



法人籌碼動態

11月30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	-21,794	-3,314	-124	-71	-2,005	-20
投信	-2,685	53	646	0	12	2
自營商	14,555	1,780	-195	2	417	-78

11月30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	-34	-19	3,635	1,394	27,793	4,393
投信	1	0	0	0	-59	0
自營商	-11	-7	-9,771	-4,698	5,001	-869

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	25.33	聯發科	-10.41	台指期前十大 市場佔比	49.9%	56.2%
南電	8.84	台塑化	-5.58			
長榮	7.75	統一	-3.52			
欣興	7.35	統一超	-2.88	電子期前十大 市場佔比	63.7%	72.0%
富邦媒	7.11	元大金	-2.37			
矽力-KY	6.72	台化	-2.29			
陽明	5.29	中鋼	-1.80	金融期前十大 市場佔比	61.1%	92.3%
聯電	5.26	富邦金	-1.75			
國泰金	3.35	友達	-1.72			
瑞昱	3.16	台灣大	-1.37	非金電期前十大 市場佔比	86.5%	93.6%
前十名合計	80.17	後十名合計	-33.69			

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

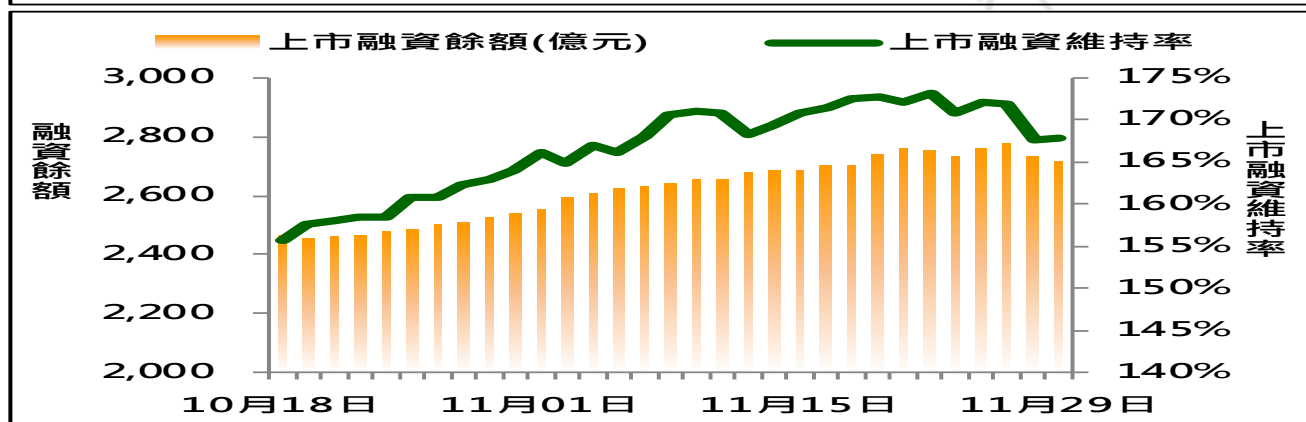
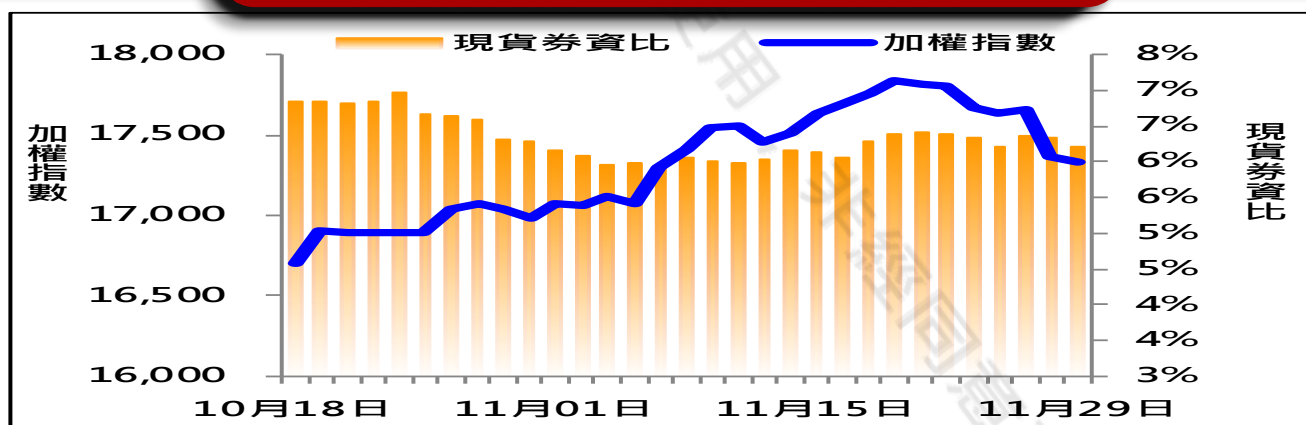


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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24日	6.8	-18,965	-258	13.4	14,039	-85
11月25日	-82.6	-20,322	-1,357	-2.8	14,521	482
11月26日	-309.6	-20,043	279	-68.7	13,593	-928
11月29日	60.6	-18,480	1,563	-17.5	12,775	-818
11月30日	-166.9	-21,794	-3,314	-23.1	14,555	1,780

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24日	2,911	19,375	-16,464	-9,577	11,736	-21,313
11月25日	1,967	19,994	-18,027	-16,439	18,454	-34,893
11月26日	3,425	21,557	-18,132	-17,602	9,509	-27,111
11月29日	2,241	23,400	-21,159	-5,073	5,870	-10,943
11月30日	3,635	27,793	-24,158	-9,771	5,001	-14,772

現貨券資比 & 上市融資維持率



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。

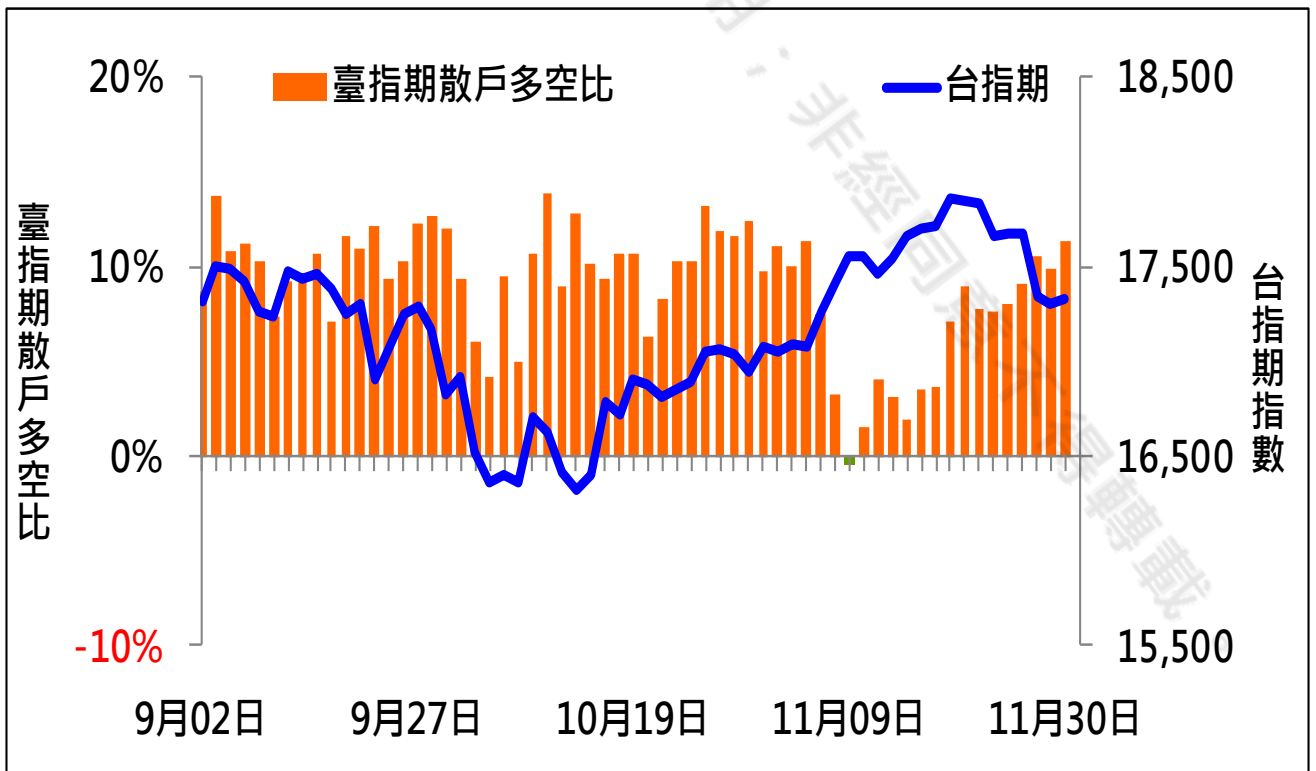
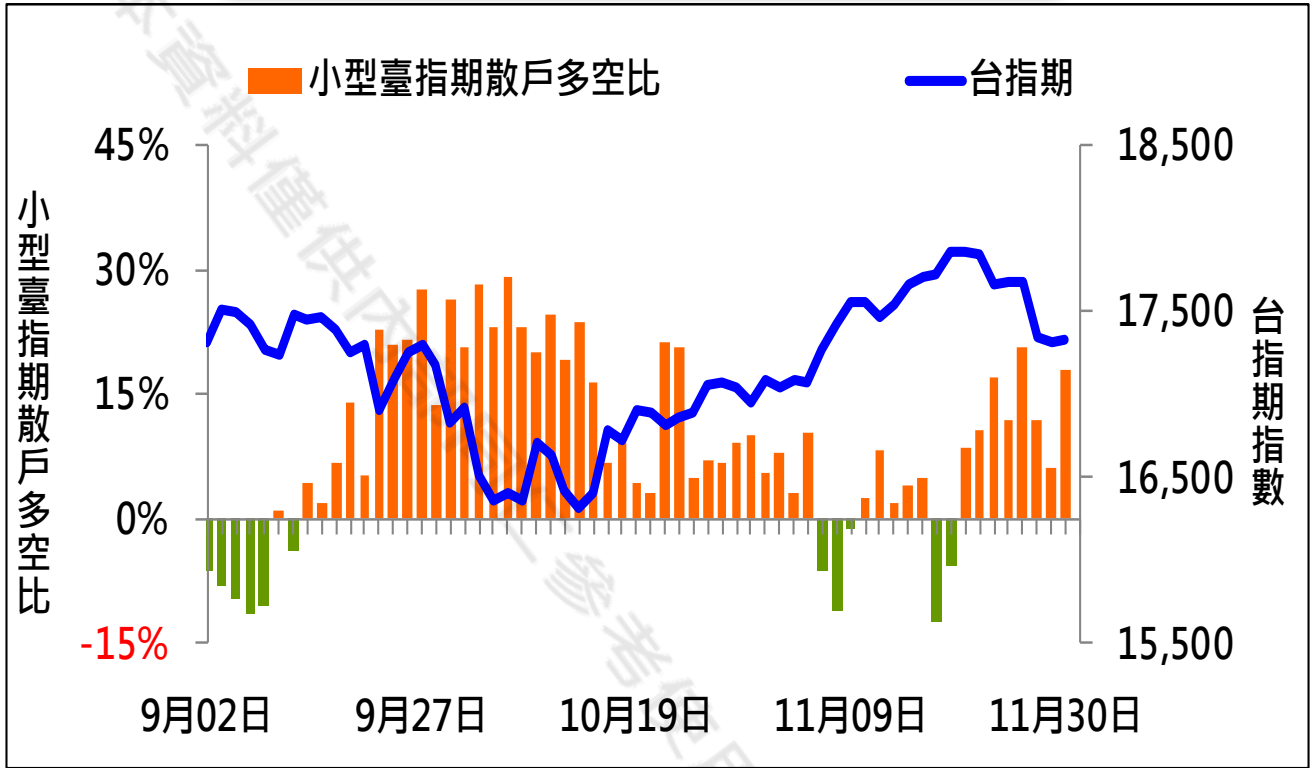
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



散戶多空比



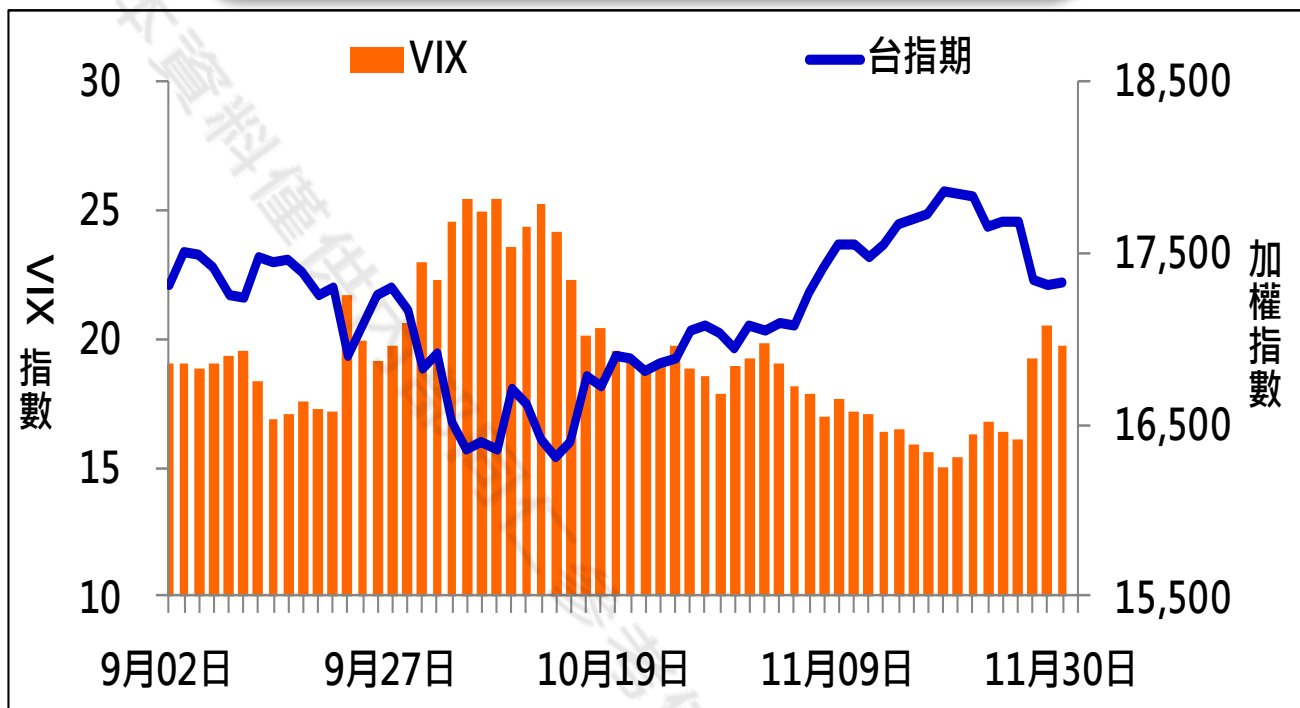
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

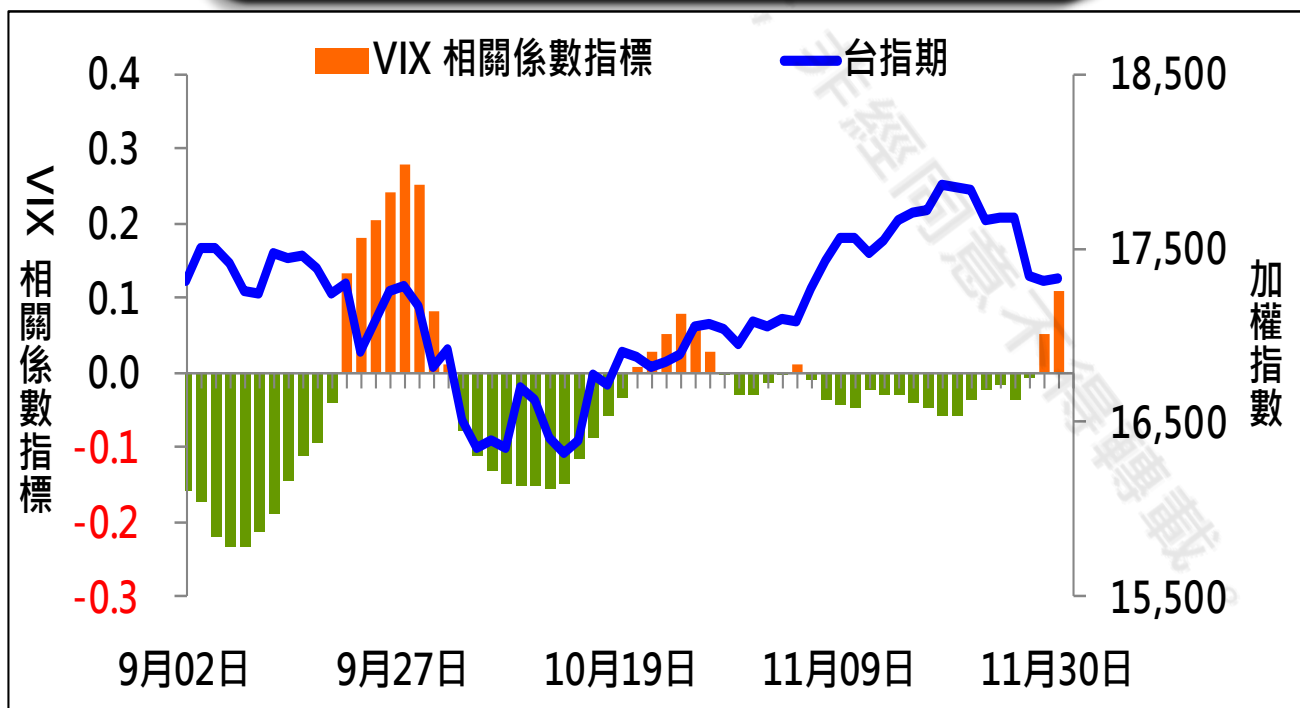
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



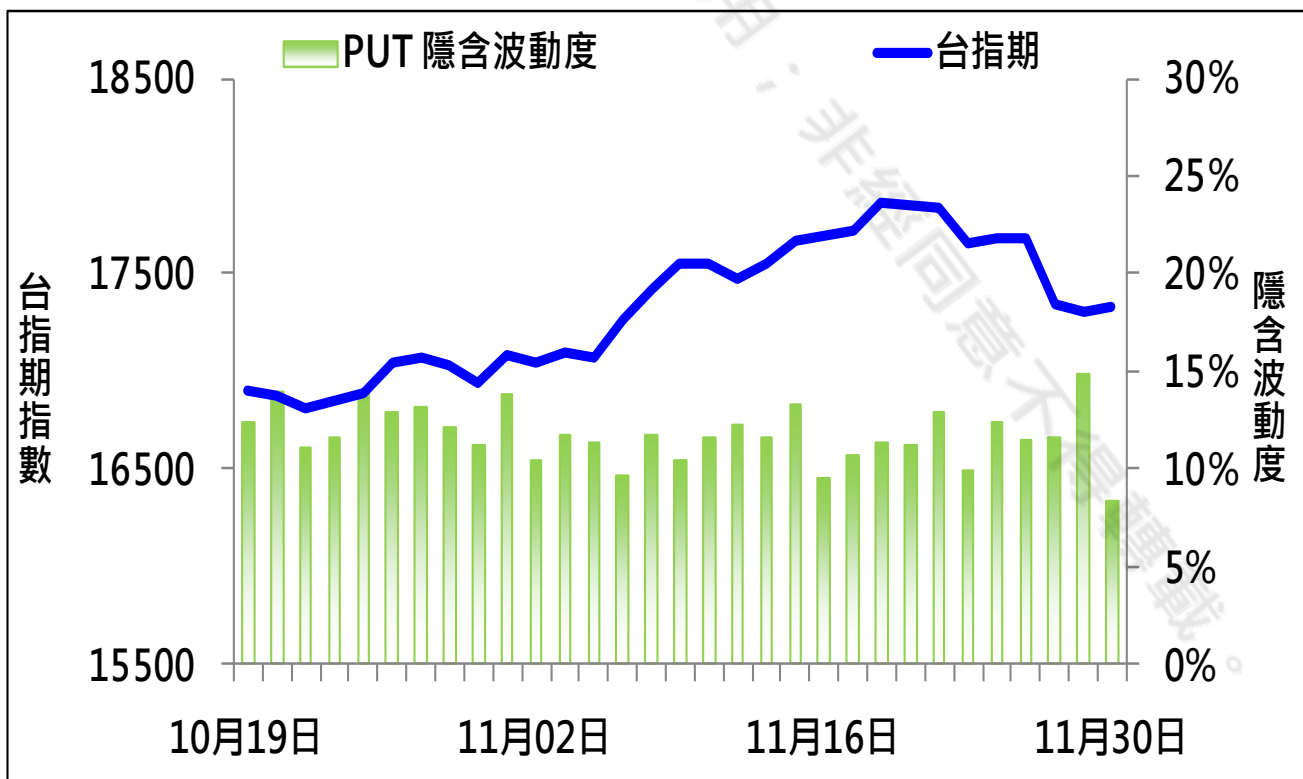
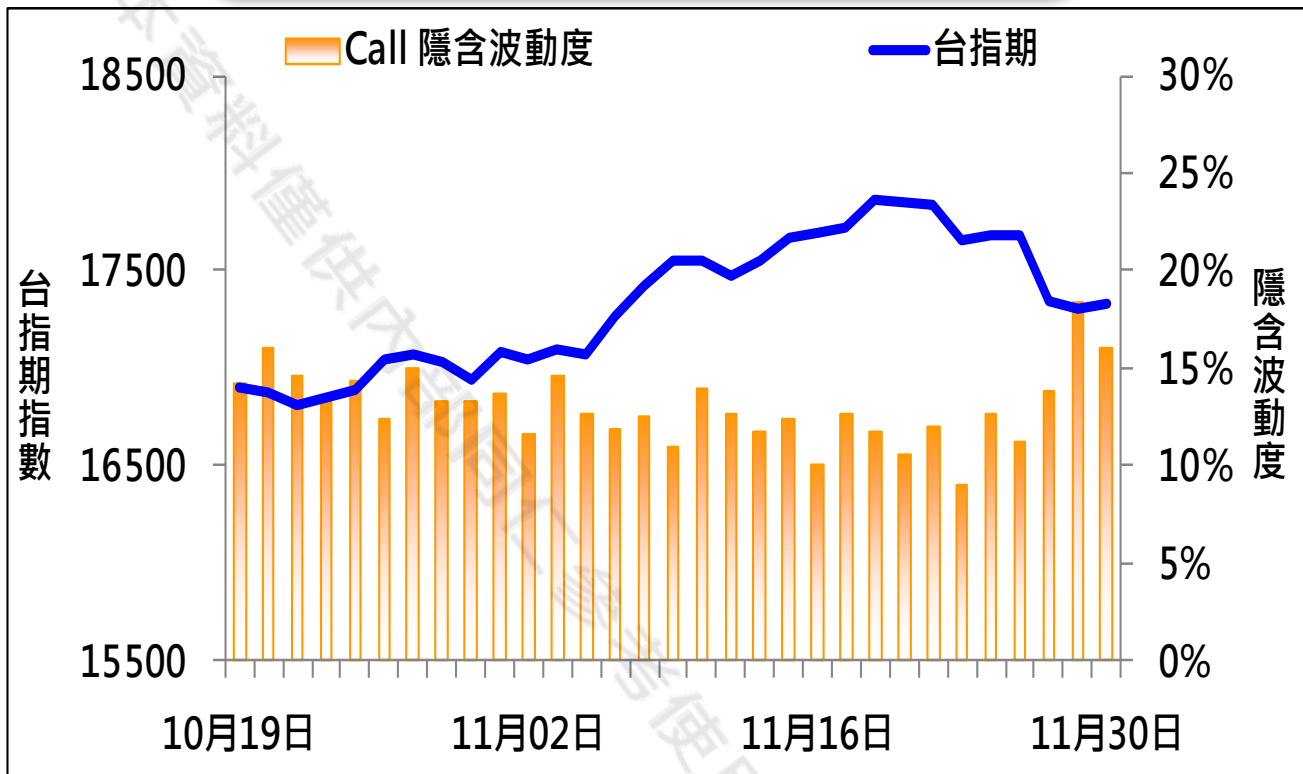
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/30

結算日：2021/12/1

OI 增減	Call	202112W1 履約價	Put	OI 增減
0	10	16,800	4,876	-473
1	1	16,850	1,448	489
0	27	16,900	4,229	-816
2	2	16,950	2,890	726
-23	50	17,000	9,217	-1,367
10	14	17,050	2,860	576
39	434	17,100	7,503	-183
-38	453	17,150	5,273	-1,589
-151	1,235	17,200	10,402	2,775
-446	1,027	17,250	8,992	2,135
-376	2,909	17,300	9,511	2,952
1,630	5,048	17,350	8,081	2,662
3,269	9,444	17,400	12,976	7,235
2,520	9,054	17,450	5,260	3,052
714	12,427	17,500	6,745	2,612
3,697	12,832	17,550	3,562	1,018
※ 6,255	18,648	17,600	3,885	512
2,401	11,196	17,650	1,992	75
779	11,738	17,700	1,977	-25
992	6,454	17,750	582	24
-484	7,564	17,800	398	-2
-295	3,222	17,850	157	-4
-1,587	4,552	17,900	167	-17
-184	3,276	17,950	219	-3
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
17,420	132,944	0.9803	130,320	21,965

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：2021/11/30

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112月 履約價	Put	OI 增減
0	131	16,000	3,351	524
0	5	16,100	1,337	442
0	33	16,200	8,264	-173
0	4	16,300	4,730	555
0	30	16,400	8,203	1,573
5	30	16,500	3,852	117
4	50	16,600	3,510	38
-3	67	16,700	13,901	1,296
108	210	16,800	5,330	106
34	258	16,900	4,267	165
11	732	17,000	7,917	1,001
-13	2,634	17,100	3,791	-173
795	3,264	17,200	5,299	180
298	1,818	17,300	3,670	470
142	2,351	17,400	3,167	783
-68	3,177	17,500	2,635	340
106	3,608	17,600	3,585	1,902
127	5,580	17,700	2,265	-351
-434	9,676	17,800	1,716	12
317	7,162	17,900	973	-3
386	11,537	18,000	1,033	-34
180	6,385	18,100	144	-32
-89	8,013	18,200	78	-10
58	8,221	18,300	14	2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,121	116,547	1.1436	133,281	9,931
昨日 P/C	1.0875	今日增減變化		0.0561

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。

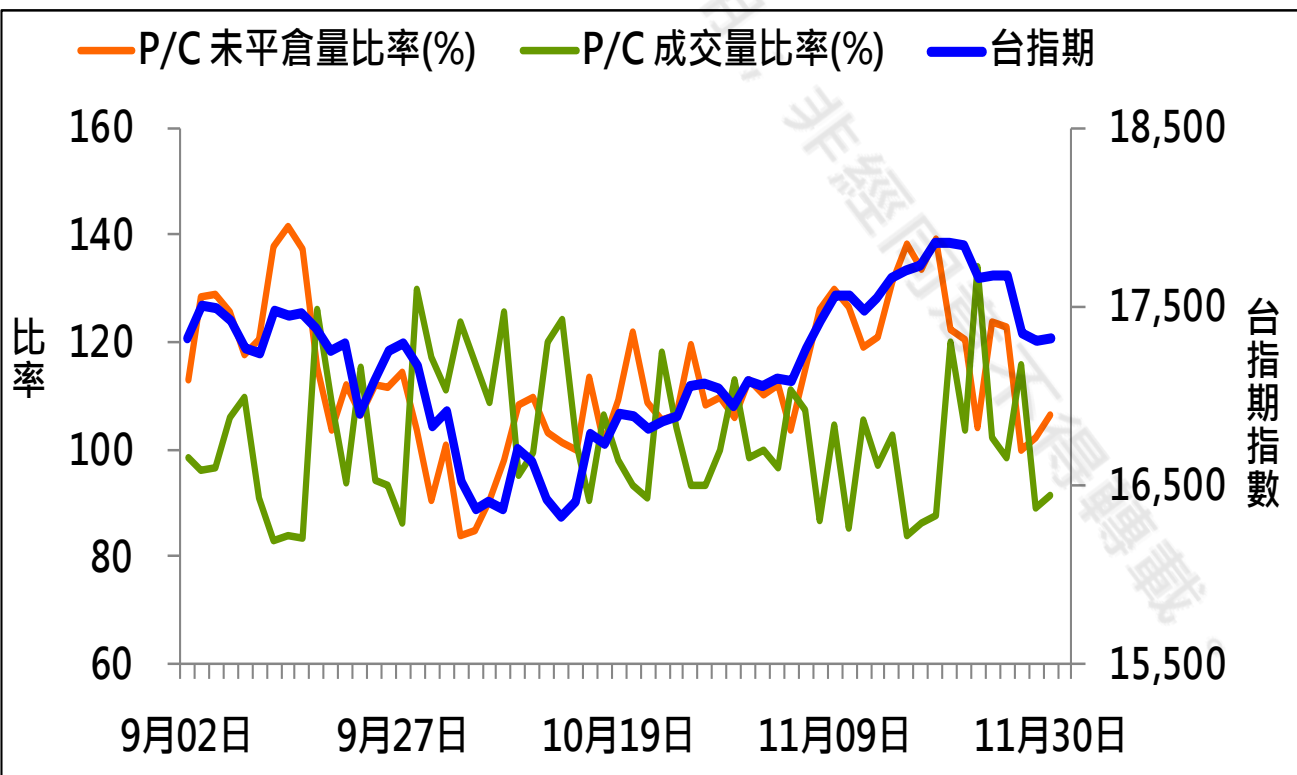
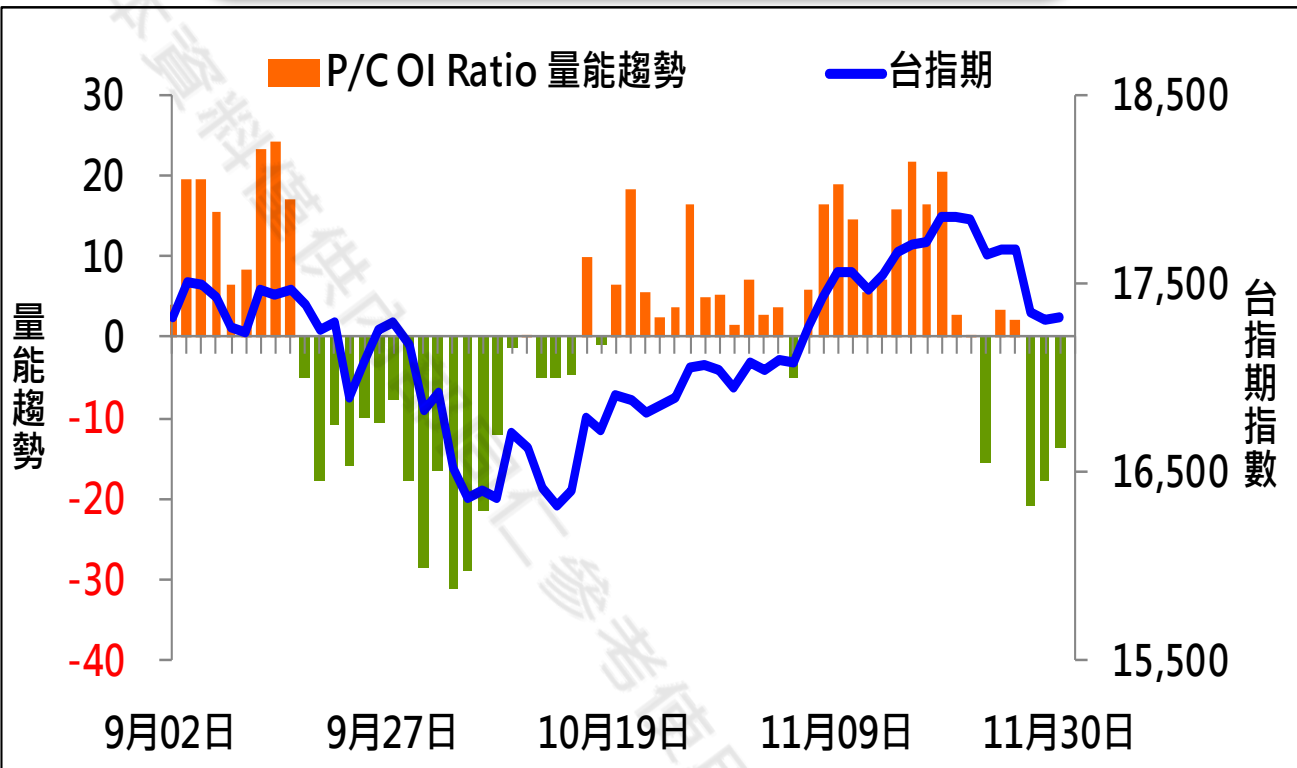
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/11/30 開 17428 高 17537 低 17312 收 17327 s 點量 111906 □ +16 (+0.09%)

SMA5 17466.60 ↓ SMA20 17530.10 ↑ SMA60 17157.03 ↑ SMA120 17245.74 ↑ SMA200 16959.81 ↑



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