



## 法人籌碼動態

11月01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	-22,084	1,758	298	74	-1,713	49
投信	-3,816	318	159	-2	24	0
自營商	17,740	-59	61	50	258	-21

11月01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	-123	22	1,916	784	16,751	3,697
投信	2	0	0	0	-61	0
自營商	96	-20	-10,326	4,093	12,073	-2,438

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台達電	10.70	國泰金	-2.42	台指期前十大 市場佔比	47.0%	54.8%
南電	5.01	日月光投控	-2.31			
聯發科	4.72	鴻海	-2.28			
台塑化	4.71	富邦金	-1.90	電子期前十大 市場佔比	59.0%	68.4%
中租-KY	4.54	大成鋼	-1.67			
世芯-KY	2.31	聯電	-1.64			
緯穎	2.25	國巨	-1.15	金融期前十大 市場佔比	65.7%	89.1%
聯合再生	2.06	萬海	-1.10			
大立光	1.77	台塑	-1.05			
宏達電	1.75	中鋼	-1.04	非金電期前十大 市場佔比	91.2%	93.4%
前十名合計	39.82	後十名合計	-16.56			

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 (109)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

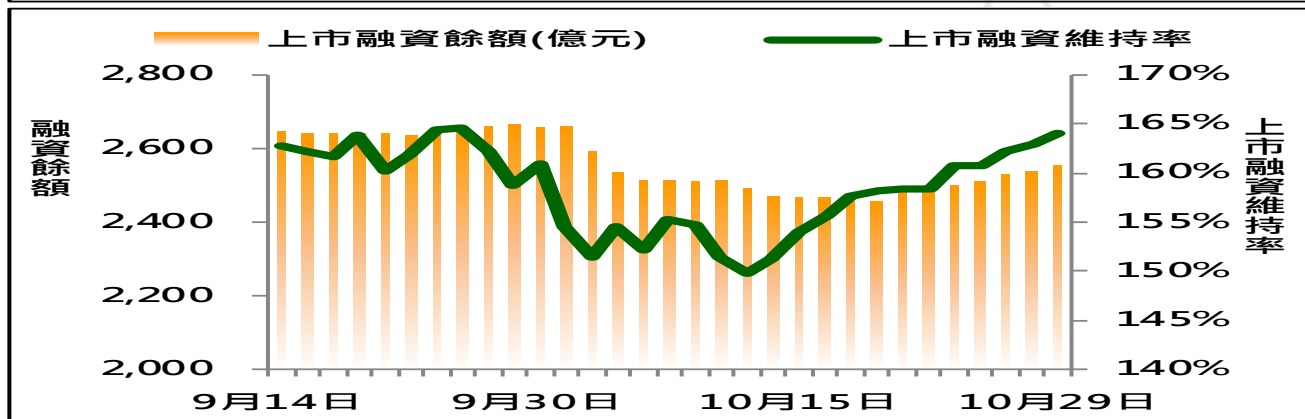
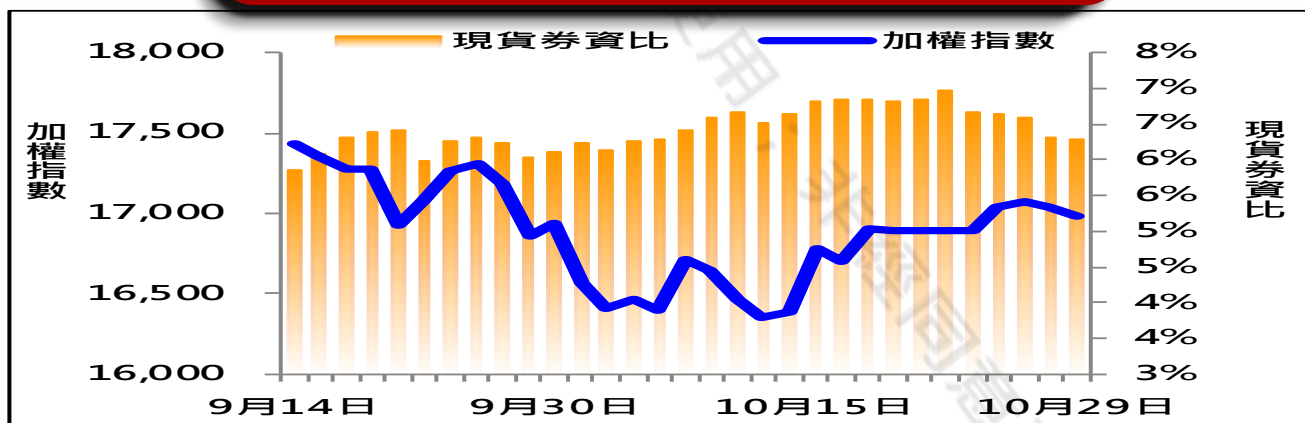


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
10月26日	68.6	-22,065	-2,037	11.9	14,900	-1,108
10月27日	24.6	-22,666	-601	6.2	16,711	1,811
10月28日	-73.5	-22,414	252	-8.1	16,748	37
10月29日	-115.2	-23,842	-1,428	-1.8	17,799	1,051
11月01日	-32.0	-22,084	1,758	3.1	17,740	-59

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
10月26日	8,559	18,223	-9,664	3,355	-2,221	5,576
10月27日	1,851	3,941	-2,090	-7,670	15,017	-22,687
10月28日	1,869	8,932	-7,063	-5,813	14,879	-20,692
10月29日	1,132	13,054	-11,922	-14,419	14,511	-28,930
11月01日	1,916	16,751	-14,835	-10,326	12,073	-22,399

## 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。

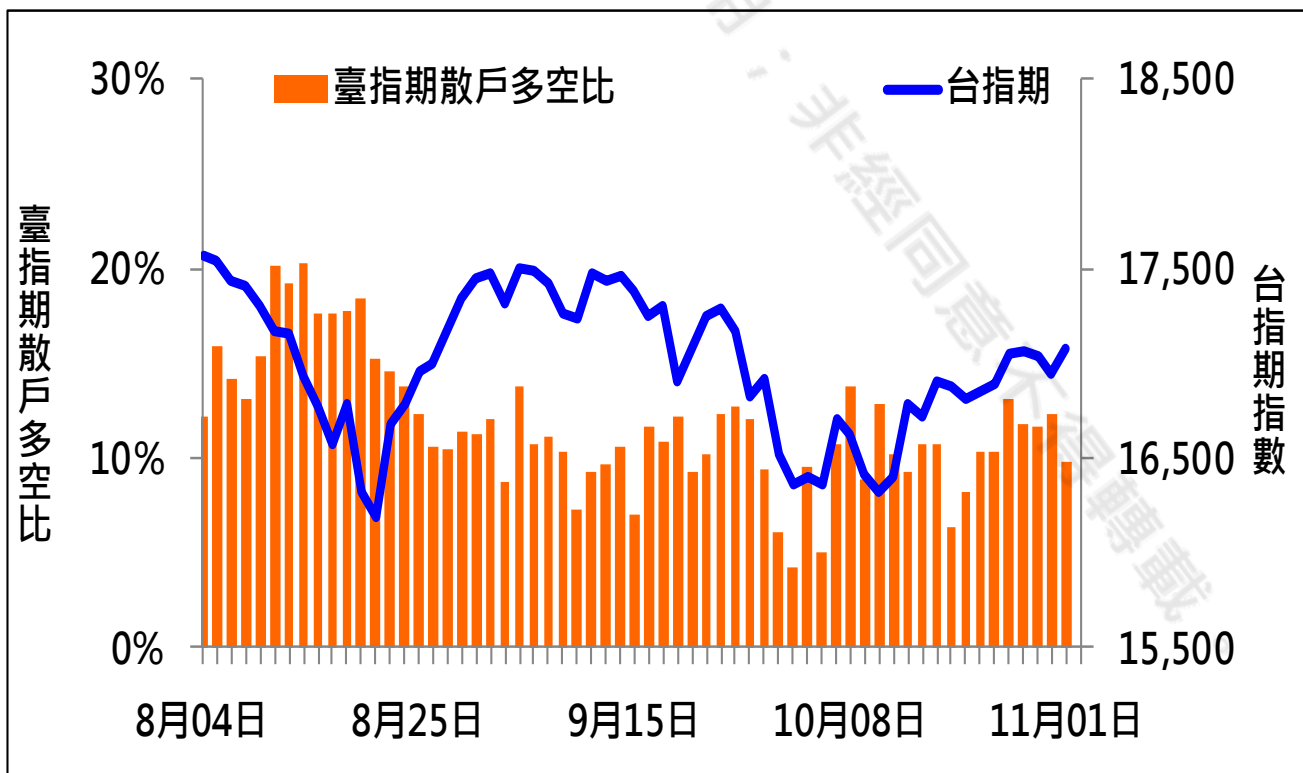
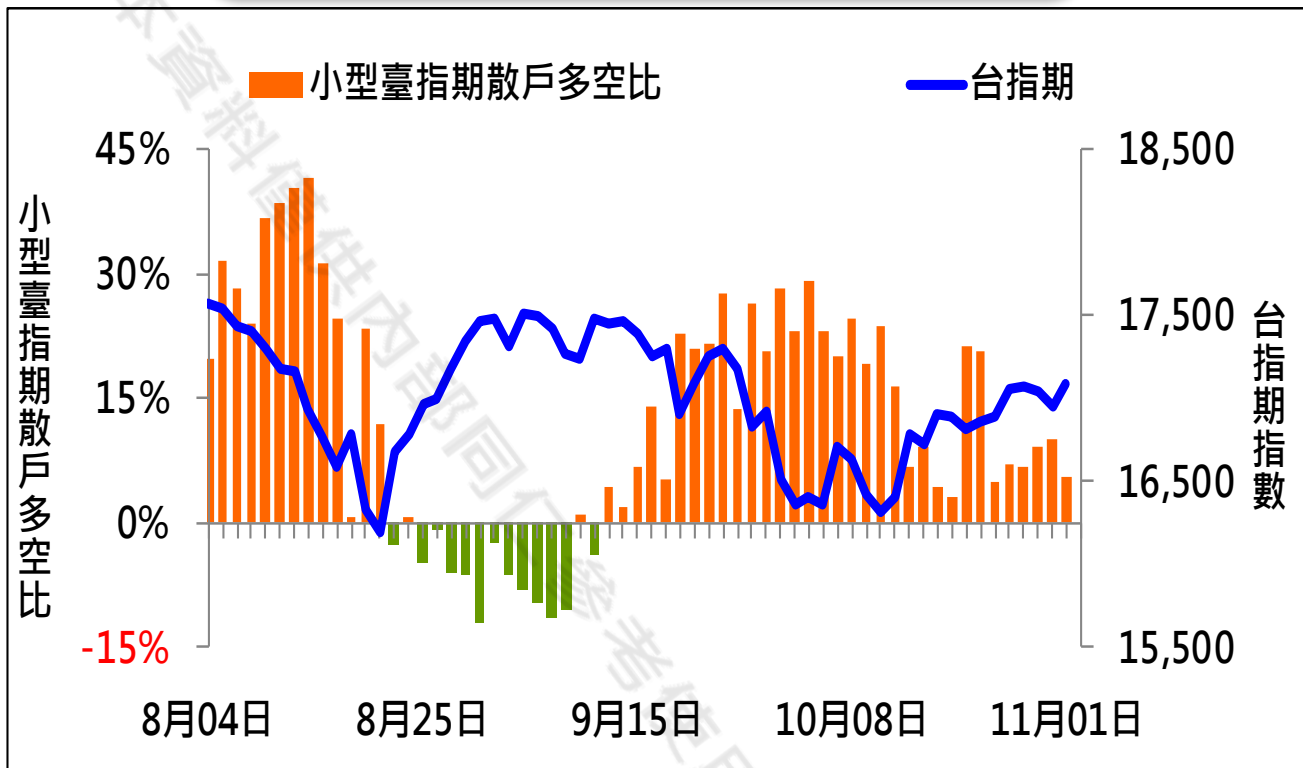
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管總字第007號

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



## 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。

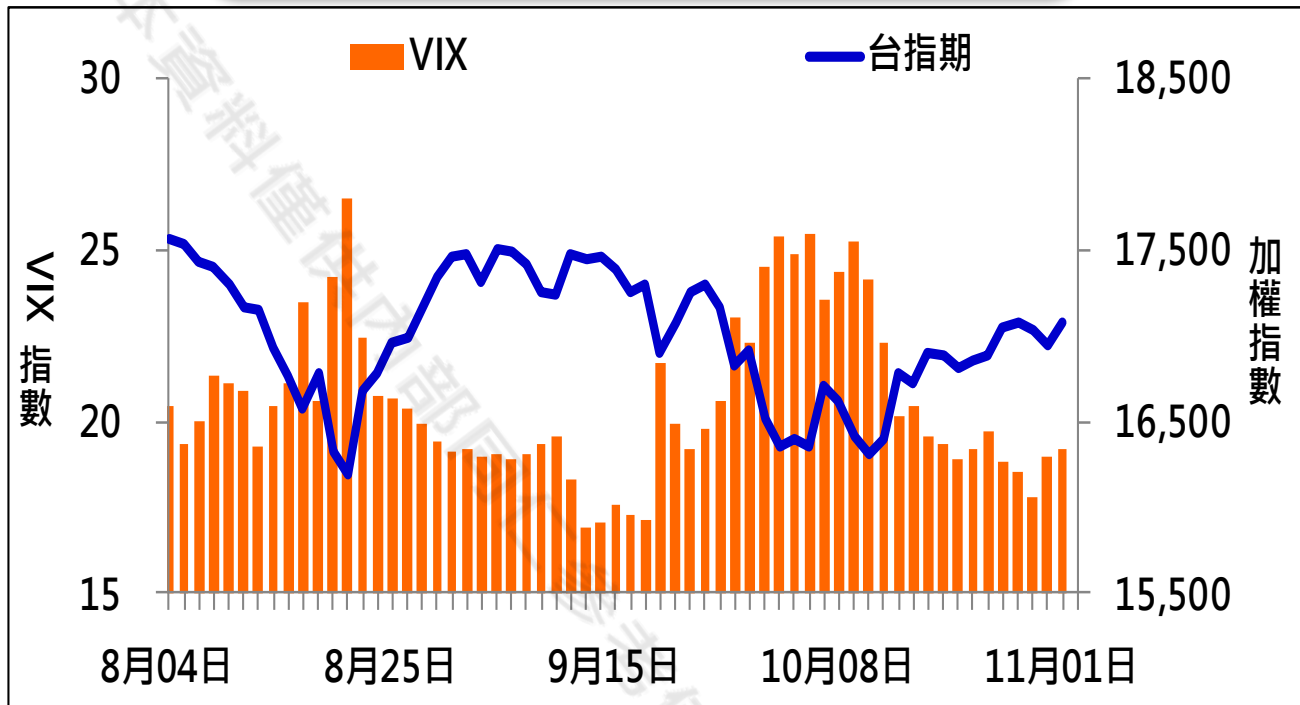
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

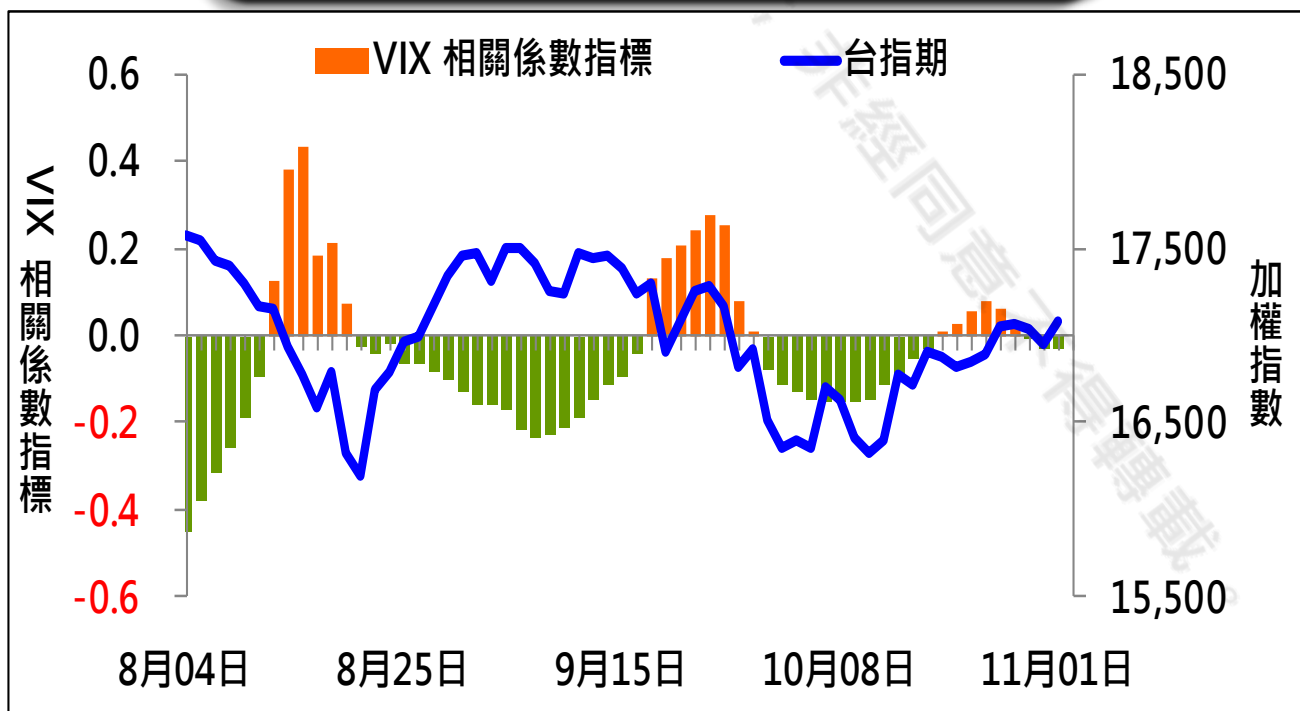
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 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。

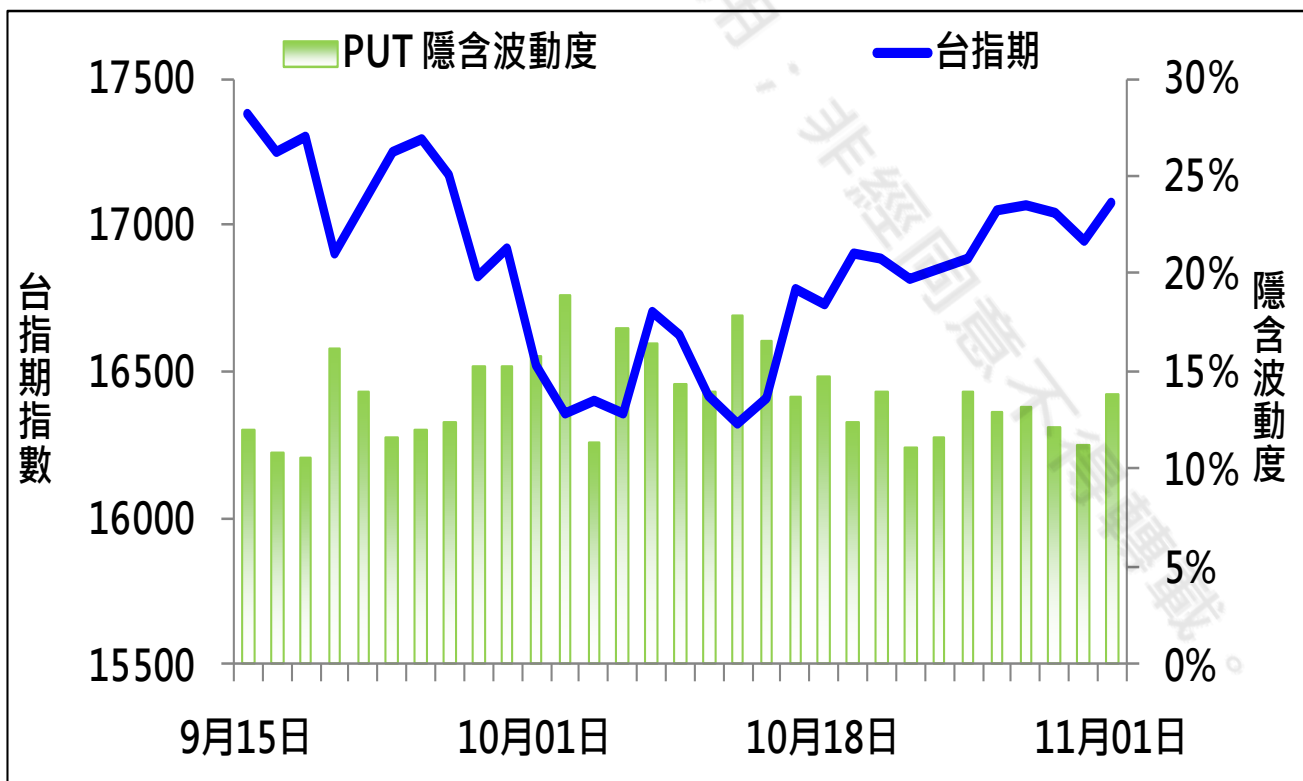
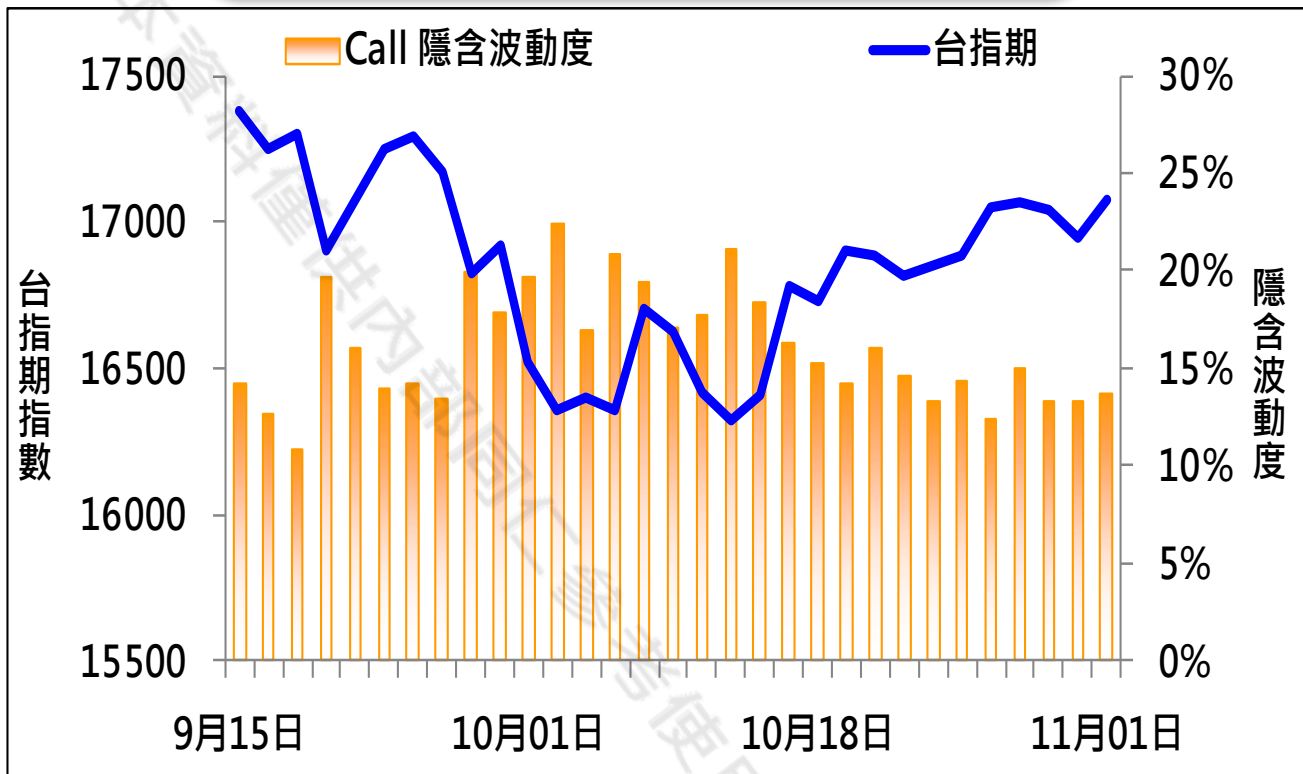
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 (109)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

日期：2021/11/1

結算日：2021/11/3

OI 增減	Call	202111W1 履約價	Put	OI 增減
0	1	16,200	1,718	-373
0	1	16,300	5,600	464
0	1	16,400	3,128	441
8	30	16,500	5,423	-165
1	2	16,550	4,265	1,406
20	40	16,600	5,269	94
24	57	16,650	4,554	-413
25	116	16,700	6,462	71
62	170	16,750	5,525	-342
130	555	16,800	10,486	2,681
-53	810	16,850	6,732	2,747
-327	1,587	16,900	9,447	4,047
-55	2,111	16,950	8,440	4,563
297	4,761	17,000	8,491	4,004
-22	4,547	17,050	4,737	1,971
1,573	8,749	17,100	4,170	2,470
1,880	5,843	17,150	1,571	656
1,870	9,559	17,200	1,115	423
2,776	8,983	17,250	482	259
※ 2,875	11,070	17,300	235	24
1,572	7,927	17,350	88	34
1,102	7,212	17,400	74	29
-148	3,701	17,450	12	0
1,020	5,891	17,500	14	2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
15,060	91,282	1.1317	103,301	24,879

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 (109)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

日期：2021/11/1

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,700	1,882	105
0	150	15,800	2,227	-95
0	4	15,900	2,043	-31
1	46	16,000	5,255	914
-1	30	16,100	3,231	102
-3	244	16,200	4,675	431
23	722	16,300	4,314	1,130 ※
-8	1,208	16,400	6,518	152
-9	729	16,500	5,884	115
-6	1,351	16,600	4,756	529
-32	1,617	16,700	4,997	746
-84	1,409	16,800	3,671	565
0	2,754	16,900	2,403	184
114	4,008	17,000	2,444	701
-12	2,972	17,100	1,191	317
136	3,063	17,200	1,173	114
185	4,241	17,300	1,386	28
438	7,269	17,400	506	1
-186	7,763	17,500	71	6
※	672	17,600	169	5
258	6,933	17,700	26	2
85	7,677	17,800	8	1
50	2,730	17,900	9	0
316	5,626	18,000	4	1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
2,407	89,978	1.0232	92,064	7,958
昨日 P/C	0.9604	今日增減變化		0.0628

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。

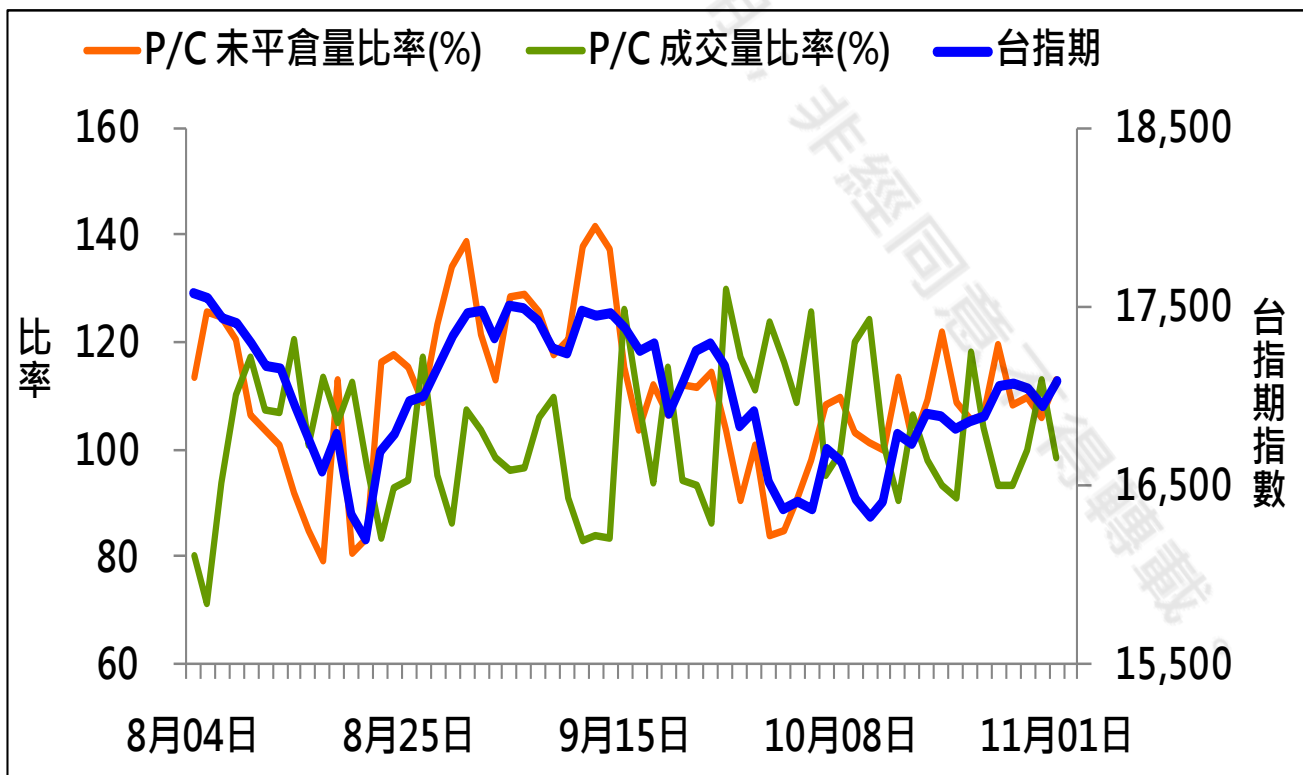
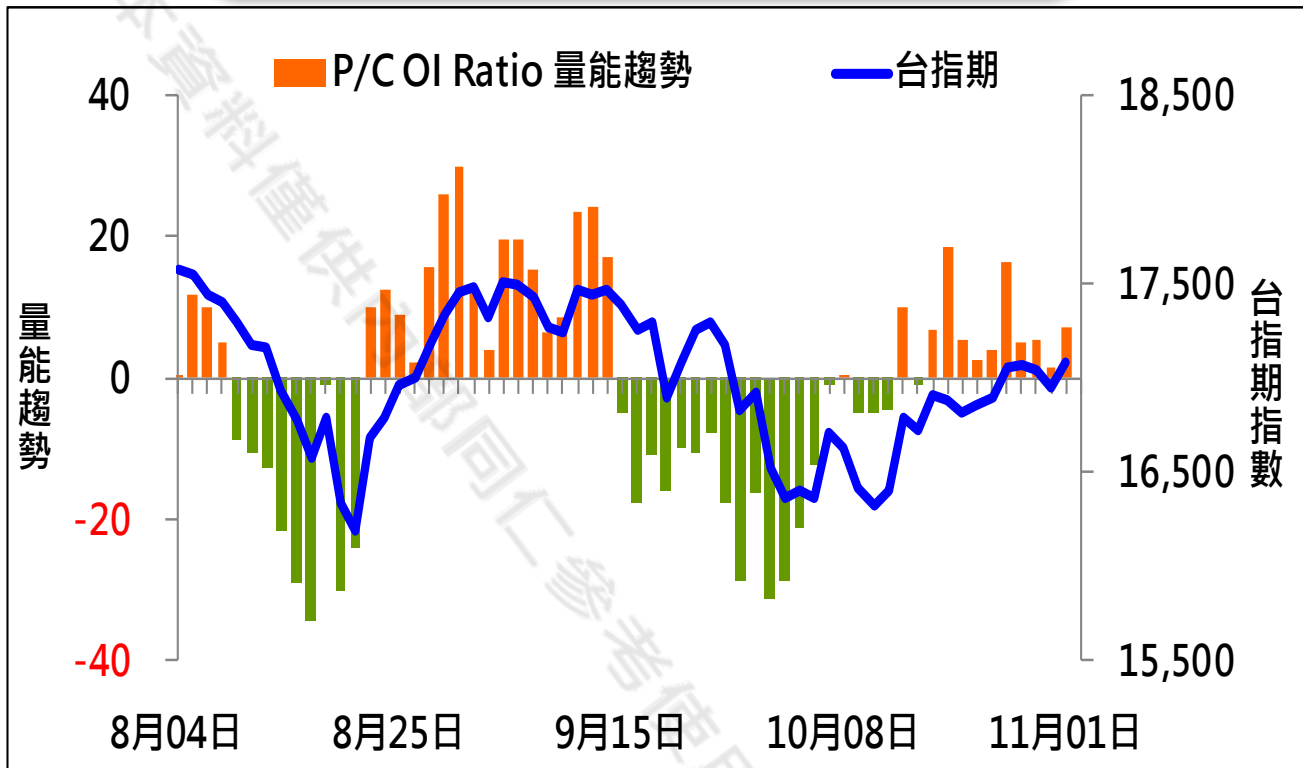
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 (109)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

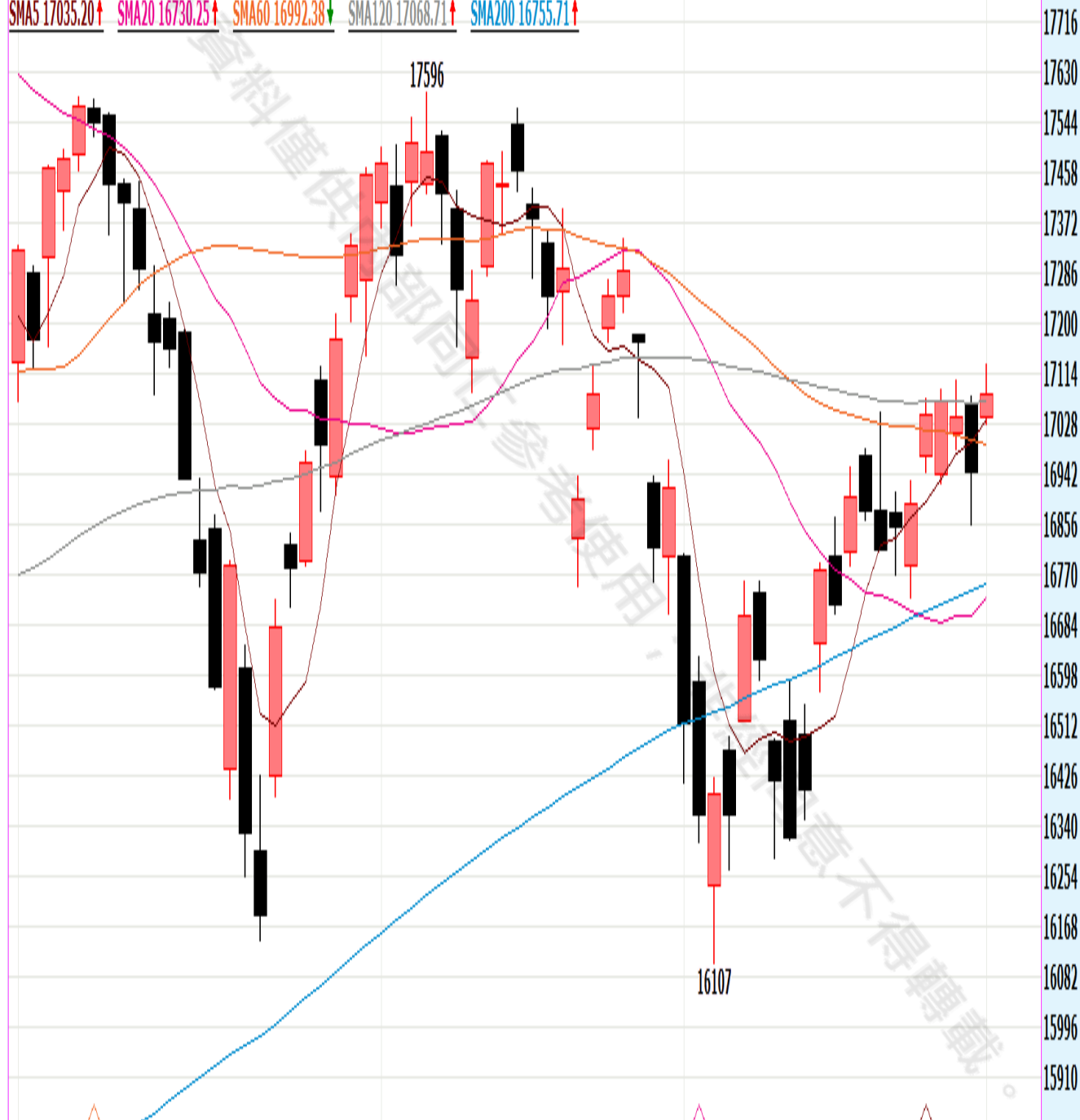




## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX\*1) 日線圖 2021/11/01 開 17040 高 17130 低 17028 收 17079 s 點量 79806 □ +133 (+0.78%)

SMA5 17035.20 ↑ SMA20 16730.25 ↑ SMA60 16992.38 ↓ SMA120 17068.71 ↑ SMA200 16755.71 ↑



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 (109)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 (109)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