

法人籌碼動態

11月28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	-149	1,207	-245	-23	-139	14
投信	7,536	360	169	-1	8	0
自營商	-2,906	72	19	46	-122	-11
11月28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	-68	5	33,588	-1,010	33,464	1,393
投信	0	0	0	0	-31	0
自營商	65	-22	6,549	7,510	9,451	-10,610

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	58.06	台光電	-2.08	台指期前十大 市場佔比	49.4%	48.5%
聯發科	5.63	聯電	-1.80			
台塑化	5.48	中華電	-1.24			
鴻海	4.43	日月光投控	-0.70	電子期前十大 市場佔比	59.7%	57.8%
世芯-KY	4.19	上海商銀	-0.47			
和泰車	3.92	宏碁	-0.39			
南亞科	3.37	統一	-0.36	金融期前十大 市場佔比	61.9%	77.8%
台達電	3.32	致茂	-0.34			
國巨	3.11	可成	-0.33			
旭隼	3.09	中鋼	-0.25	非金電期前十大 市場佔比	93.8%	89.1%
前十名合計	94.61	後十名合計	-7.96			

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

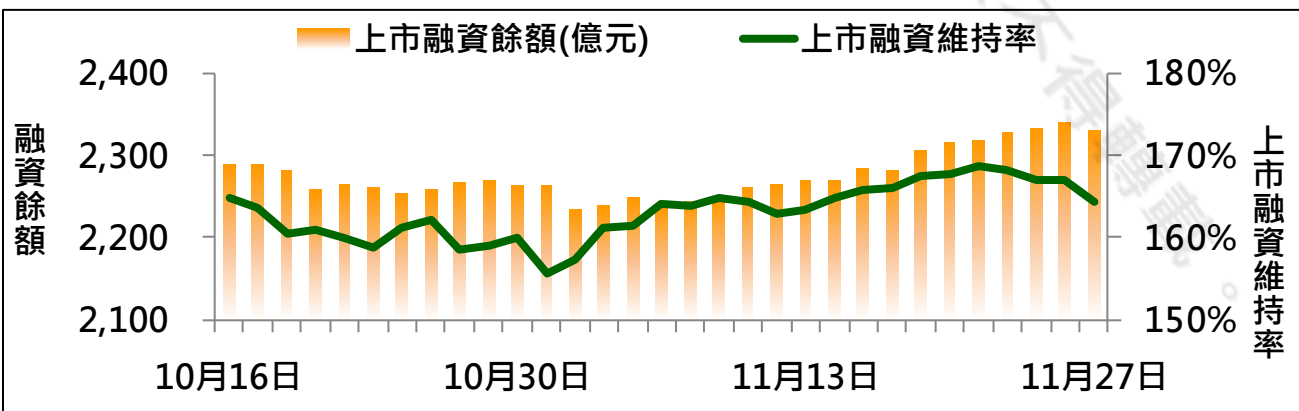
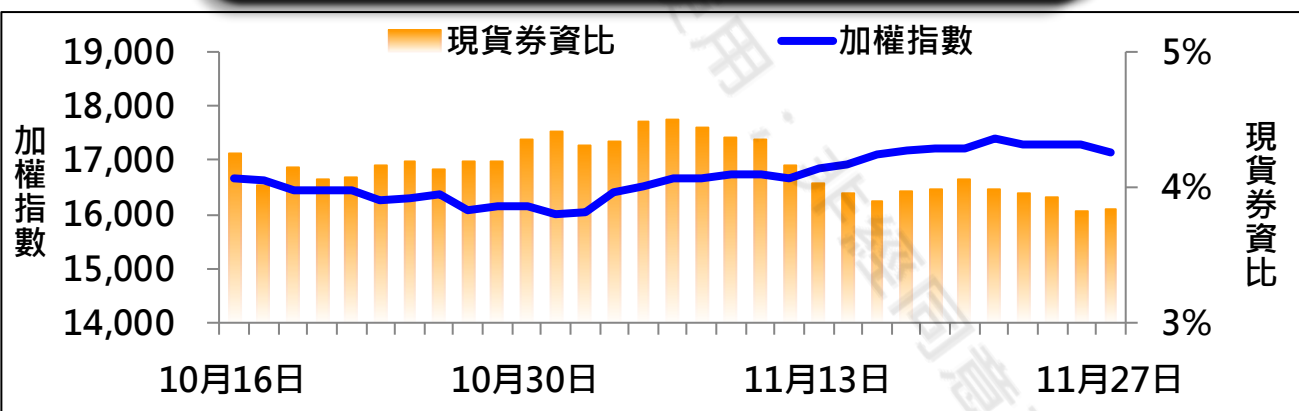
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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
11月28日	200.0	-149	1,207	30.6	-2,906	72

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
11月28日	33,588	33,464	124	6,549	9,451	-2,902

現貨券資比 & 上市融資維持率



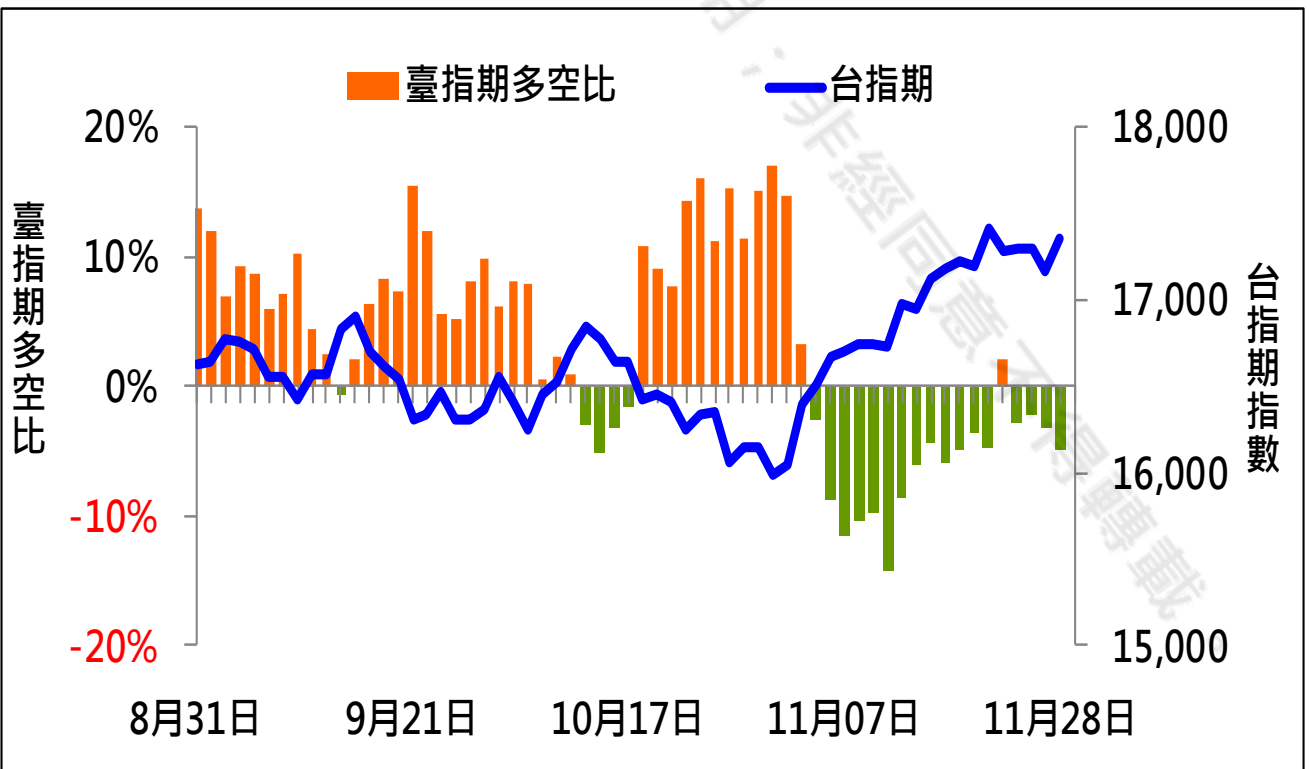
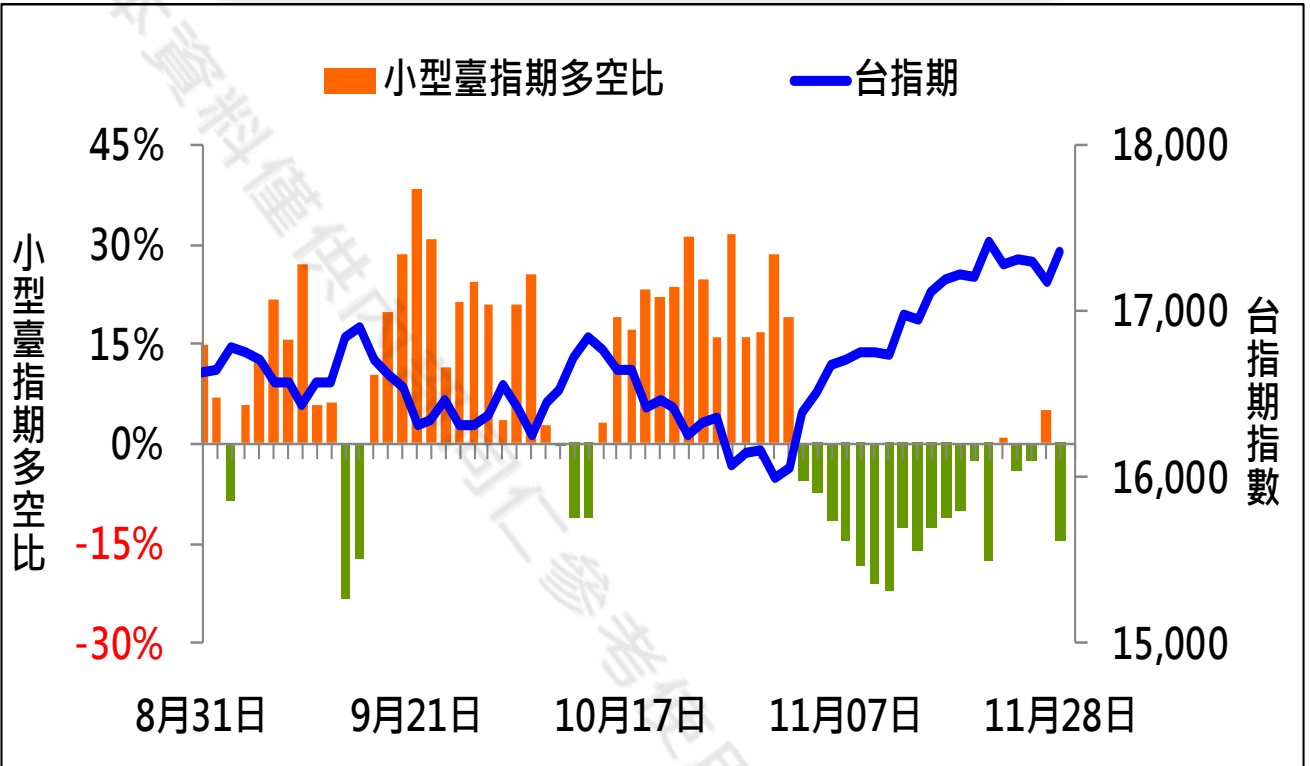
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



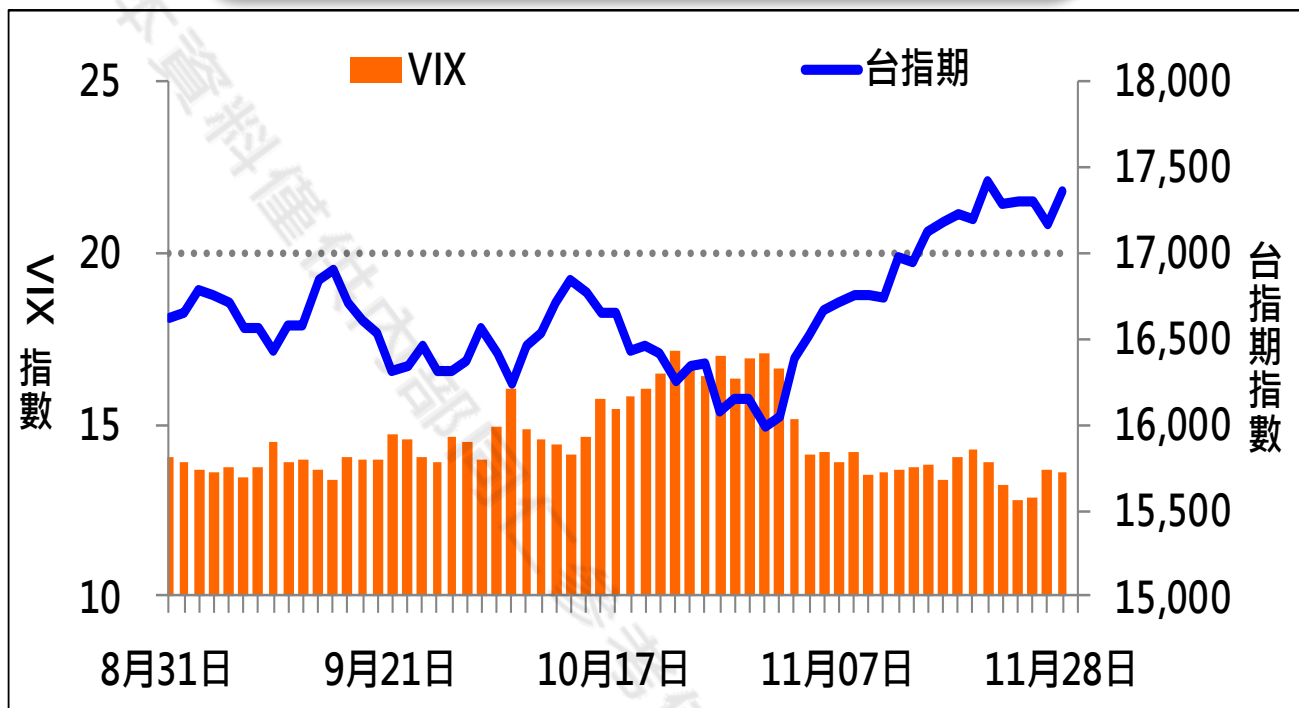
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

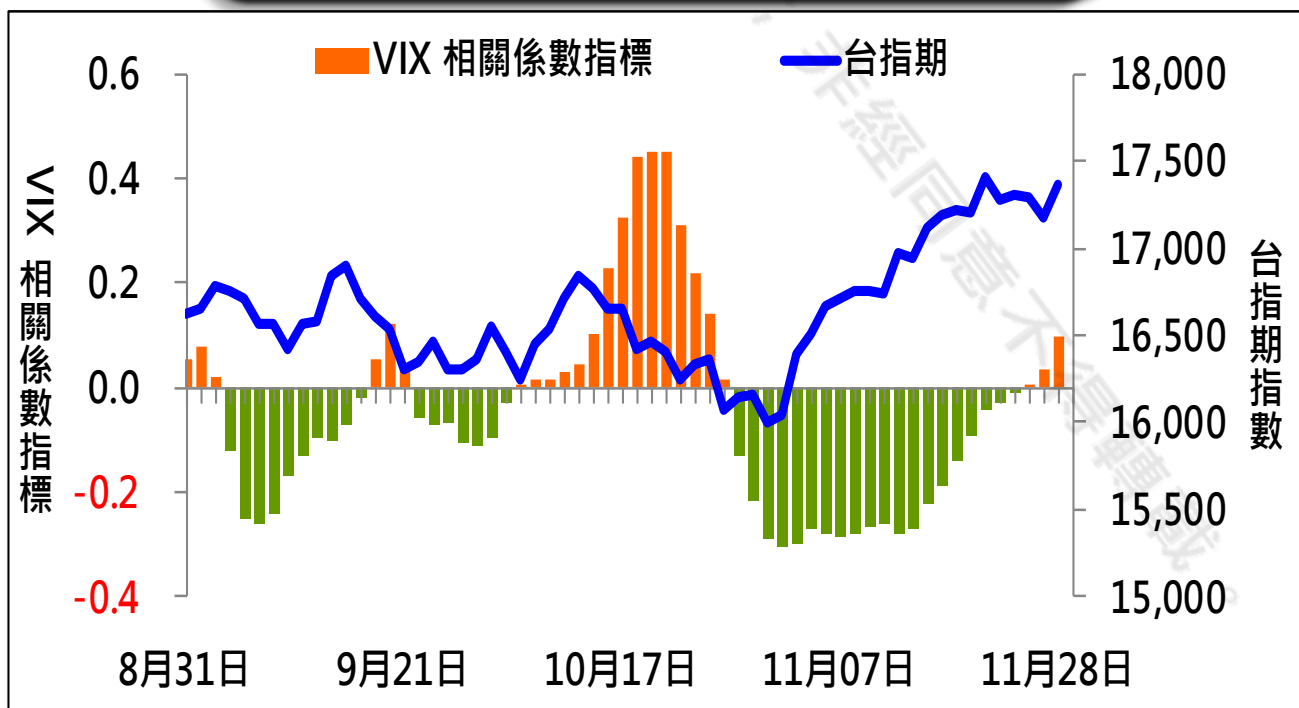
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



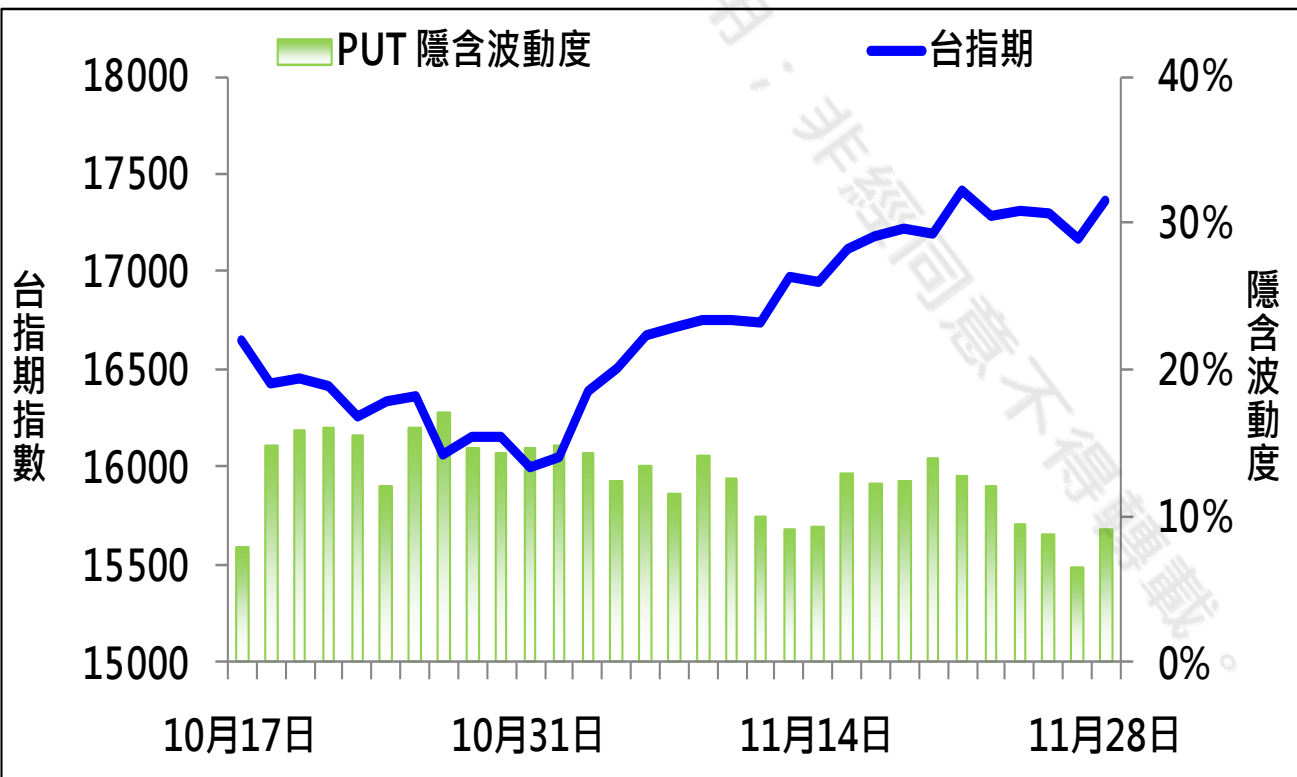
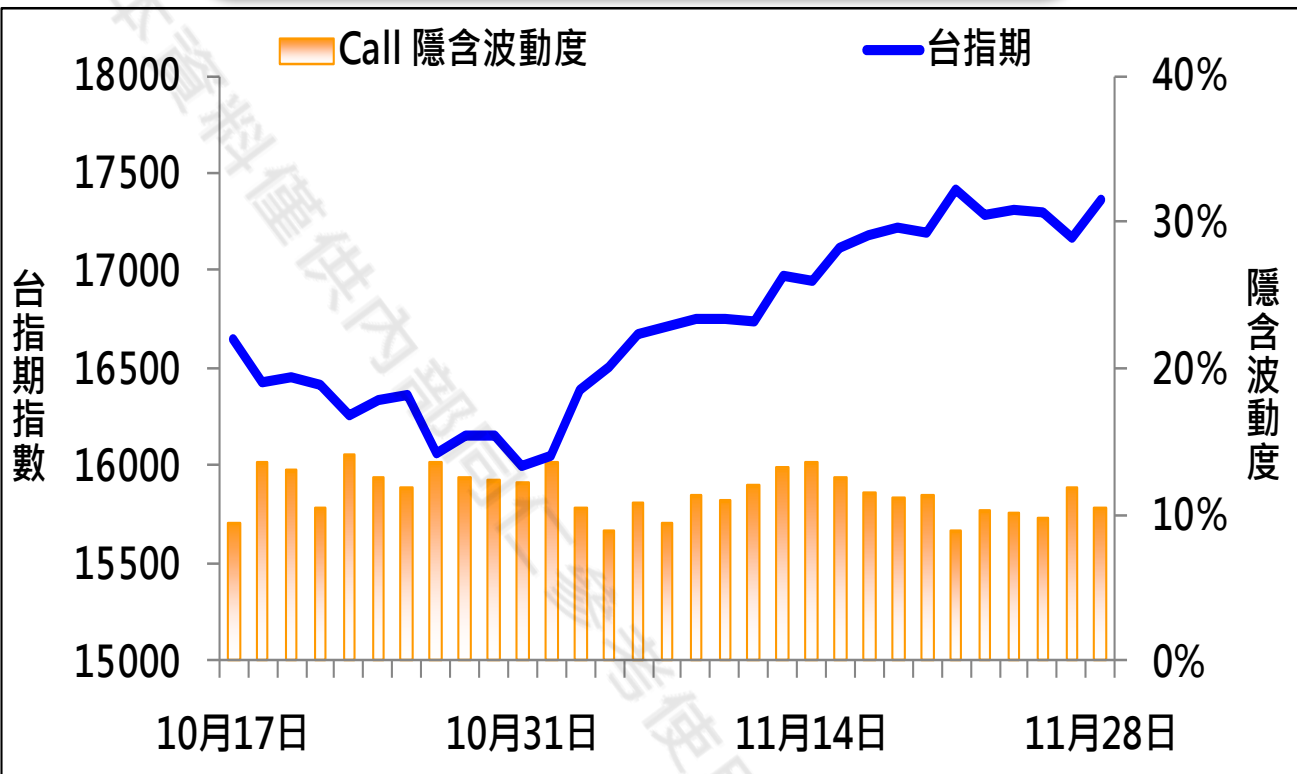
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2023/11/28

結算日：2023/11/29

OI 增減	Call	202311W5 履約價	Put	OI 增減
-2	7	16,800	4,680	718
0	2	16,850	3,034	-82
-23	56	16,900	5,454	-177
-39	89	16,950	5,781	-797
-80	259	17,000	9,529	-1,609
-108	584	17,050	9,397	-2,147
-622	798	17,100	11,557	1,572
-1,245	1,114	17,150	14,555	7,467
-3,464	3,113	17,200	19,519	7,758
-1,953	4,054	17,250	12,803	4,759
-5,112	6,675	17,300	10,798	6,981
-933	8,981	17,350	8,551	6,335
1,334	11,974	17,400	3,793	2,733
※ 4,146	15,002	17,450	1,558	1,020
-452	18,422	17,500	740	260
116	7,119	17,550	170	33
-80	8,153	17,600	136	3
280	4,778	17,650	32	8
-92	5,354	17,700	24	-2
115	1,986	17,750	5	5
-319	4,365	17,800	4	-2
-17	1,460	17,850	1	0
-71	2,750	17,900	4	1
-8,631	110,540	總計	141,245	34,964
P/C	1.2778		增減	0.3859

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：2023/11/28

結算日：2023/12/20

OI 增減	Call	202312月 履約價	Put	OI 增減
0	2	12,200	1,245	0
0	102	16,100	2,353	-112
0	184	16,200	4,703	-17
0	115	16,300	4,027	476
-2	495	16,400	5,089	116
-2	287	16,500	8,869	-349
4	516	16,600	3,746	-284
53	1,339	16,700	6,303	-31
-17	3,301	16,800	5,601	269
9	2,404	16,900	4,708	108
-73	2,762	17,000	7,768	757
-14	3,962	17,100	4,334	1,347
112	4,716	17,200	2,334	17
-216	6,429	17,300	1,954	655
-373	6,012	17,400	1,019	112
-99	8,633	17,500	576	94
539	7,828	17,600	530	72
-110	5,455	17,700	242	65
123	8,144	17,800	290	51
-174	9,169	17,900	158	22
66	9,222	18,000	46	27
131	2,768	18,100	45	6
※ 1,096	2,970	18,200	15	3
72	958	18,300	10	0
1,559	109,093	總計	120,832	4,184
P/C	1.1076		增減	0.0229

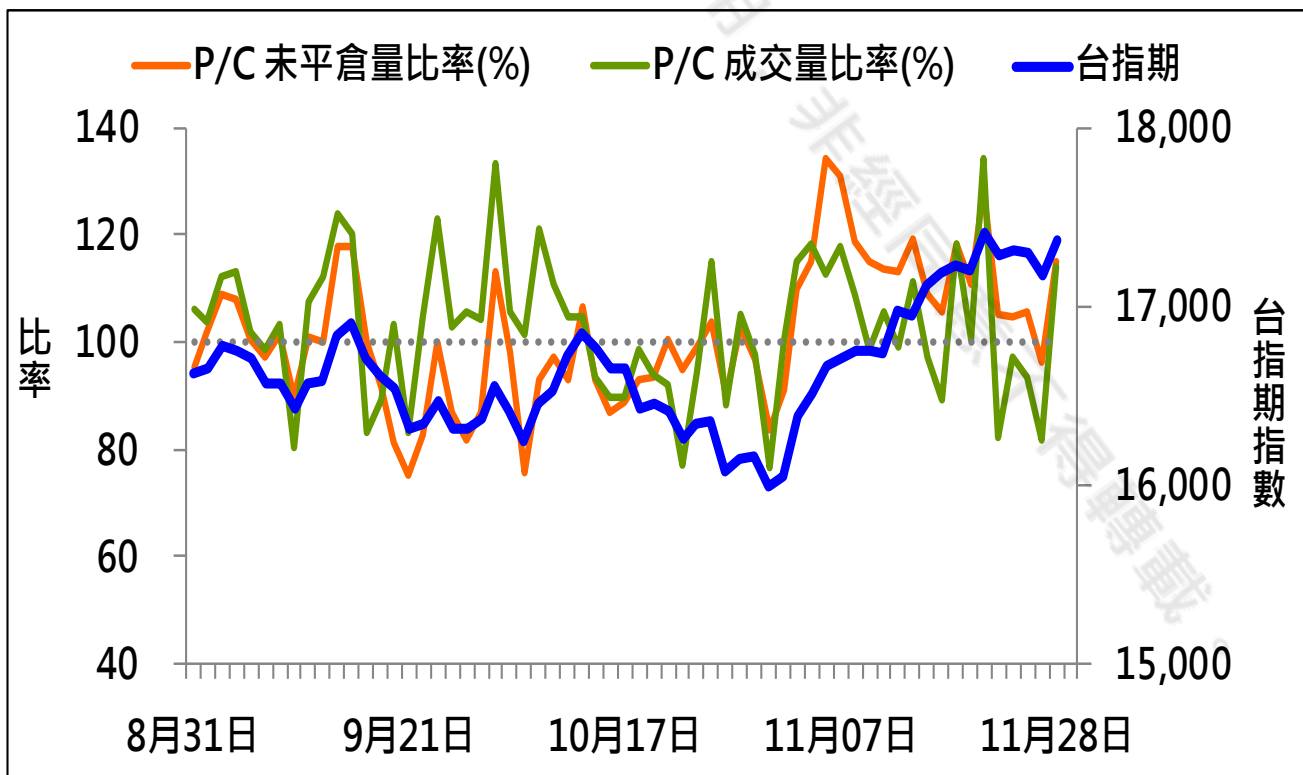
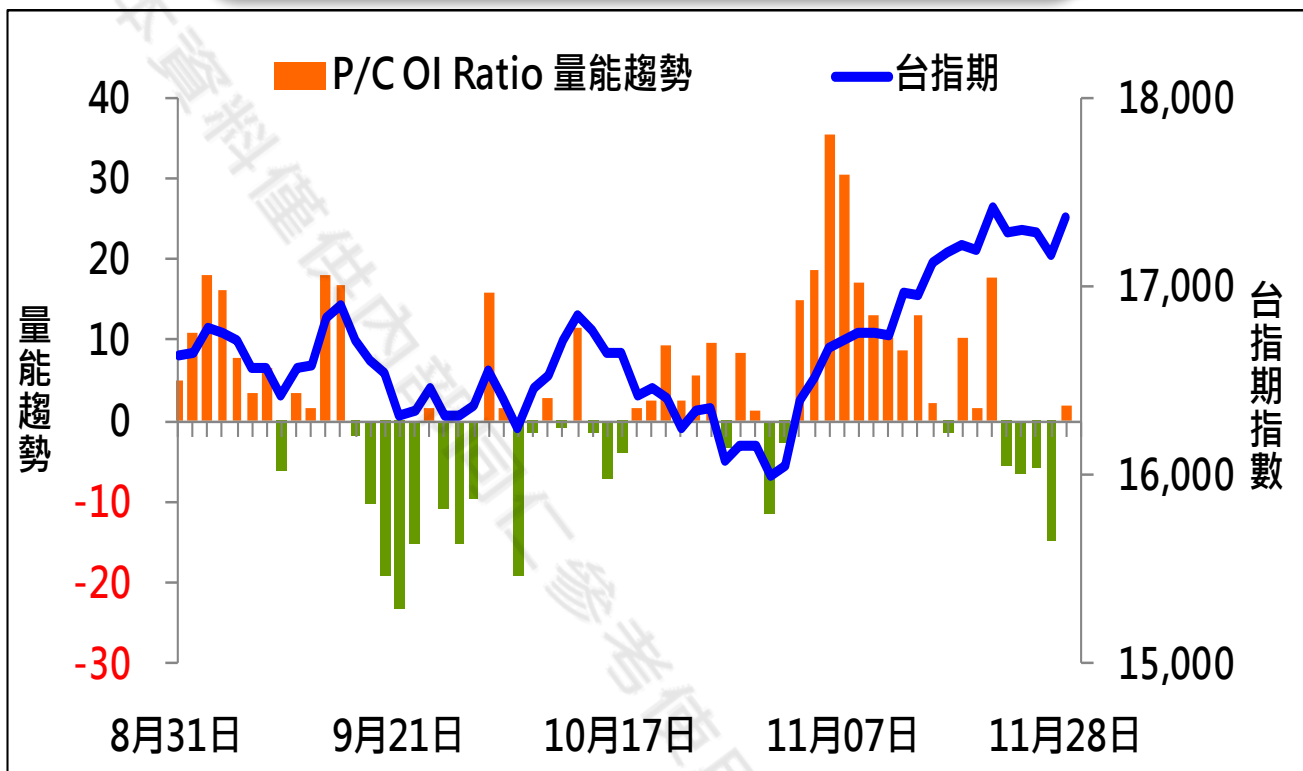
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

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 2023/11/28 開 17215 高 17402 低 17195 收 17360 s點量 87471 口 +188 (+1.09%)

SMA5 17283.60↓ SMA20 16948.05↑ SMA60 16645.07↑ SMA120 16757.98↑



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 (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