



## 法人籌碼動態

11月05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	-21,396	1,701	411	40	-1,718	99
投信	-3,051	513	163	0	24	0
自營商	17,899	822	-111	5	201	-32

11月05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	-95	36	2,957	3,095	19,985	2,001
投信	2	0	0	0	-61	0
自營商	69	-33	-5,998	689	5,622	-4,014

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台積電	111.13	大立光	-2.21	台指期前十大 市場佔比	45.8%	50.8%
聯詠	8.12	祥碩	-1.26			
長榮	7.75	南亞科	-1.02			
聯電	7.37	中鋼	-0.78	電子期前十大 市場佔比	55.0%	68.4%
台達電	7.28	華新科	-0.56			
聯發科	6.29	南亞	-0.52			
矽力-KY	5.07	潤泰全	-0.47	金融期前十大 市場佔比	63.6%	91.2%
南電	4.90	南帝	-0.44			
鴻海	4.57	中鴻	-0.40			
群創	4.10	聯合再生	-0.40	非金電期前十大 市場佔比	92.8%	91.4%
前十名合計	166.58	後十名合計	-8.05			

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

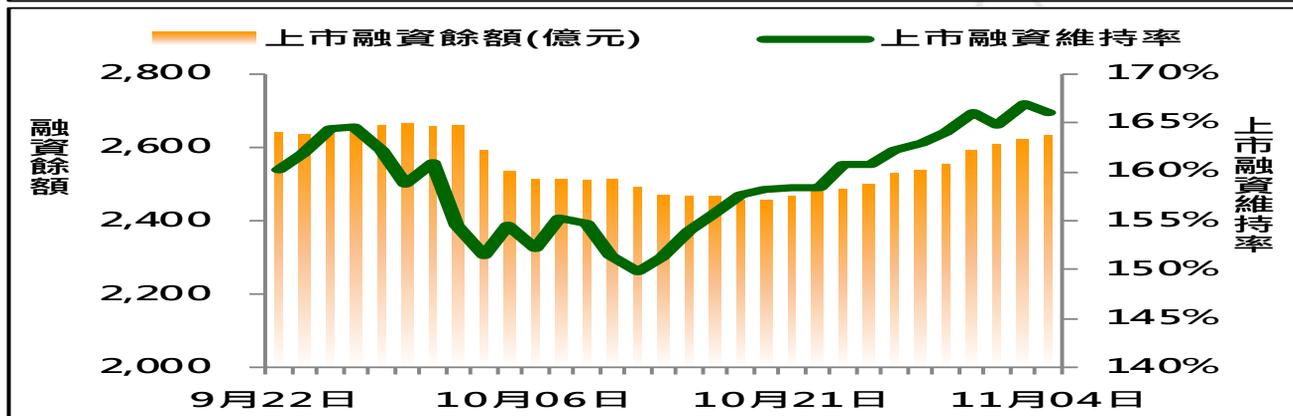
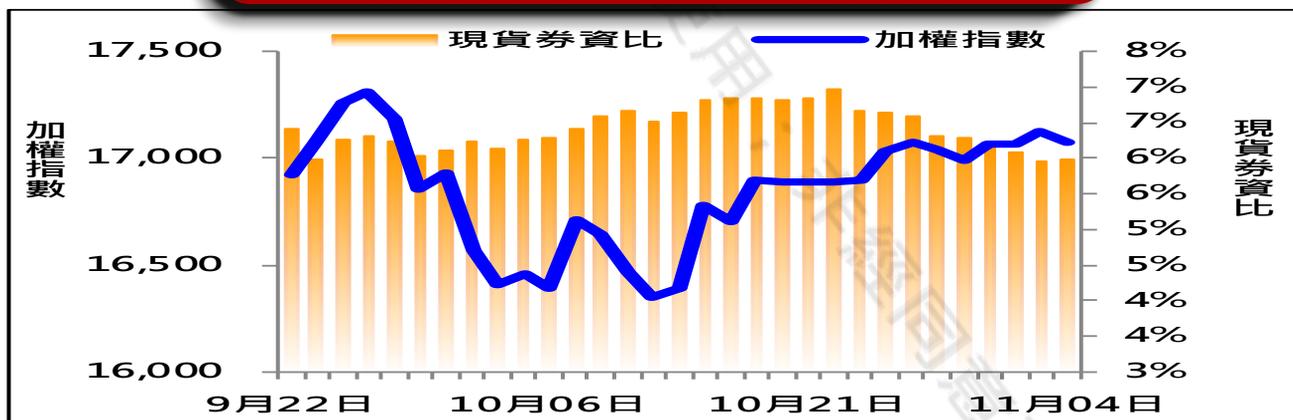


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
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
11月05日	265.5	-21,396	1,701	12.7	17,899	822

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
11月05日	2,957	19,985	-17,028	-5,998	5,622	-11,620

## 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。

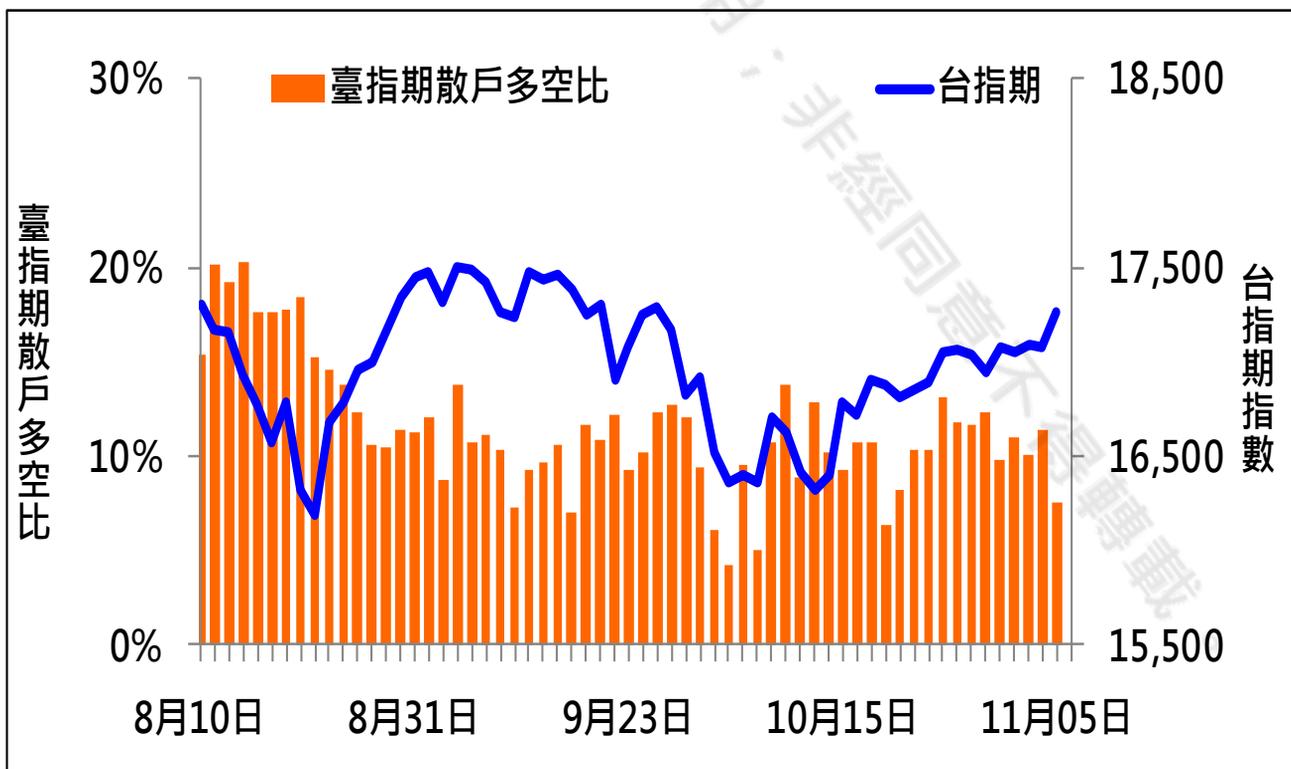
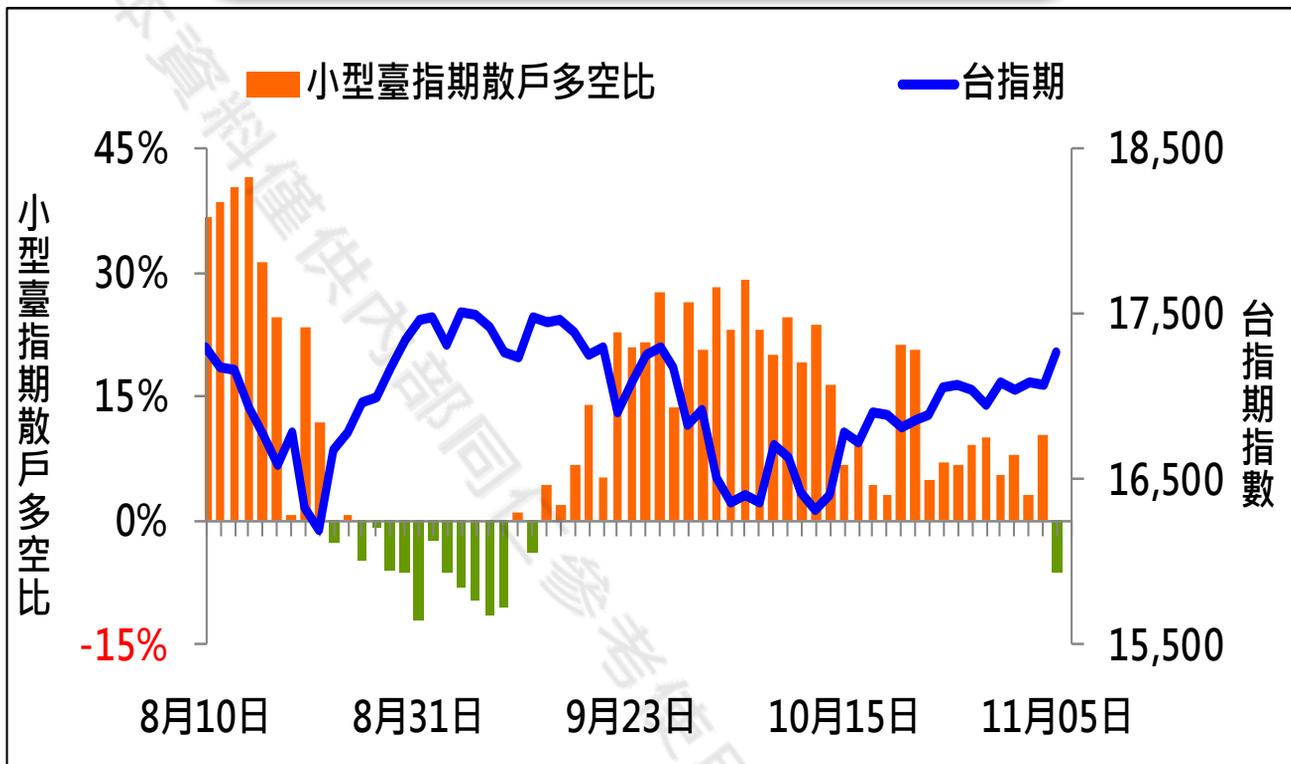
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



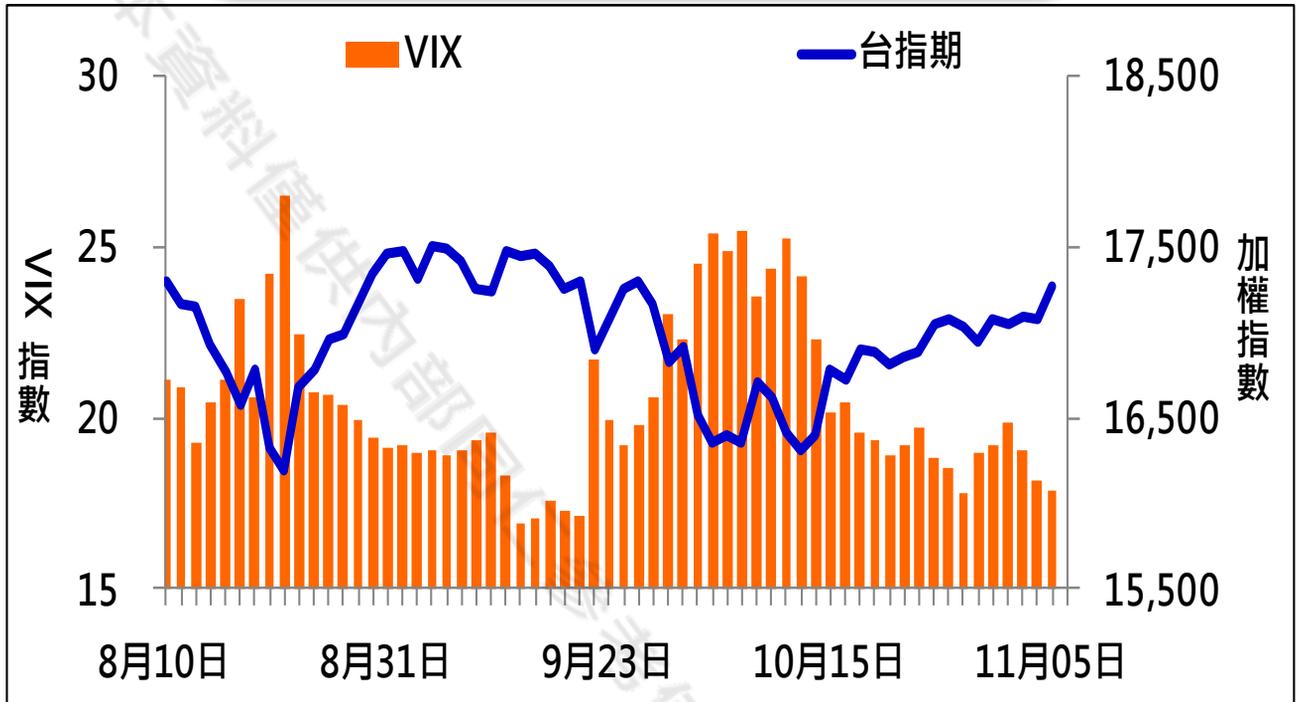
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

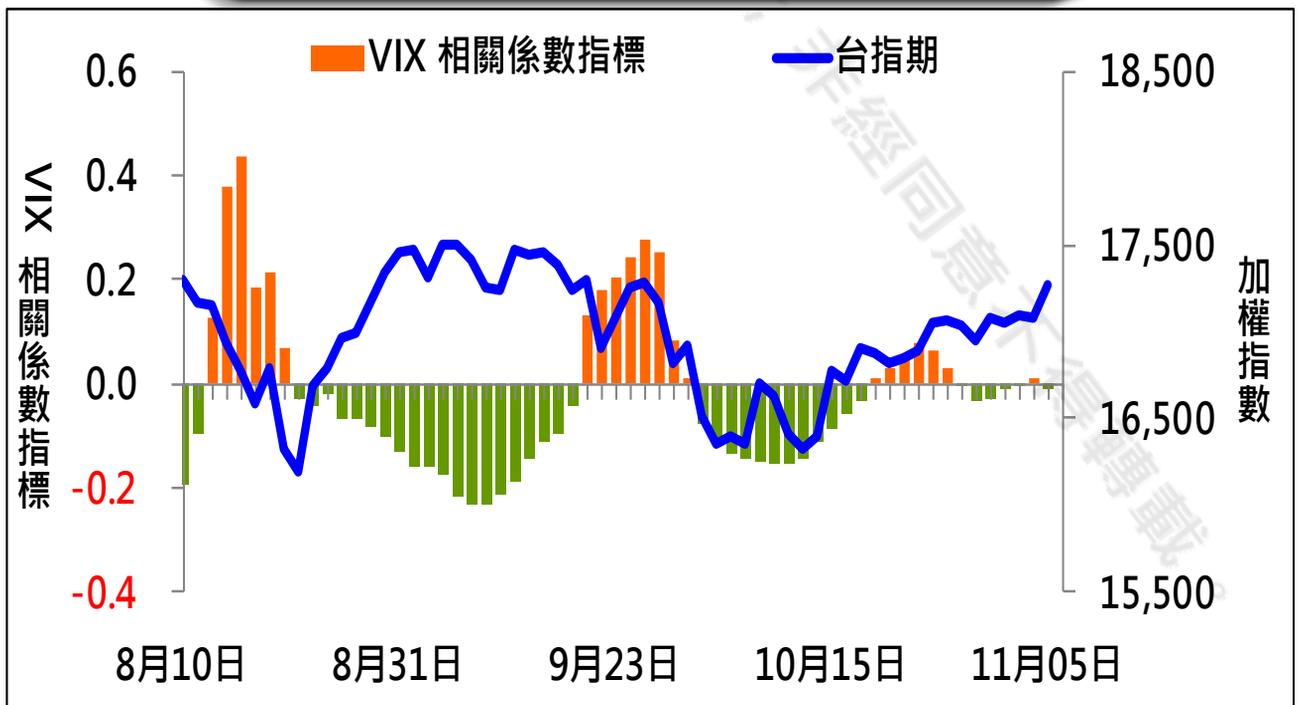
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



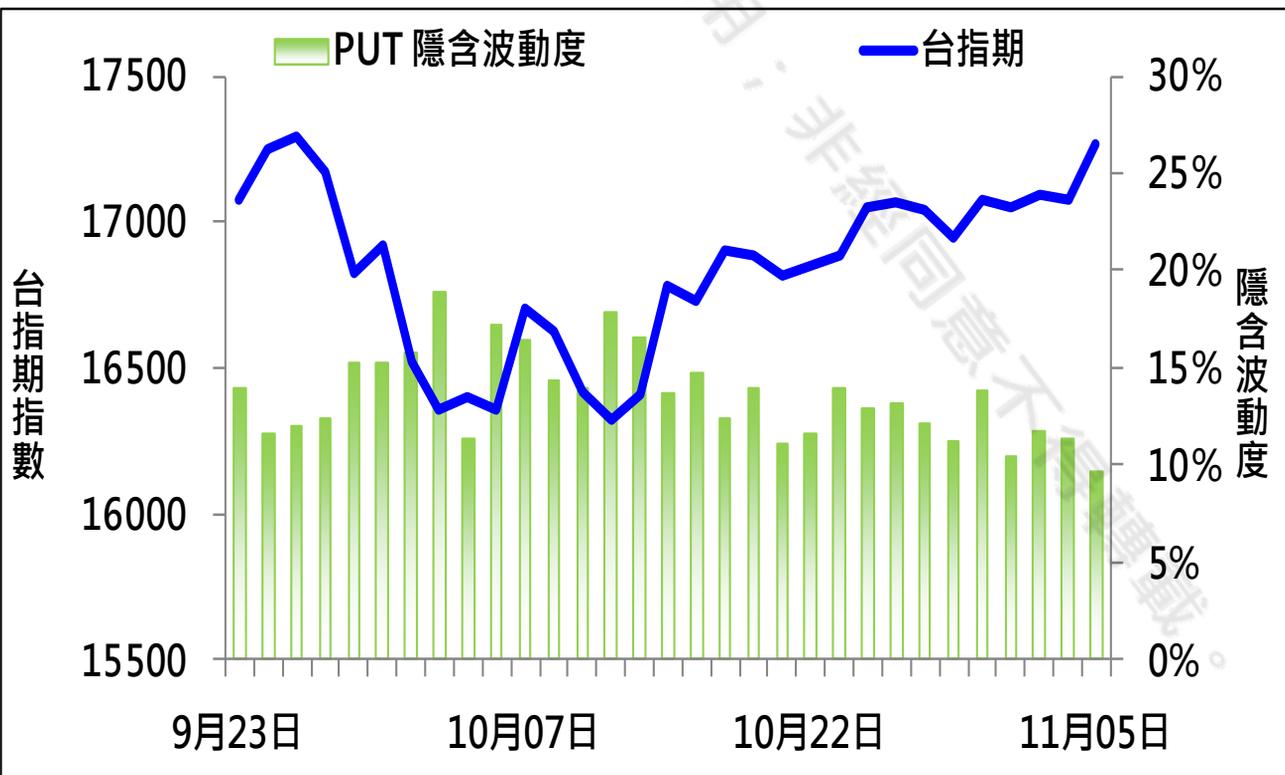
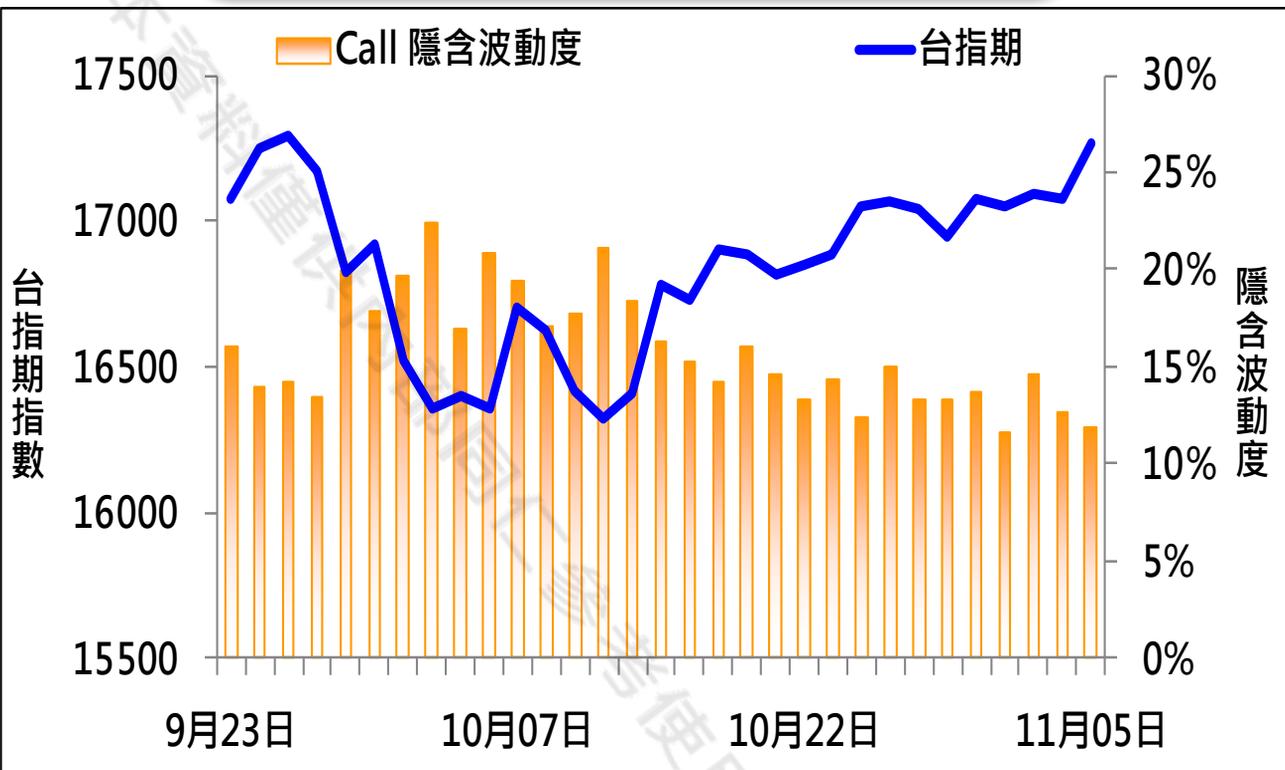
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/5

結算日：2021/11/10

OI 增減	Call	202111W2 履約價	Put	OI 增減
1	12	16,600	3,426	-414
0	5	16,650	2,357	571
-4	35	16,700	4,197	250
-39	6	16,750	4,504	804
-13	85	16,800	5,730	787
-13	77	16,850	5,787	2,253
123	377	16,900	5,236	1,210
-62	184	16,950	4,185	1,203
233	1,135	17,000	10,090	5,396 ※
-29	887	17,050	4,161	2,093
-316	2,422	17,100	7,095	4,511
-253	2,792	17,150	3,946	2,497
-619	4,319	17,200	3,821	2,528
-373	3,665	17,250	2,025	1,588
273	7,314	17,300	1,299	552
1,275	6,278	17,350	411	290
990	8,262	17,400	328	243
2,867	9,515	17,450	80	61
2,408	9,208	17,500	105	67
※ 3,020	7,282	17,550	5	5
747	5,442	17,600	28	6
950	2,953	17,700	17	14
428	1,656	17,800	2	1
-242	556	17,900	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
11,427	75,131	1.0796	81,114	27,266

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：2021/11/5

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	4	15,900	1,432	-351
-1	45	16,000	5,332	-394
0	31	16,100	3,335	-1,322
0	241	16,200	5,164	-144
-1	702	16,300	5,400	29
-7	1,180	16,400	6,828	164
-17	732	16,500	9,349	118
-22	1,334	16,600	6,003	1,457
-31	1,516	16,700	4,937	282
-61	1,424	16,800	5,258	869
155	2,939	16,900	3,943	75
21	4,265	17,000	5,682	1,776 ※
-192	3,702	17,100	2,026	502
-486	3,348	17,200	1,934	-55
-335	5,229	17,300	1,704	181
-155	7,391	17,400	715	145
78	9,658	17,500	280	28
-470	13,377	17,600	209	25
-10	8,617	17,700	53	24
187	9,485	17,800	26	6
※	372	17,900	10	0
85	6,263	18,000	8	2
321	3,956	18,100	0	0
218	2,772	18,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
-742	102,656	1.0698	109,819	2,999
昨日 P/C	1.0331	今日增減變化		0.0367

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。

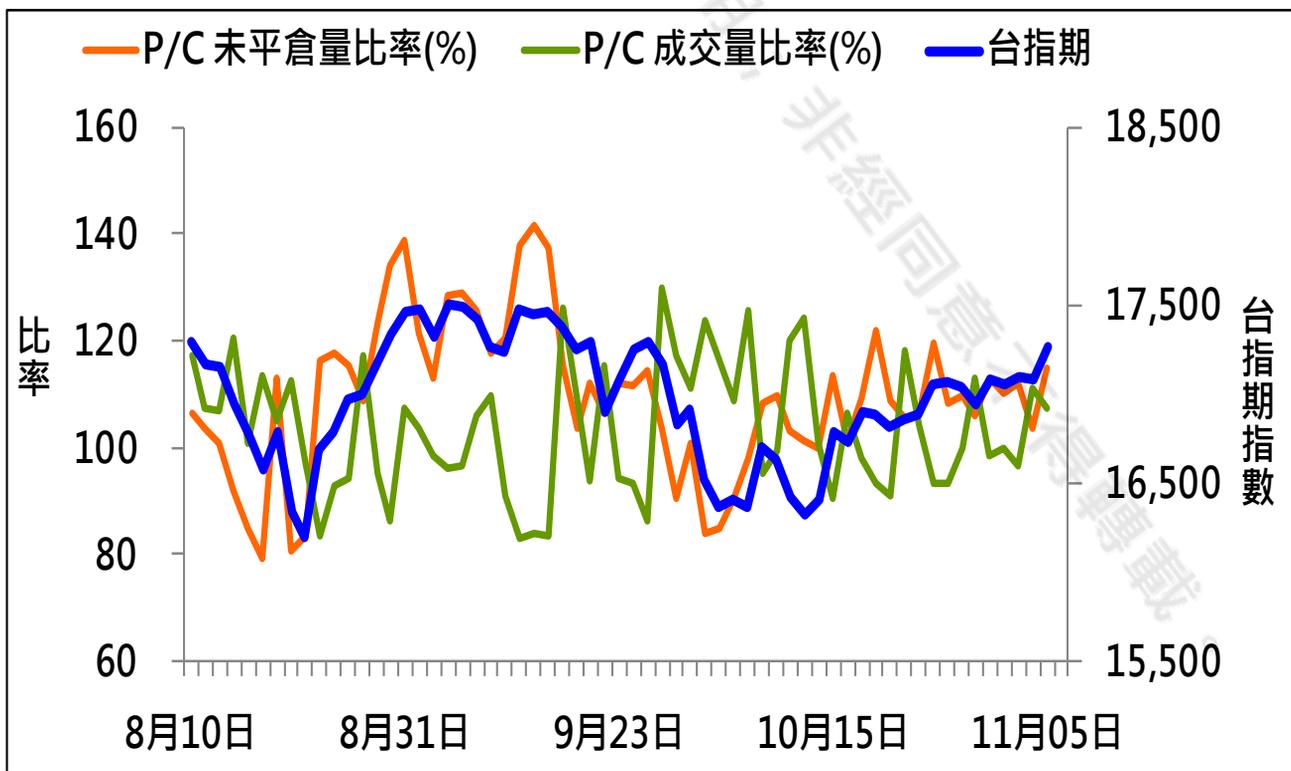
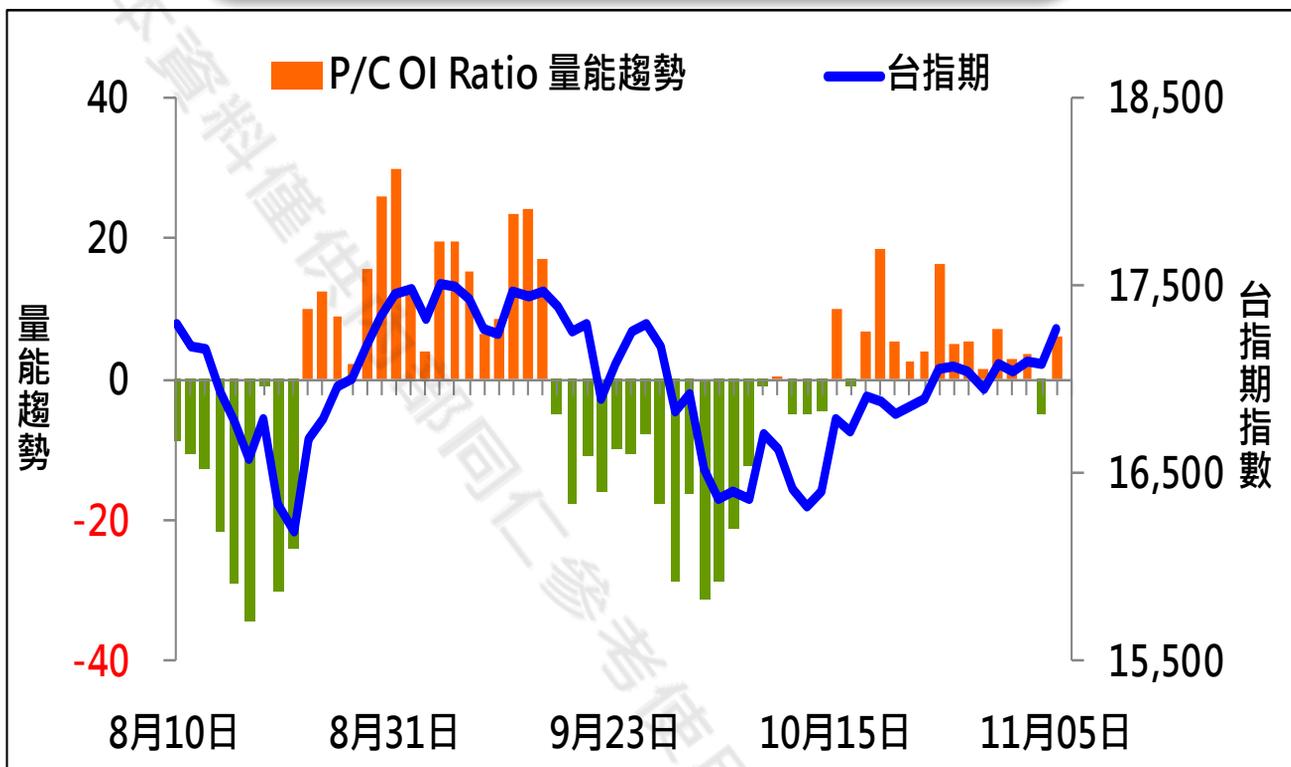
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/11/05 開 17150 高 17279 低 17106 收 17267 ↑ 點量 90064 □ +194 (+1.14%)



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