

法人籌碼動態

11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	-45,338	3,124	-463	-2	-342	13
投信	25,736	-81	258	-8	19	0
自營商	-719	676	-49	13	35	-6
11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	0	0	-9,059	-3,120	-1,213	-1,212
投信	0	0	-124	0	0	0
自營商	0	0	3,706	-2,090	-167	-8,357

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名	
智邦	4.75	台積電	-84.46
華南金	2.67	鴻海	-27.09
東元	2.12	聯發科	-15.63
上海商銀	1.90	廣達	-13.21
台灣大	1.82	緯穎	-11.67
遠傳	1.60	長榮	-10.78
長榮航	0.88	緯創	-7.08
統一	0.74	日月光投控	-6.44
正新	0.74	富邦金	-6.19
統一超	0.68	華碩	-5.56
前十名合計	17.89	後十名合計	-188.11

單位：口	多	空
台指期前十大市場佔比	45.8%	60.5%
電子期前十大市場佔比	55.9%	74.6%
金融期前十大市場佔比	47.3%	80.3%
非金電期前十大市場佔比	100.0%	92.3%

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

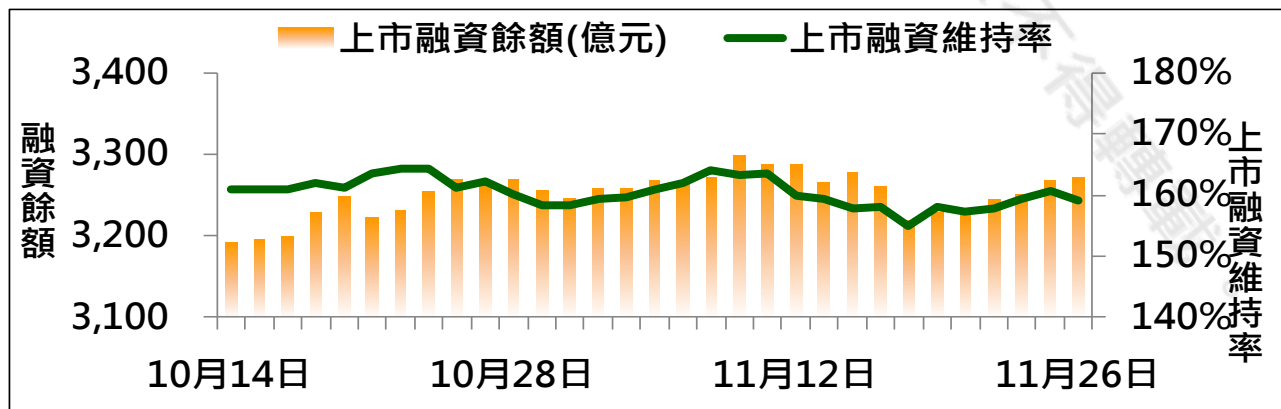
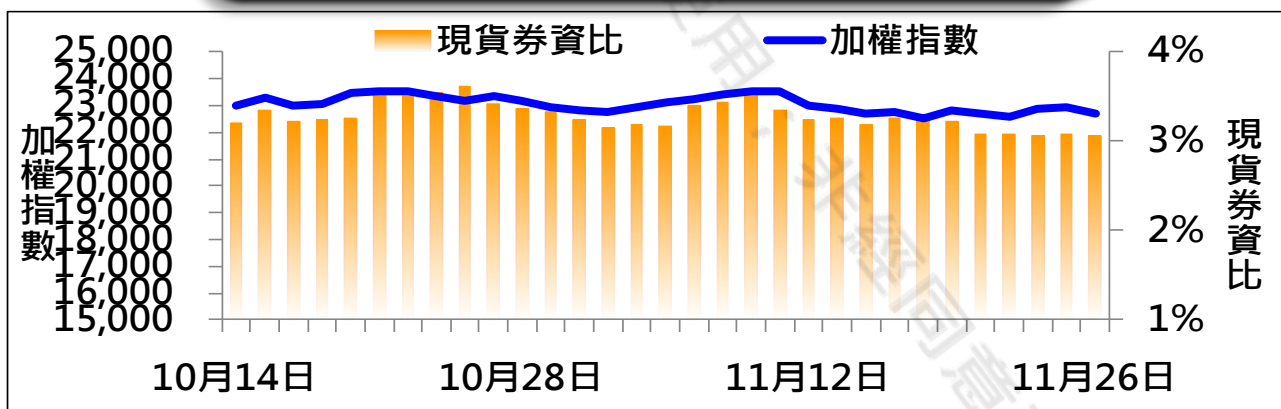
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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21日	-263.5	-43,707	-1,822	-18.2	-1,272	-259
11月22日	83.1	-38,202	5,505	34.5	-3,269	-1,997
11月25日	52.2	-46,343	-8,141	40.0	-2,744	525
11月26日	-292.5	-48,462	-2,119	-78.5	-1,395	1,349
11月27日	-409.9	-45,338	3,124	-139.6	-719	676

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21日	-2,131	2,348	-4,479	1,671	5,384	-3,713
11月22日	-2,525	638	-3,163	16,120	3,226	12,894
11月25日	-4,390	301	-4,691	13,292	7,295	5,997
11月26日	-5,939	-1	-5,938	5,796	8,190	-2,394
11月27日	-9,059	-1,213	-7,846	3,706	-167	3,873

現貨券資比 & 上市融資維持率



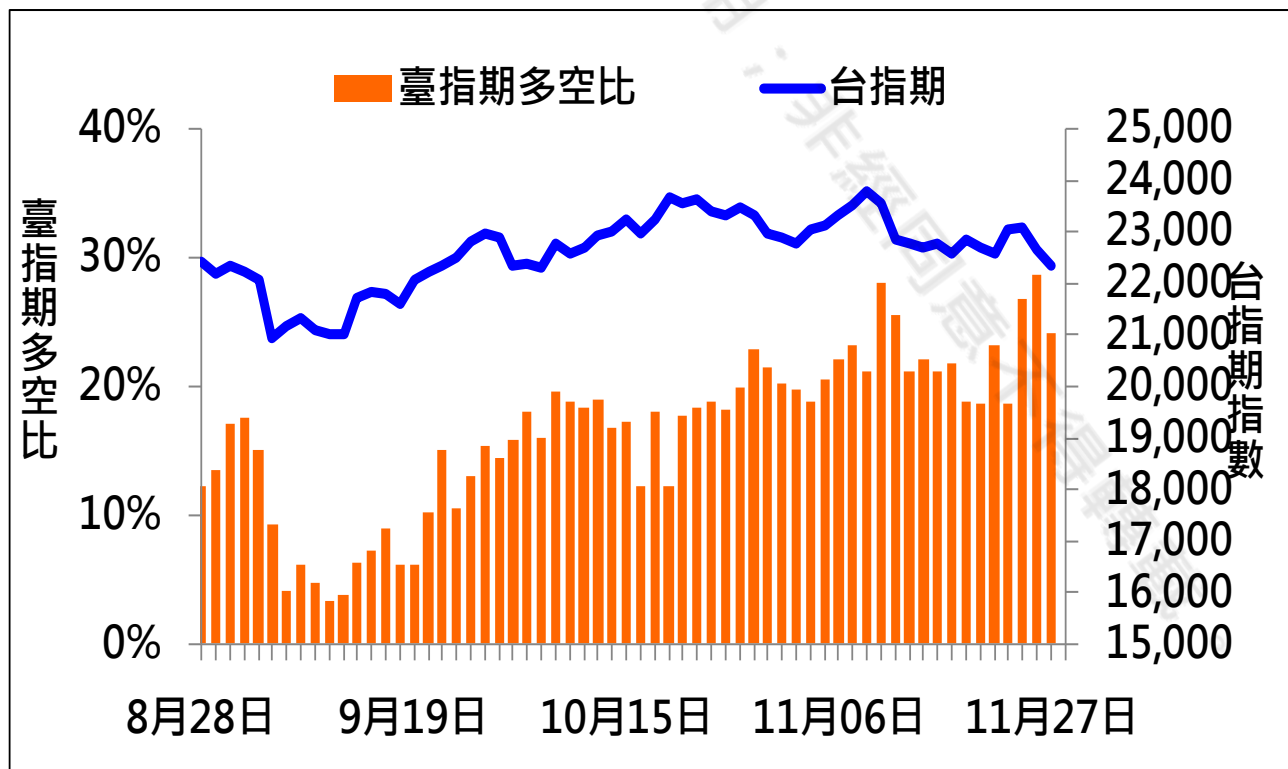
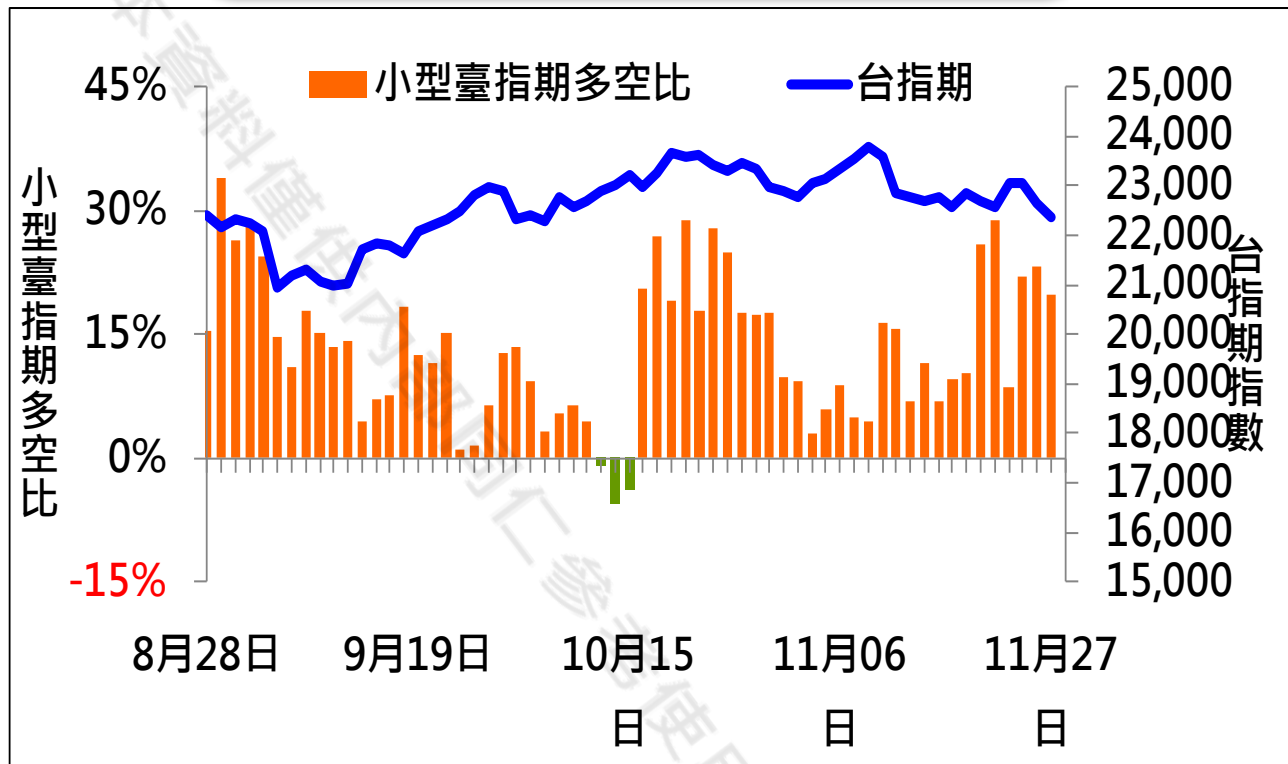
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



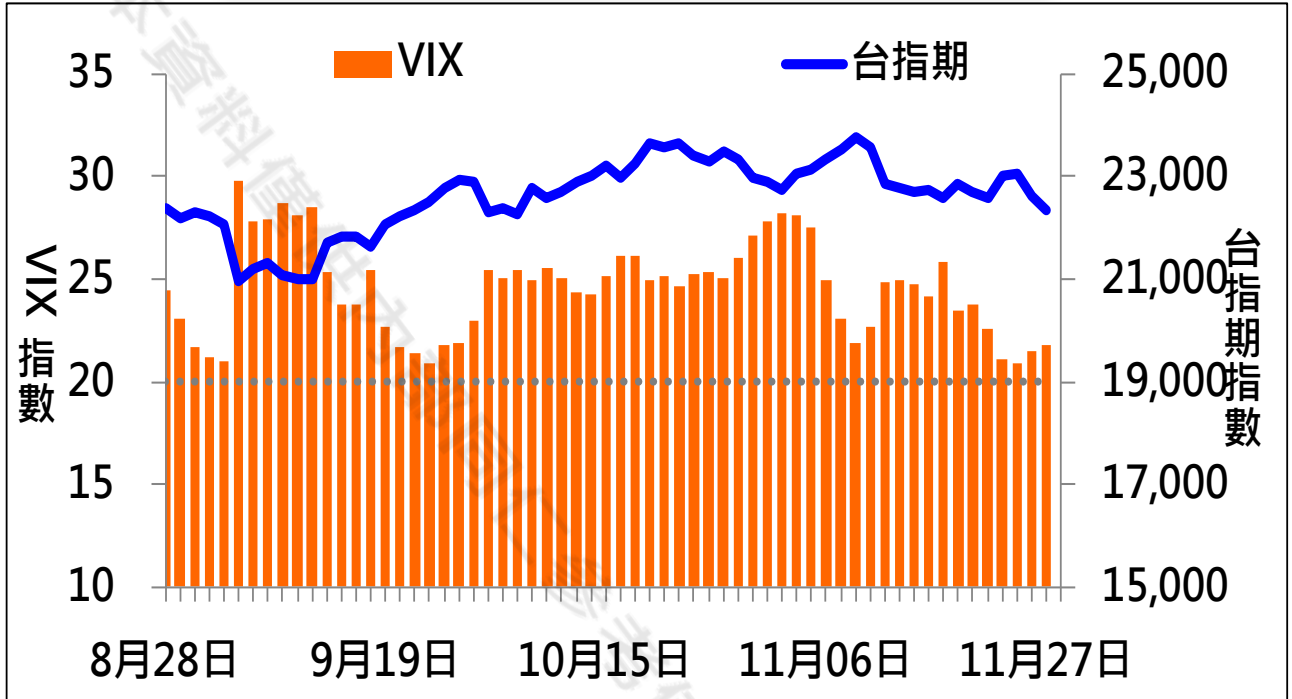
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

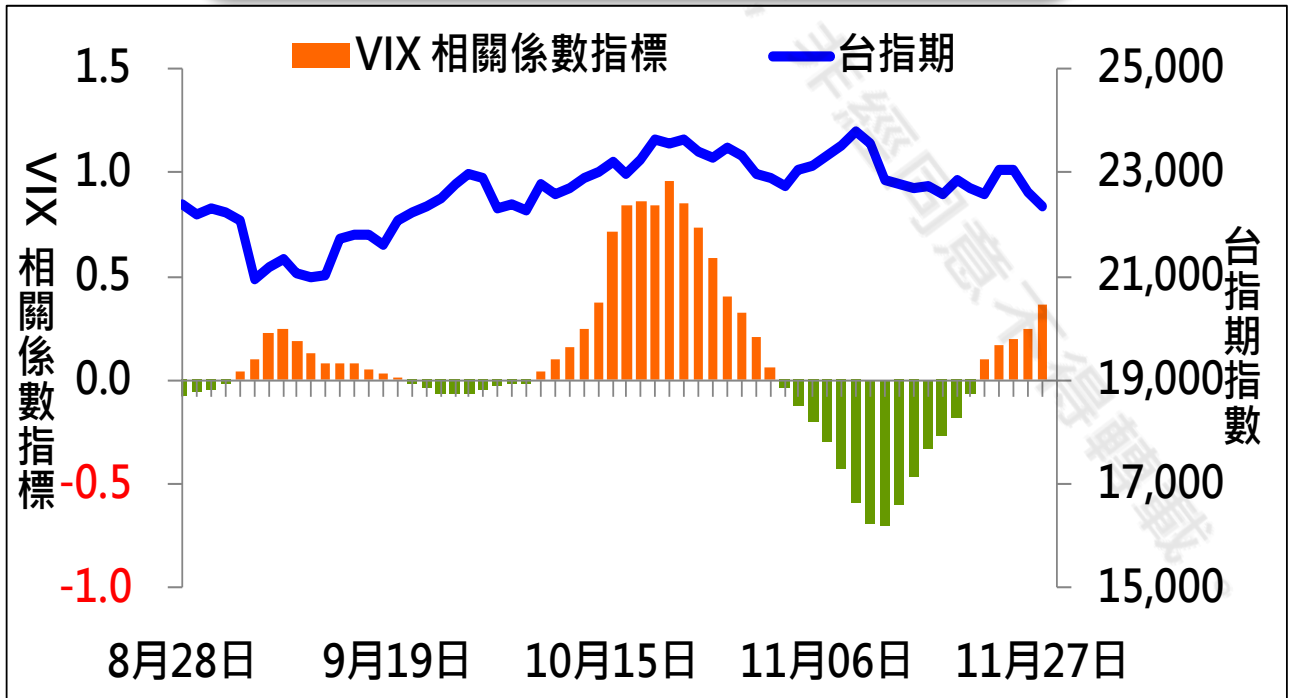
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



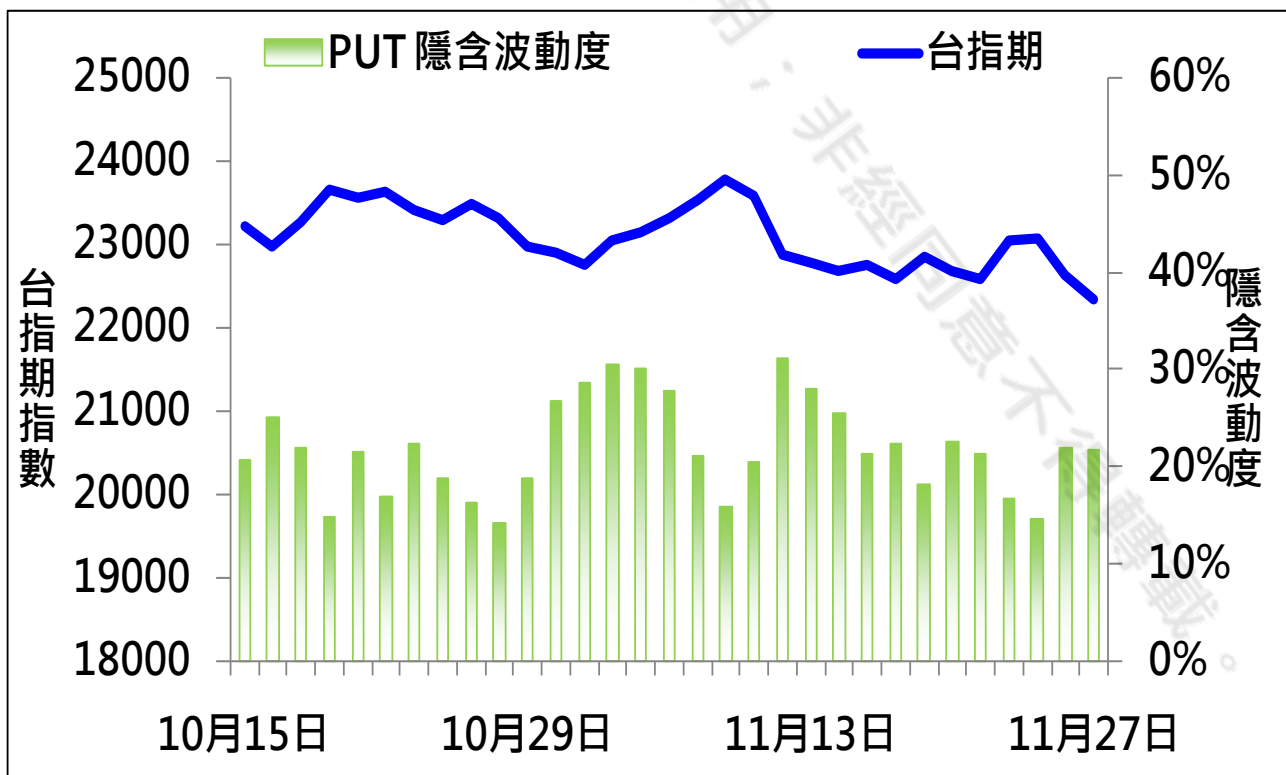
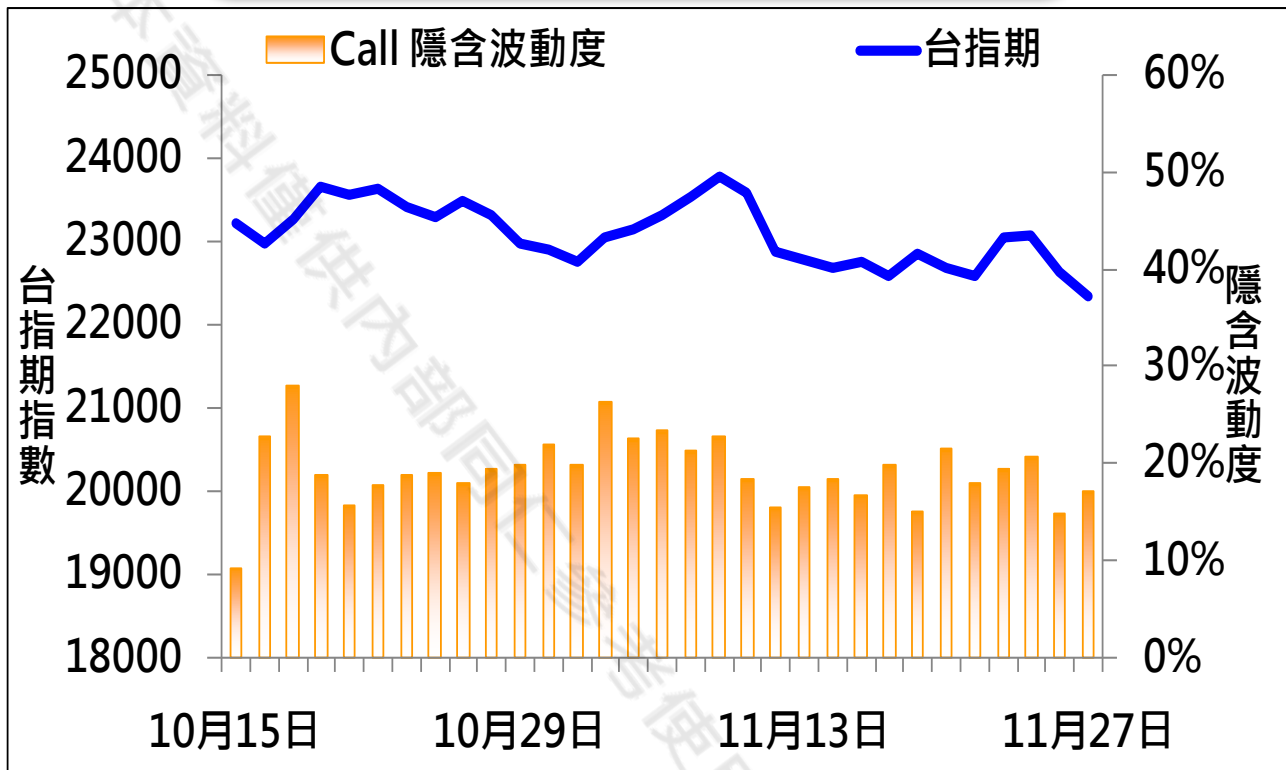
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2024/11/27

結算日：2024/12/4

OI 增減	Call	202412W1 履約價	Put	OI 增減
35	38	22,000	1,241	739
1	1	22,050	189	86
28	31	22,100	653	452
4	5	22,150	163	87
126	127	22,200	1,042	352
25	25	22,250	645	515
74	90	22,300	569	173
208	209	22,350	344	54
229	314	22,400	639	355
312	339	22,450	1,510	1,452
649	718	22,500	1,299	1,064
244	285	22,550	1,807	1,698
927	1,015	22,600	530	87
132	241	22,650	79	-59
694	878	22,700	244	89
878	1,018	22,750	105	-11
854	1,139	22,800	545	420
538	632	22,850	60	5
1,663	1,791	22,900	239	2
924	1,275	22,950	92	-4
1,544	1,790	23,000	101	15
869	1,096	23,050	37	-6
1,351	1,657	23,100	70	2
1,228	1,522	23,150	58	0
※ 1,816	2,268	23,200	43	-19
631	1,081	23,250	6	-19
715	1,540	23,300	25	-2
1,001	1,362	23,350	20	0
1,115	1,402	23,400	28	-49
778	876	23,450	11	0
1,054	1,978	23,500	5	-2
22,444	33,606	總計	24,706	15,497
P/C	0.7352		增減	-0.0899

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：2024/11/27

結算日：2024/12/18

OI 增減	Call	202412 月 履約價	Put	OI 增減
3	102	21,600	1,130	50
1	17	21,700	1,249	49
3	57	21,800	2,544	1
13	46	21,900	1,509	30
20	190	22,000	2,789	366 ※
24	94	22,100	947	-131
32	134	22,200	1,170	-353
32	87	22,300	1,324	-15
9	899	22,400	2,149	101
109	272	22,500	1,407	63
65	533	22,600	775	36
73	628	22,700	584	-40
97	854	22,800	447	2
129	1,057	22,900	606	-53
571	2,376	23,000	490	-6
52	1,613	23,100	81	-6
647	1,725	23,200	219	-14
511	1,715	23,300	191	-2
203	1,213	23,400	58	-1
160	1,732	23,500	144	5
88	1,393	23,600	47	-3
816	2,216	23,700	48	-22
301	2,105	23,800	48	0
195	3,213	23,900	34	0
※ 1,374	7,831	24,000	86	1
149	1,725	24,100	10	0
6,102	54,752	總計	48,151	298
P/C	0.8794		增減	-0.1042

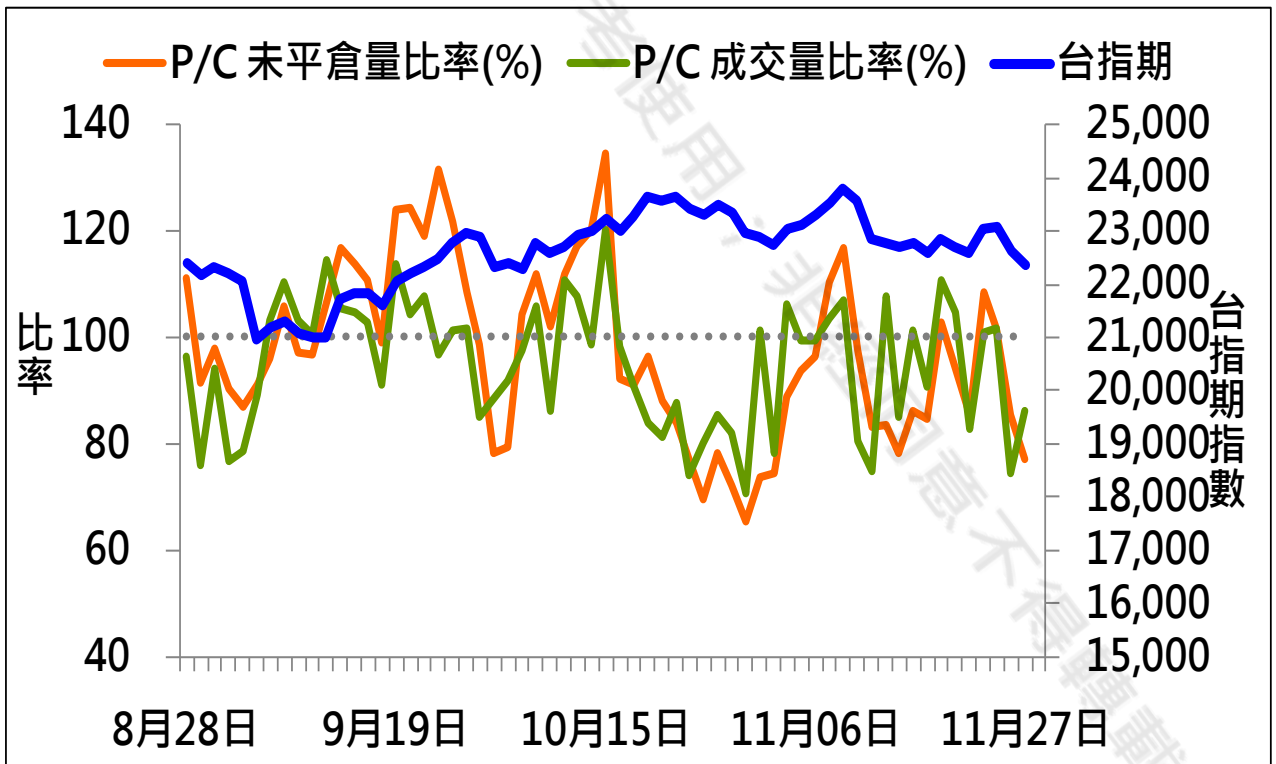
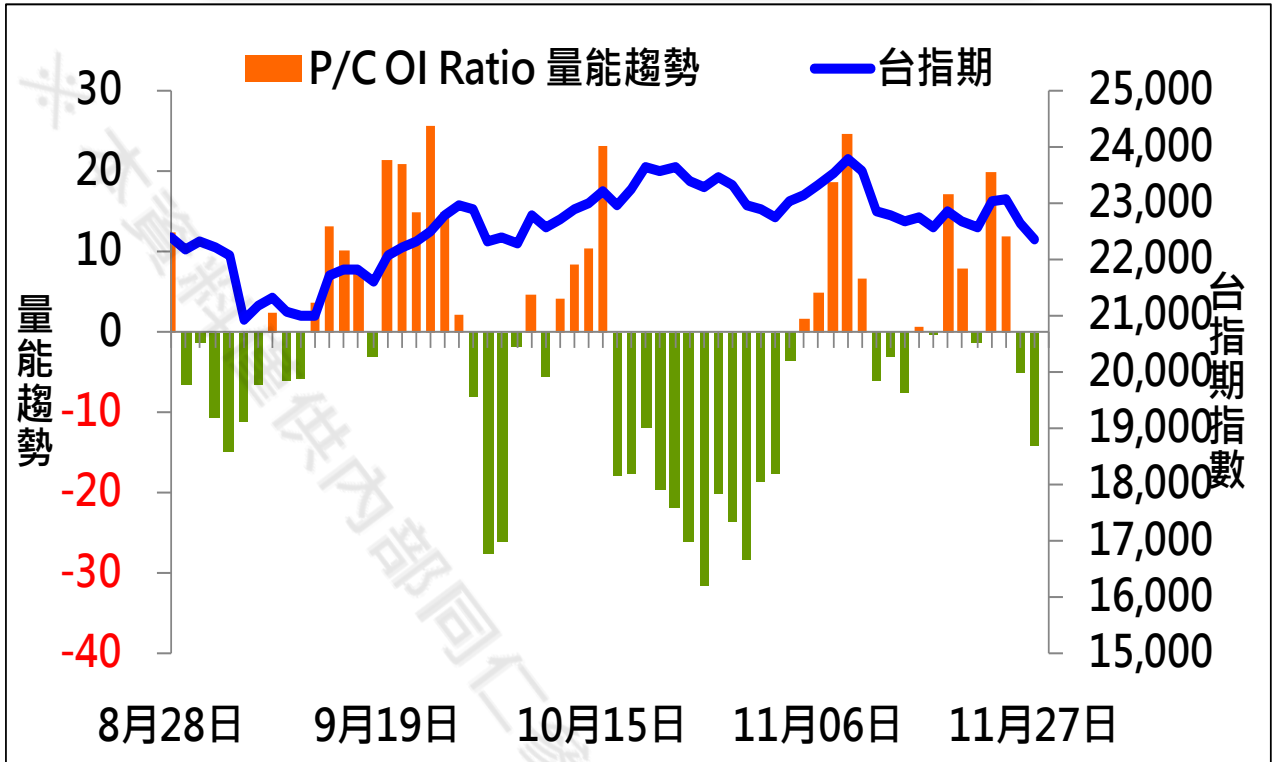
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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



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