

法人籌碼動態

12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	-12,235	-340	-160	-17	-503	0
投信	9,937	1,096	193	22	10	0
自營商	-966	1,229	-77	39	-60	8
12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	-21	0	25,367	3,349	34,265	748
投信	0	0	0	0	-42	0
自營商	5	-2	-7,079	-906	-1,063	6,835

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	49.74	世芯-KY	-2.67	台指期前十大 市場佔比	48.1%	54.0%
聯發科	20.45	鴻海	-2.22			
聯電	10.79	台勝科	-2.11			
華碩	4.63	瑞昱	-1.80	電子期前十大 市場佔比	51.9%	55.8%
宏碁	3.51	力成	-1.09			
大立光	2.13	長榮航	-0.86			
台達電	2.08	群光	-0.73	金融期前十大 市場佔比	49.2%	79.0%
矽力*-KY	1.90	威盛	-0.64			
台化	1.69	廣達	-0.62			
南亞科	1.68	台塑化	-0.61	非金電期前十大 市場佔比	94.9%	93.2%
前十名合計	98.60	後十名合計	-13.35			

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

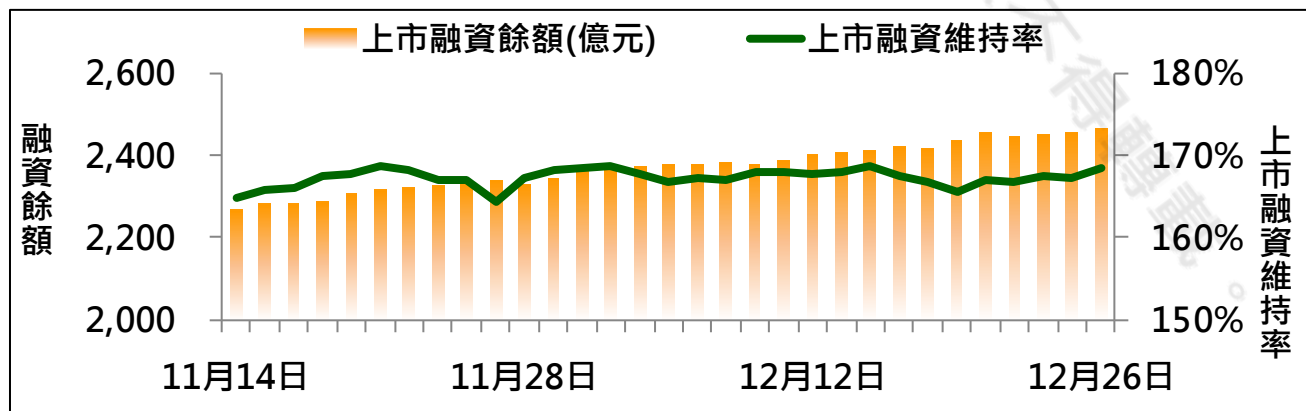
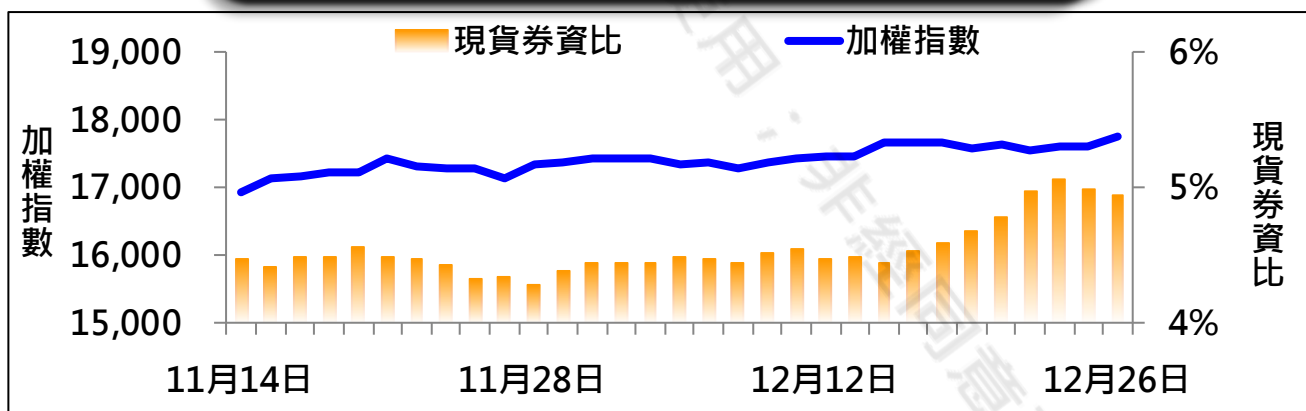
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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)
12月21日	-27.7	-17,563	-6,098	-32.8	-982	504
12月22日	61.8	-15,750	1,813	-9.4	-904	78
12月25日	-8.8	-14,288	1,462	-27.2	-900	4
12月26日	180.5	-11,895	2,393	-16.0	-2,195	-1,295
12月27日	367.9	-12,235	-340	-35.7	-966	1,229

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21日	18,631	29,551	-10,920	-2,469	-691	-1,778
12月22日	21,852	31,701	-9,849	1,021	-7,000	8,021
12月25日	21,472	32,158	-10,686	3,071	-6,494	9,565
12月26日	22,018	33,517	-11,499	-6,173	-7,898	1,725
12月27日	25,367	34,265	-8,898	-7,079	-1,063	-6,016

現貨券資比 & 上市融資維持率



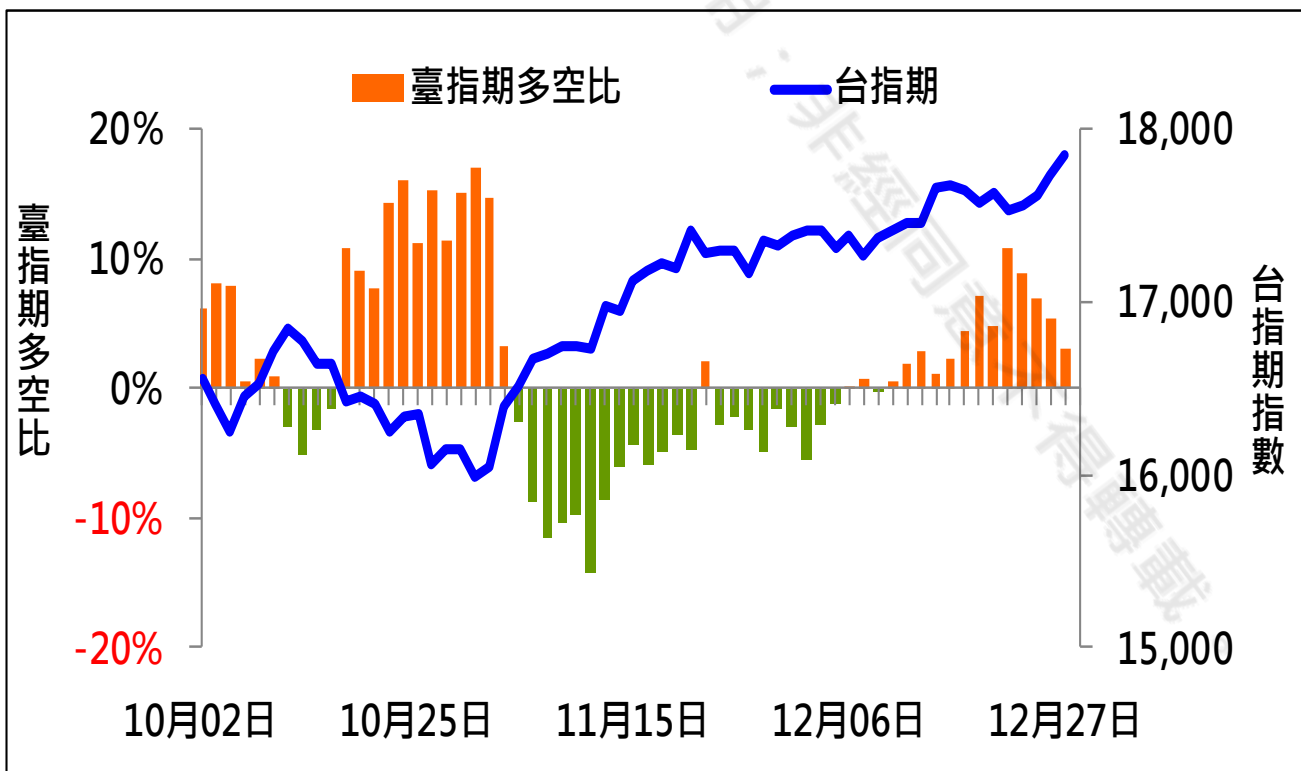
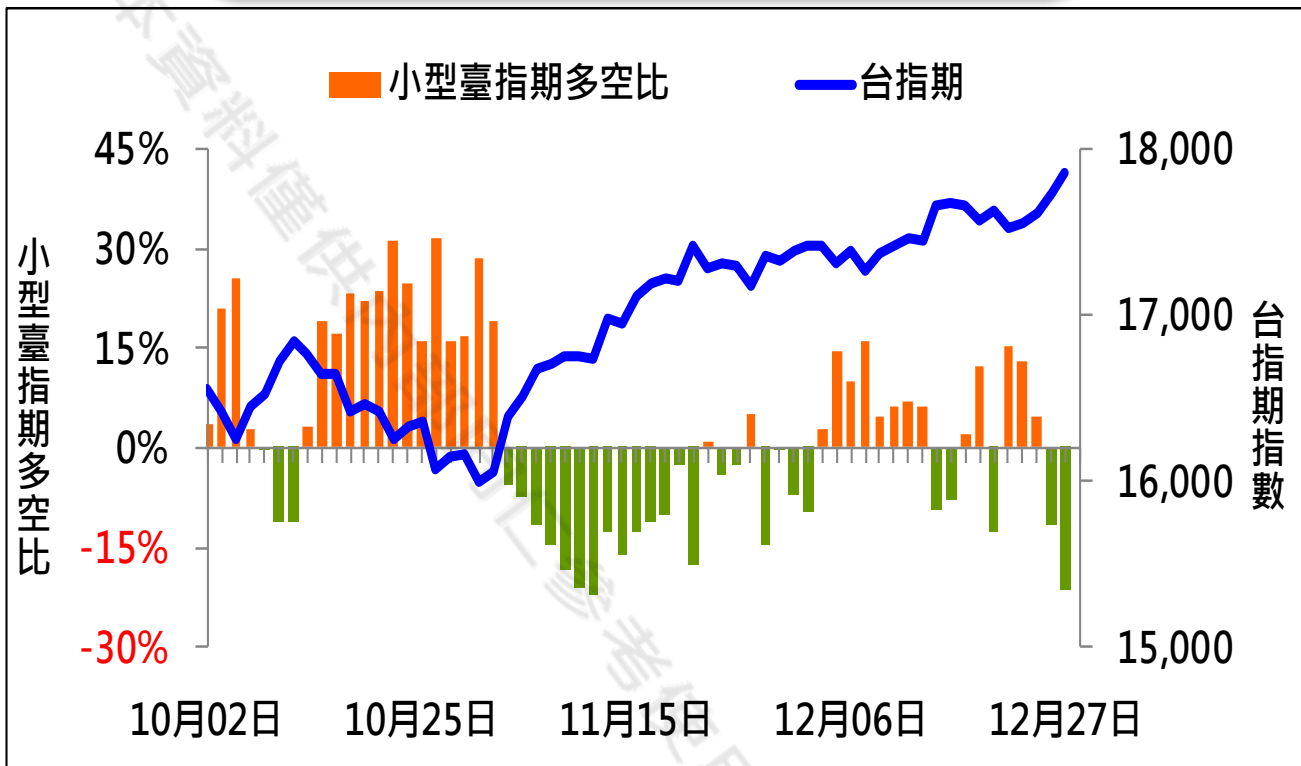
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



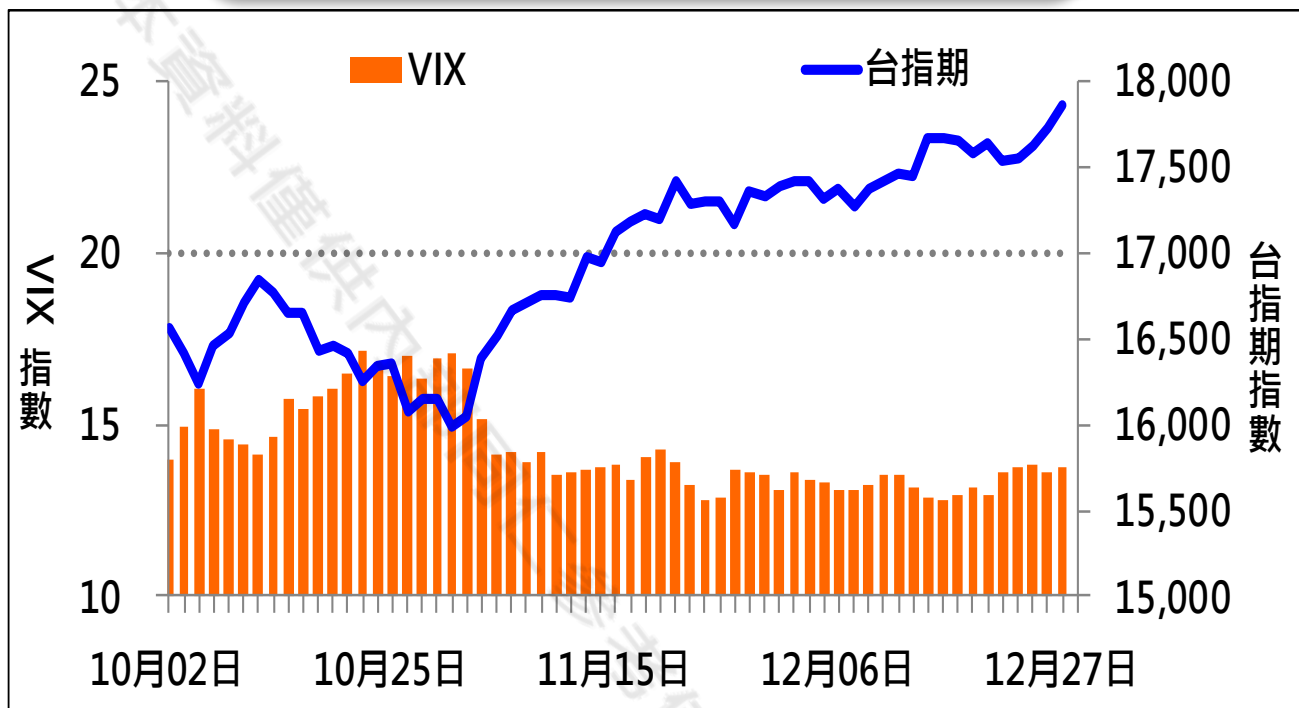
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

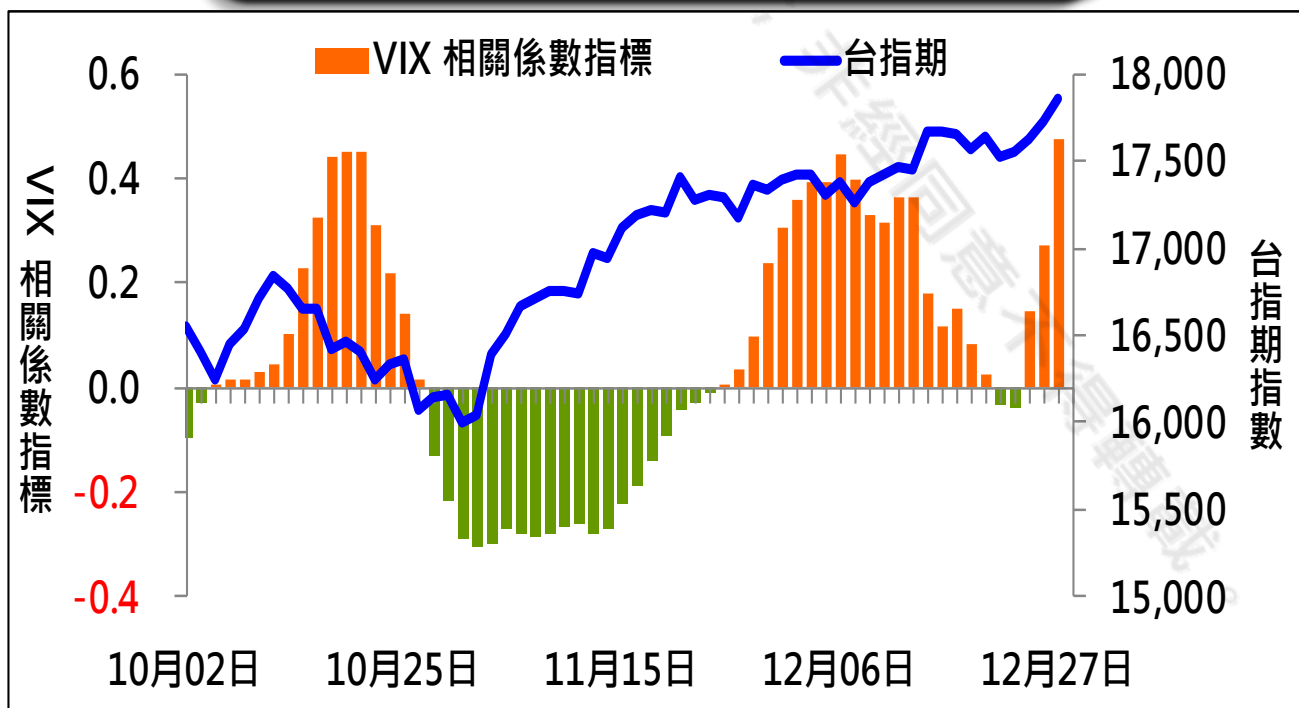
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



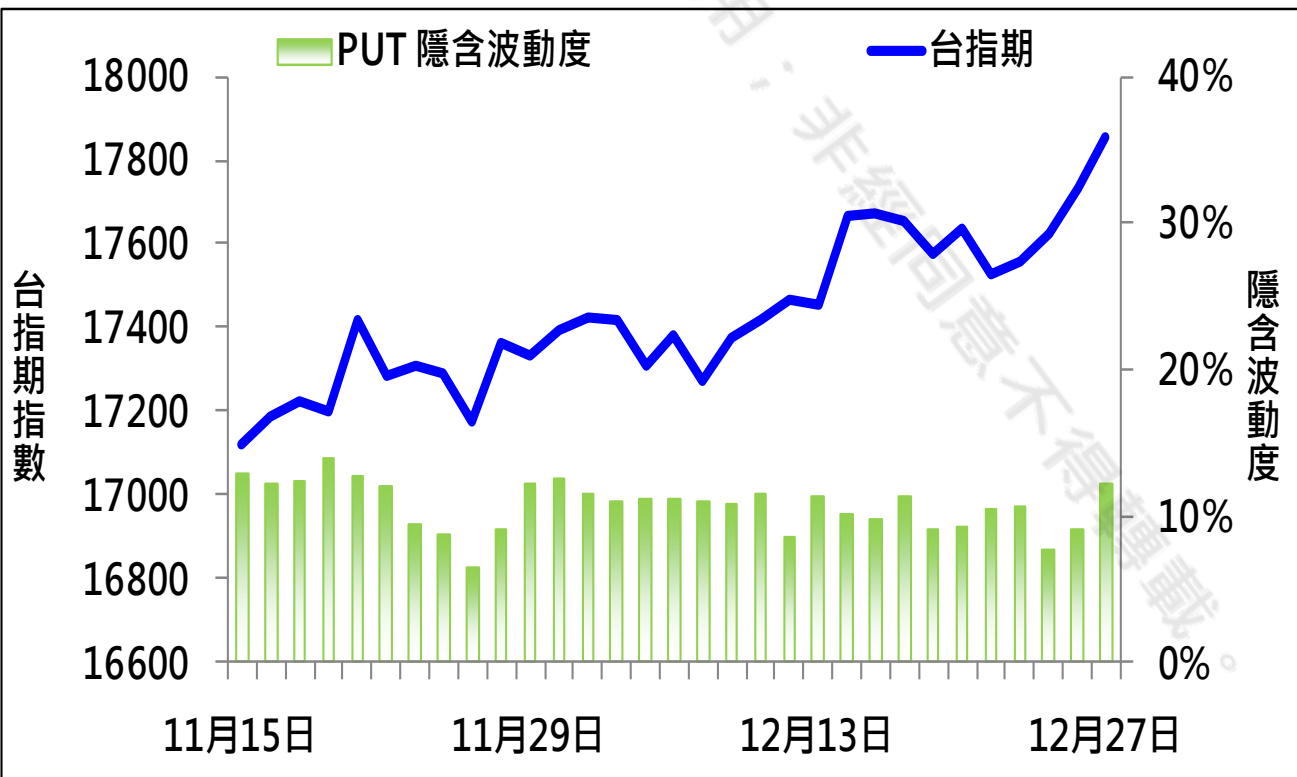
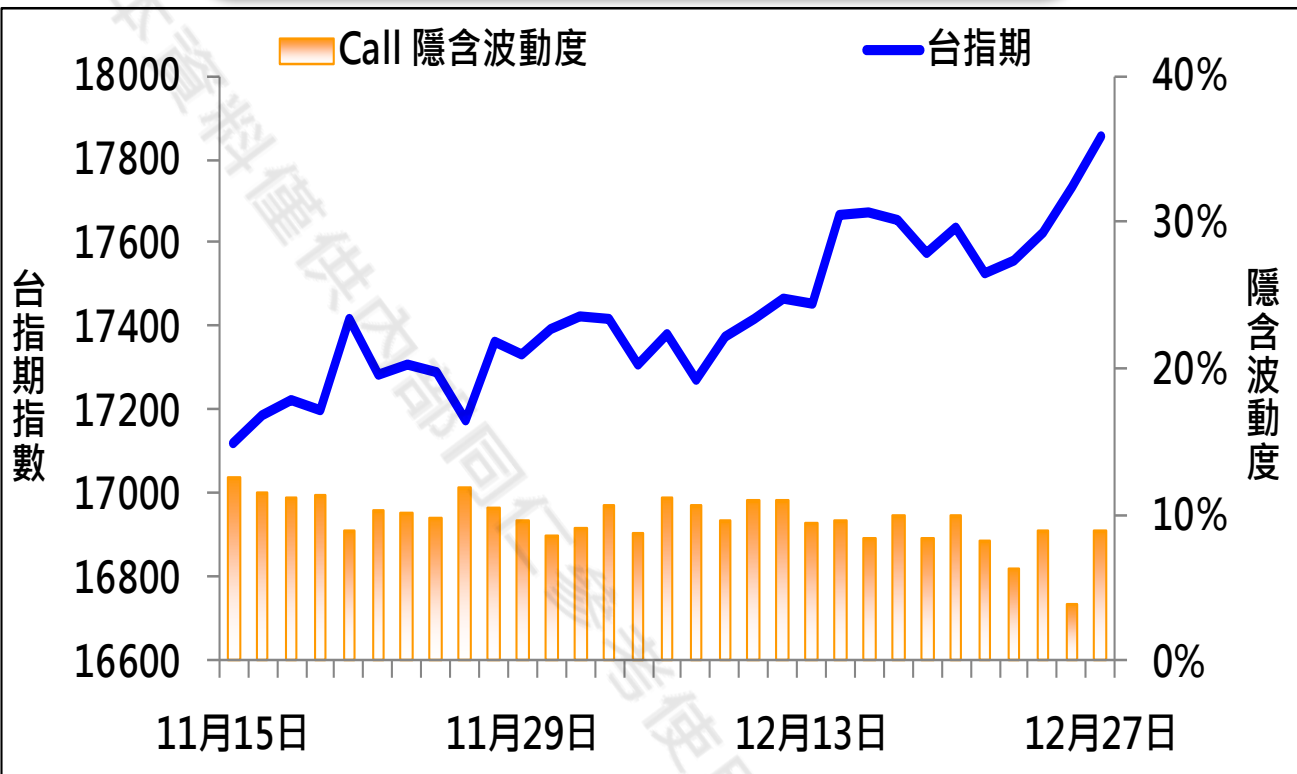
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2023/12/27

結算日：2024/1/3

OI 增減	Call	202401W1 履約價	Put	OI 增減
-4	54	17,350	1,703	-148
-5	67	17,400	4,101	2,476
1	68	17,450	2,246	1,168
34	621	17,500	3,949	1,914
-1	425	17,550	2,268	1,540
-46	450	17,600	2,753	1,983
-24	522	17,650	2,101	1,589
224	1,030	17,700	3,034	2,529
486	1,277	17,750	1,921	1,656
464	1,602	17,800	1,951	1,753
557	2,826	17,850	1,849	1,679
963	2,514	17,900	1,293	1,220
1,025	2,580	17,950	294	290
※ 3,565	5,696	18,000	412	397
1,089	2,181	18,050	30	30
1,004	2,618	18,100	35	35
1,195	1,417	18,150	6	6
1,455	1,792	18,200	67	67
989	989	18,250	25	25
553	616	18,300	0	0
338	718	18,400	0	0
7	21	18,500	0	0
1	233	18,600	0	0
13,898	30,550	總計	41,782	21,848
P/C	1.3677		增減	0.1706

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：2023/12/27

結算日：2024/1/17

OI 增減	Call	202401 月 履約價	Put	OI 增減
1	79	16,700	3,883	-6
-1	84	16,800	3,962	12
3	70	16,900	4,576	-446
1	381	17,000	7,269	-691
-2	631	17,100	3,519	29
-9	1,174	17,200	5,105	667
-6	658	17,300	4,184	875
-45	3,514	17,400	7,189	1,489
-76	2,075	17,500	2,492	751
-100	4,323	17,600	3,025	546
-166	4,008	17,700	1,363	418
-73	5,471	17,800	583	164
-71	3,697	17,900	329	44
480	7,755	18,000	470	317
-882	6,885	18,100	154	41
1,074	7,011	18,200	73	25
937	6,437	18,300	546	17
※ 1,577	4,413	18,400	54	4
908	3,897	18,500	15	12
122	2,074	18,600	6	4
486	1,360	18,700	0	0
-23	1,063	18,800	3	0
-22	1,473	18,900	0	0
4,907	84,100	總計	85,156	4,861
P/C	1.0126		增減	-0.0014

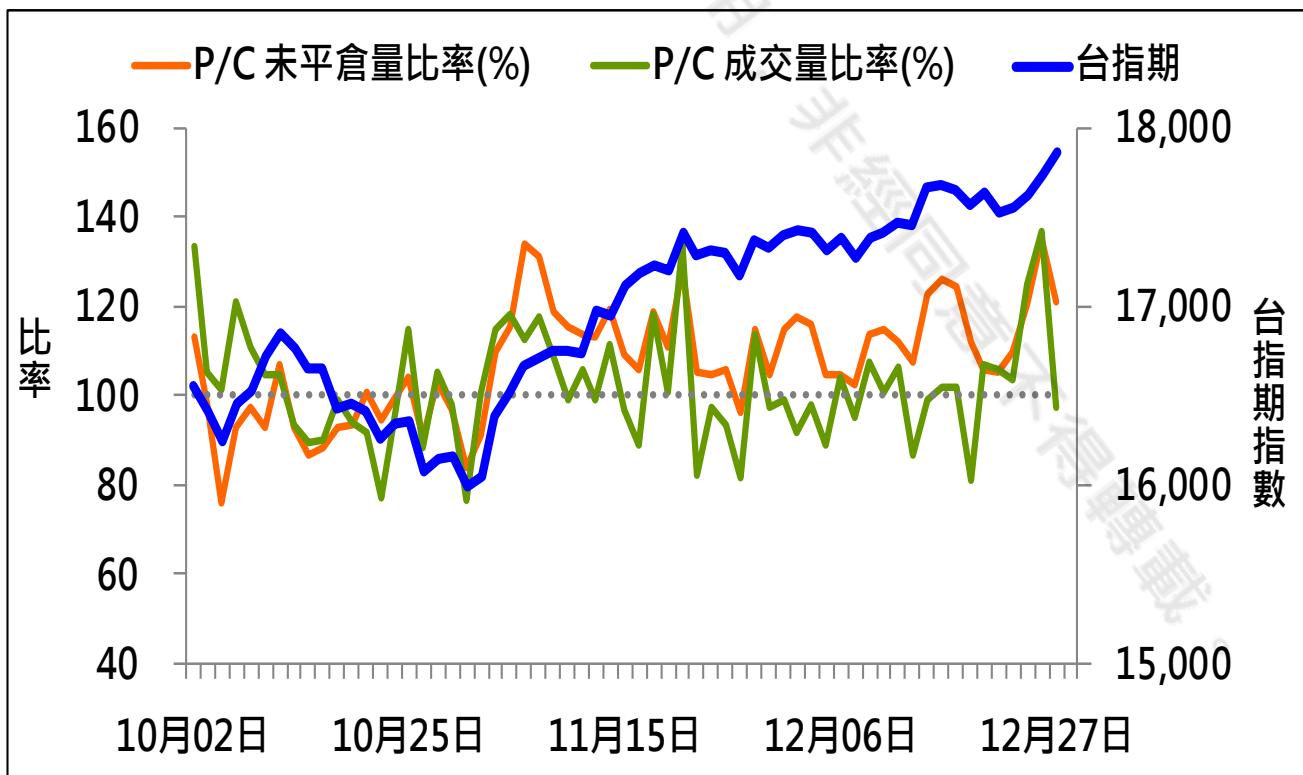
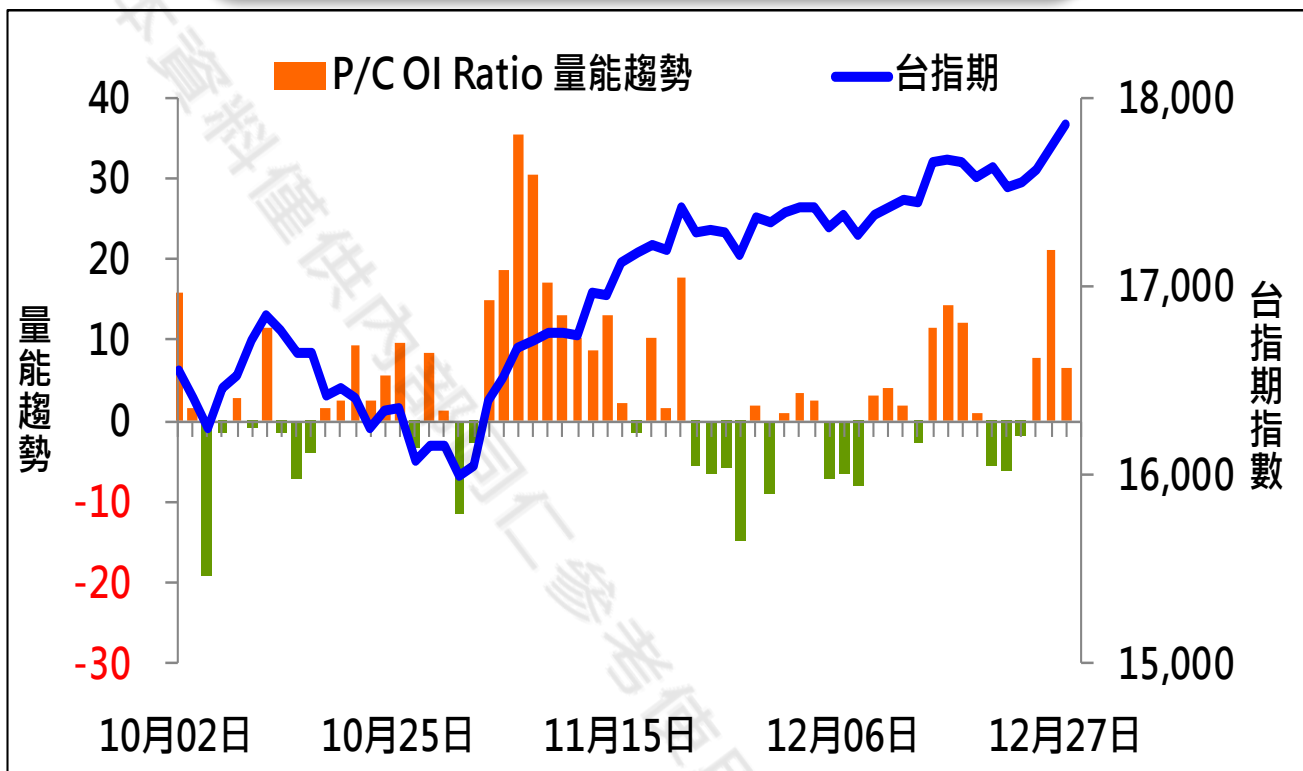
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

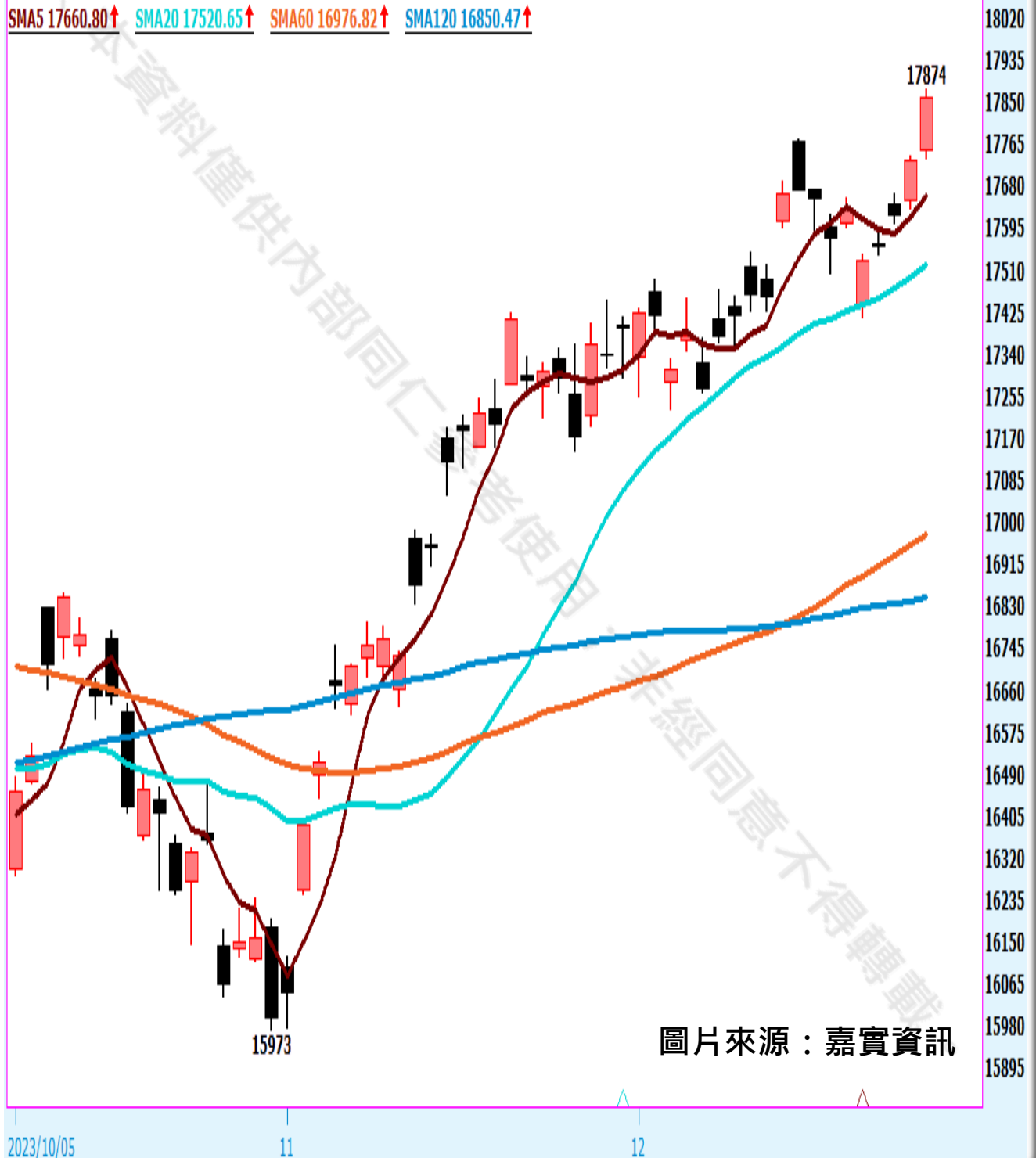
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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)(FTTX*1) 日線圖 2023/12/27 開 17755 高 17874 低 17737 收 17859 s點 量 64820 口 +125 (+0.70%)

SMA5 17660.80↑ SMA20 17520.65↑ SMA60 16976.82↑ SMA120 16850.47↑



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