

法人籌碼動態

01月16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	-17,248	4,520	-81	78	-601	6
投信	3,928	-3,532	173	0	8	0
自營商	-1,463	-2,158	-277	25	-117	-37
01月16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	-9	22	62,598	1,551	47,375	-874
投信	0	0	0	0	-42	0
自營商	-10	-30	-15,750	-4,615	3,616	-3,658

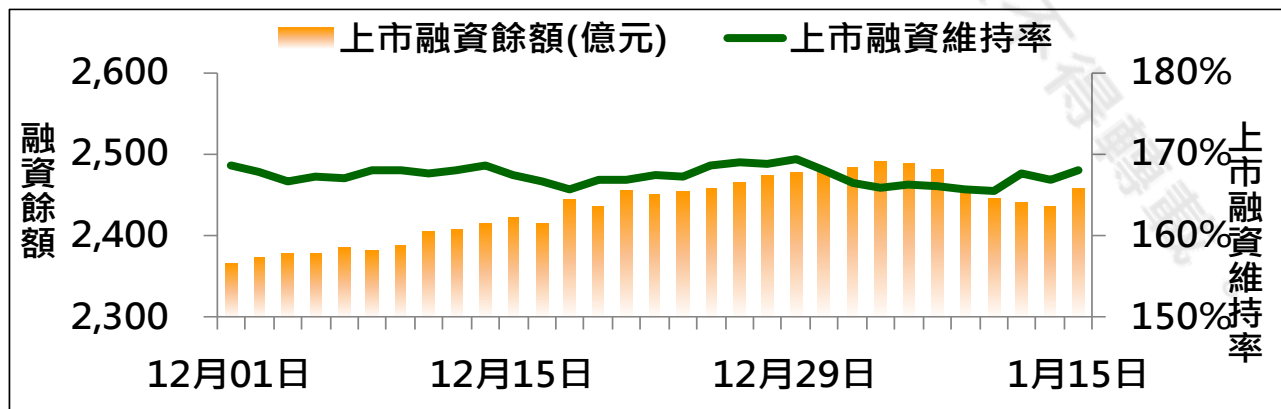
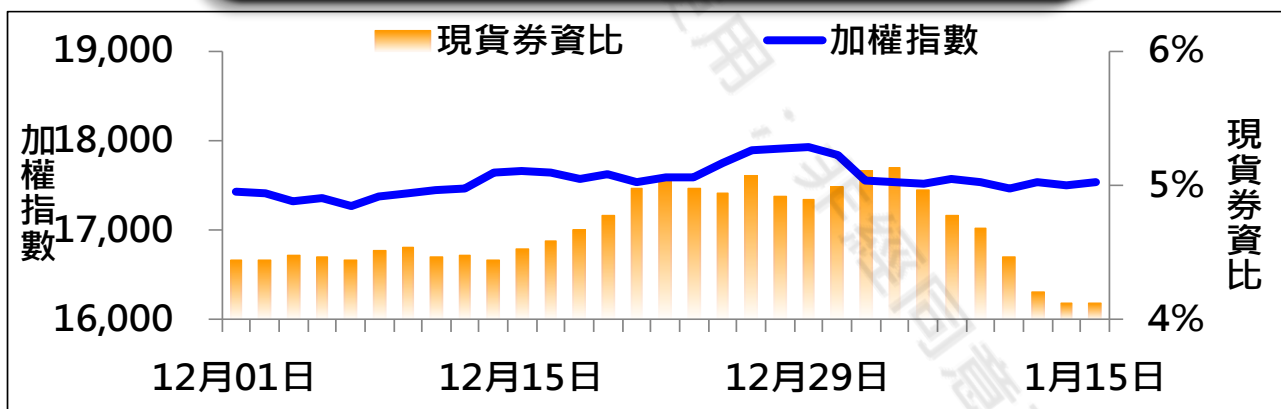
個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				台指期前十大 市場佔比	多	空
群創	2.61	台積電	-49.67		45.8%	54.3%
緯穎	2.51	聯發科	-13.79	電子期前十大 市場佔比	55.0%	59.2%
文晔	2.45	台塑化	-10.34			
廣達	1.85	和泰車	-5.16	金融期前十大 市場佔比	53.3%	70.6%
智原	1.43	台化	-5.05			
欣興	1.22	台達電	-4.98	非金電期前十大 市場佔比	99.3%	93.7%
大聯大	1.14	南亞	-4.56			
采鈺	1.11	富邦金	-4.20			
奇鋆	1.10	台塑	-3.86			
友達	0.98	中華電	-3.71			
前十名合計	16.40	後十名合計	-105.31			

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10日	-31.1	-24,555	-295	-31.9	-85	-609
01月11日	36.1	-25,309	-754	-13.5	678	763
01月12日	27.4	-26,404	-1,095	-42.3	1,285	607
01月15日	-90.9	-21,768	4,636	-18.5	695	-590
01月16日	-451.1	-17,248	4,520	-31.3	-1,463	-2,158

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
01月12日	45,128	51,027	-5,899	-8,046	10,370	-18,416
01月15日	61,047	48,249	12,798	-11,135	7,274	-18,409
01月16日	62,598	47,375	15,223	-15,750	3,616	-19,366

現貨券資比 & 上市融資維持率



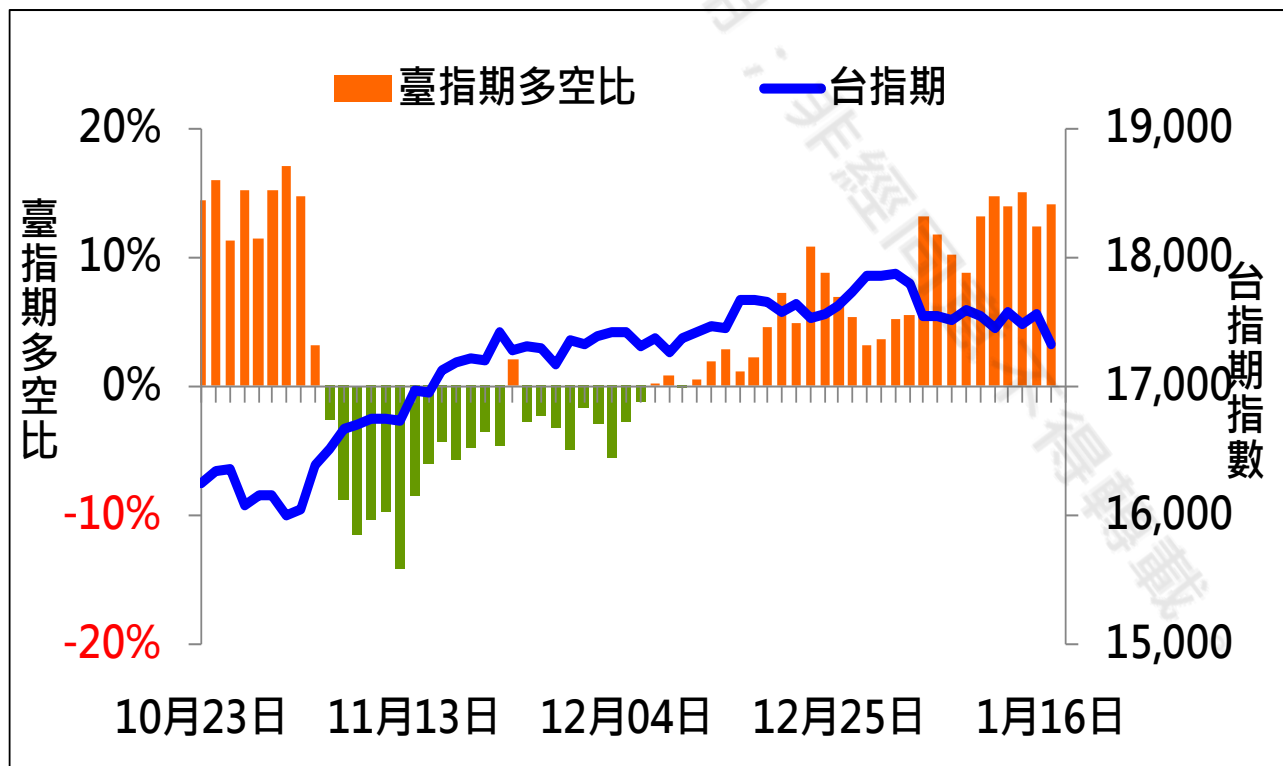
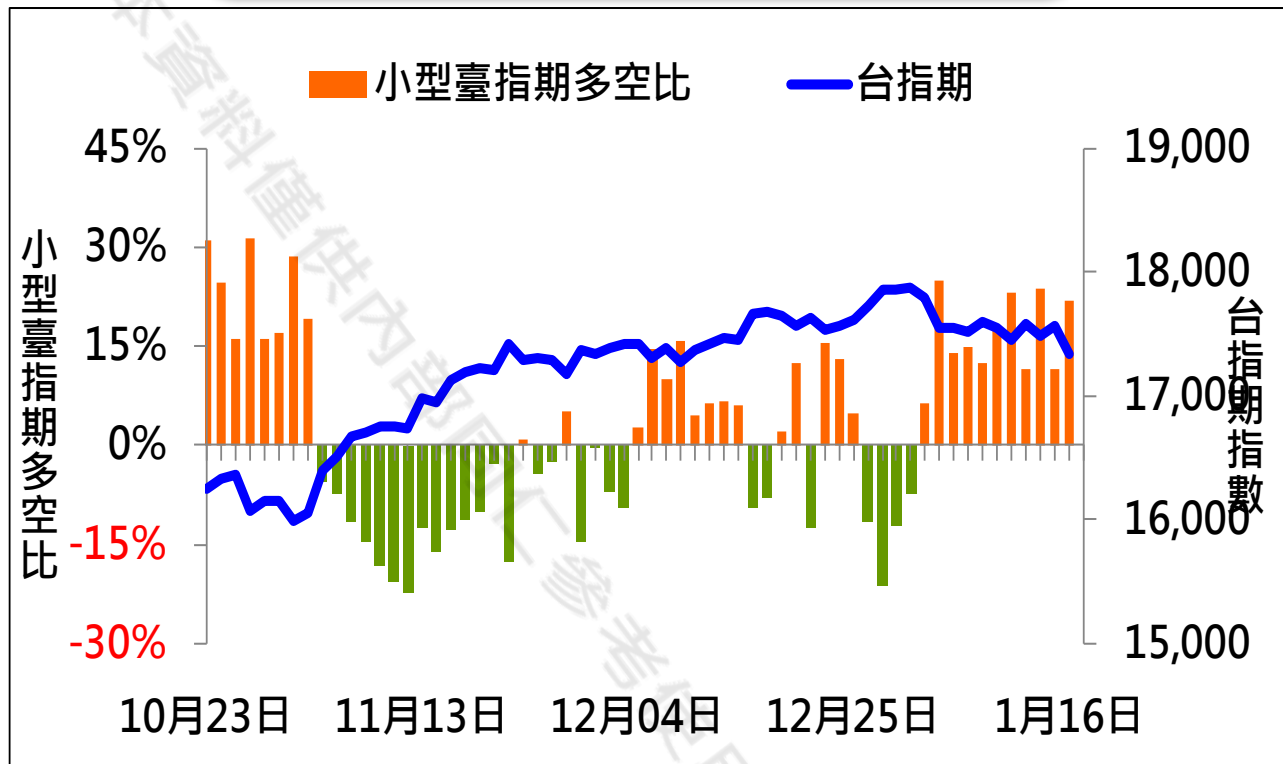
期權交易財務槓桿高，交易者請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易者須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

散戶多空比



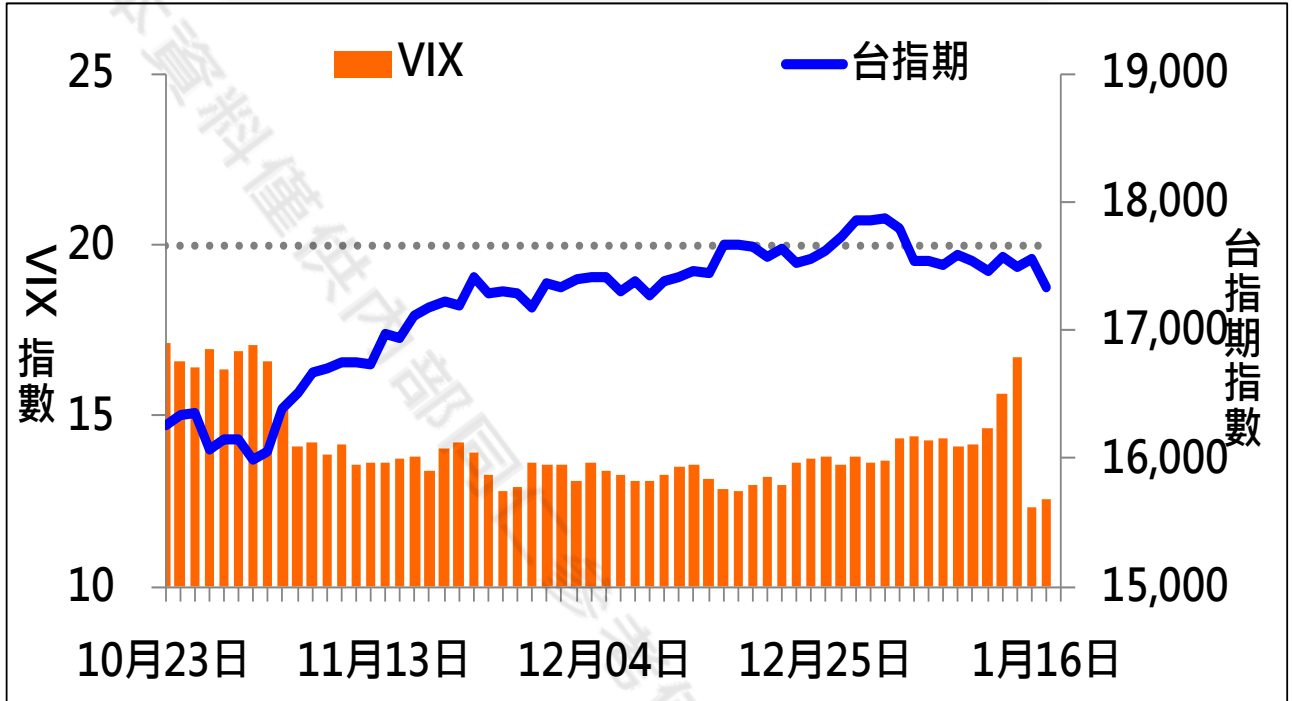
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

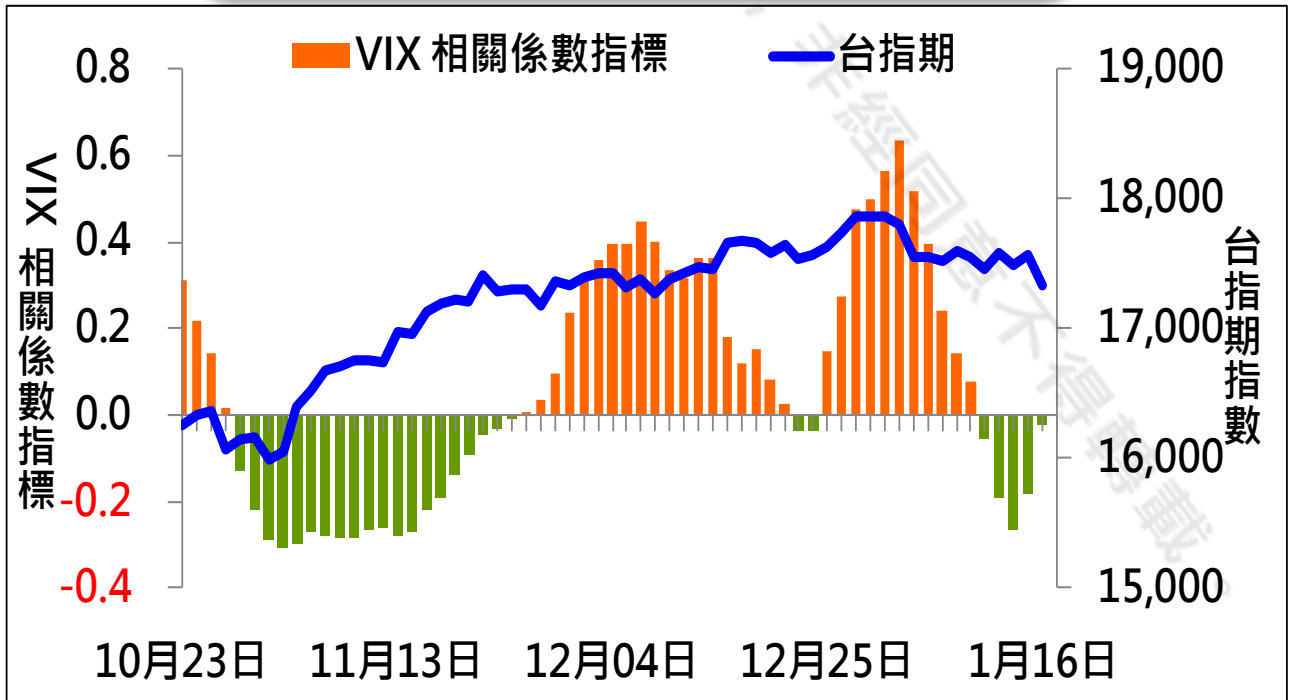
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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

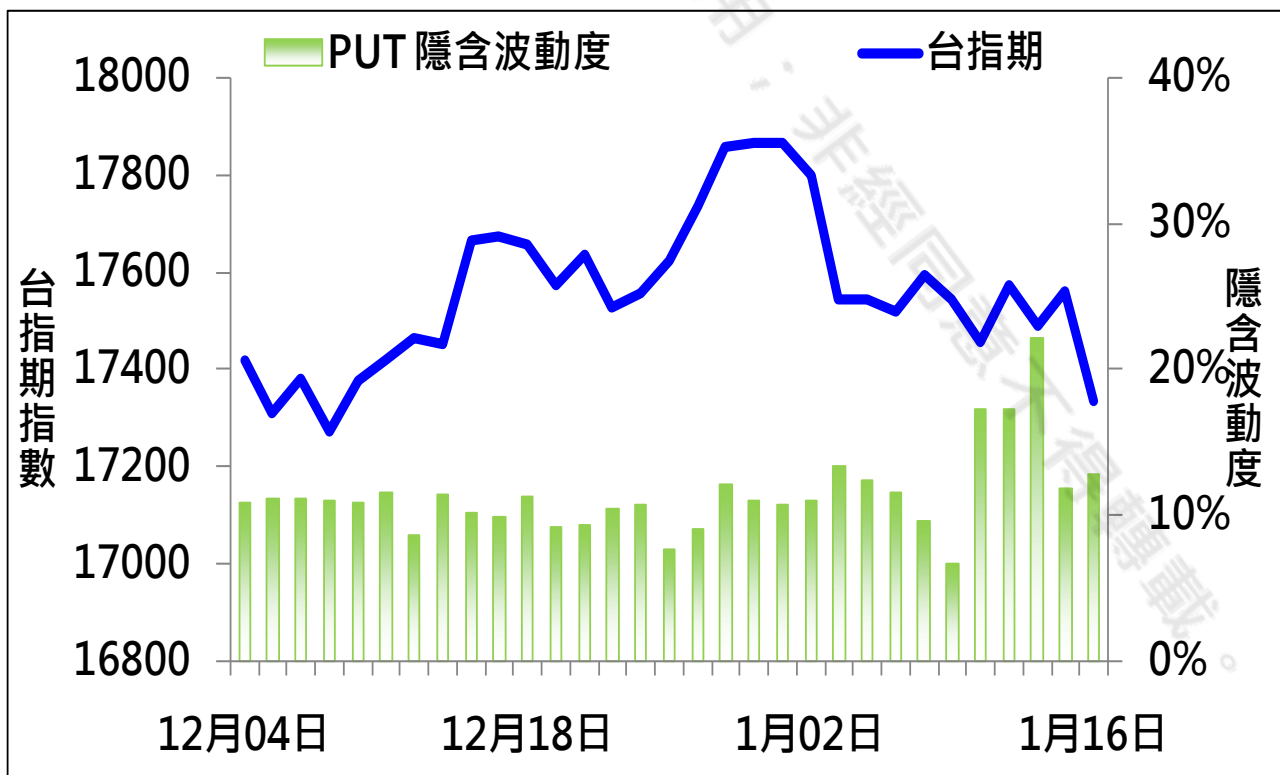
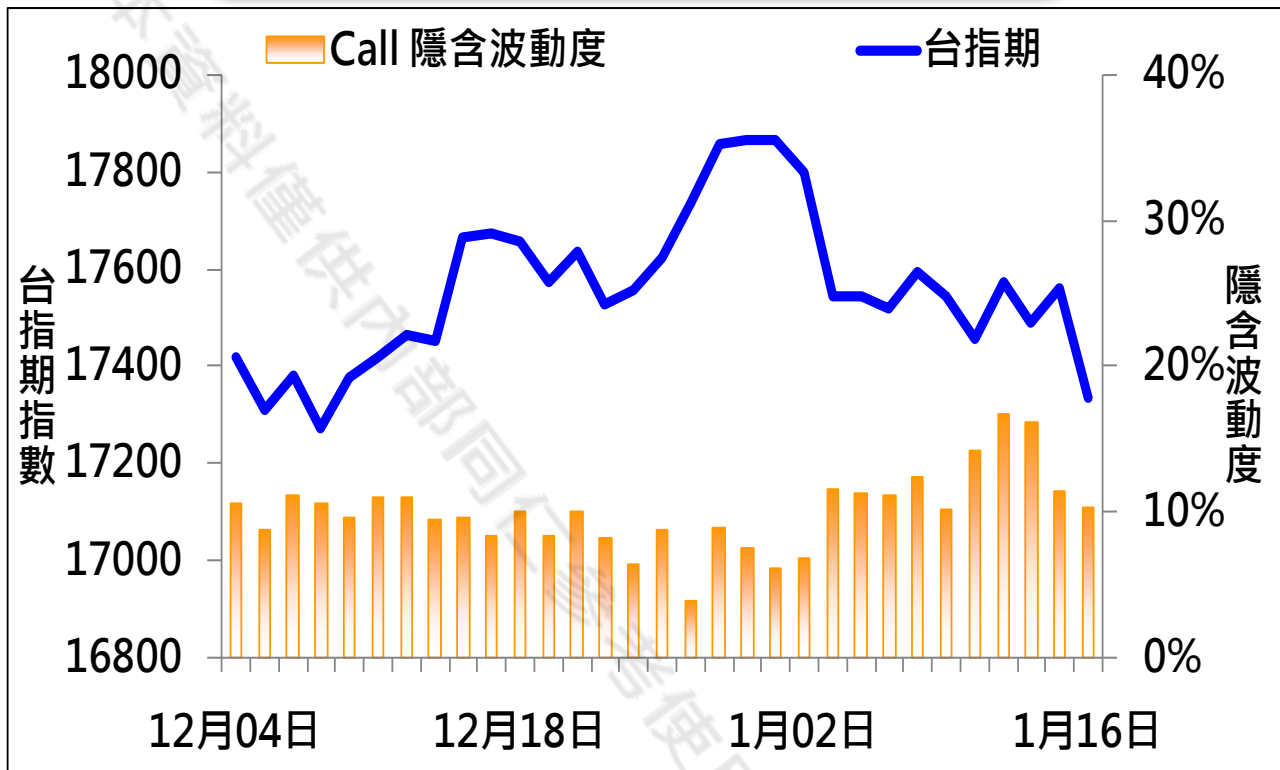


期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/1/16

結算日：2024/1/17

OI 增減	Call	202401 月 履約價	Put	OI 增減
2	158	16,900	8,957	-66
0	0	16,950	2,499	328
-4	676	17,000	12,797	137
-2	12	17,050	3,513	741
-18	673	17,100	8,902	891
8	56	17,150	6,018	1,521
86	1,512	17,200	14,204	1,254
979	1,103	17,250	7,249	3,178 ※
1,645	2,567	17,300	12,447	-37
4,838	5,265	17,350	8,375	1,874
7,255	10,760	17,400	17,080	229
10,232	13,363	17,450	5,314	-783
※ 14,049	19,364	17,500	7,425	-3,704
7,522	10,480	17,550	3,104	-850
2,143	12,390	17,600	3,917	-1,417
1,436	8,101	17,650	1,287	-398
-1,046	12,322	17,700	1,384	-676
-1,760	11,539	17,750	316	-88
-5,360	12,450	17,800	1,602	-213
-5,101	4,828	17,850	75	-21
-2,499	18,209	17,900	803	-102
-1,986	5,528	17,950	202	-56
-1,341	21,531	18,000	351	-49
26,124	247,609	總計	199,389	-2,792
P/C	0.8053		增減	-0.1076

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

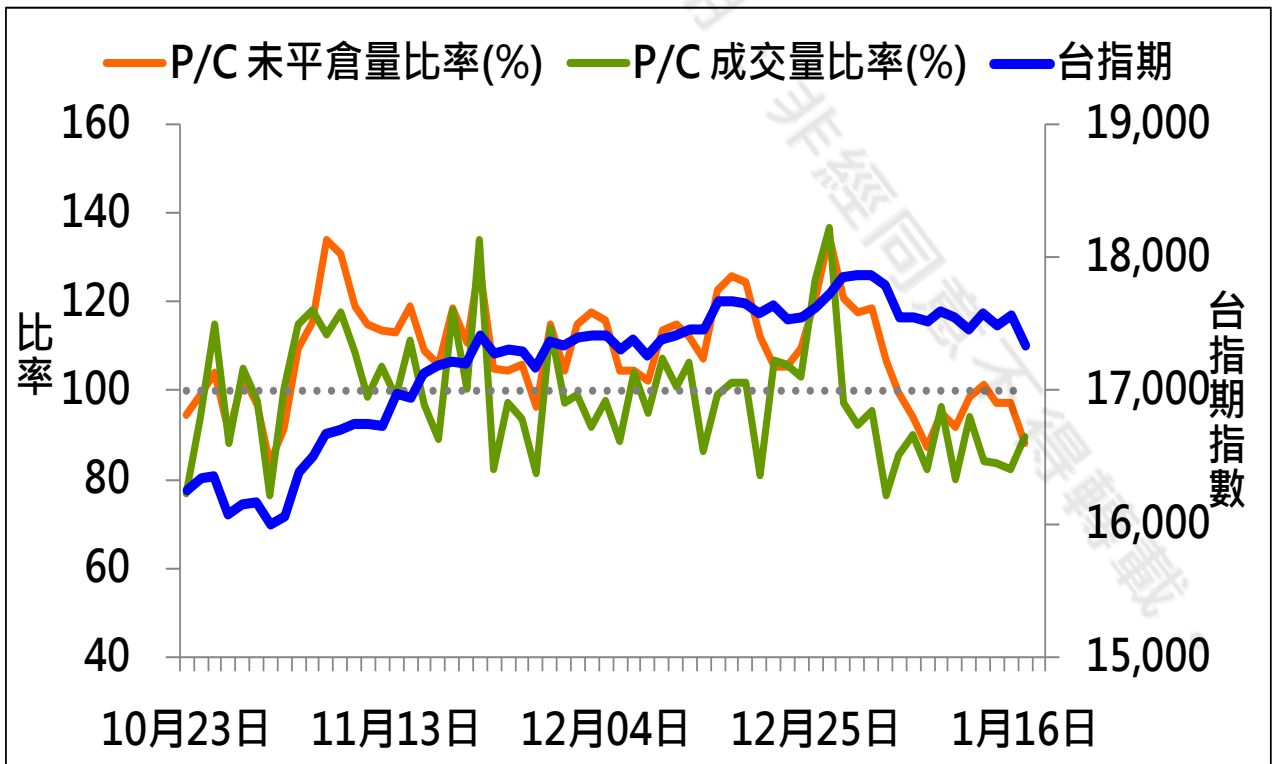
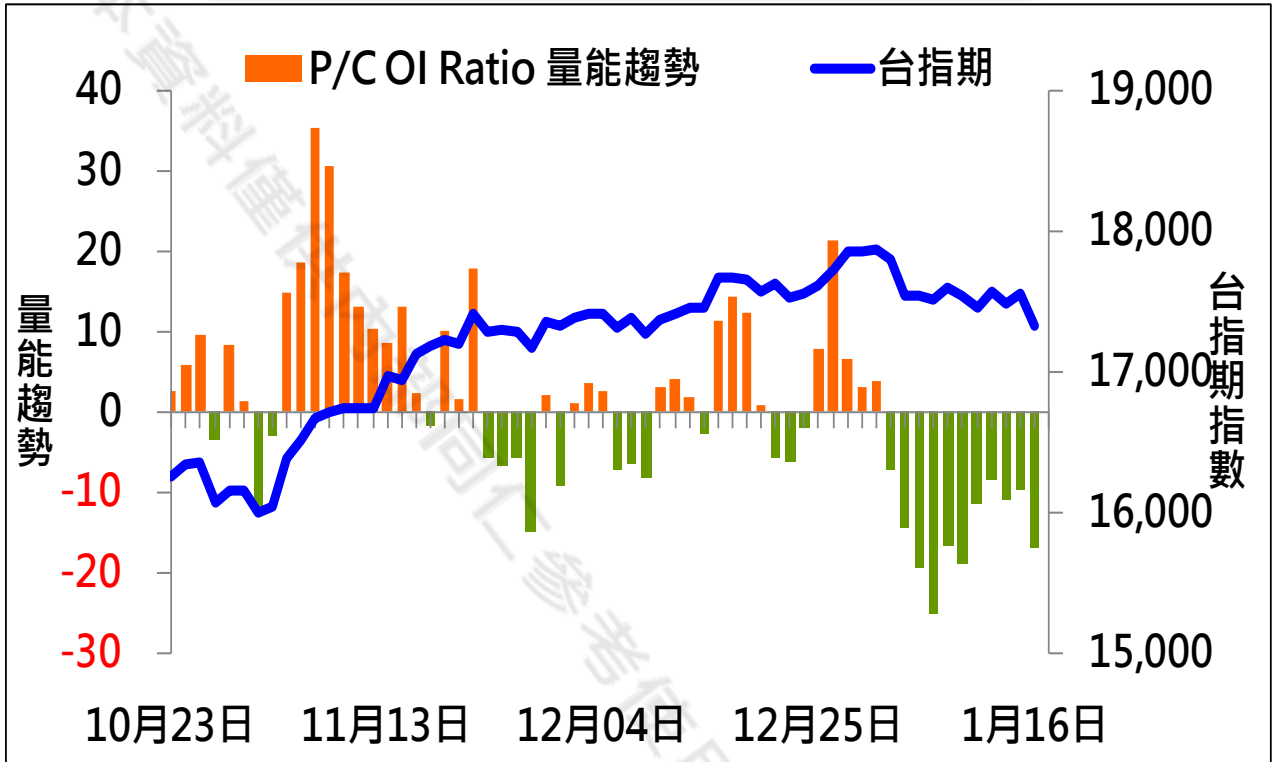
次月選擇權OI變化

資料日期：2024/1/16

結算日：2024/2/21

OI 增減	Call	202402 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,100	448	2
0	0	16,200	478	29
0	0	16,300	1,336	205
0	1	16,400	1,435	69
1	1	16,500	1,416	127
0	19	16,600	2,208	337
2	11	16,700	2,307	257
3	27	16,800	2,459	671
0	6	16,900	2,145	320
9	62	17,000	2,811	12
30	54	17,100	2,204	37
31	126	17,200	3,159	1,493 ※
69	254	17,300	1,901	123
163	280	17,400	1,910	157
679	2,116	17,500	1,397	-123
271	1,250	17,600	6,247	-24
110	958	17,700	188	-1
599	2,228	17,800	105	-3
376	1,383	17,900	213	19
※ 1,125	3,494	18,000	34	-3
470	2,837	18,100	27	0
342	3,779	18,200	12	0
705	3,842	18,300	7	-8
4,357	32,636	總計	40,258	4,357
P/C	1.2335		增減	-0.0360

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



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