

法人籌碼動態

01月02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	-17,429	-717	-181	30	-617	-16
投信	10,029	-161	222	0	10	0
自營商	1,441	455	-155	-82	18	92
01月02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	-7	8	28,585	1,516	36,020	-551
投信	0	0	0	0	-42	0
自營商	17	0	-15,671	1,725	20,801	4,551

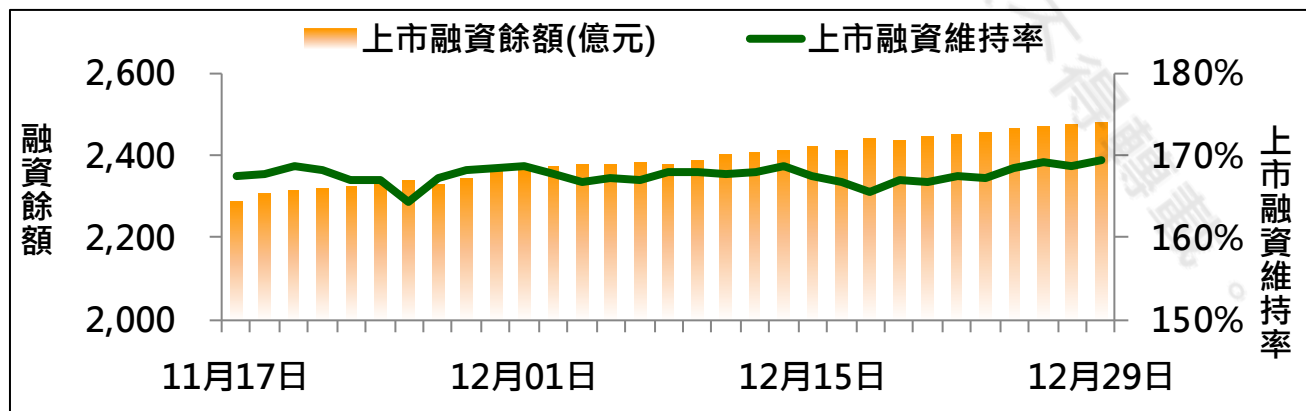
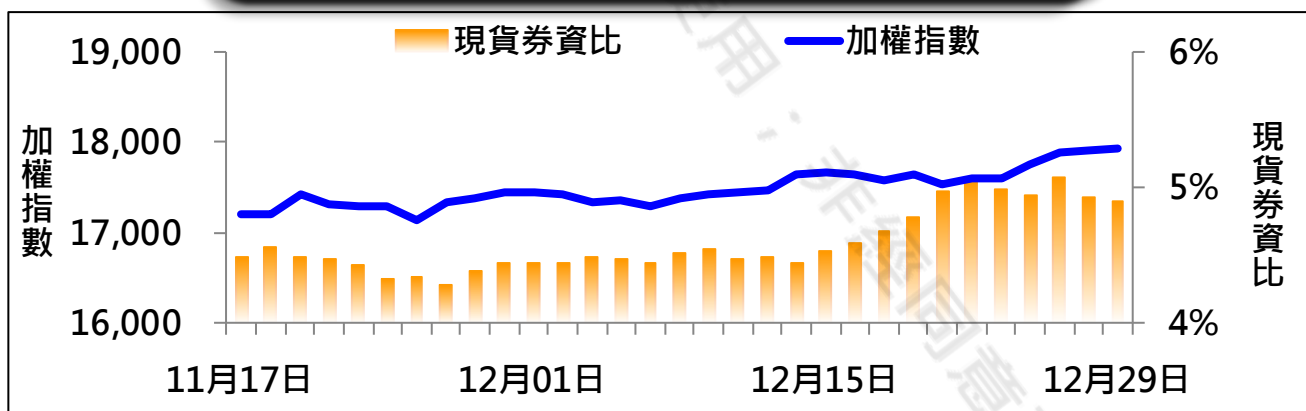
個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
長榮	5.06	聯發科	-17.35	台指期前十大 市場佔比	51.3%	56.4%
世芯-KY	3.94	廣達	-12.94			
長榮航	3.53	智邦	-5.27			
鴻海	2.21	緯創	-4.53	電子期前十大 市場佔比	51.7%	58.7%
陽明	1.89	矽力*-KY	-3.98			
潤泰新	1.36	緯穎	-3.63			
華航	1.35	大立光	-3.62	金融期前十大 市場佔比	51.0%	80.7%
華城	1.25	創意	-2.99			
中華電	1.24	台達電	-2.90			
台灣大	1.01	聯電	-2.79	非金電期前十大 市場佔比	94.4%	95.2%
前十名合計	22.85	後十名合計	-60.01			

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
12月28日	193.3	-13,618	-1,383	-64.3	-525	441
12月29日	121.6	-16,712	-3,094	-39.0	986	1,511
01月02日	10.5	-17,429	-717	-44.5	1,441	455

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
12月28日	26,484	35,943	-9,459	-16,488	9,192	-25,680
12月29日	27,069	36,571	-9,502	-17,396	16,250	-33,646
01月02日	28,585	36,020	-7,435	-15,671	20,801	-36,472

現貨券資比 & 上市融資維持率

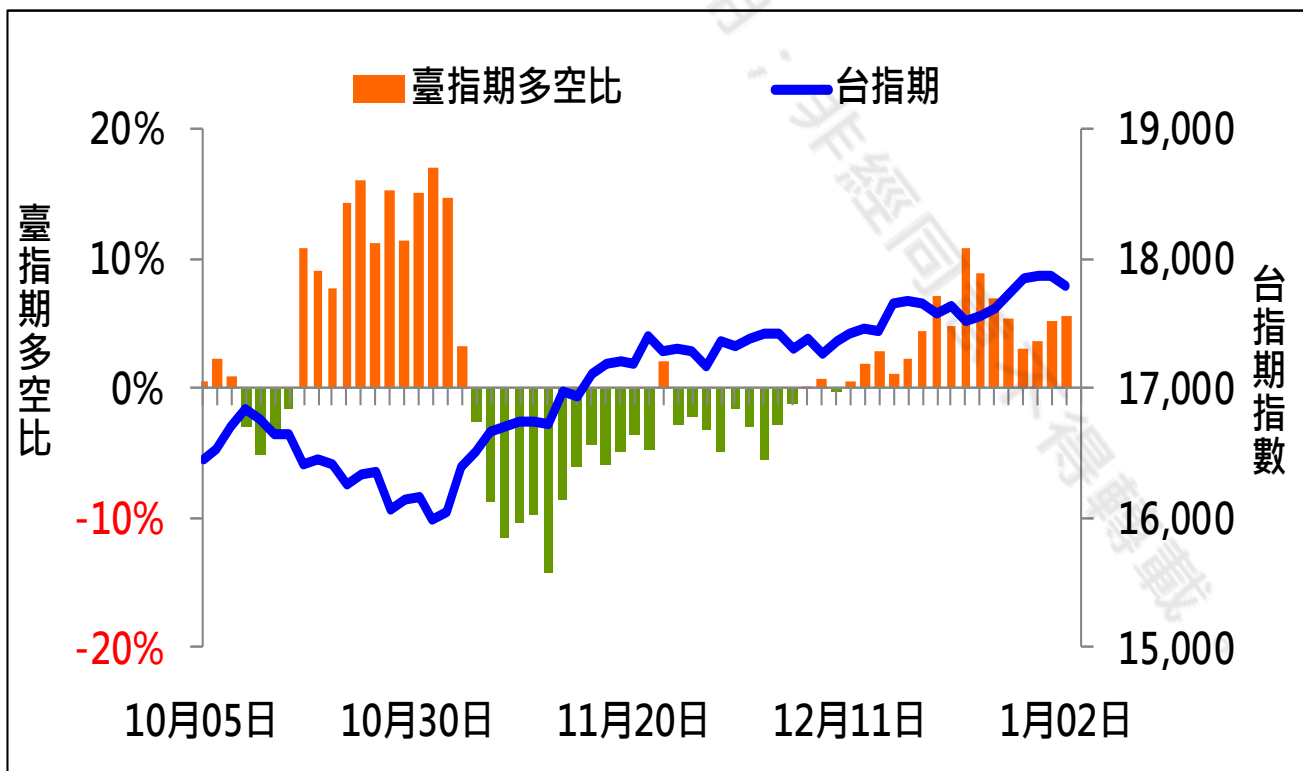
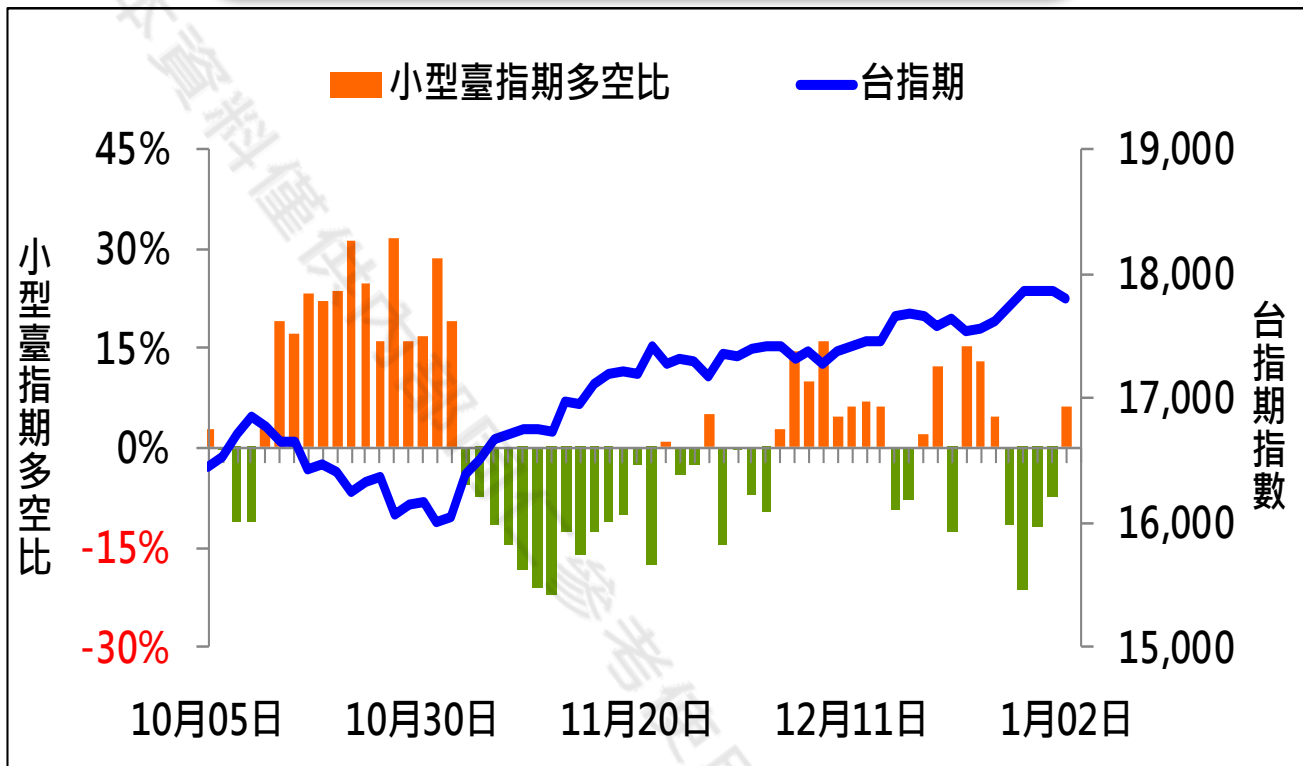


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



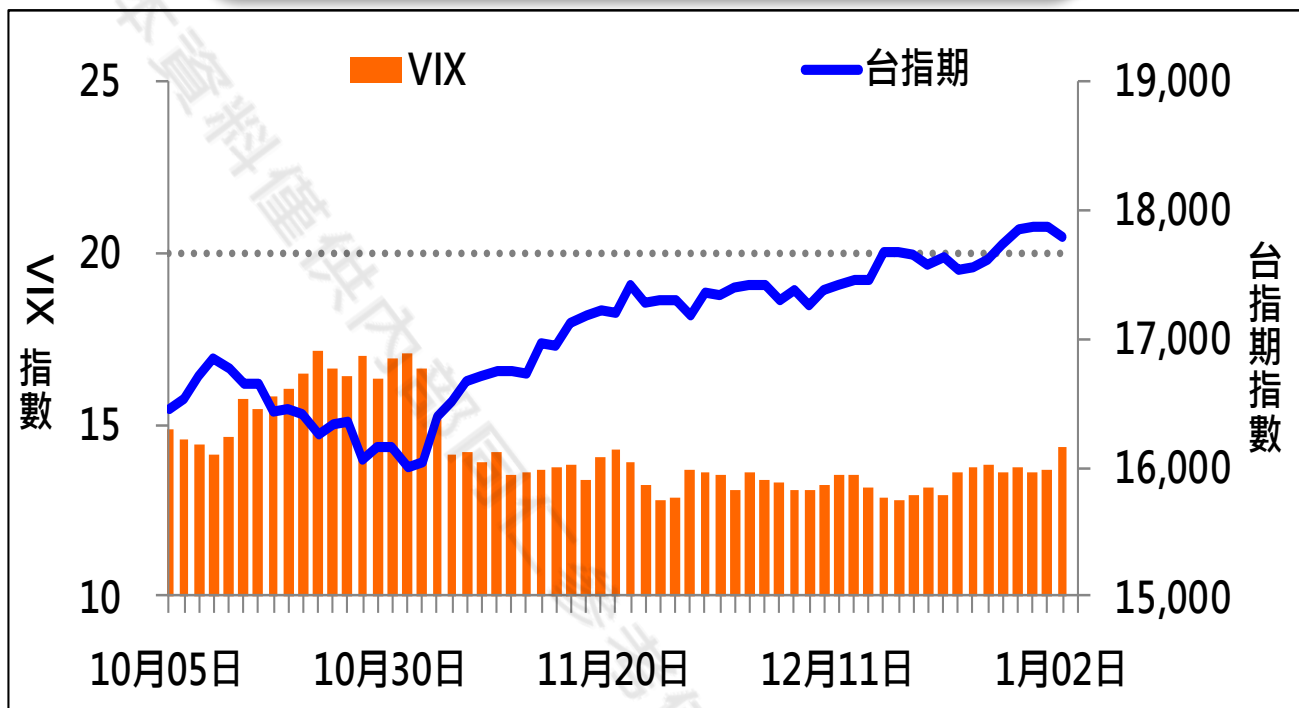
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

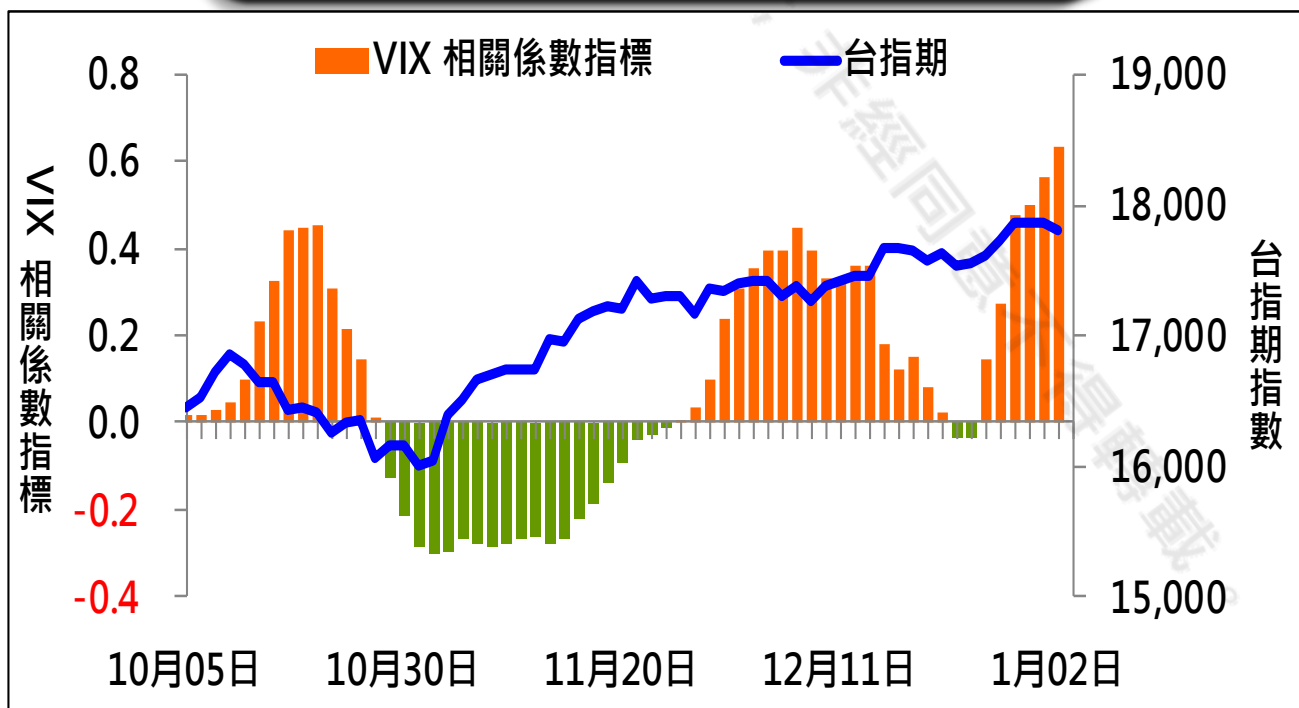
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



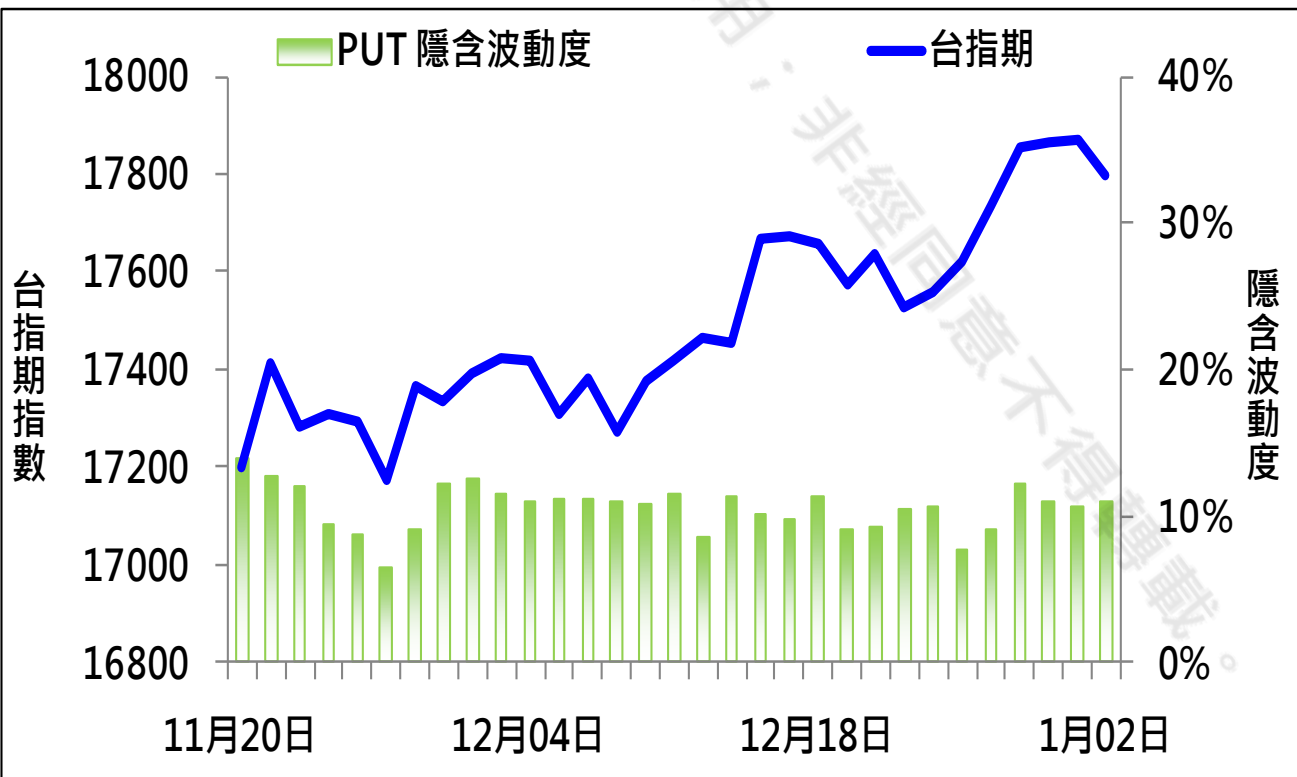
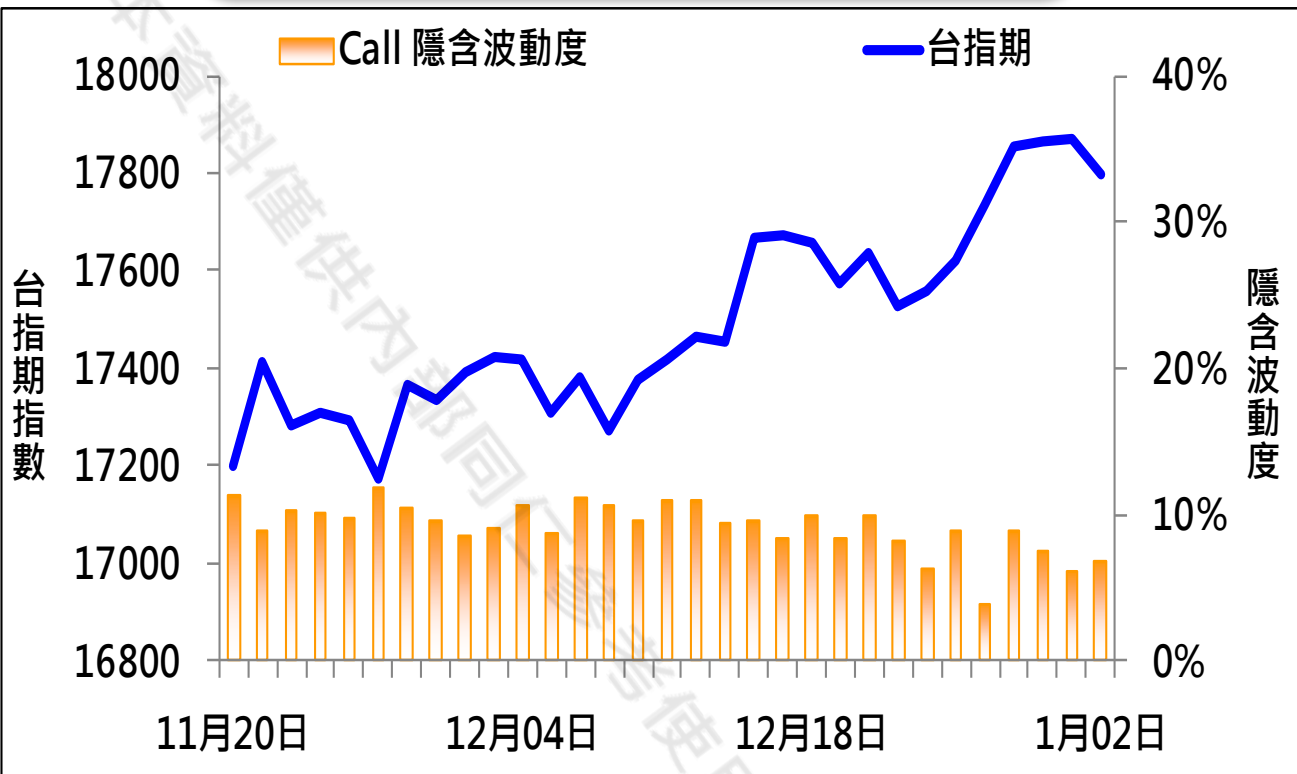
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/1/2

結算日：2024/1/3

OI 增減	Call	202401W1 履約價	Put	OI 增減
0	11	17,250	1,242	-5
5	37	17,300	2,649	67
0	37	17,350	3,340	34
-3	119	17,400	6,669	543
1	86	17,450	3,801	172
-31	581	17,500	7,485	-533
-29	477	17,550	5,903	988
66	527	17,600	10,595	2,957
213	825	17,650	11,851	3,228
-259	1,845	17,700	13,426	4,475
1,055	2,523	17,750	12,744	4,142
5,943	8,597	17,800	9,465	4,022
5,720	10,614	17,850	5,651	1,239
7,814	14,426	17,900	4,003	305
5,309	12,227	17,950	1,229	302
※ 8,626	20,036	18,000	1,066	37
1,924	11,606	18,050	166	-114
-576	9,534	18,100	268	-78
280	6,395	18,150	22	2
512	5,040	18,200	83	-5
881	3,363	18,250	28	2
-309	2,987	18,300	1	1
-41	1,212	18,350	0	0
37,365	115,953	總計	111,922	21,824
P/C	0.9652		增減	-0.1812

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

雙週選擇權OI變化

資料日期：2024/1/2

結算日：2024/1/17

OI 增減	Call	202401月 履約價	Put	OI 增減
2	82	16,700	3,965	64
105	189	16,800	4,063	111
20	155	16,900	4,477	116
-1	424	17,000	7,759	279
2	638	17,100	4,277	57
-3	1,173	17,200	5,635	215
-7	650	17,300	5,404	389
-62	3,554	17,400	8,906	974
15	2,231	17,500	3,903	728
-682	3,717	17,600	3,625	156
-570	3,364	17,700	1,909	79
605	5,581	17,800	2,008	236
484	5,165	17,900	1,041	189
351	8,150	18,000	543	14
315	7,171	18,100	226	14
90	7,602	18,200	148	14
-734	6,129	18,300	620	12
※	898	18,400	54	4
777	5,355	18,500	30	2
73	2,737	18,600	3	-1
198	1,952	18,700	0	0
97	1,098	18,800	3	0
-7	712	18,900	0	0
2,127	90,398	總計	99,086	4,255
P/C	1.0961		增減	0.0218

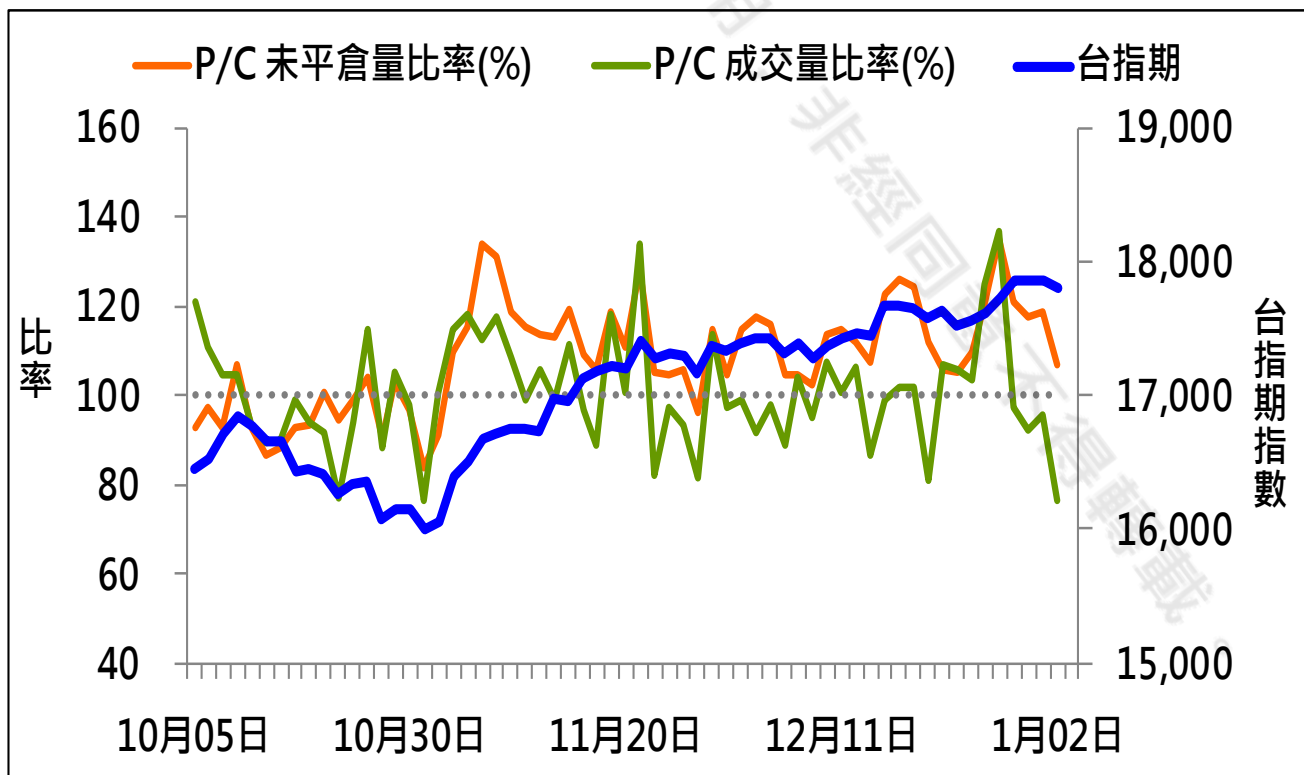
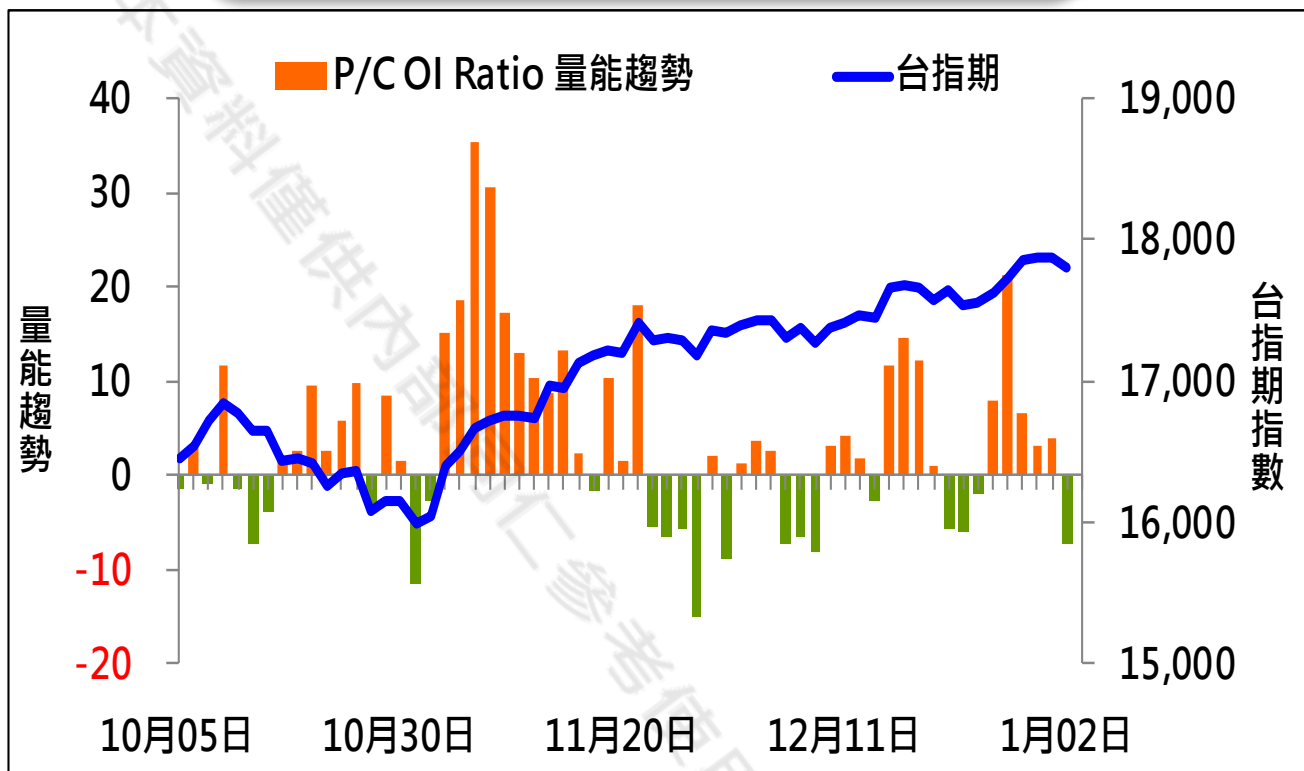
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

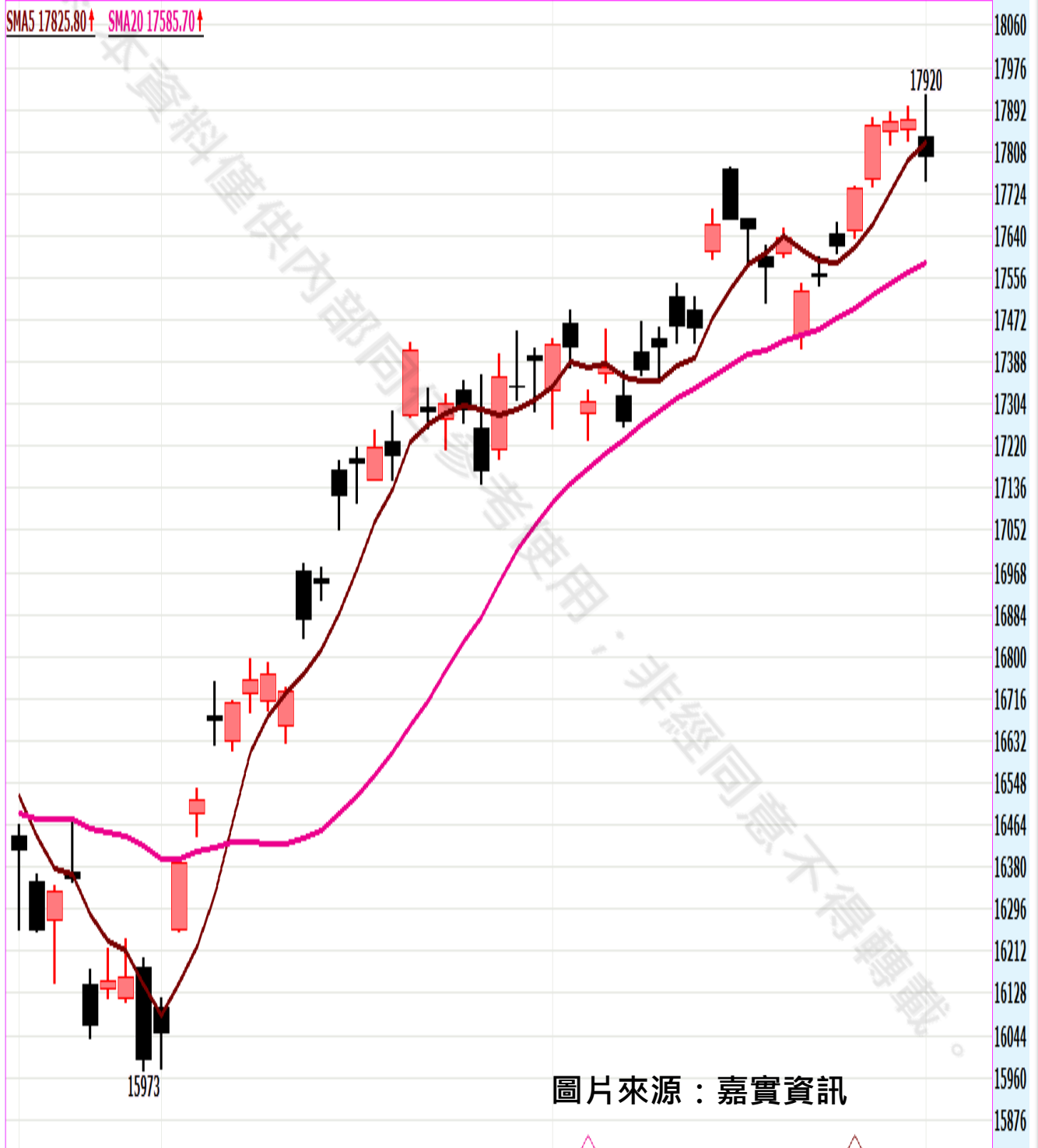
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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)(FTTX*1) 日線圖 2024/01/02 開 17838 高 17920 低 17751 收 17800 點 量 82827 口 -70 (-0.39%)

SMA5 17825.80 ↑ SMA20 17585.70 ↑



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