



## 法人籌碼動態

11月03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	-21,534	909	260	-37	-1,757	-65
投信	-3,905	67	163	0	24	0
自營商	17,012	124	26	5	227	-16

11月03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	-134	-14	-1,290	-3,508	15,075	-5,125
投信	2	0	0	0	-61	0
自營商	102	19	-8,878	127	11,385	2,457

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	12.05	富邦煤	-5.54	台指期前十大 市場佔比	47.9%	52.6%
萬海	7.68	台達電	-4.28			
陽明	6.07	欣興	-4.22			
友達	3.01	中租-KY	-3.28	電子期前十大 市場佔比	58.1%	69.3%
華新科	2.24	旭隼	-1.73			
南亞科	2.14	台塑化	-1.57			
台塑	2.10	儒鴻	-1.18	金融期前十大 市場佔比	65.4%	91.2%
聯發科	2.10	緯穎	-1.09			
國巨	2.06	統一超	-1.03			
智邦	1.75	豐泰	-1.02	非金電期前十大 市場佔比	90.5%	93.2%
前十名合計	41.20	後十名合計	-24.93			

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

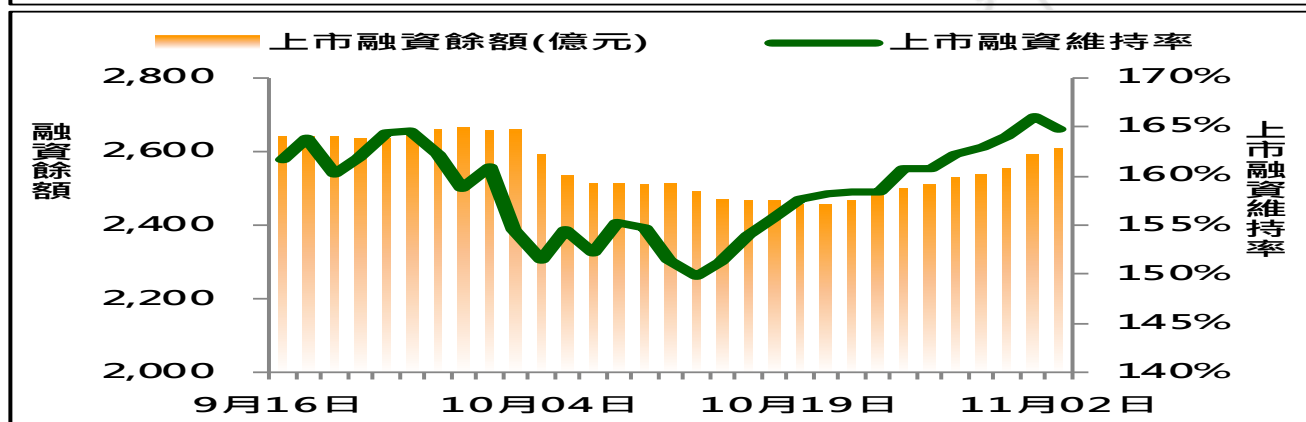
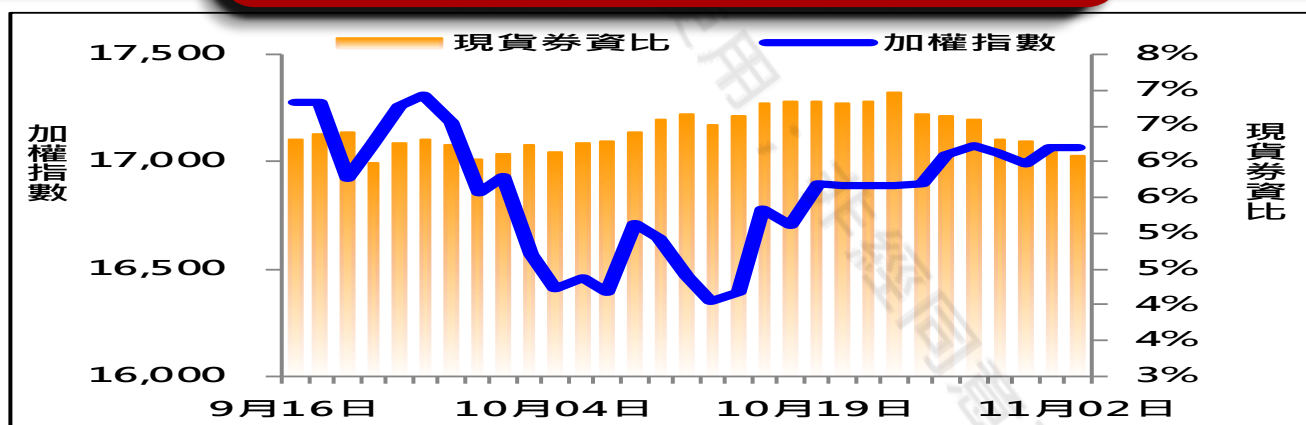


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月02日	19.7	-22,443	-359	-13.4	16,888	-852
11月03日	38.9	-21,534	909	6.2	17,012	124

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
11月02日	2,218	20,200	-17,982	-9,005	8,928	-17,933
11月03日	-1,290	15,075	-16,365	-8,878	11,385	-20,263

## 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。

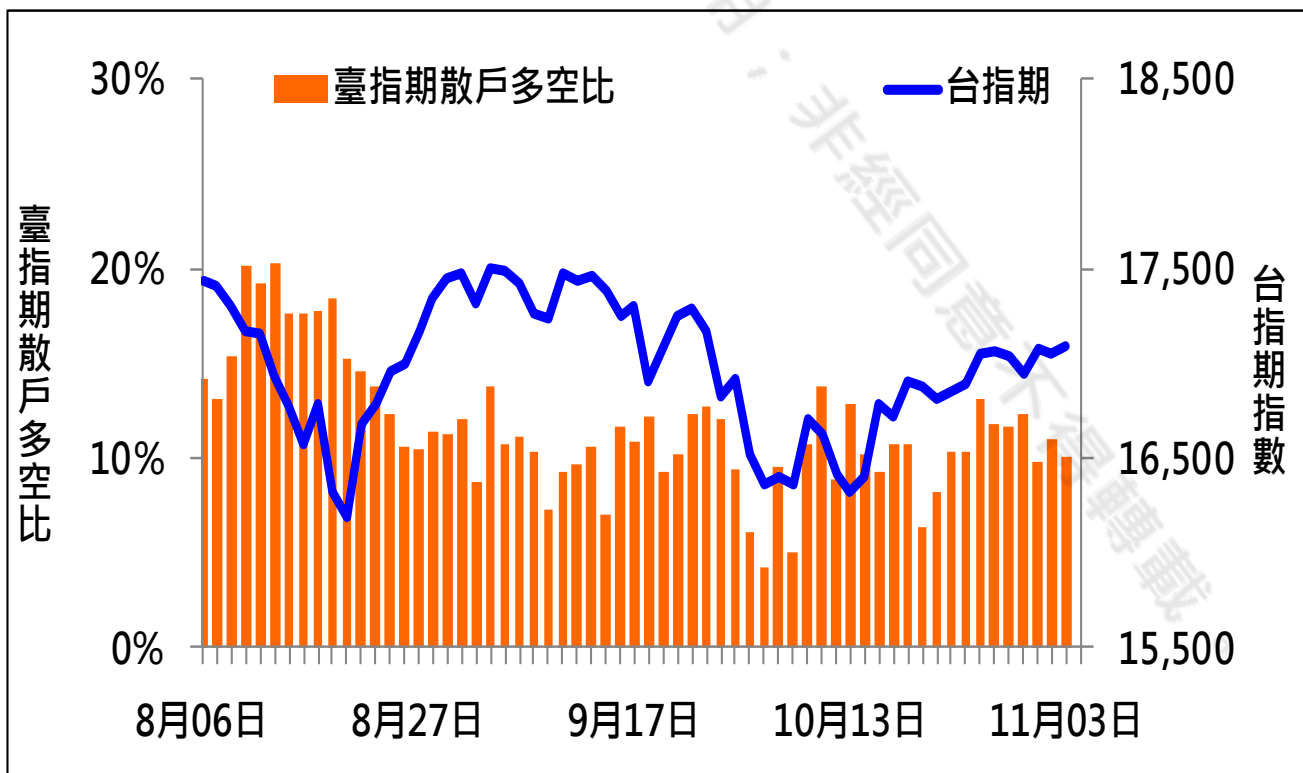
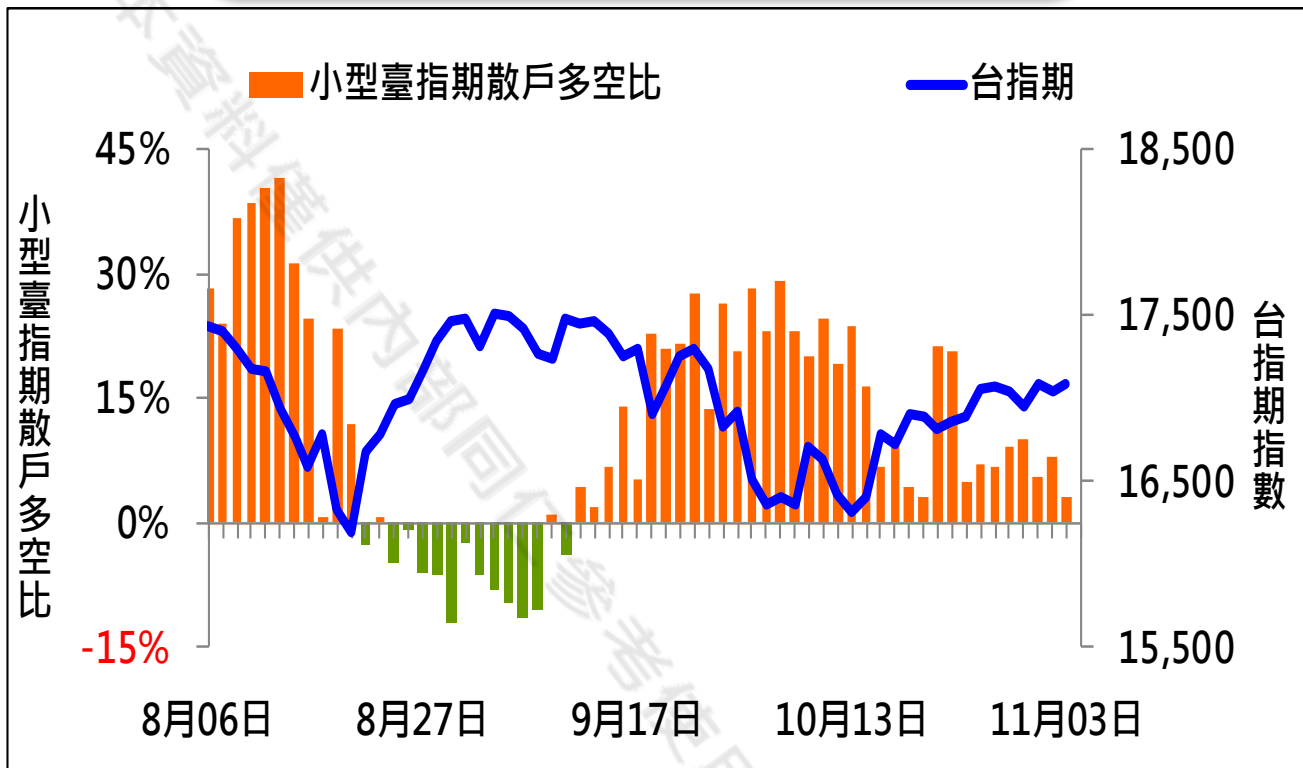
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

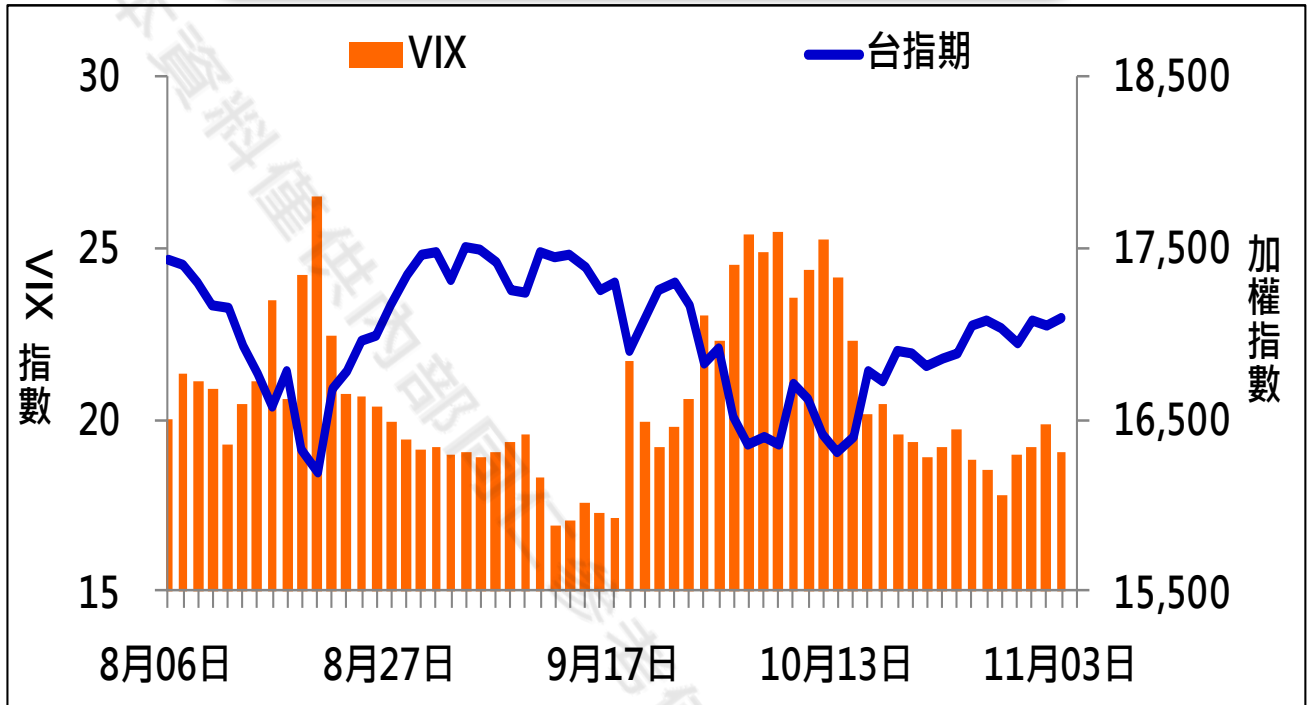
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

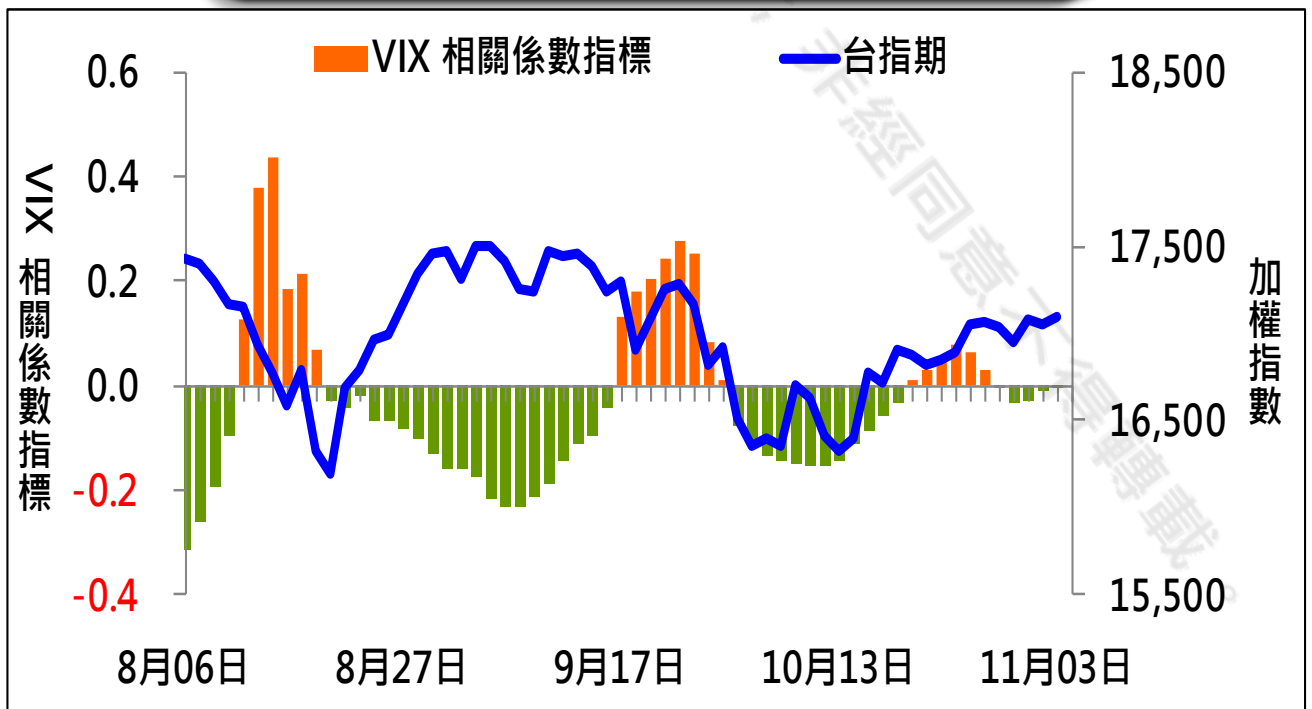
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



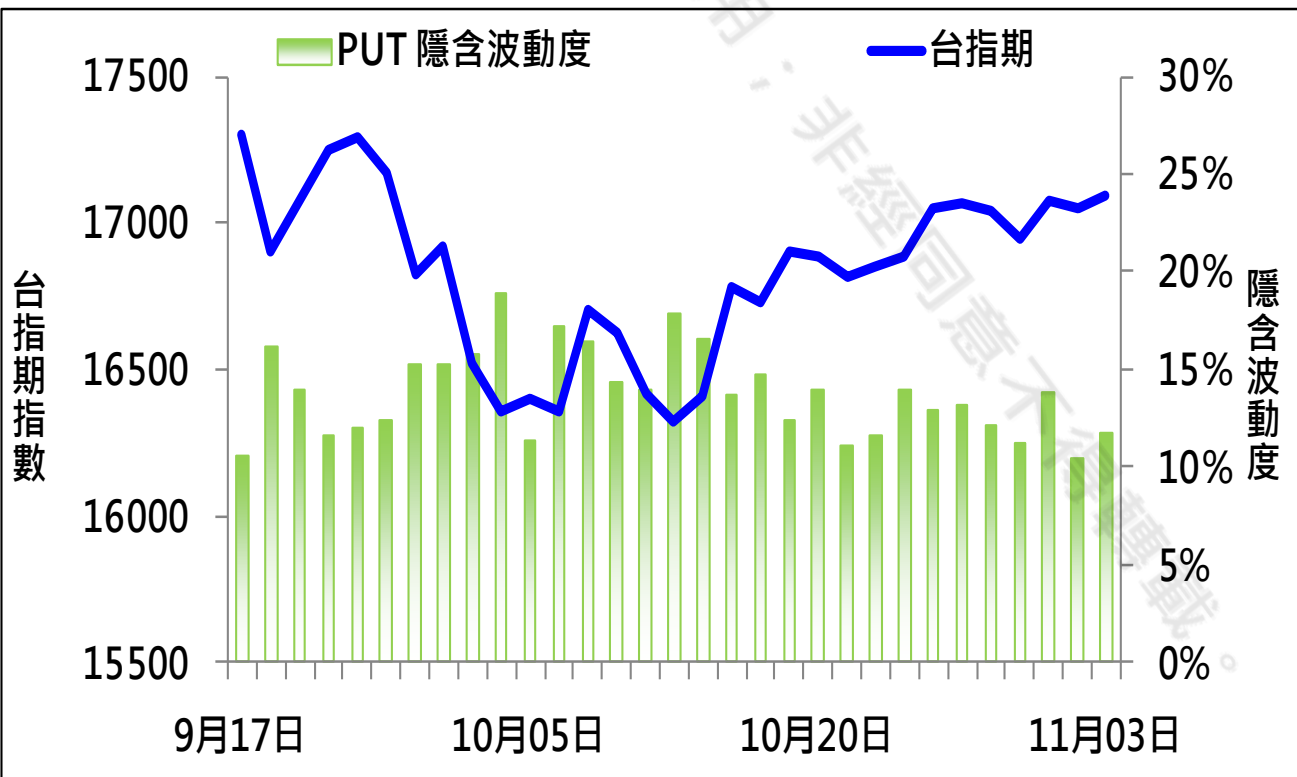
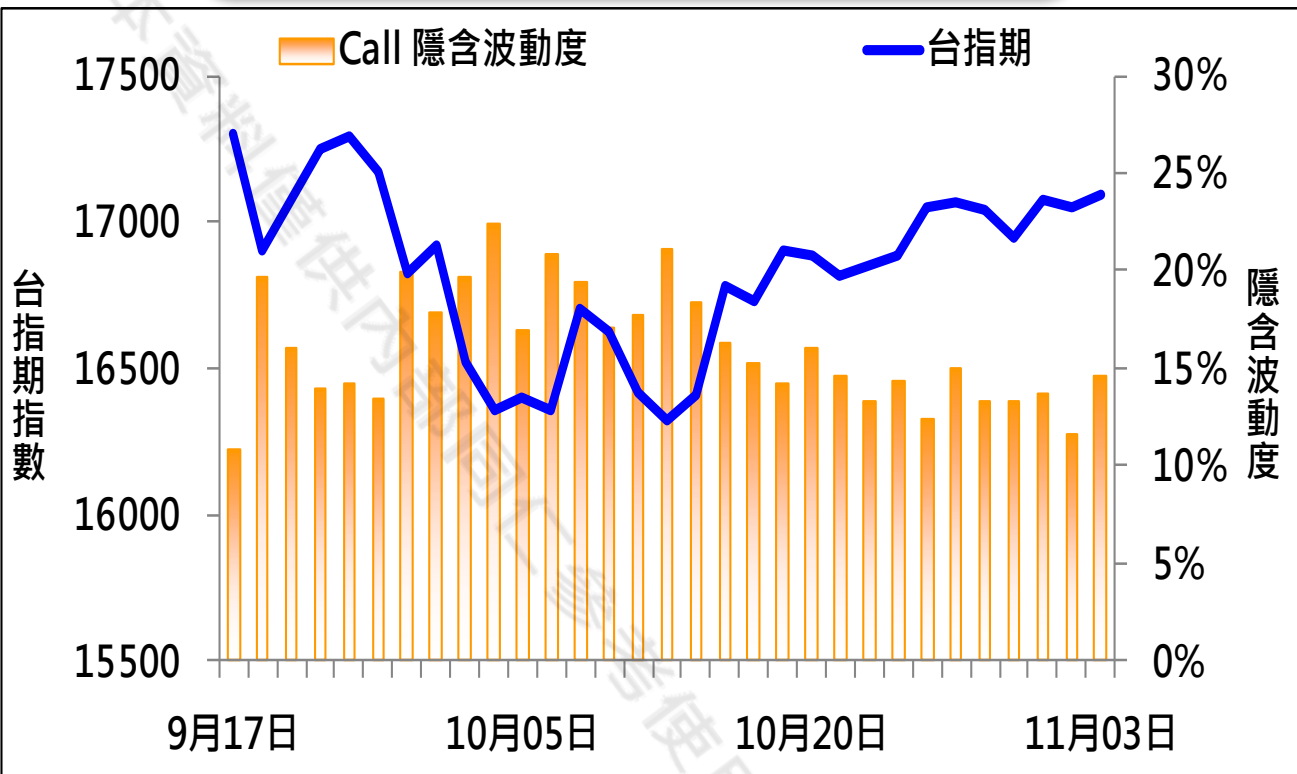
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/3

結算日：2021/11/10

OI 增減	Call	202111W2 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,200	728	728
0	0	16,300	674	674
0	0	16,400	1,252	1,252
0	0	16,500	2,739	2,739 ※
8	8	16,600	1,568	1,568
3	3	16,650	953	953
10	10	16,700	1,410	1,410
11	11	16,750	901	901
28	28	16,800	1,389	1,389
41	41	16,850	1,031	1,031
123	123	16,900	1,436	1,436
45	45	16,950	667	667
420	420	17,000	1,868	1,868
317	317	17,050	761	761
1,193	1,193	17,100	836	836
810	810	17,150	325	325
1,124	1,124	17,200	361	361
1,319	1,319	17,250	101	101
1,633	1,633	17,300	70	70
1,504	1,504	17,350	27	27
1,391	1,391	17,400	16	16
※ 3,658	3,658	17,450	0	0
2,162	2,162	17,500	3	3
1,323	1,323	17,550	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
20,990	20,990	1.0398	21,825	21,825

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：2021/11/3

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,700	1,744	-125
0	150	15,800	2,192	126
0	4	15,900	1,981	3
0	46	16,000	5,763	557
0	30	16,100	4,373	1,006
0	243	16,200	5,055	490
-2	717	16,300	5,644	-100
3	1,201	16,400	6,674	-66
31	755	16,500	6,974	1,091
-2	1,351	16,600	4,452	334
23	1,544	16,700	4,090	-81
-12	1,408	16,800	3,886	446
3	2,744	16,900	3,177	-29
132	4,305	17,000	3,354	78
72	3,633	17,100	1,566	219
309	3,499	17,200	1,416	62
262	5,333	17,300	1,456	36
182	7,031	17,400	535	1
359	8,999	17,500	188	53
※	797	17,600	177	0
446	7,568	17,700	29	0
394	8,401	17,800	16	1
167	2,897	17,900	12	0
173	6,067	18,000	4	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,334	97,022	1.0333	100,254	5,310
昨日 P/C	1.0134	今日增減變化		0.0199

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。

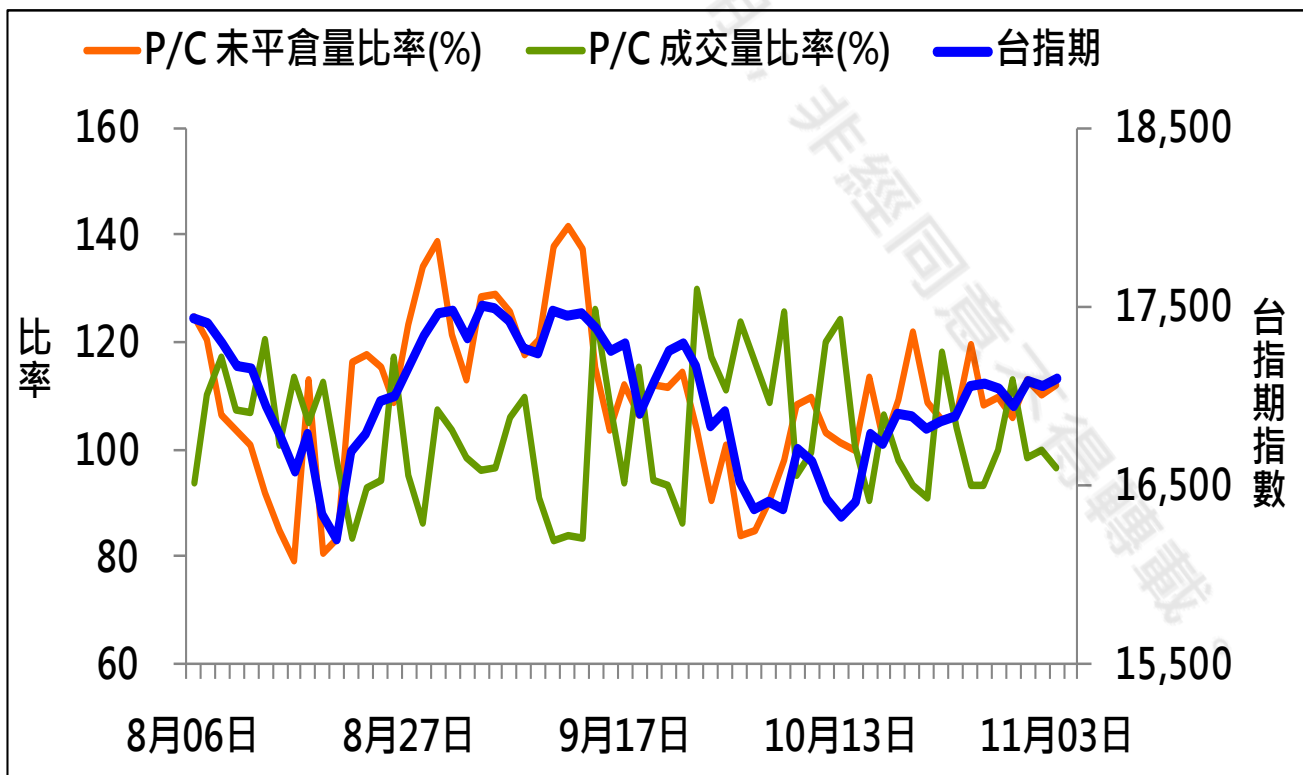
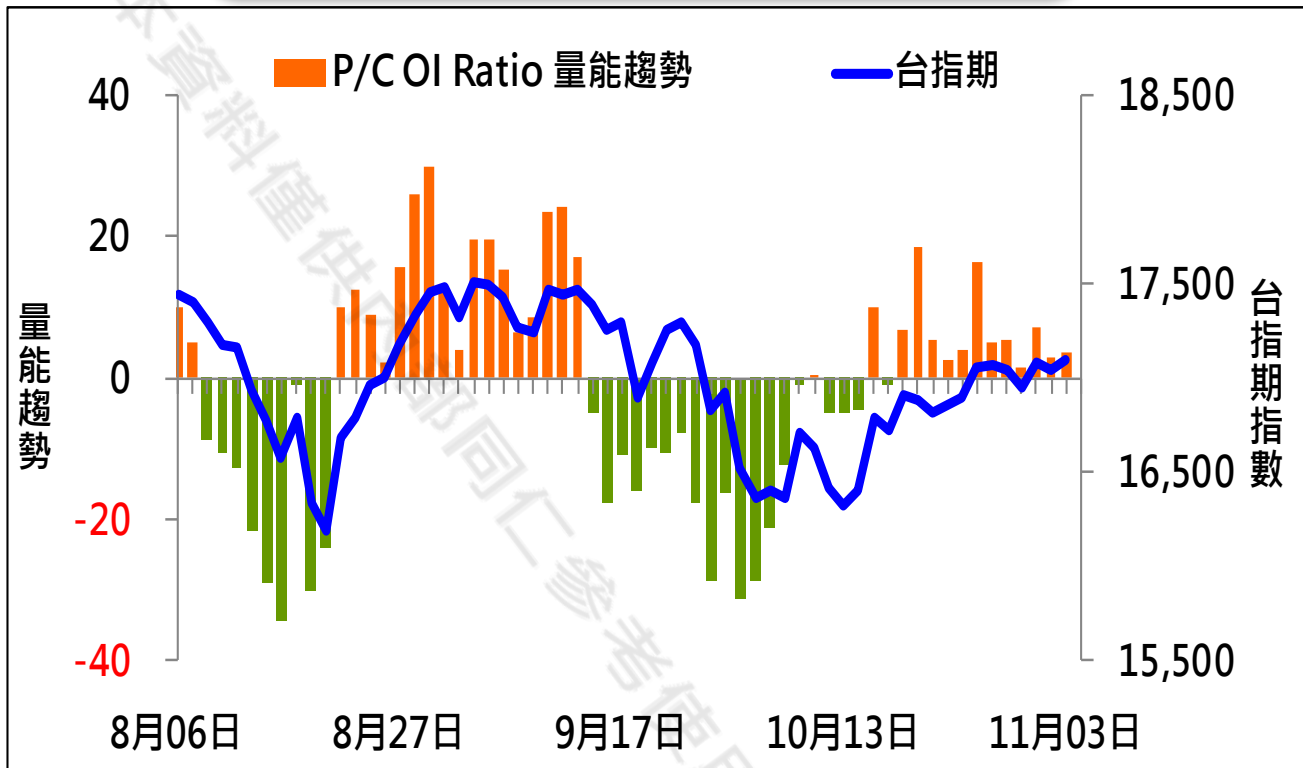
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

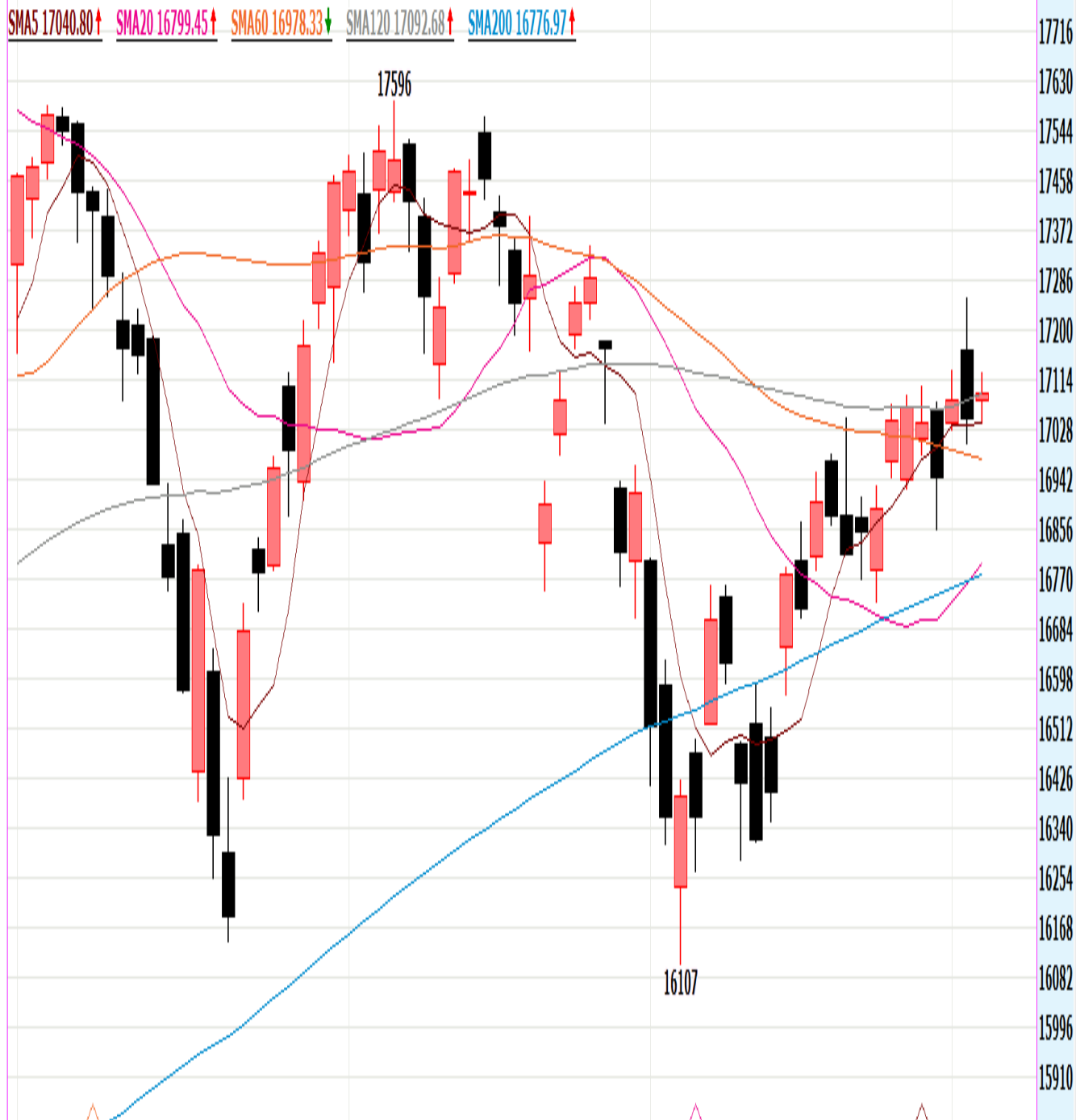
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所





## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX\*1) 日線圖 2021/11/03 開 17081 高 17127 低 17040 收 17092 s 點量 72076 □ +45 (+0.26%)



圖片來源：嘉實資訊

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 (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