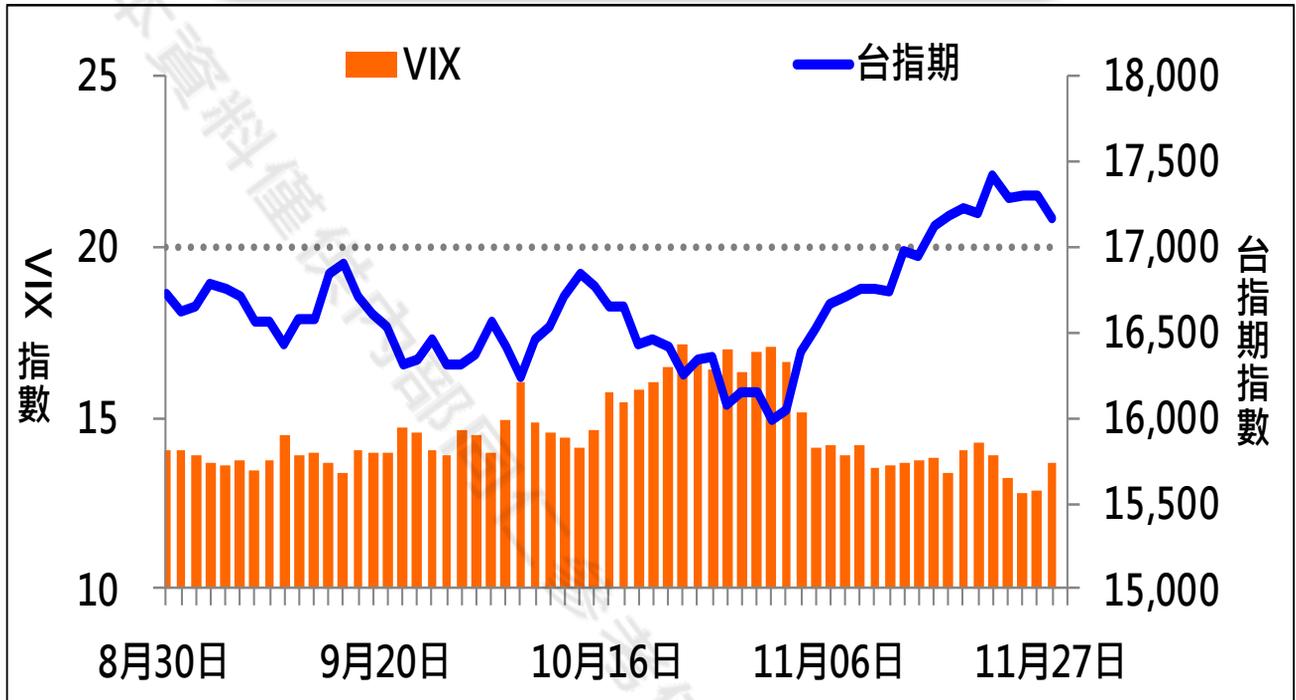


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

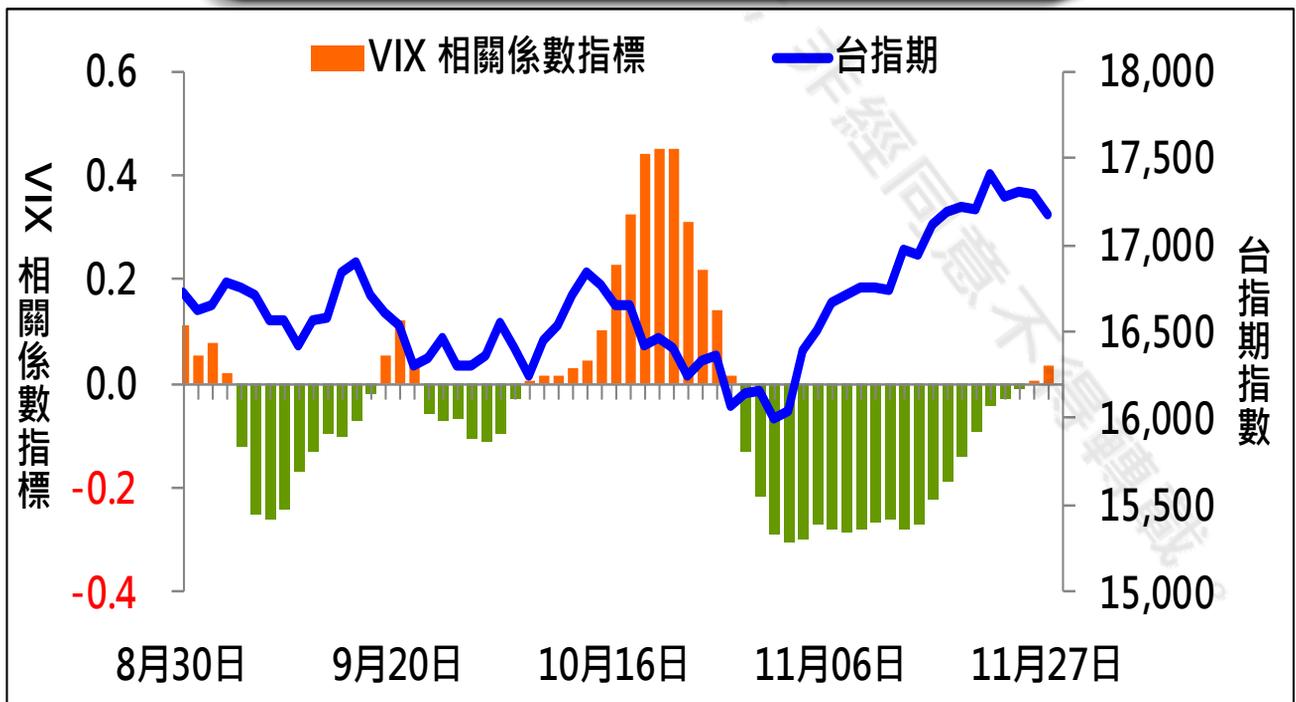
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

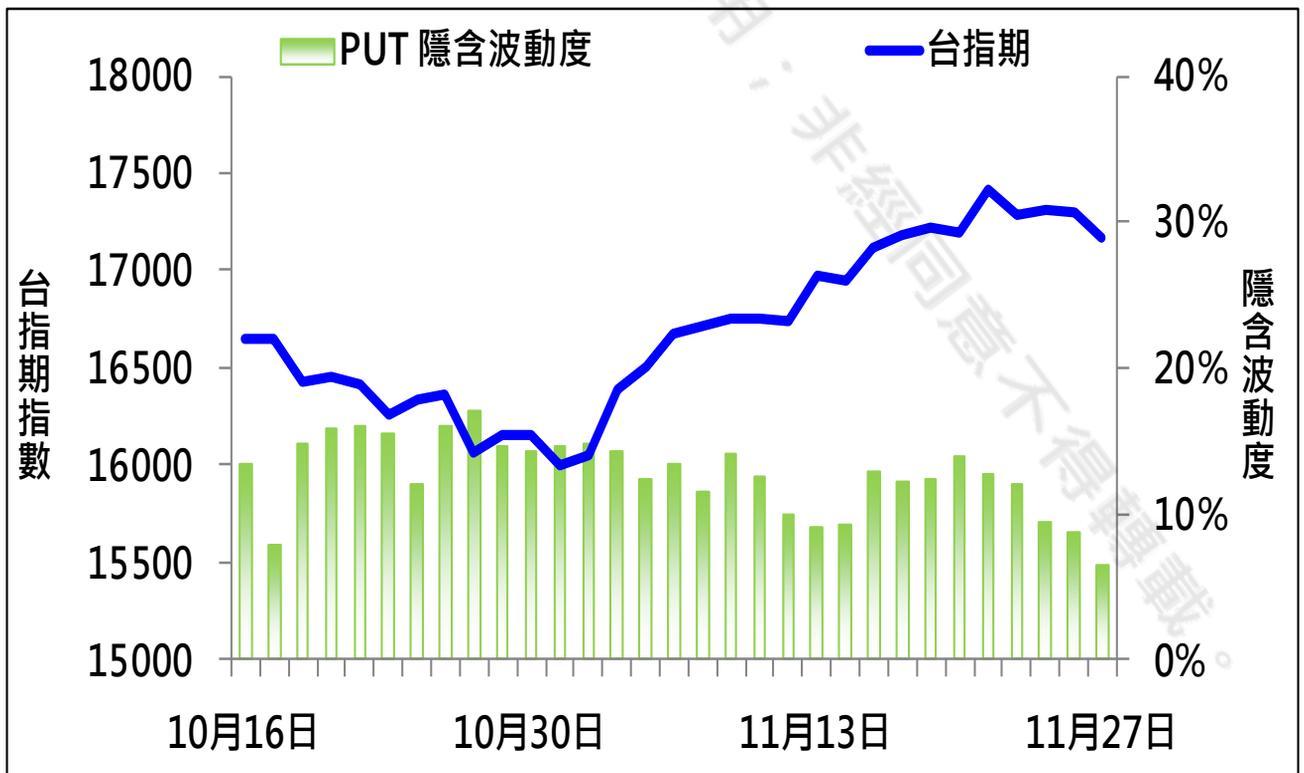
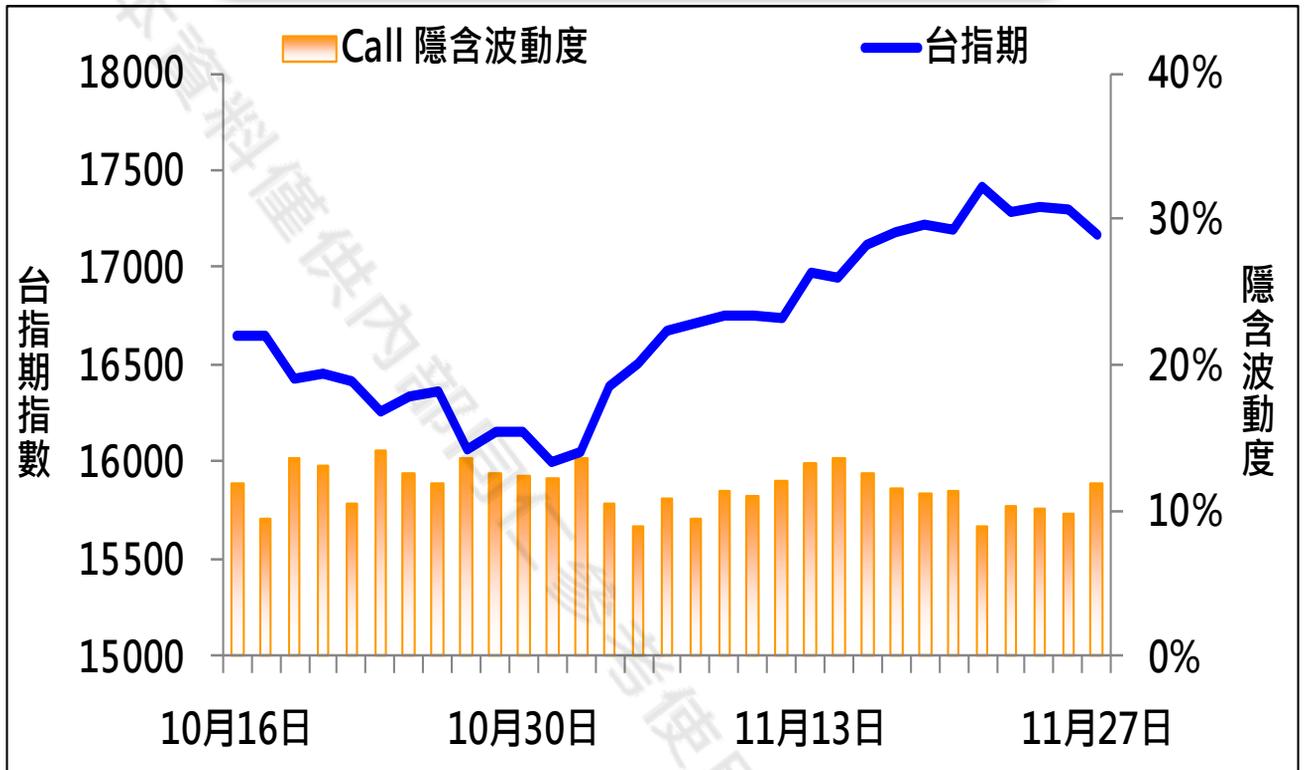


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

資料日期：2023/11/27

結算日：2023/11/29

OI 增減	Call	202311W5 履約價	Put	OI 增減
0	1	16,600	2,489	-19
-1	2	16,650	915	93
-3	10	16,700	2,347	124
3	8	16,750	1,851	116
-18	9	16,800	3,962	90
0	2	16,850	3,116	-281
-10	79	16,900	5,631	52
99	128	16,950	6,578	537
253	339	17,000	11,138	454
586	692	17,050	11,544	809
688	1,420	17,100	9,985	-653
1,887	2,359	17,150	7,088	-170
4,379	6,577	17,200	11,761	4,112
3,796	6,007	17,250	8,044	2,797
※ 6,393	11,787	17,300	3,817	-1,406
3,298	9,914	17,350	2,216	-131
1,289	10,640	17,400	1,060	-402
2,410	10,856	17,450	538	-165
2,912	18,874	17,500	480	98
-652	7,003	17,550	137	17
-512	8,233	17,600	133	19
-905	4,498	17,650	24	0
-718	5,446	17,700	26	1
24,847	119,171	總計	106,281	6,100
P/C	0.8918		增減	-0.1703

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 (112)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

資料日期：2023/11/27

結算日：2023/12/20

OI 增減	Call	202312月 履約價	Put	OI 增減
0	0	-	0	0
0	10	15,900	1,662	100
0	86	16,000	4,109	13
0	102	16,100	2,465	192
0	184	16,200	4,720	-55
0	115	16,300	3,551	81
-9	497	16,400	4,973	286
1	289	16,500	9,218	354
0	512	16,600	4,030	-89
42	1,286	16,700	6,334	160
-8	3,318	16,800	5,332	132
20	2,395	16,900	4,600	-155
22	2,835	17,000	7,011	-393
73	3,976	17,100	2,987	122
206	4,604	17,200	2,317	704
-15	6,645	17,300	1,299	86
※	771	17,400	907	-40
129	8,732	17,500	482	-74
162	7,289	17,600	458	-164
272	5,565	17,700	177	-18
459	8,021	17,800	239	15
653	9,343	17,900	136	1
568	9,156	18,000	19	-1
114	2,637	18,100	39	-1
3,290	107,534	總計	116,648	1,014
P/C	1.0848		增減	-0.0245

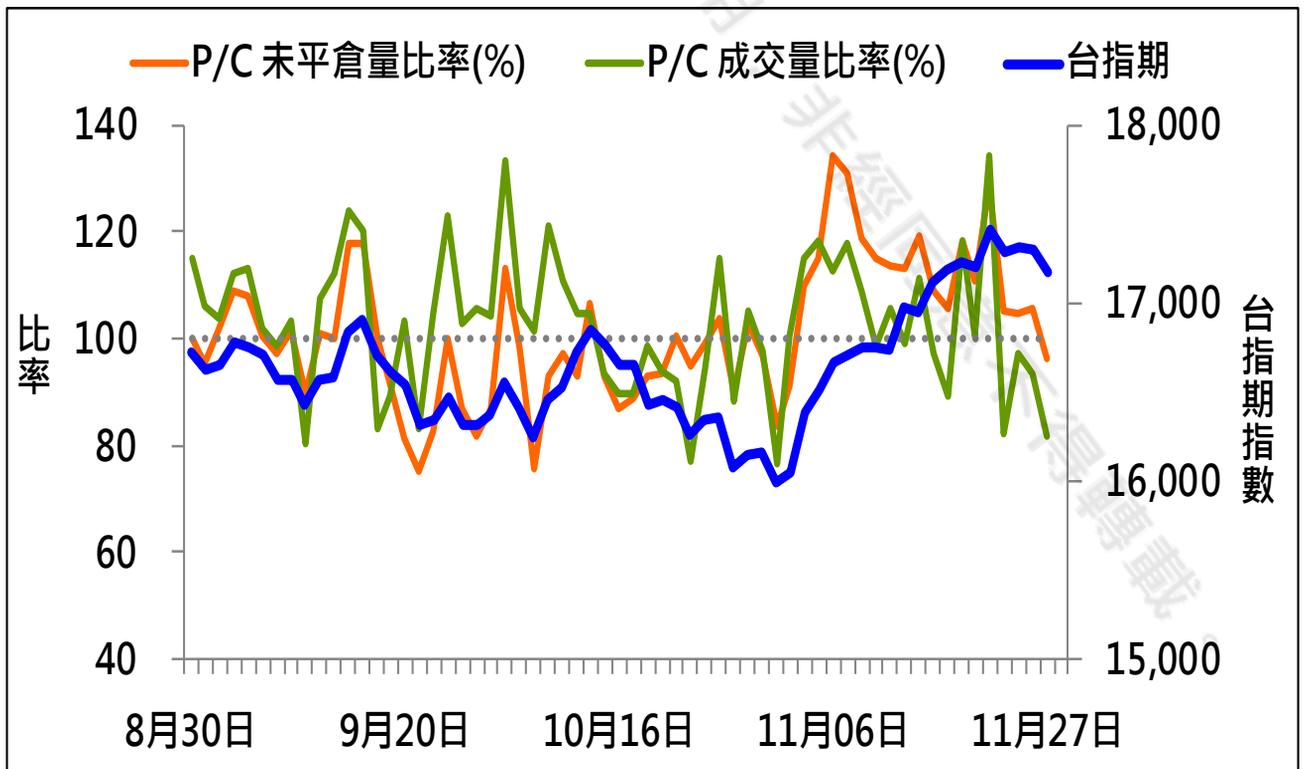
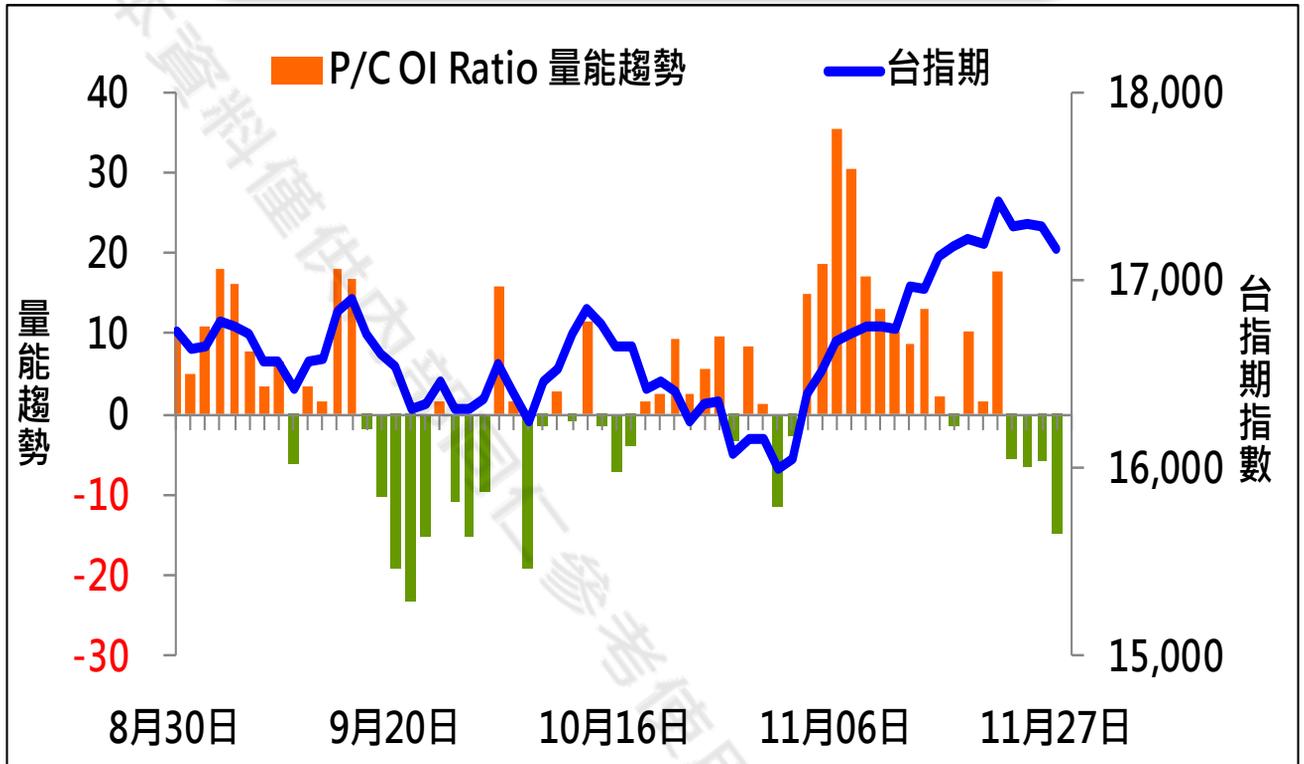
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年管期總字第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 (112)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 2023/11/27 開 17257 高 17361 低 17145 收 17172 s 點 量 90354 □ -121 (-0.70%)

SMA5 17293.80 ↓ SMA20 16879.90 ↑ SMA60 16632.73 ↑ SMA120 16752.34 ↑



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 (112)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 (112)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