

法人籌碼動態

01月11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	-25,309	-754	-111	9	-603	4
投信	9,081	652	178	0	8	0
自營商	678	763	-298	52	-108	-53
01月11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	-26	15	47,138	-1,539	49,528	5,206
投信	0	0	0	0	-42	0
自營商	18	-11	-12,841	5,852	3,446	1,318

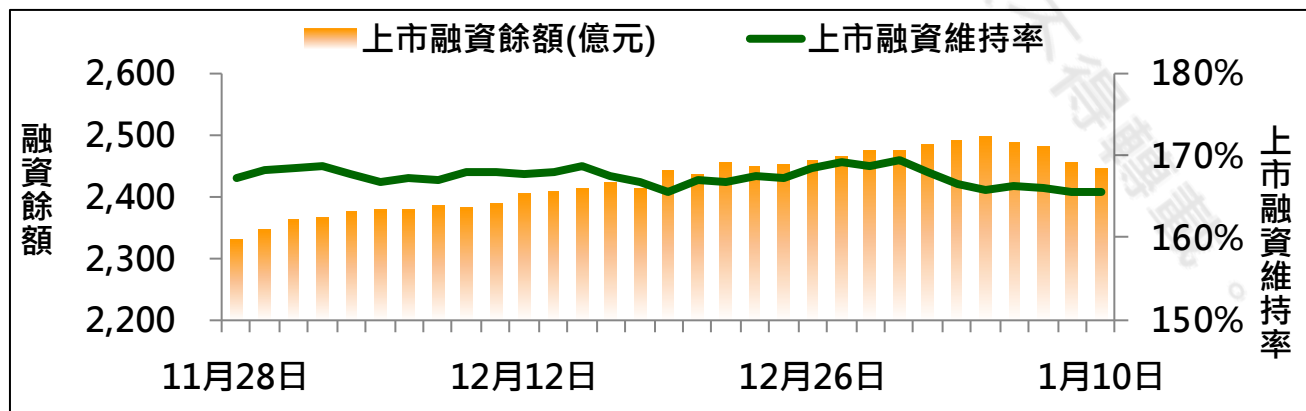
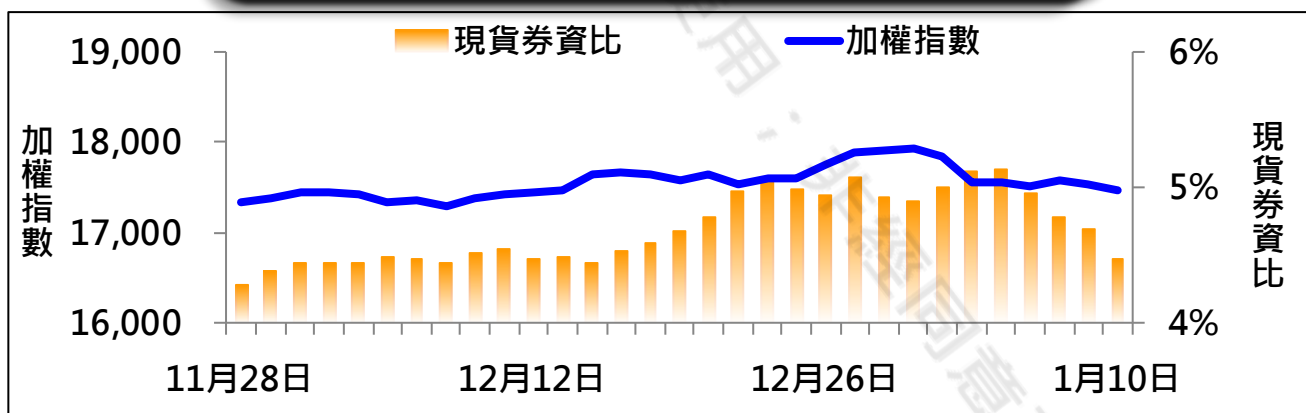
個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
台積電	16.55	南亞	-2.53	台指期前十大 市場佔比	44.5%	57.3%
緯穎	7.81	台塑	-2.23			
廣達	7.40	南亞科	-2.08			
世芯-KY	4.18	聯發科	-2.04	電子期前十大 市場佔比	53.6%	56.3%
技嘉	3.14	京元電子	-1.48			
創意	2.99	日月光投控	-1.40			
緯創	2.87	台塑化	-1.22	金融期前十大 市場佔比	51.7%	78.9%
智原	2.82	華城	-1.21			
文曄	2.45	欣興	-0.97			
英業達	2.23	瑞昱	-0.90	非金電期前十大 市場佔比	95.9%	94.1%
前十名合計	52.44	後十名合計	-16.06			

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)
01月05日	-42.3	-19,682	788	-40.5	186	1,145
01月08日	24.0	-18,791	891	-54.7	419	233
01月09日	-5.8	-24,260	-5,469	-77.1	524	105
01月10日	-31.1	-24,555	-295	-31.9	-85	-609
01月11日	36.1	-25,309	-754	-13.5	678	763

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
01月05日	39,811	40,815	-1,004	-16,421	10,316	-26,737
01月08日	43,356	40,734	2,622	-11,986	5,734	-17,720
01月09日	47,855	43,151	4,704	-19,805	7,118	-26,923
01月10日	48,677	44,322	4,355	-18,693	2,128	-20,821
01月11日	47,138	49,528	-2,390	-12,841	3,446	-16,287

現貨券資比 & 上市融資維持率



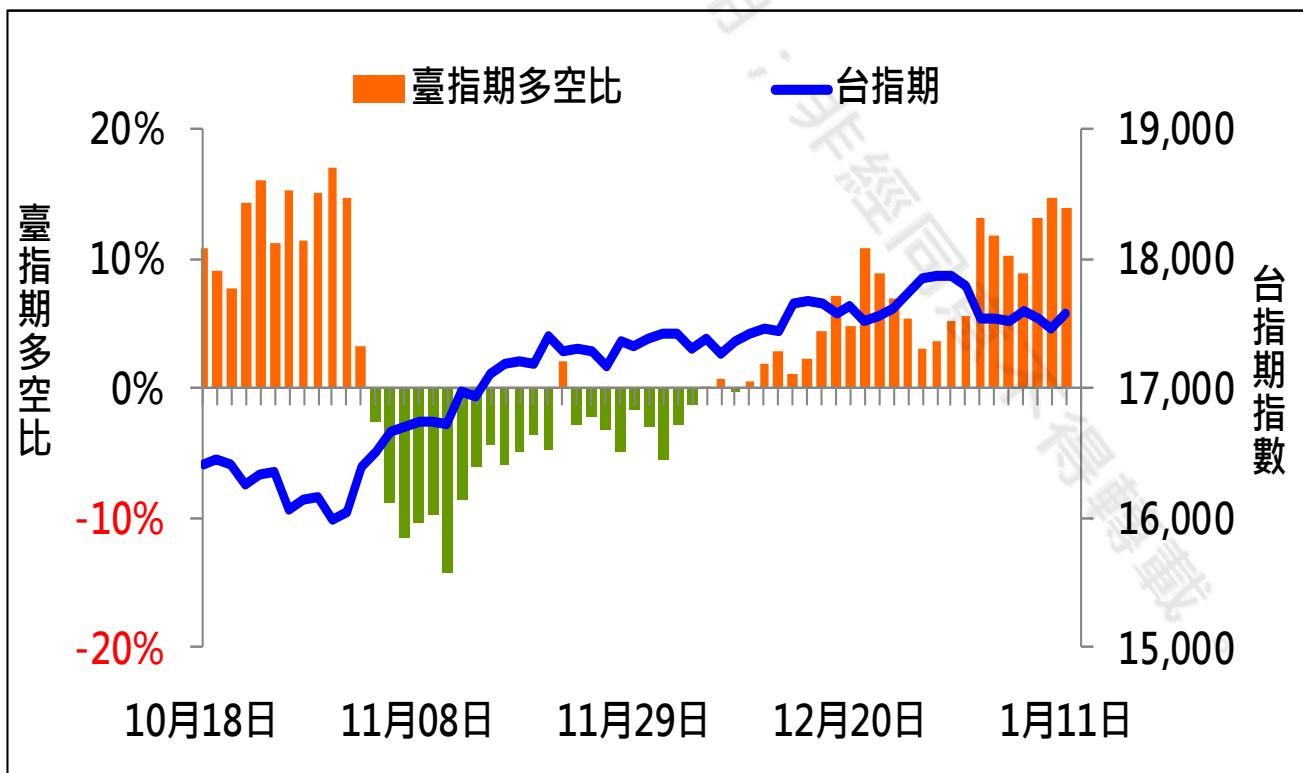
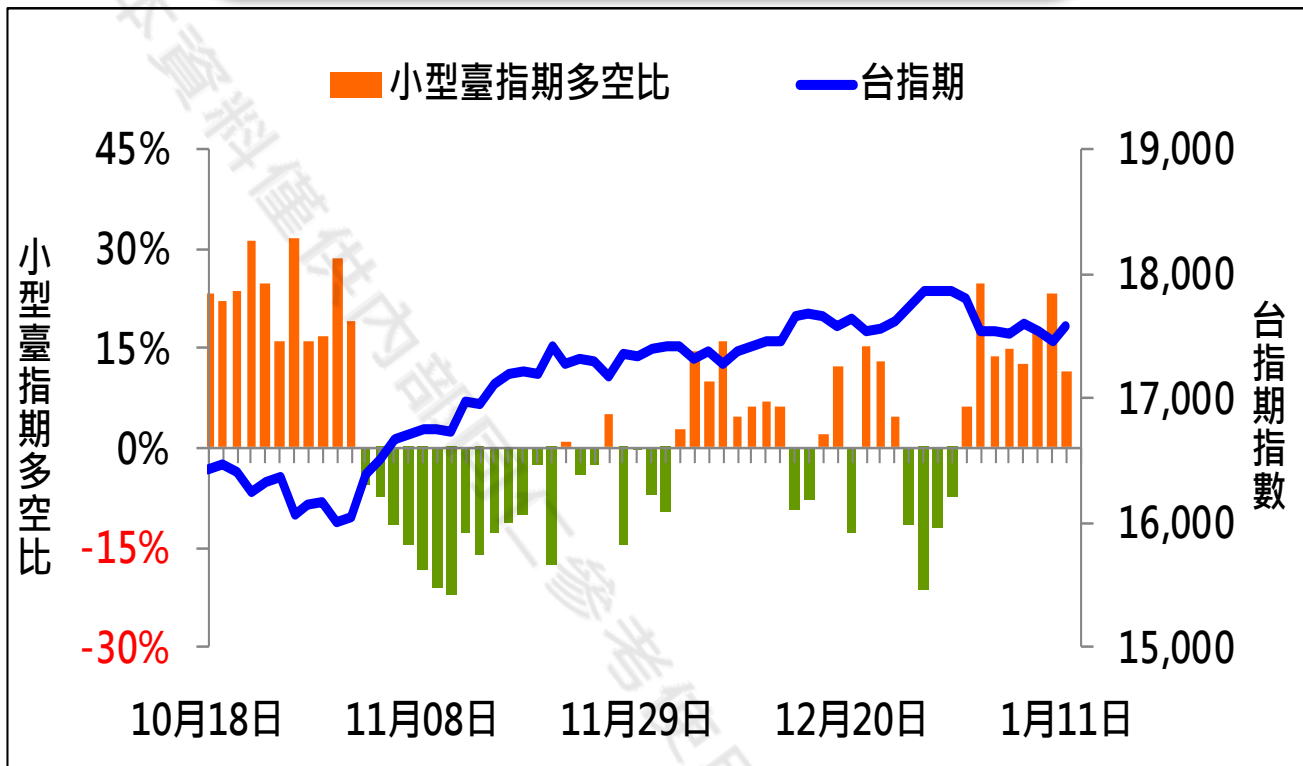
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



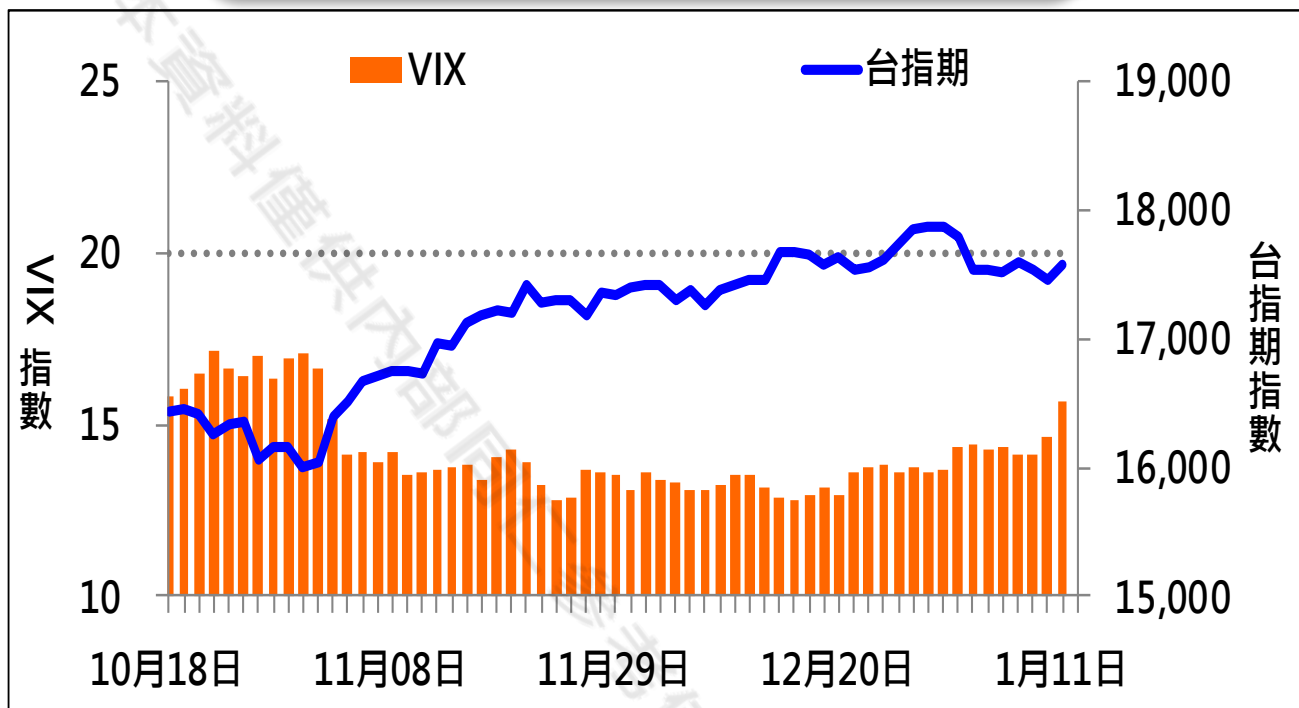
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

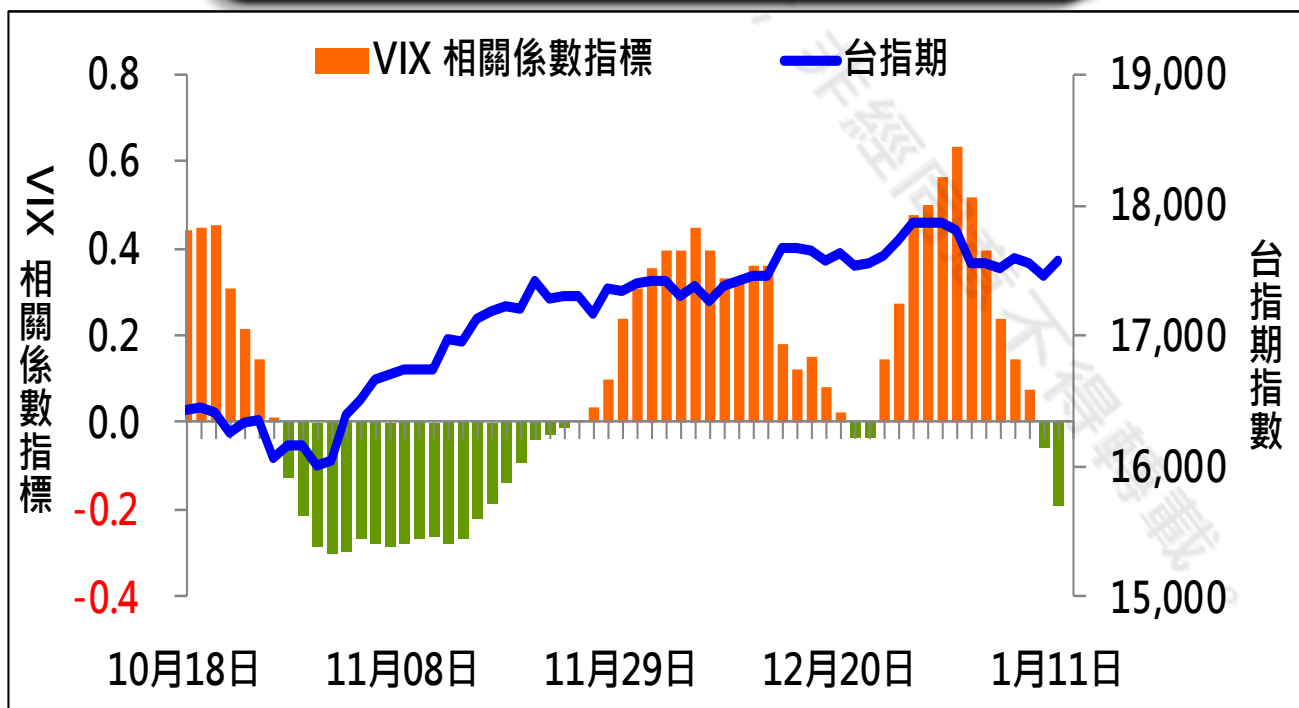
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



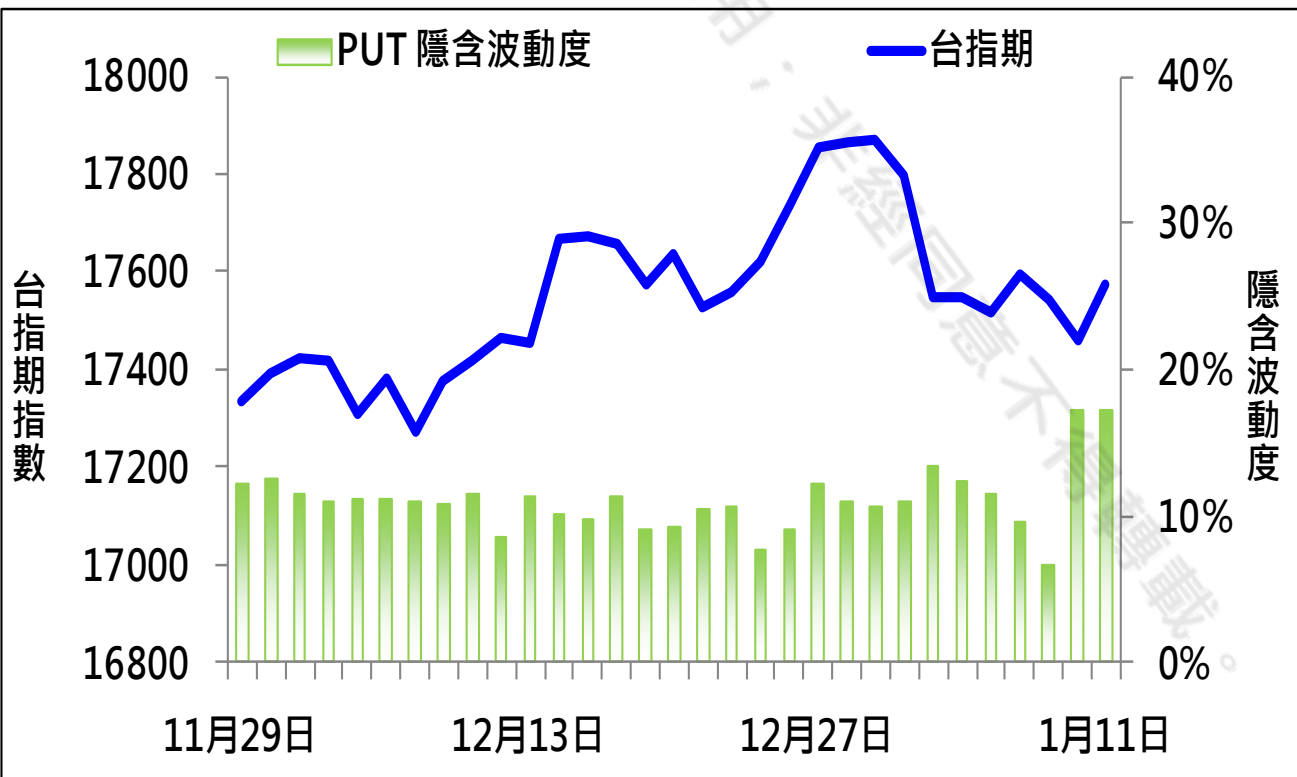
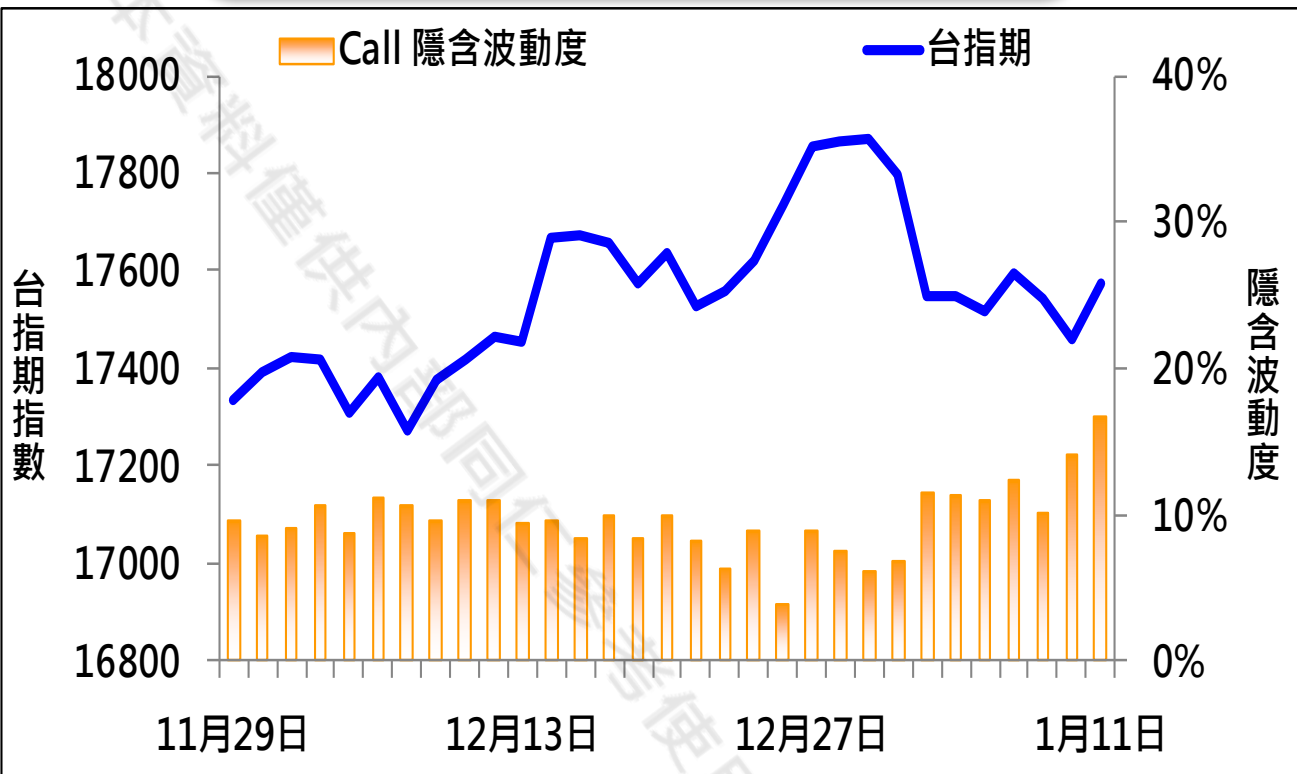
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

近月選擇權OI變化

資料日期：2024/1/11

結算日：2024/1/17

OI 增減	Call	202401月 履約價	Put	OI 增減
0	156	16,900	7,754	1,936
0	0	16,950	768	768
2	457	17,000	12,354	2,240
3	12	17,050	2,576	843
-24	648	17,100	8,434	2,186
0	60	17,150	2,517	557
2	1,231	17,200	10,695	2,404
23	80	17,250	2,907	1,025
-82	832	17,300	7,946	2,042
-192	292	17,350	3,524	1,907
418	4,142	17,400	12,007	1,564
418	2,774	17,450	3,339	1,163
805	4,898	17,500	6,881	1,217
698	2,445	17,550	2,002	1,357
660	6,704	17,600	5,344	798
325	3,147	17,650	823	39
284	9,181	17,700	1,715	16
2,369	5,967	17,750	258	-19
※ 4,884	13,696	17,800	1,719	64
1,453	3,734	17,850	72	-1
-41	9,074	17,900	848	-43
1,548	4,073	17,950	92	50
2,116	19,372	18,000	452	2
664	9,422	18,050	22	-2
1,213	14,328	18,100	312	-5
335	2,024	18,150	19	9
1,003	9,054	18,200	160	1
20,905	173,732	總計	165,138	30,448
P/C	0.9505		增減	0.0692

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

次月選擇權OI變化

資料日期：2024/1/11

結算日：2024/2/21

OI 增減	Call	202402 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,300	943	-1
0	1	16,400	731	138
0	0	16,500	905	205
15	19	16,600	1,364	89
1	7	16,700	929	139
1	15	16,800	1,371	632
2	6	16,900	1,496	232
-1	43	17,000	2,181	159
0	19	17,100	1,905	165
27	63	17,200	1,214	298
23	89	17,300	485	90
14	92	17,400	678	108
350	899	17,500	507	119
41	580	17,600	6,191	54
150	601	17,700	181	24
147	785	17,800	96	2
64	795	17,900	196	6
147	1,788	18,000	27	1
423	2,053	18,100	27	0
396	2,735	18,200	12	1
※ 733	2,474	18,300	22	4
-14	1,965	18,400	3	0
49	1,665	18,500	0	0
2,959	20,483	總計	26,843	3,087
P/C	1.3105		增減	-0.0451

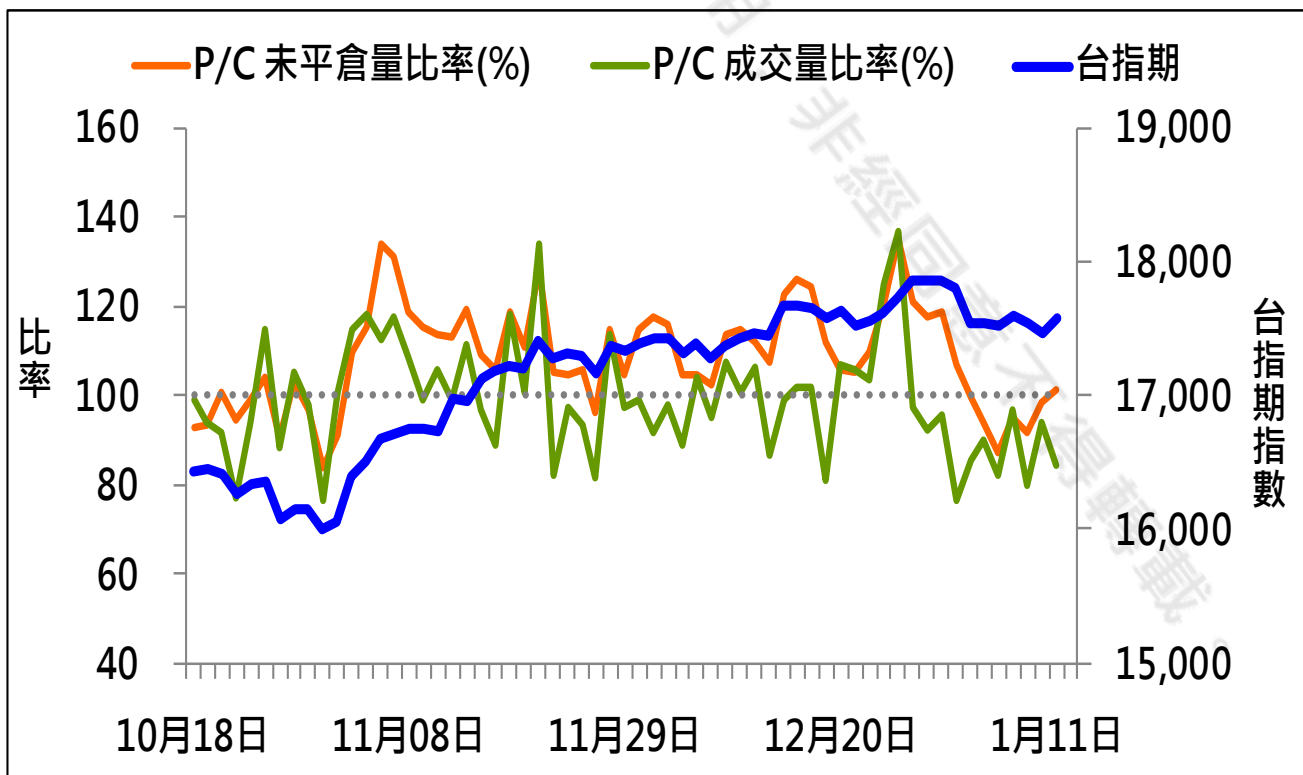
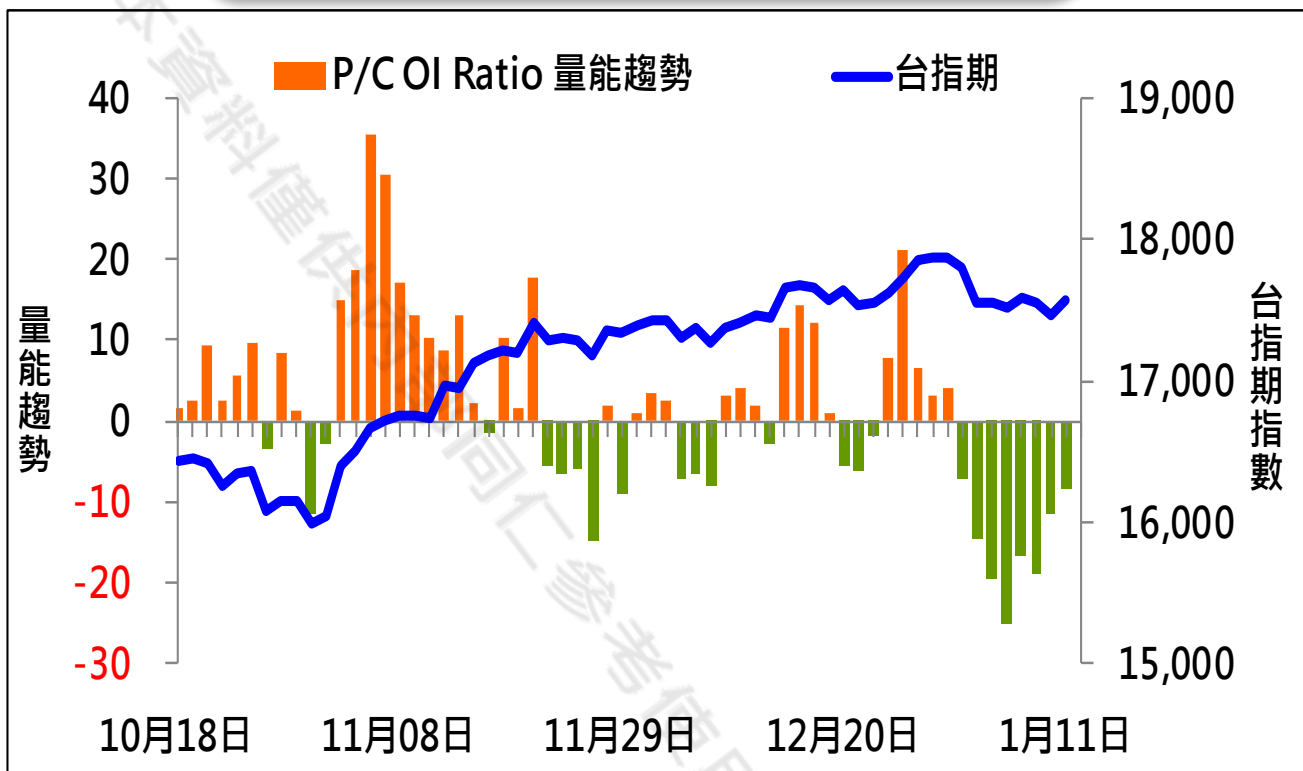
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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)(FTX*1) 日線圖 2024/01/11 開 17490 高 17606 低 17481 收 17570 s點 量 86899 口 +110 (+0.63%)

SMA5 17538.00↑ SMA20 17641.50↑ SMA60 17153.85↑



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