



## 法人籌碼動態

11月17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	-15,550	-487	606	438	-1,527	202
投信	-1,347	242	153	-595	24	0
自營商	13,823	296	-125	268	322	158

11月17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	-53	-105	-339	-5,850	12,236	-22,562
投信	2	0	0	0	-59	1
自營商	54	146	4,555	360	3,454	25,954

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
國泰金	10.66	鴻海	-4.57	台指期前十大 市場佔比	55.9%	57.9%
富邦金	7.96	長榮	-4.30			
開發金	6.41	聯發科	-2.62			
台達電	4.71	陽明	-2.17	電子期前十大 市場佔比	70.4%	75.6%
富邦媒	4.15	萬海	-1.83			
聯詠	4.11	台塑化	-1.57			
華航	3.39	研華	-1.40	金融期前十大 市場佔比	69.1%	90.4%
新光金	3.07	和泰車	-1.26			
中信金	2.64	旭隼	-1.15			
聯電	2.46	台塑	-1.05	非金電期前十大 市場佔比	95.6%	96.2%
前十名合計	49.56	後十名合計	-21.91			

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

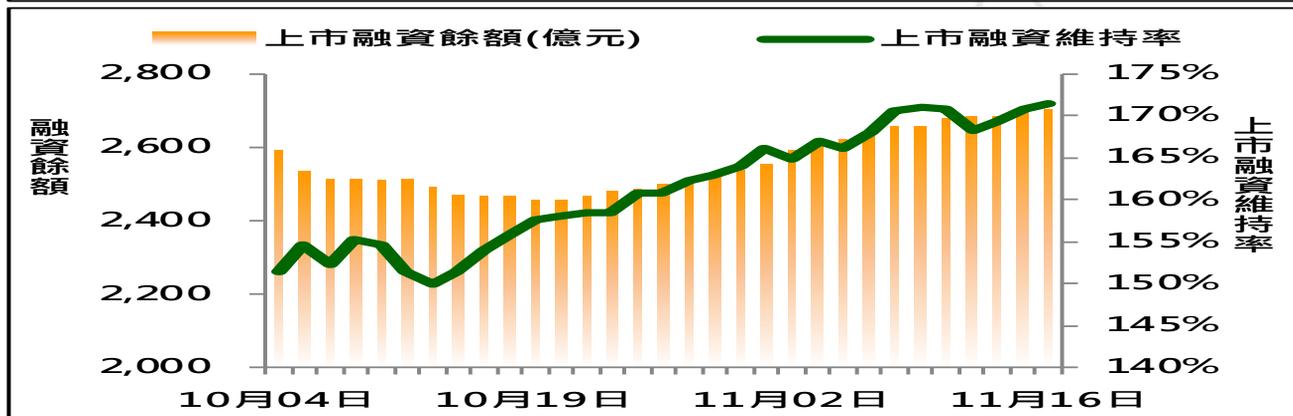
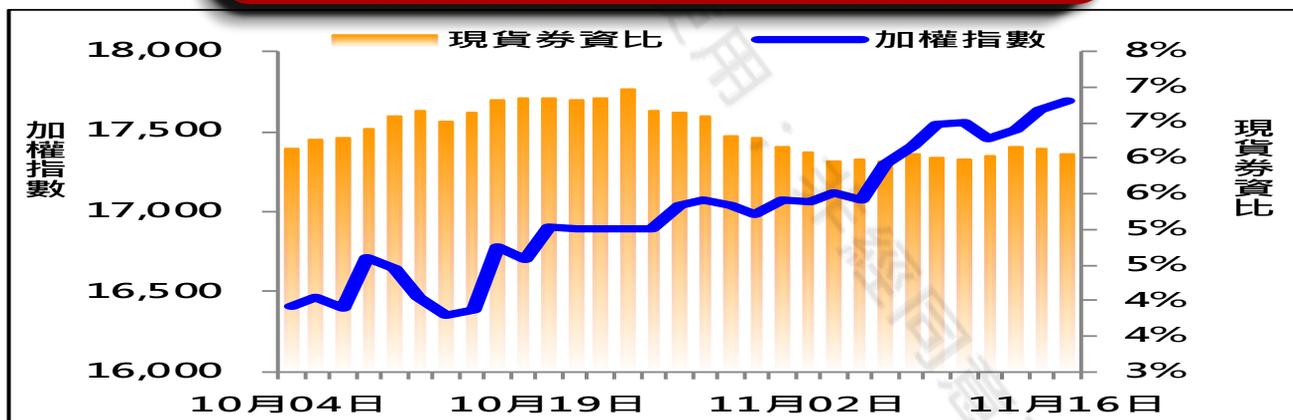


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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11日	-70.7	-17,990	-1,477	-5.8	16,505	-951
11月12日	79.3	-16,971	1,019	-4.8	16,223	-282
11月15日	54.4	-15,579	1,392	-0.1	15,500	-723
11月16日	77.0	-15,063	516	-12.9	13,527	-1,973
11月17日	-2.3	-15,550	-487	-6.6	13,823	296

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11日	3,583	30,755	-27,172	-14,008	4,427	-18,435
11月12日	5,093	33,468	-28,375	-11,679	202	-11,881
11月15日	3,951	36,924	-32,973	-3,534	-6,977	3,443
11月16日	5,511	34,798	-29,287	4,195	-22,500	26,695
11月17日	-339	12,236	-12,575	4,555	3,454	1,101

## 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。

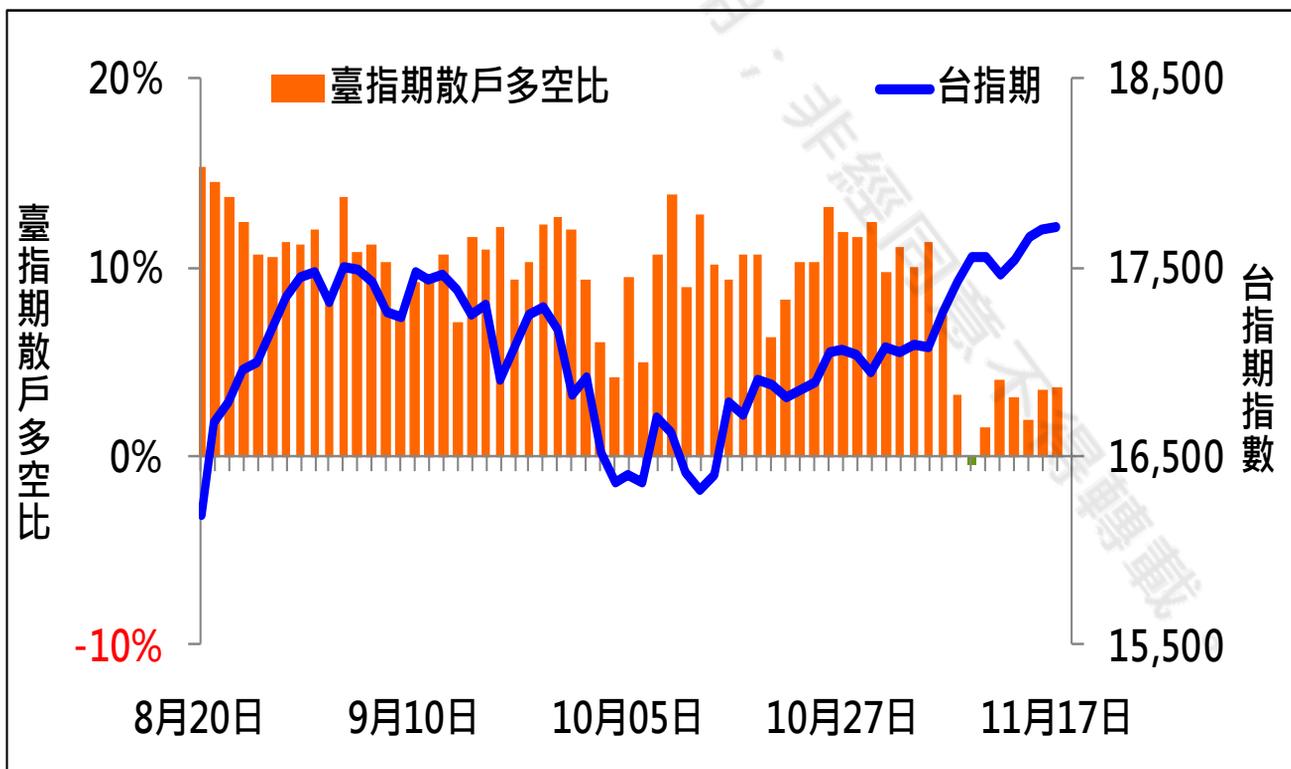
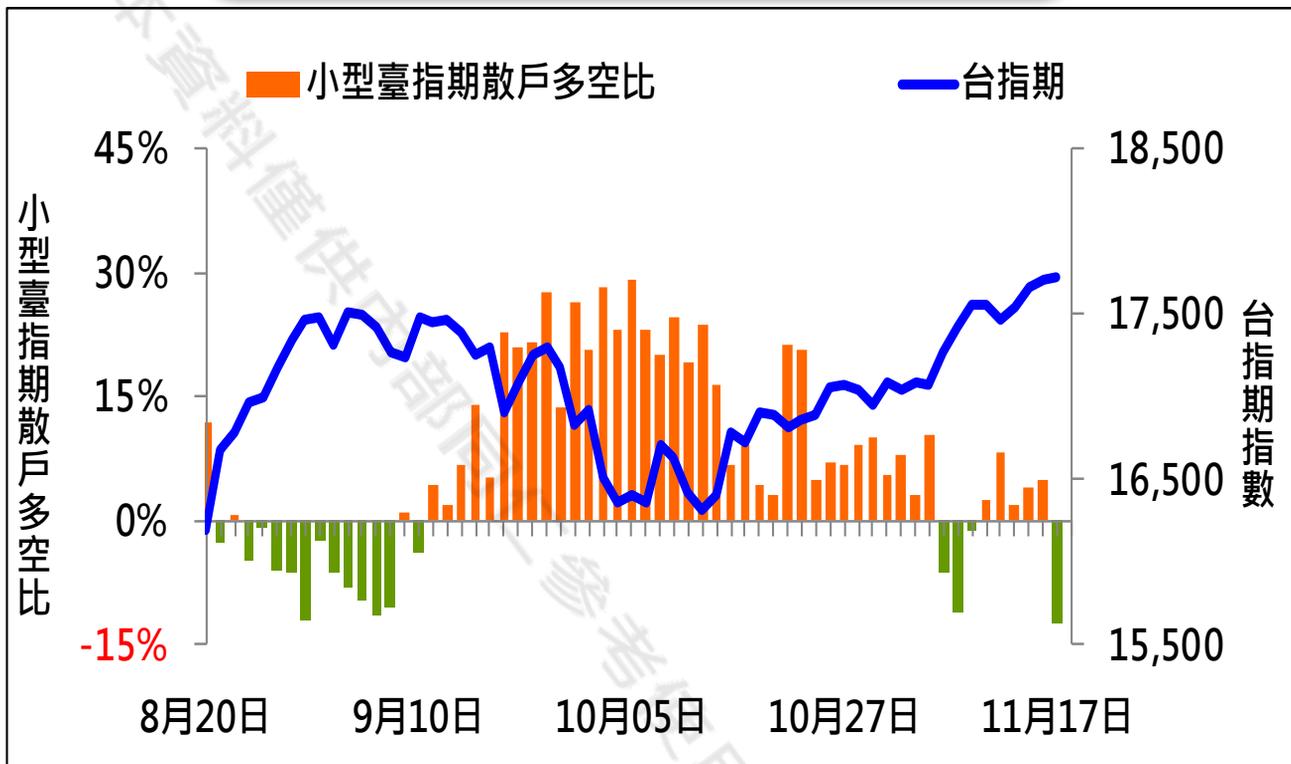
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



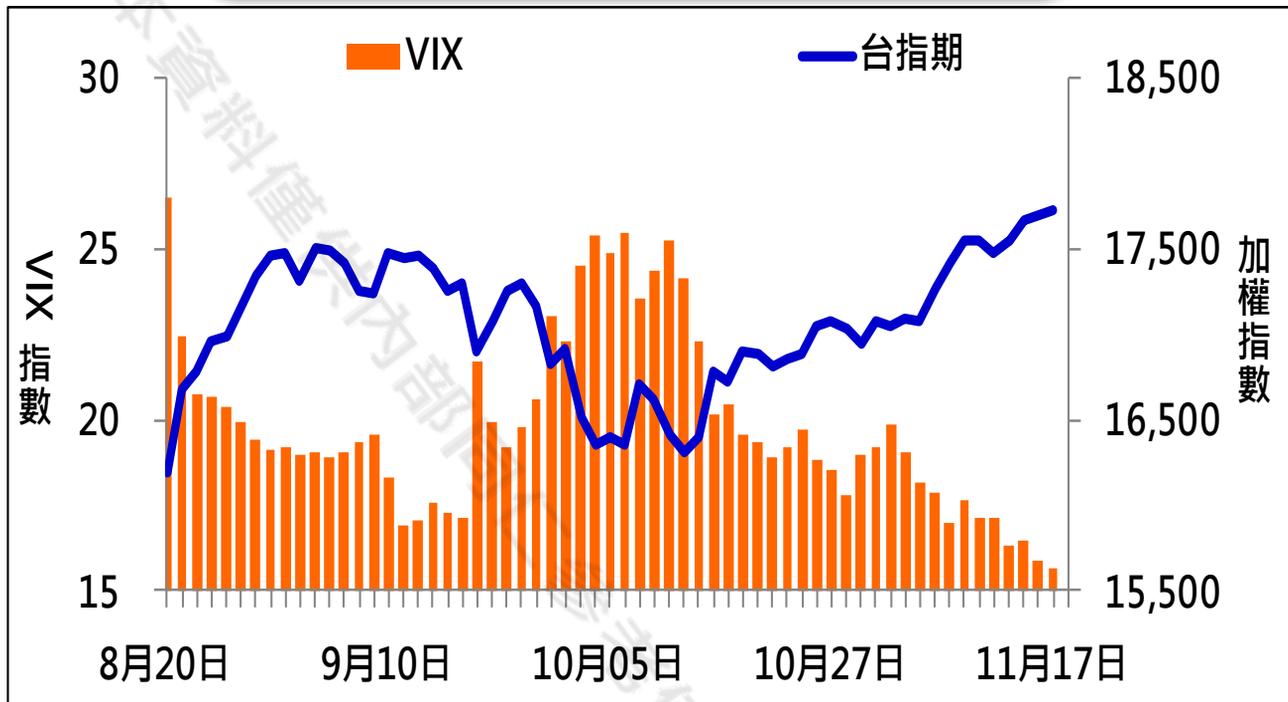
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

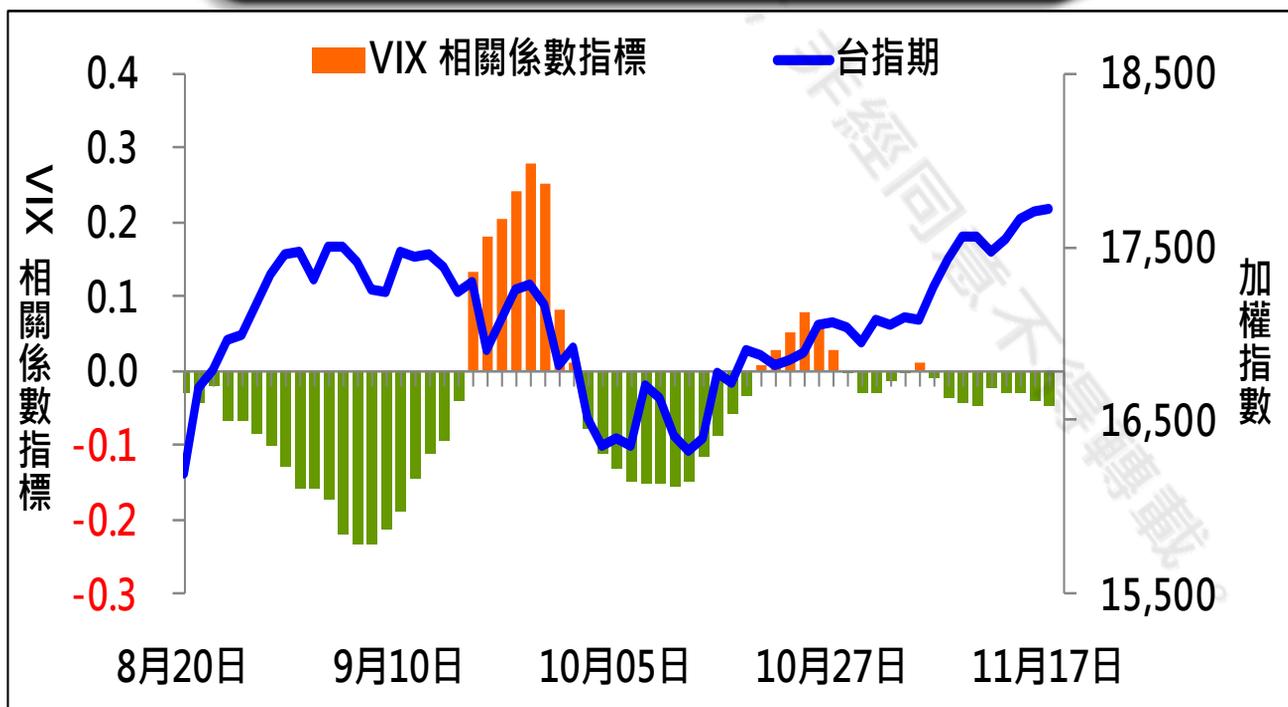
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



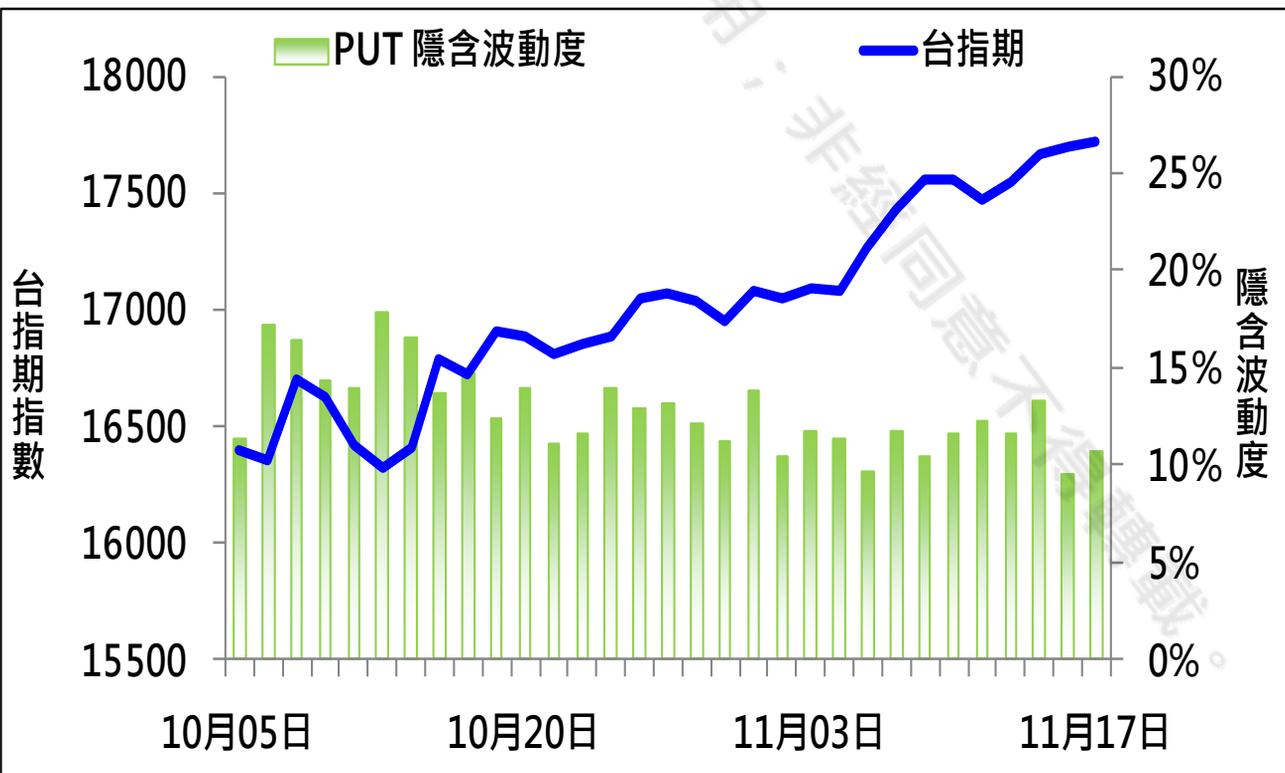
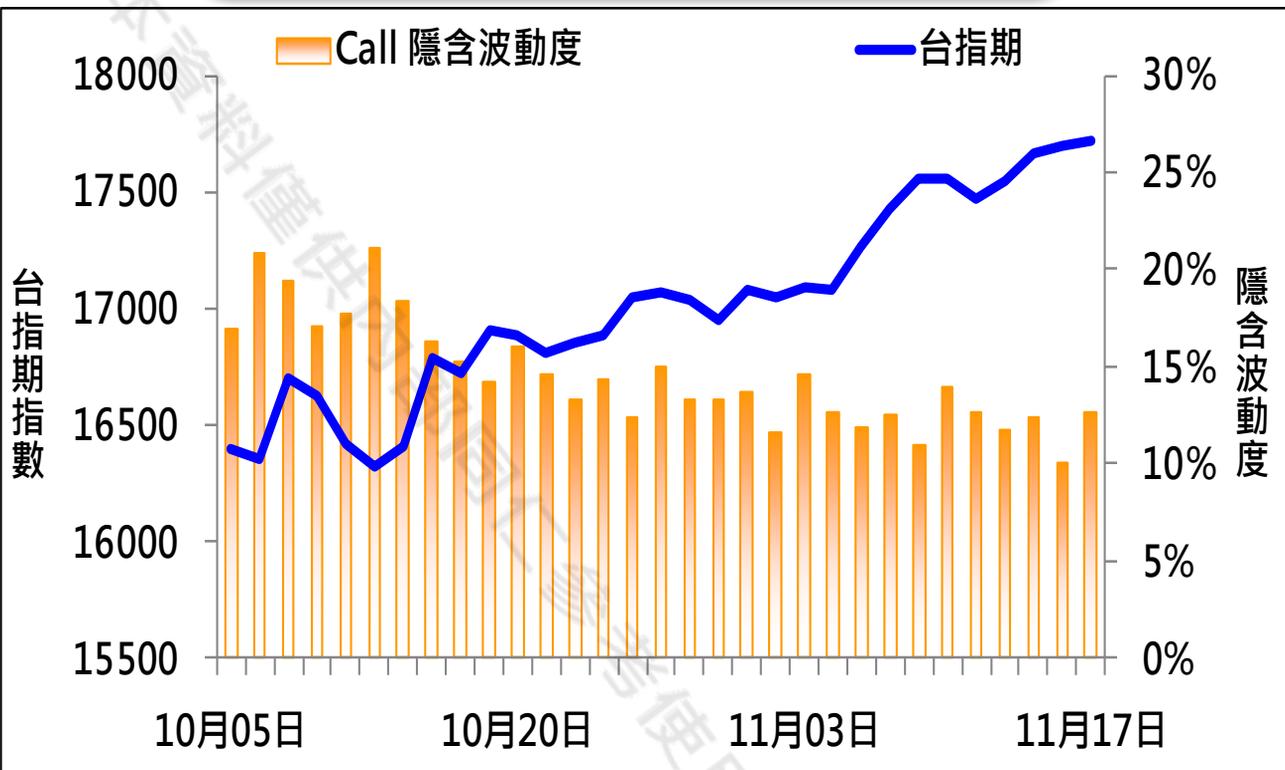
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/11/17

結算日：2021/11/24

OI 增減	Call	202111W4 履約價	Put	OI 增減
1	1	17,000	802	802
0	0	17,100	636	636
5	5	17,200	1,438	1,438
0	0	17,250	1,047	1,047
37	37	17,300	1,719	1,719
3	3	17,350	1,162	1,162
20	20	17,400	1,836	1,836
38	38	17,450	1,982	1,982
31	31	17,500	1,584	1,584
50	50	17,550	1,651	1,651
166	166	17,600	1,727	1,727
301	301	17,650	879	879
986	986	17,700	1,577	1,577
1,183	1,183	17,750	874	874
1,829	1,829	17,800	422	422
1,179	1,179	17,850	216	216
1,836	1,836	17,900	388	388
1,349	1,349	17,950	75	75
※ 3,742	3,742	18,000	130	130
1,851	1,851	18,050	9	9
1,981	1,981	18,100	8	8
1,126	1,126	18,150	8	8
623	623	18,200	24	24
438	438	18,300	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
18,865	18,865	1.2243	23,097	23,097

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：2021/11/17

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112月 履約價	Put	OI 增減
0	30	16,400	6,077	289
0	25	16,500	2,639	89
0	42	16,600	2,188	282
0	65	16,700	9,484	531
27	106	16,800	3,408	447
8	183	16,900	2,636	78
156	406	17,000	3,845	409
※ 897	1,806	17,100	2,546	938 ※
232	1,666	17,200	1,977	327
-20	474	17,300	967	144
10	426	17,400	1,039	316
21	1,421	17,500	921	134
112	1,755	17,600	700	227
93	2,570	17,700	553	228
-211	2,284	17,800	341	181
245	2,839	17,900	362	215
260	4,284	18,000	914	19
794	3,591	18,100	60	43
179	3,220	18,200	19	9
506	5,070	18,300	5	4
399	3,415	18,400	182	49
507	2,580	18,500	2	2
245	1,574	18,600	8	6
394	855	18,700	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,699	57,267	1.4306	81,926	8,195
昨日 P/C	1.4298	今日增減變化		0.0008

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。

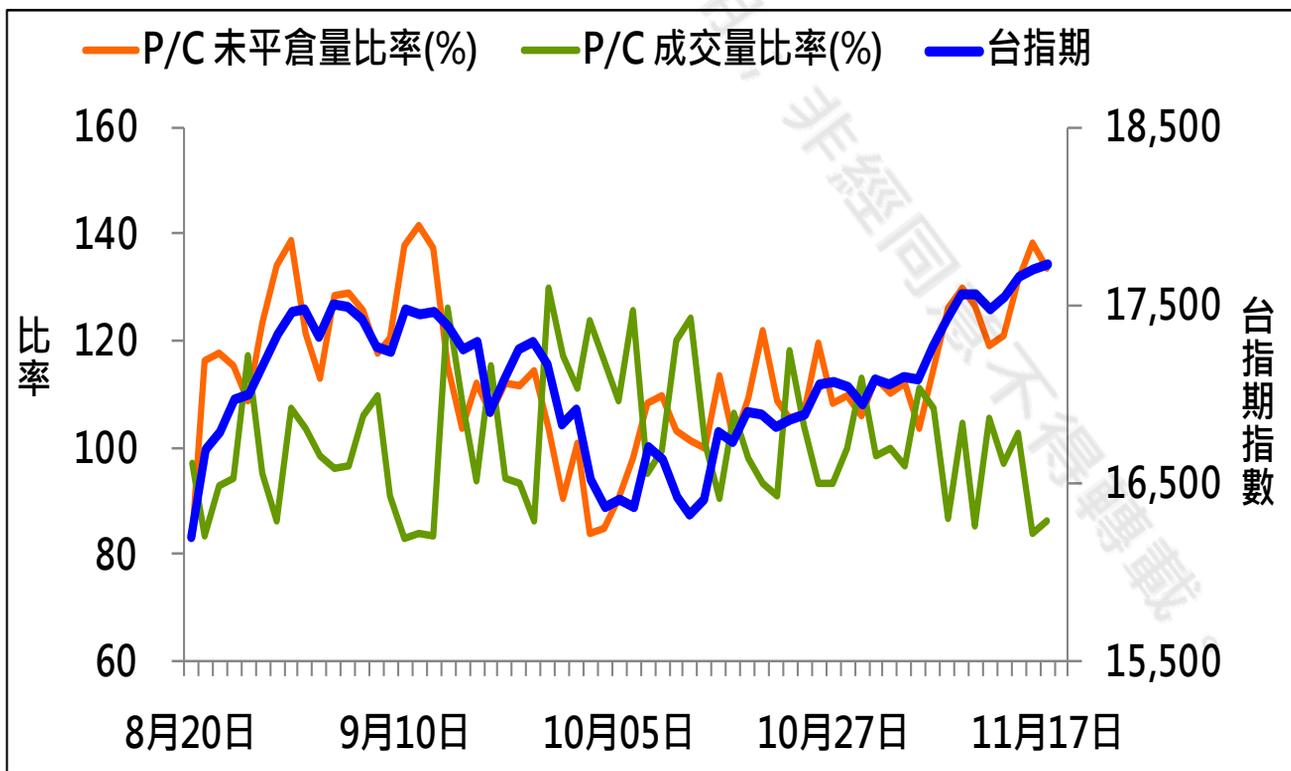
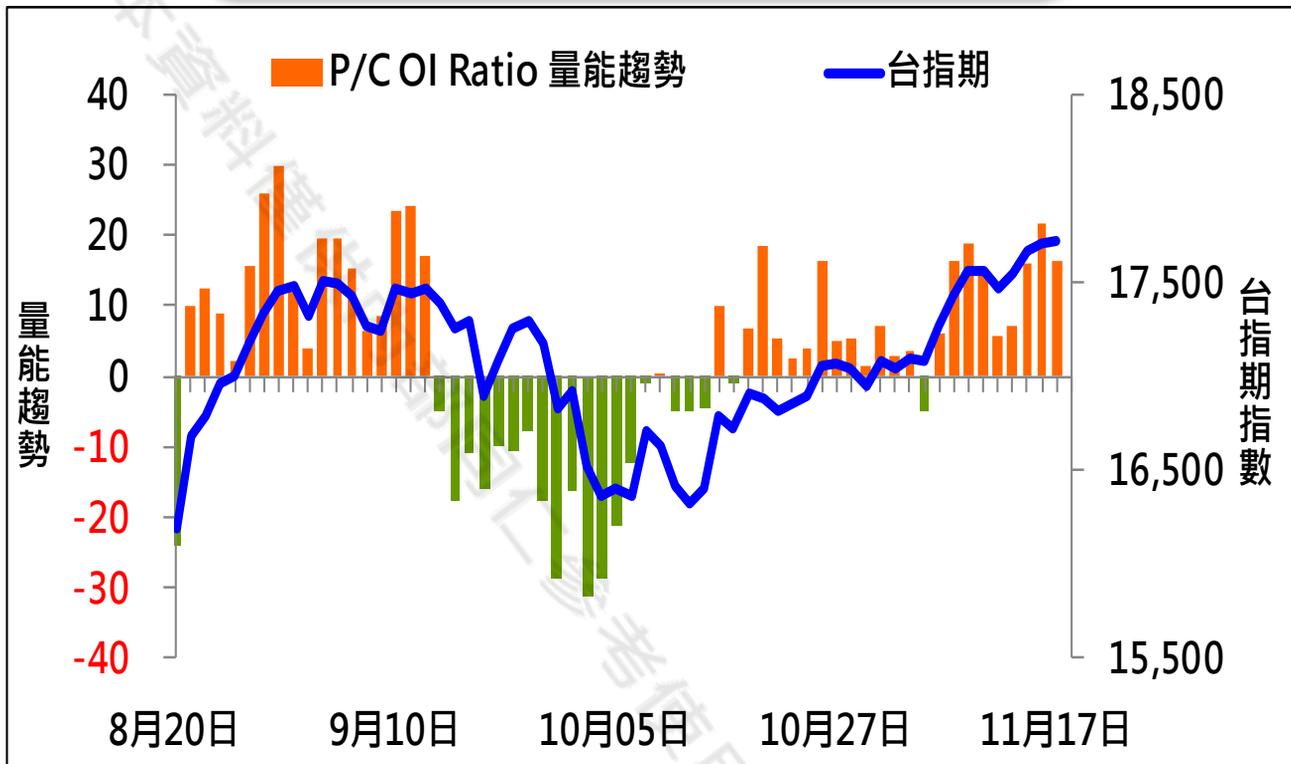
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/11/17 開 17711 高 17761 低 17678 收 17722 s 點量 52589 口 +24 (+0.14%)

SMA5 17620.20↑ SMA20 17242.25↑ SMA60 17084.20↑ SMA120 17204.37↑ SMA200 16871.44↑



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