



法人籌碼動態

11月04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	-23,097	-1,563	371	111	-1,817	-60
投信	-3,564	341	163	0	24	0
自營商	17,077	65	-116	-142	233	6

11月04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	-131	3	-138	1,152	17,984	2,909
投信	2	0	0	0	-61	0
自營商	102	0	-6,687	2,191	9,636	-1,749

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	5.56	台積電	-42.73	台指期前十大 市場佔比	48.8%	52.9%
矽力-KY	3.07	長榮	-4.30			
鴻海	2.28	台塑	-3.15			
萬海	2.19	聯電	-2.46	電子期前十大 市場佔比	57.4%	69.5%
緯穎	2.19	陽明	-2.17			
研華	2.04	聯發科	-2.10			
智邦	2.03	南亞科	-1.94	金融期前十大 市場佔比	64.3%	92.2%
微星	1.95	富邦媒	-1.85			
國泰金	1.45	台塑化	-1.57			
中華電	1.28	統一	-1.31	非金電期前十大 市場佔比	91.7%	92.5%
前十名合計	24.05	後十名合計	-63.56			

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

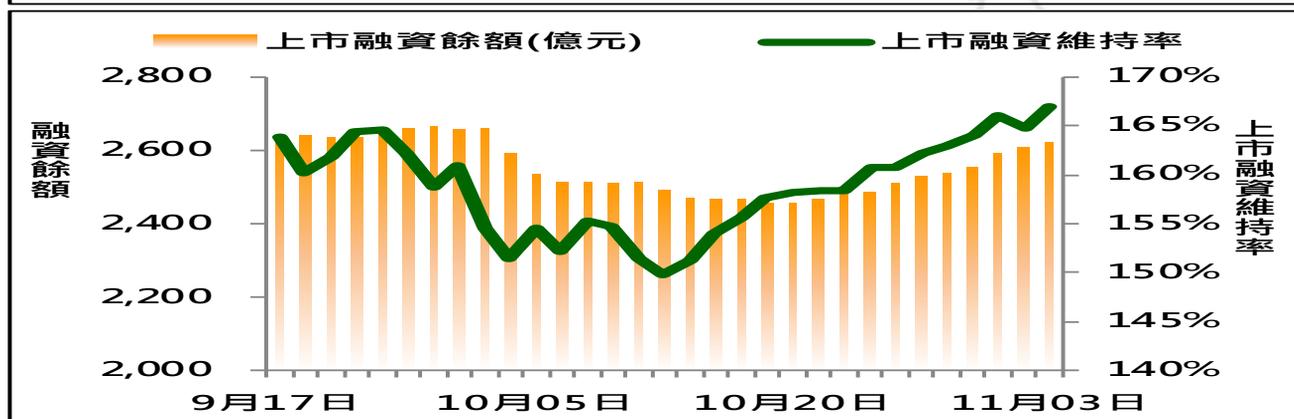
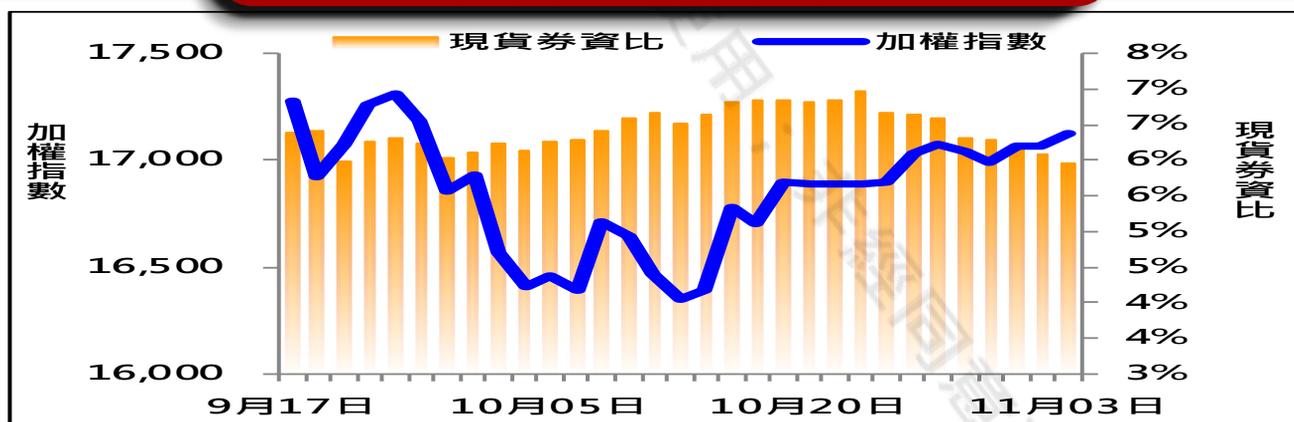


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
11月04日	-74.3	-23,097	-1,563	1.7	17,077	65

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
11月04日	-138	17,984	-18,122	-6,687	9,636	-16,323

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。

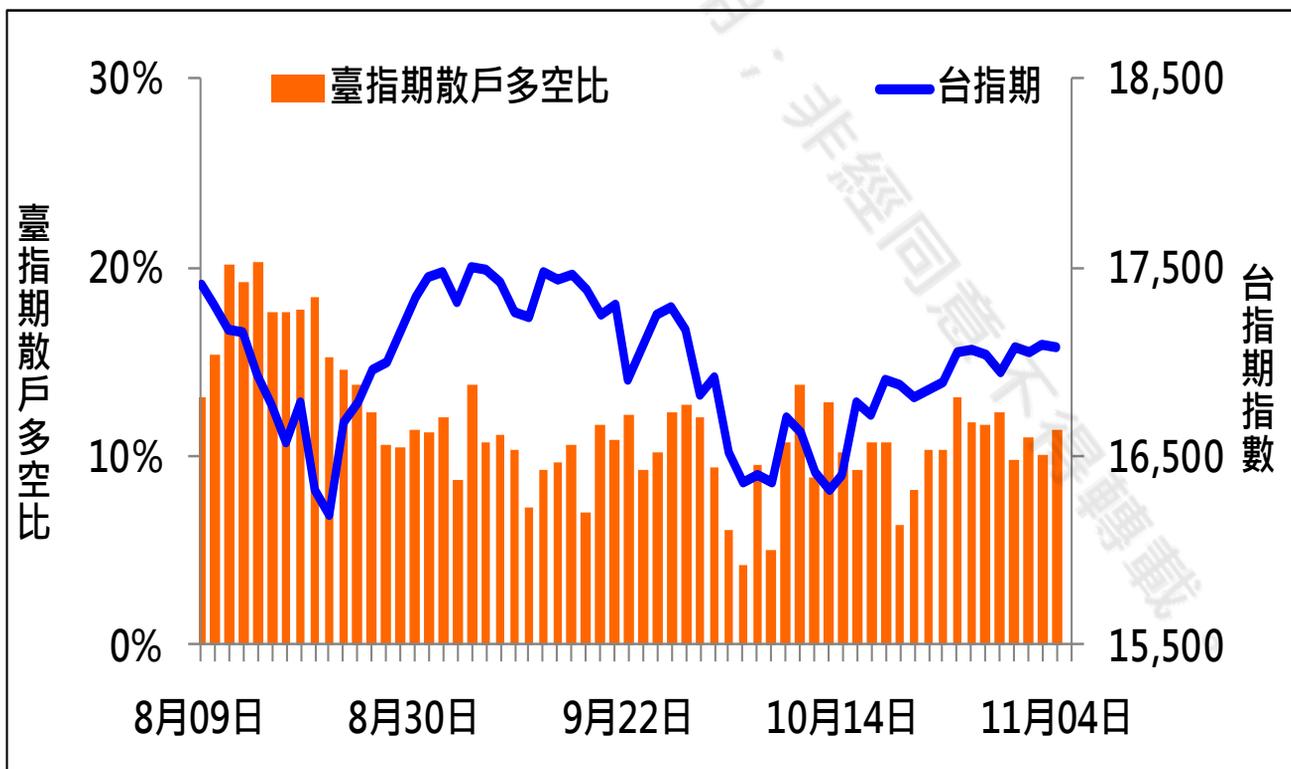
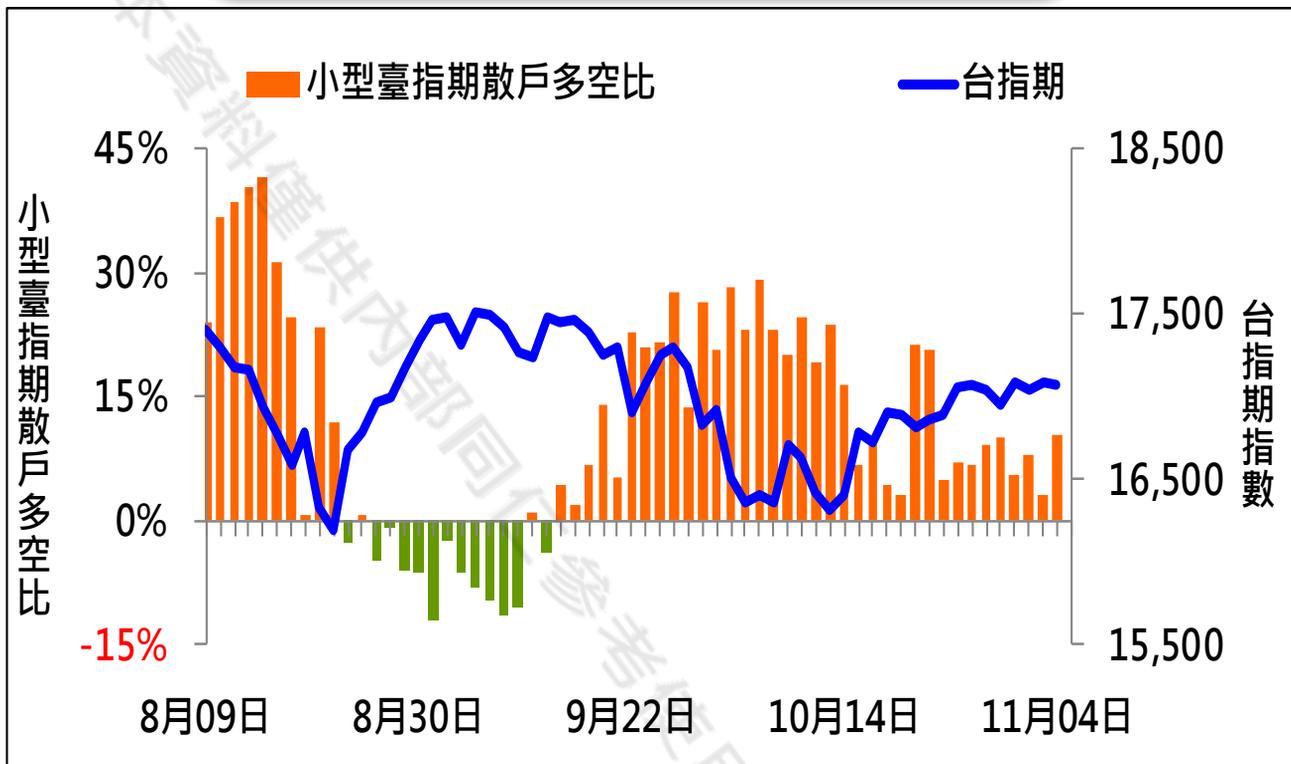
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

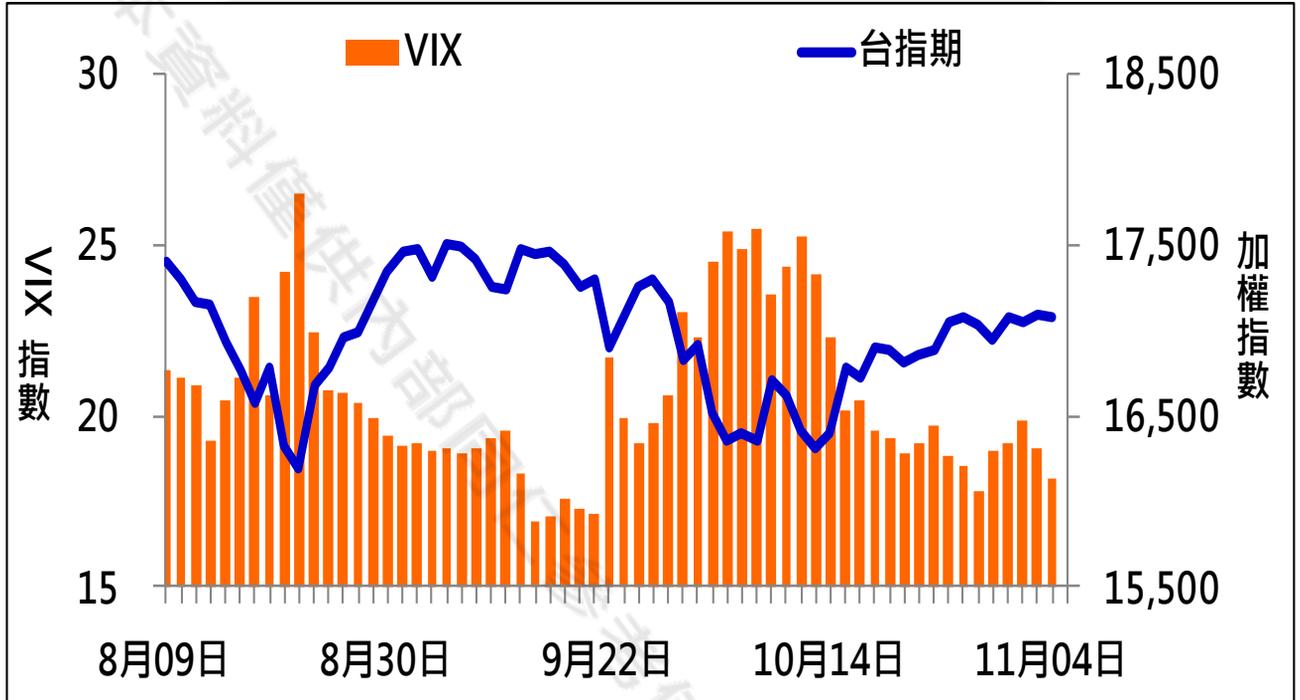
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

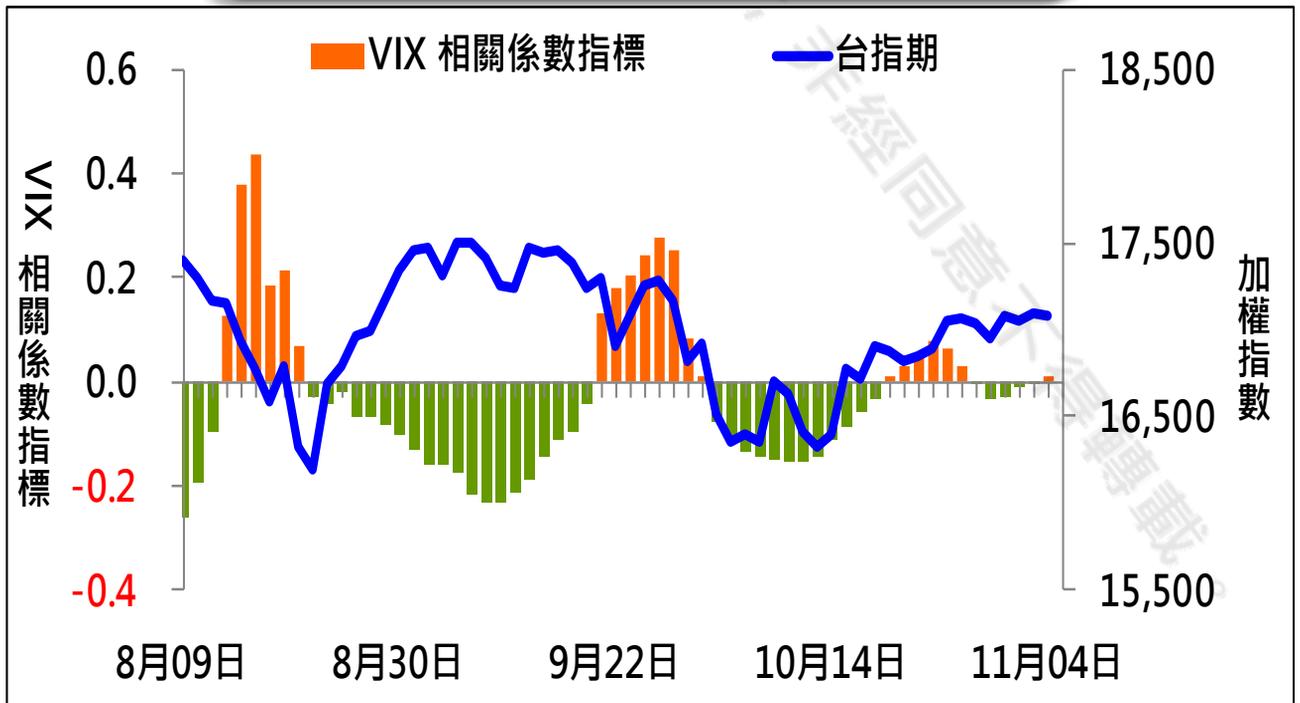
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



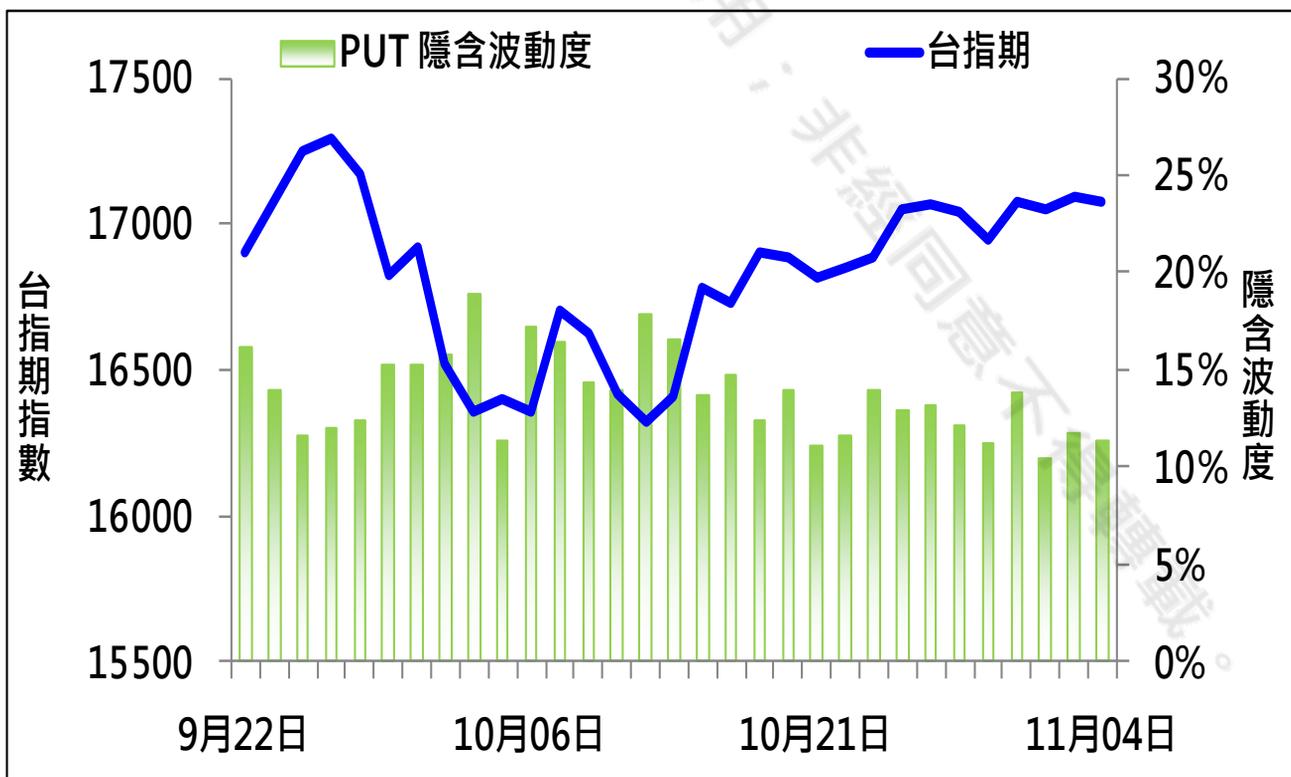
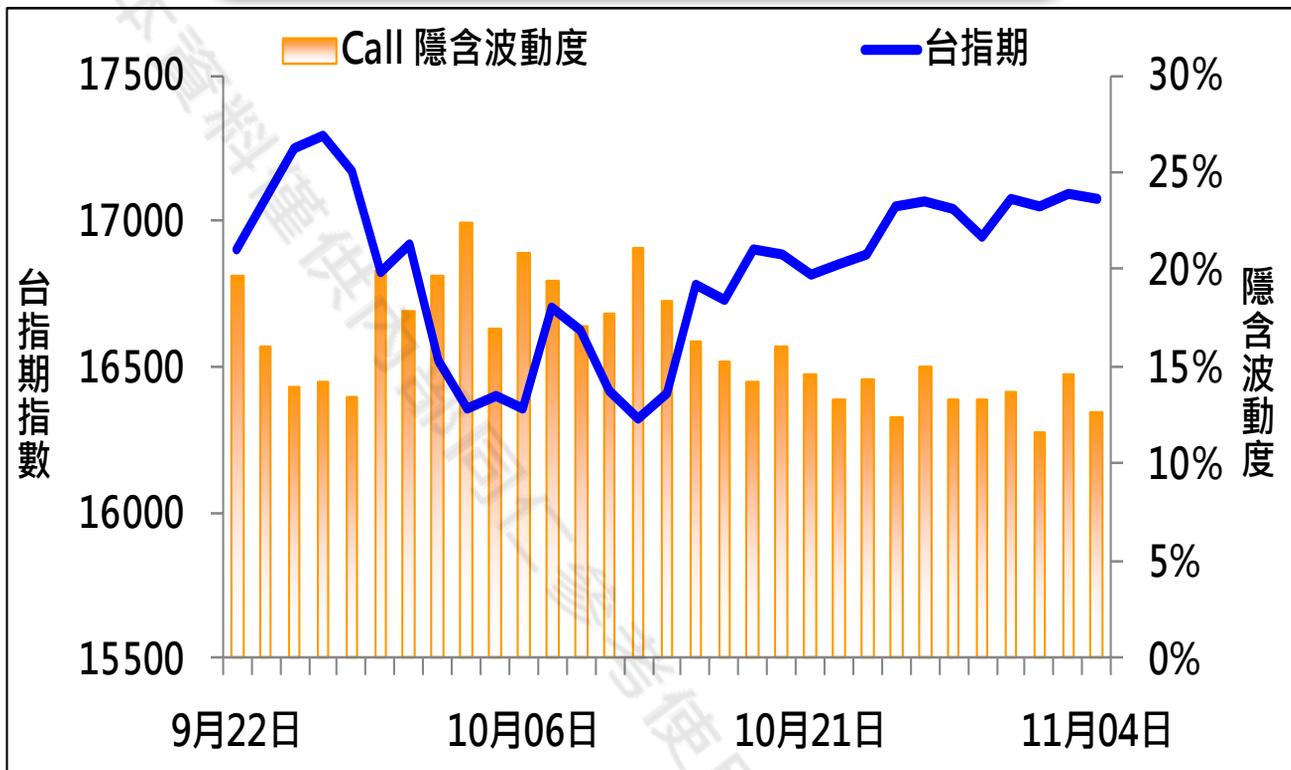
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/4

結算日：2021/11/10

OI 增減	Call	202111W2 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,200	761	33
0	0	16,300	1,210	536
0	0	16,400	1,902	650
0	0	16,500	3,424	685
3	11	16,600	3,840	2,272
2	5	16,650	1,786	833
29	39	16,700	3,947	2,537
34	45	16,750	3,700	2,799
70	98	16,800	4,943	3,554
49	90	16,850	3,534	2,503
131	254	16,900	4,026	2,590
201	246	16,950	2,982	2,315
482	902	17,000	4,694	2,826
599	916	17,050	2,068	1,307
1,545	2,738	17,100	2,584	1,748
2,235	3,045	17,150	1,449	1,124
3,814	4,938	17,200	1,293	932
2,719	4,038	17,250	437	336
5,408	7,041	17,300	747	677
3,499	5,003	17,350	121	94
※	5,881	17,400	85	69
2,990	6,648	17,450	19	19
4,638	6,800	17,500	38	35
2,939	4,262	17,550	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
42,714	63,704	0.8453	53,848	32,023

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：2021/11/4

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,700	1,701	-43
0	150	15,800	2,300	108
0	4	15,900	1,783	-198
0	46	16,000	5,726	-37
1	31	16,100	4,657	284
-2	241	16,200	5,308	253
-14	703	16,300	5,371	-273
-14	1,187	16,400	6,664	-10
-6	749	16,500	9,231	2,257
5	1,356	16,600	4,546	94
3	1,547	16,700	4,655	565
77	1,485	16,800	4,389	503
40	2,784	16,900	3,868	691
-61	4,244	17,000	3,906	552
261	3,894	17,100	1,524	-42
335	3,834	17,200	1,989	573
231	5,564	17,300	1,523	67
515	7,546	17,400	570	35
581	9,580	17,500	252	64
※ 2,179	13,847	17,600	184	7
1,059	8,627	17,700	29	0
897	9,298	17,800	20	4
-209	2,688	17,900	10	-2
111	6,178	18,000	6	2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,376	103,398	1.0331	106,820	6,566
昨日 P/C	1.0333	今日增減變化		-0.0002

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。

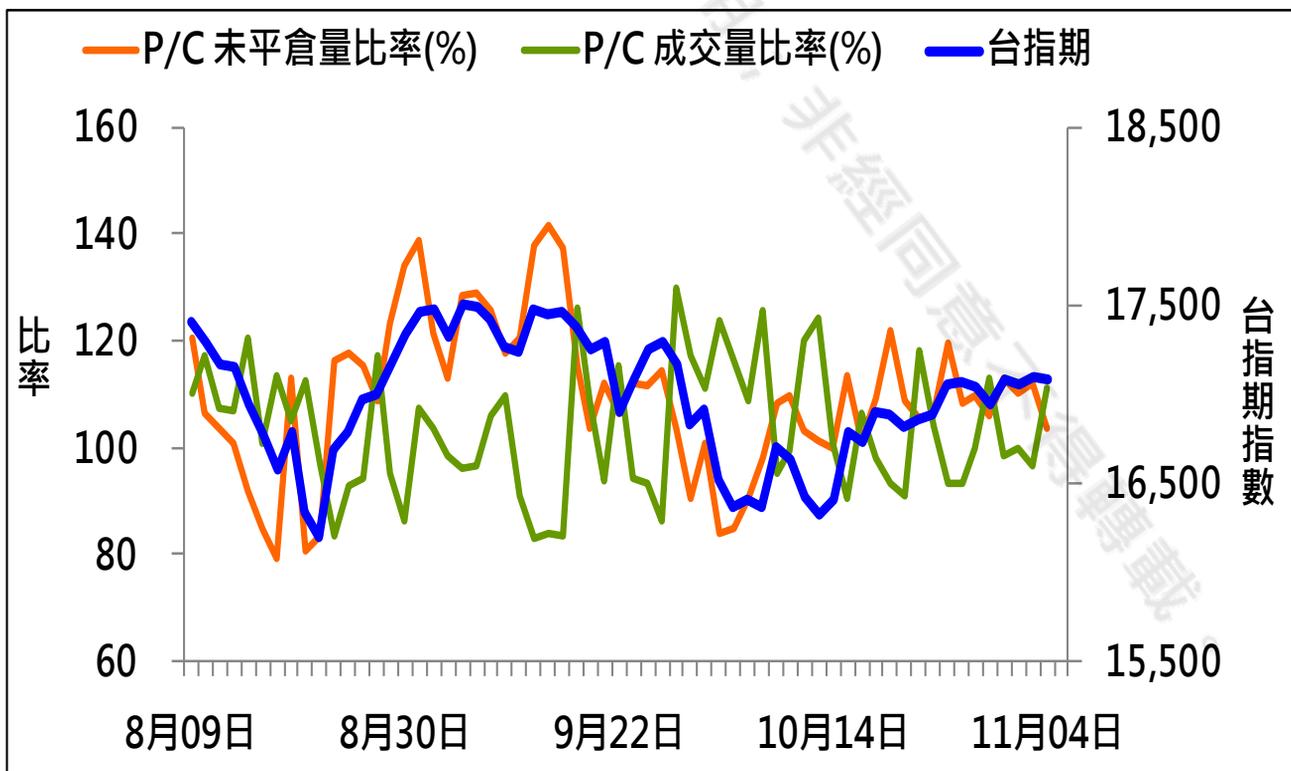
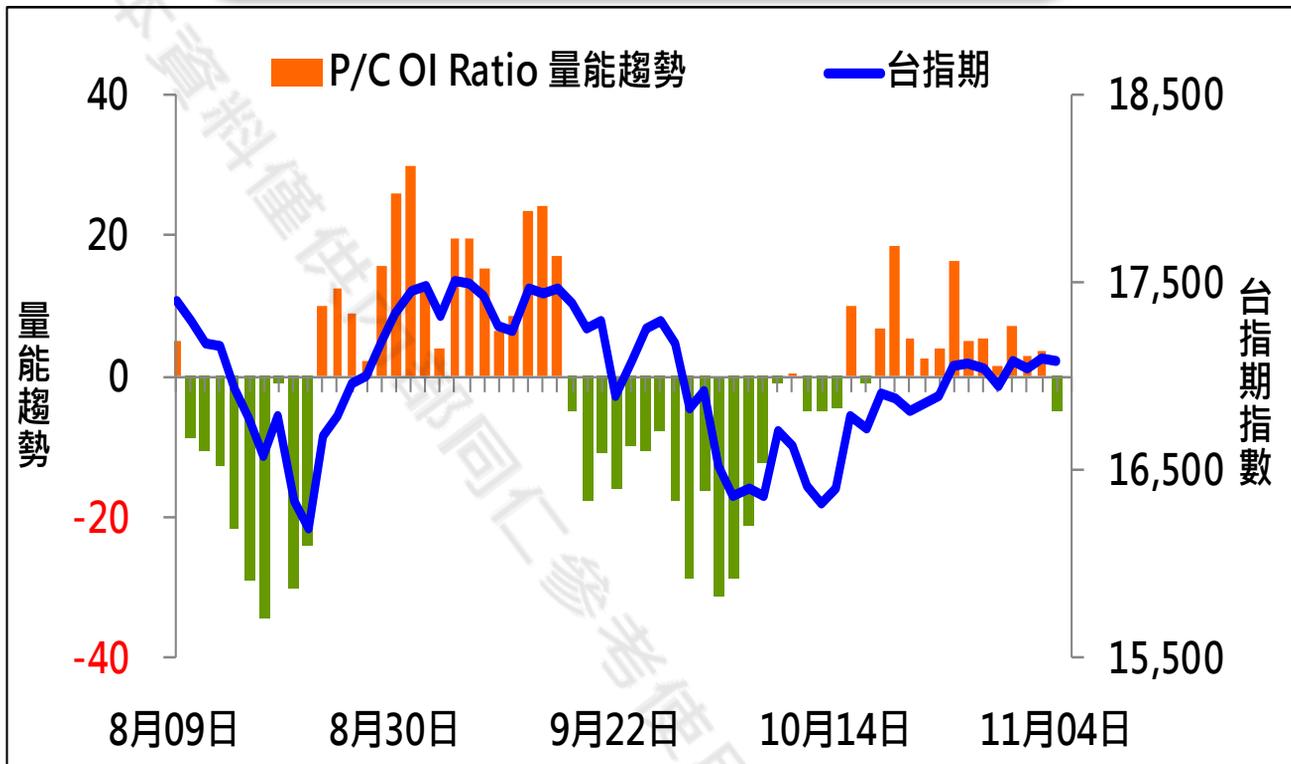
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/11/04 開 17269 高 17280 低 17050 收 17075 ↓ 點量 89933 口 -16 (-0.09%)

SMA5 17047.80 ↑ SMA20 16835.05 ↑ SMA60 16972.80 ↓ SMA120 17103.58 ↑ SMA200 16786.21 ↑



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