



法人籌碼動態

12月06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	-24,030	-1,863	-172	-21	-2,066	-12
投信	-1,840	-6	646	0	12	0
自營商	14,053	386	-72	-24	388	43

12月06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	-123	-26	1,336	-841	31,421	5,615
投信	1	0	0	0	-50	0
自營商	93	32	-11,021	-9,397	17,652	8,284

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口	多	空
聯發科	13.00	台積電	-67.46	台指期前十大 市場佔比	48.5%	54.8%
長榮	12.90	日月光投控	-4.28			
萬海	9.52	南電	-4.20			
鴻海	6.76	聯電	-4.04	電子期前十大 市場佔比	62.8%	68.7%
陽明	4.33	矽力-KY	-3.81			
瑞昱	3.65	旭隼	-1.56			
聯詠	2.37	技嘉	-1.34	金融期前十大 市場佔比	57.2%	92.3%
兆豐金	1.99	南亞科	-1.31			
台泥	1.85	國巨	-1.21			
長榮航	1.75	創意	-1.18	非金電期前十大 市場佔比	91.4%	95.0%
前十名合計	58.13	後十名合計	-90.40			

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

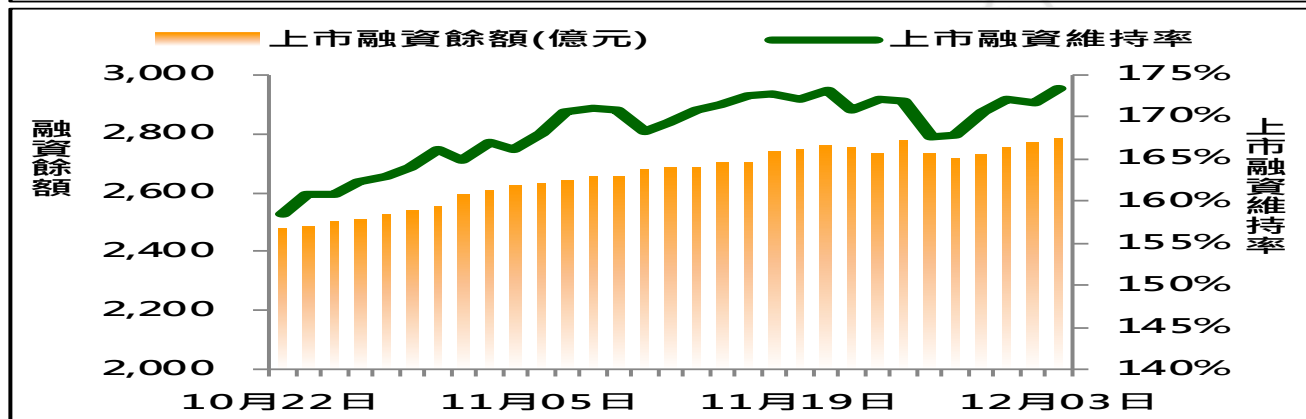
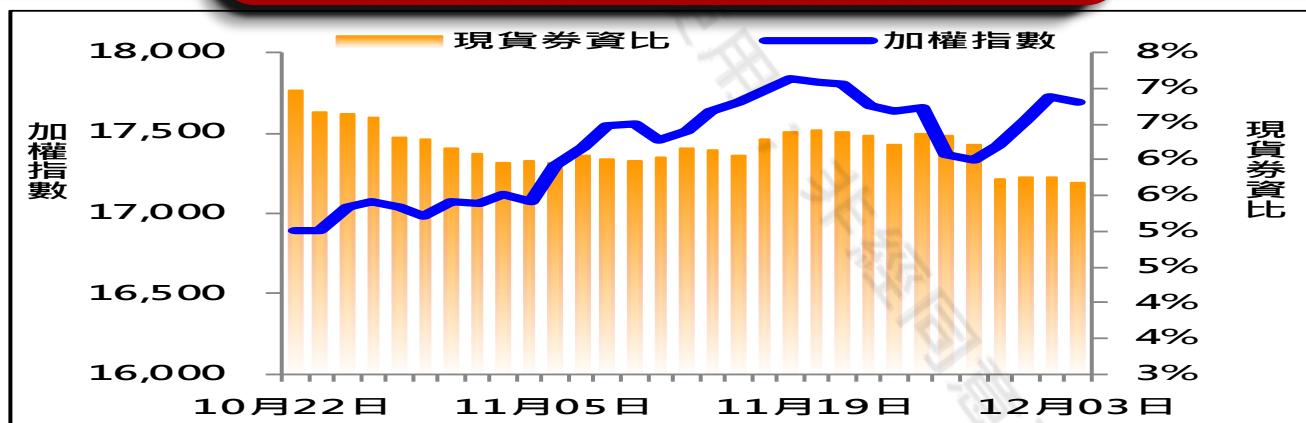


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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30日	-166.9	-21,794	-3,314	-23.1	14,555	1,780
12月01日	84.3	-21,574	220	19.4	13,705	-850
12月02日	126.3	-21,858	-284	-27.7	12,907	-798
12月03日	75.7	-22,167	-309	-3.3	13,667	760
12月06日	-78.5	-24,030	-1,863	-8.7	14,053	386

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30日	3,635	27,793	-24,158	-9,771	5,001	-14,772
12月01日	4,155	25,301	-21,146	-10,896	8,143	-19,039
12月02日	2,439	27,383	-24,944	659	3,424	-2,765
12月03日	2,177	25,806	-23,629	-1,624	9,368	-10,992
12月06日	1,336	31,421	-30,085	-11,021	17,652	-28,673

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。

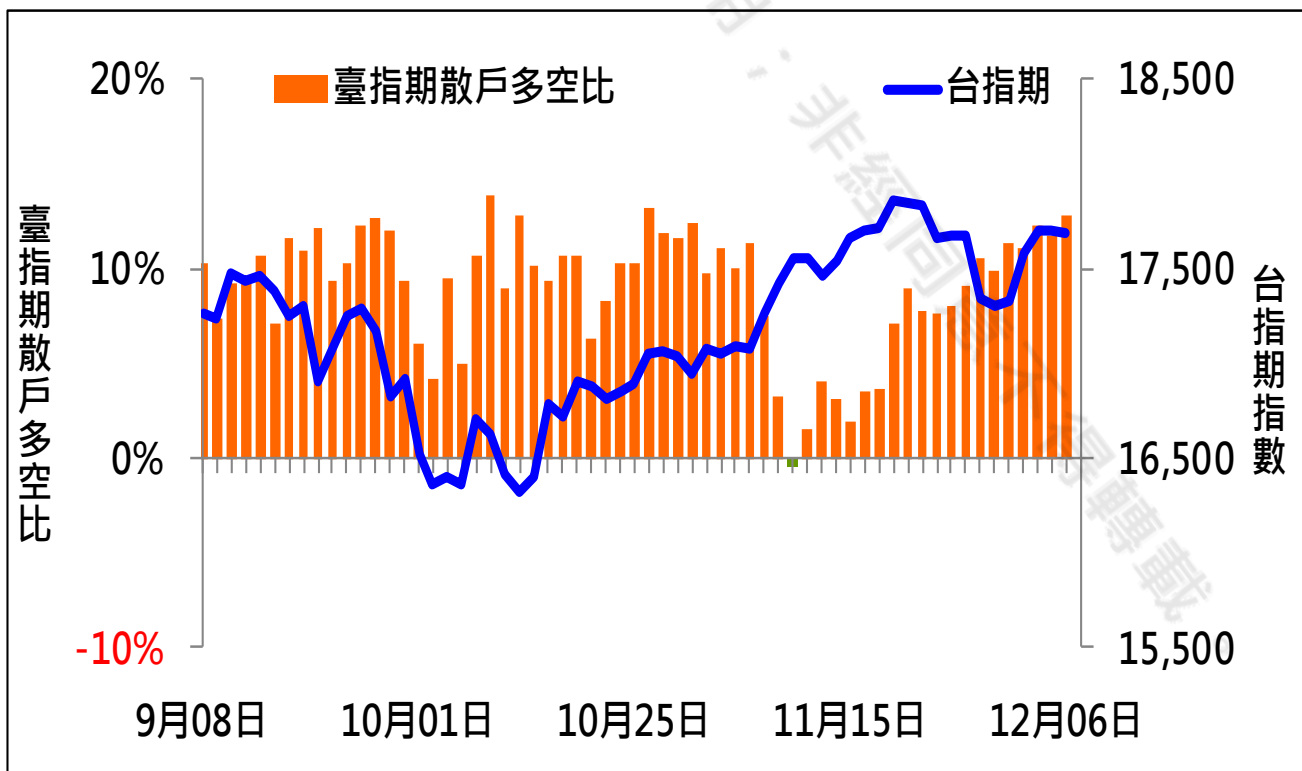
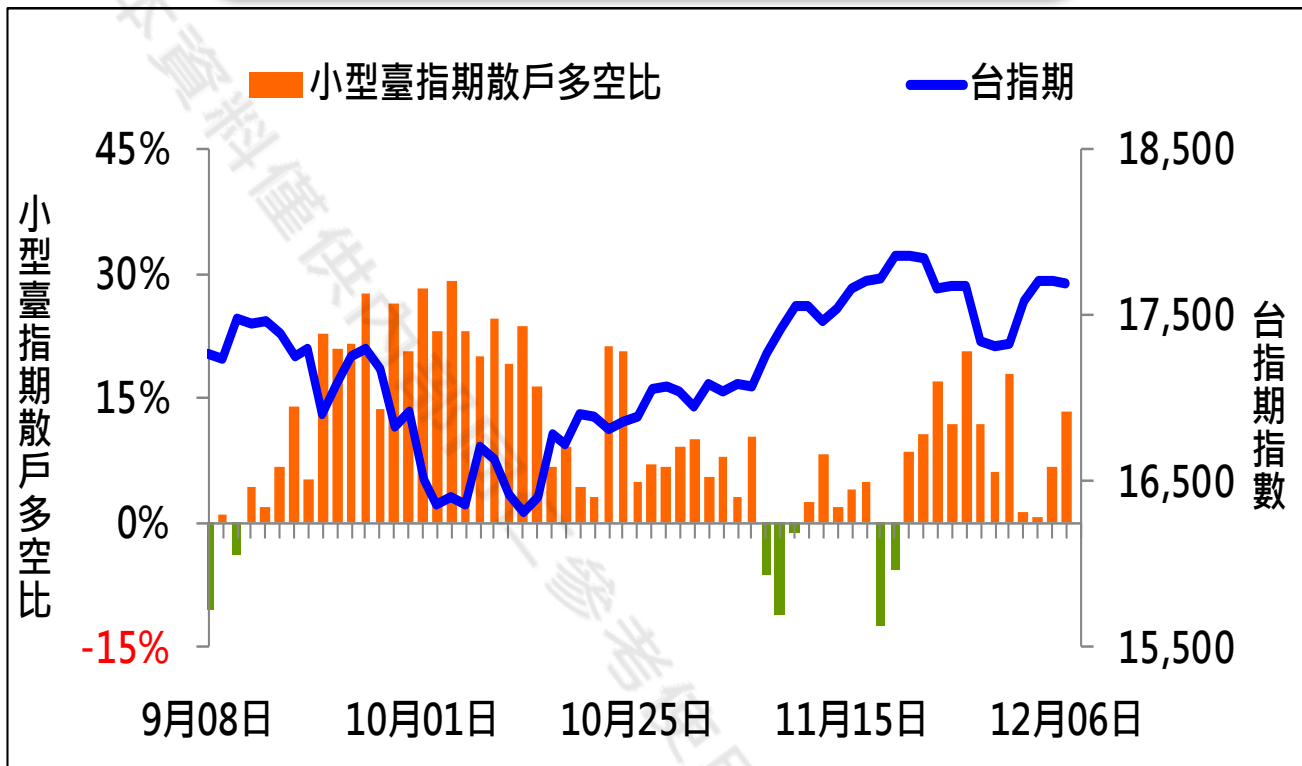
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

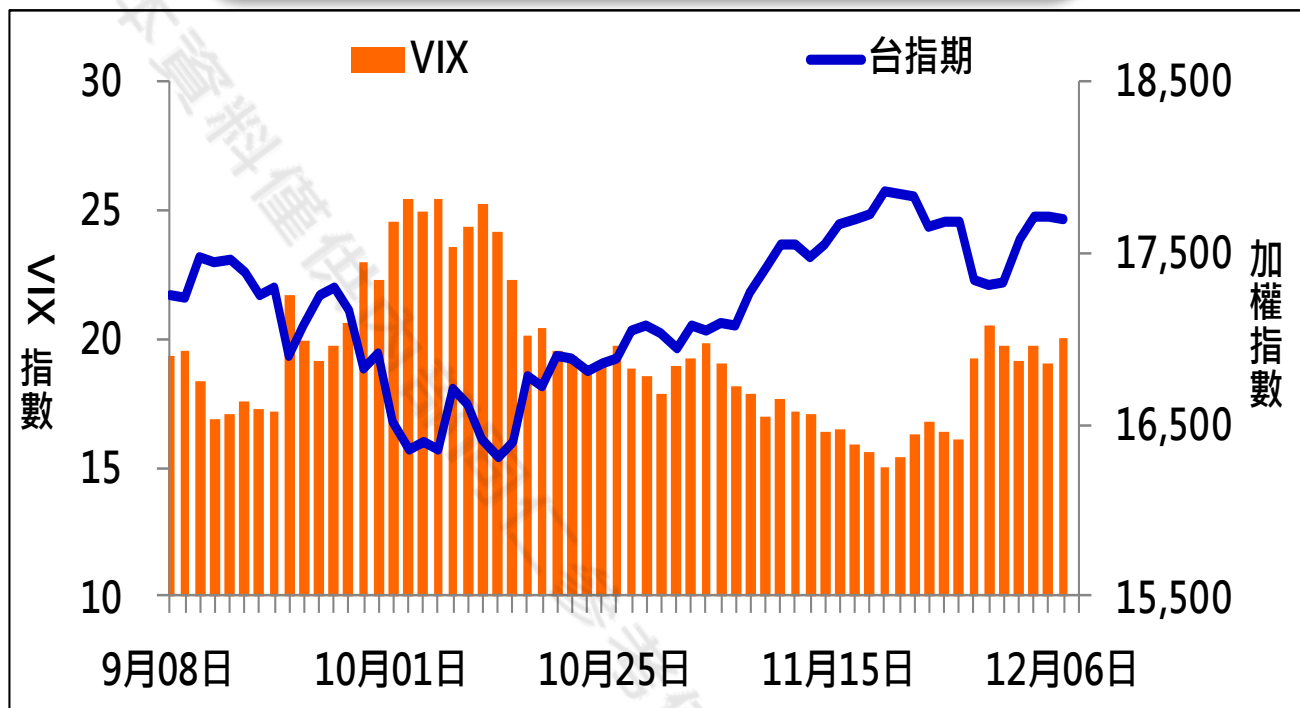
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

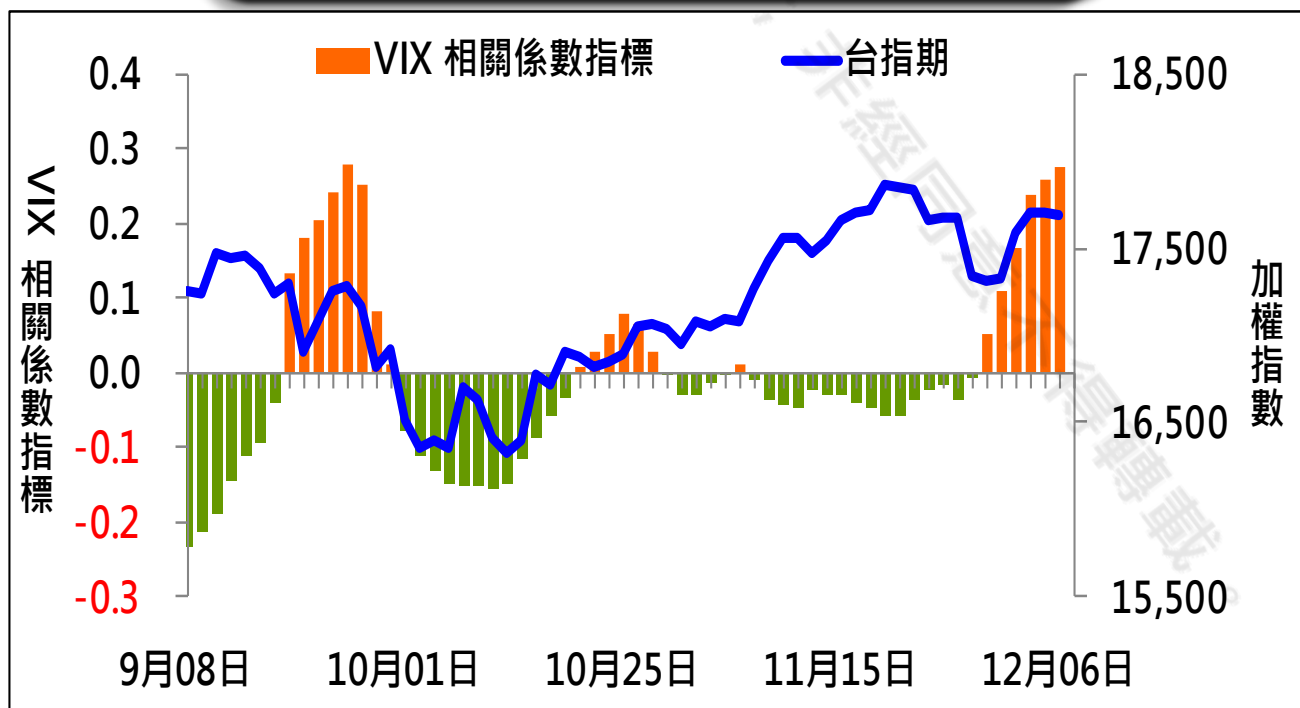
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

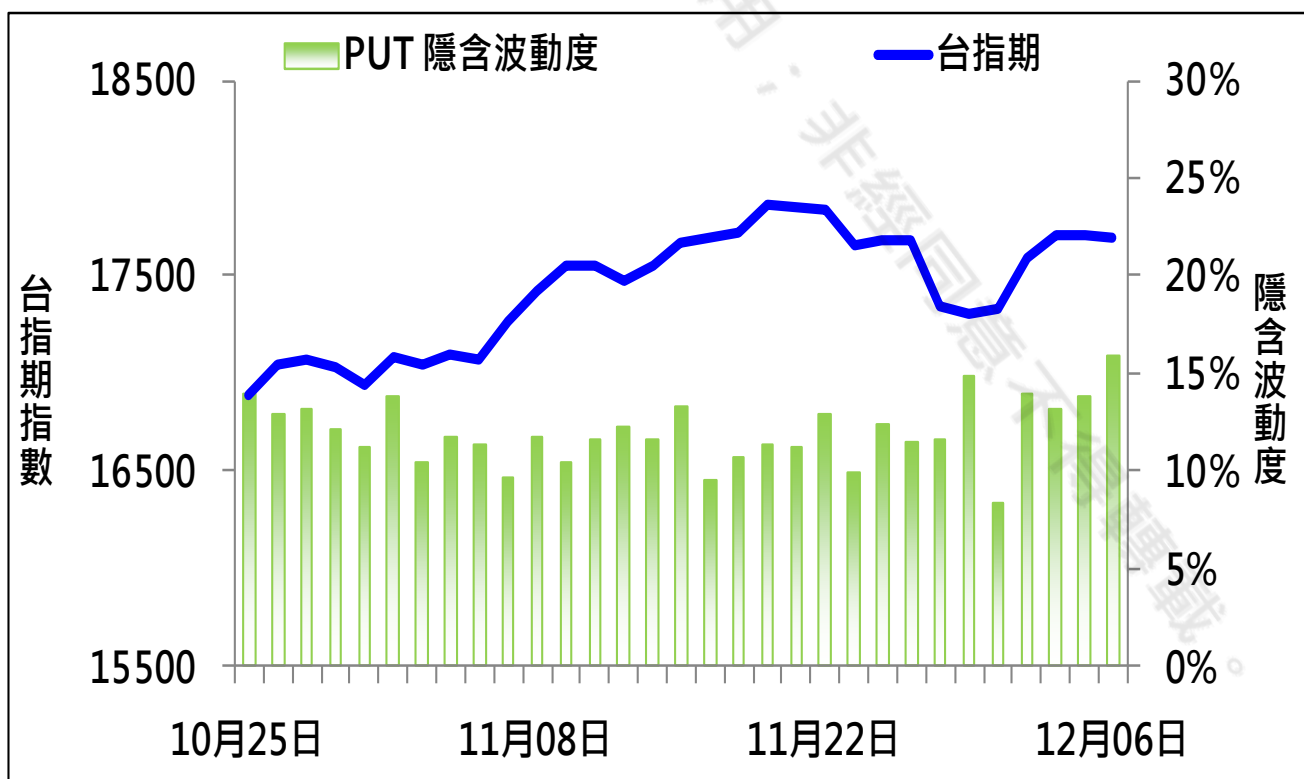
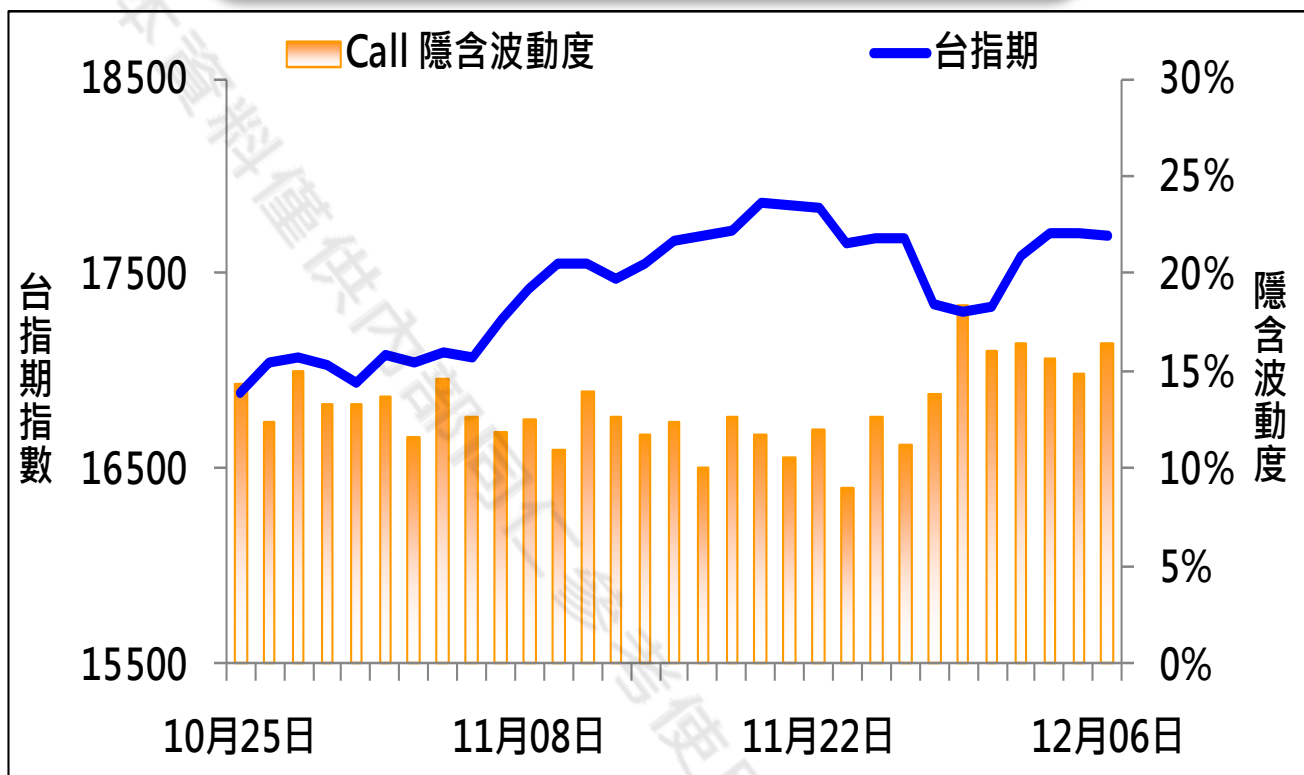
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/12/6

結算日：2021/12/8

OI 增減	Call	202112W2 履約價	Put	OI 增減
1	25	17,100	4,248	728
2	21	17,150	3,928	253
0	56	17,200	7,690	1,918
0	52	17,250	5,344	1,251
5	153	17,300	7,802	1,960
13	104	17,350	4,705	1,218
63	317	17,400	8,133	1,771
35	419	17,450	5,321	2,340
161	1,317	17,500	9,023	3,574
530	1,960	17,550	4,862	1,695
1,117	3,707	17,600	7,070	1,484
1,632	4,112	17,650	4,300	1,241
1,771	7,660	17,700	4,387	852
1,552	5,259	17,750	2,704	778
※ 4,464	9,915	17,800	1,781	478
1,507	5,729	17,850	907	347
3,329	9,736	17,900	415	15
2,971	7,477	17,950	186	64
3,107	13,407	18,000	131	-15
2,110	6,357	18,050	8	2
1,335	7,569	18,100	23	-1
657	1,384	18,150	1	0
809	3,563	18,200	7	0
159	394	18,250	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
28,215	95,379	1.1566	110,311	22,449

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：2021/12/6

結算日：2021/12/15

OI 增減	Call	202112 月 履約價	Put	OI 增減
0	4	16,300	5,275	-370
0	30	16,400	8,242	-1
0	30	16,500	4,771	-62
0	51	16,600	3,945	-170
-5	60	16,700	14,828	402
0	201	16,800	7,256	1,828
-6	237	16,900	4,713	243
4	707	17,000	10,800	1,332
-14	2,624	17,100	5,010	668
27	3,630	17,200	6,697	-470
18	1,463	17,300	5,769	693
-33	2,014	17,400	4,240	-58
79	2,686	17,500	4,137	702
384	3,818	17,600	4,262	247
201	5,762	17,700	3,343	54
693	9,244	17,800	2,144	-83
289	8,646	17,900	1,114	39
1,394	12,471	18,000	1,138	-8
998	7,329	18,100	201	22
538	8,163	18,200	97	5
※ 1,513	10,381	18,300	14	-1
53	8,797	18,400	226	0
44	7,396	18,500	7	0
56	3,828	18,600	8	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,214	119,940	1.3058	156,622	5,071
昨日 P/C	1.3326	今日增減變化		-0.0268

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。

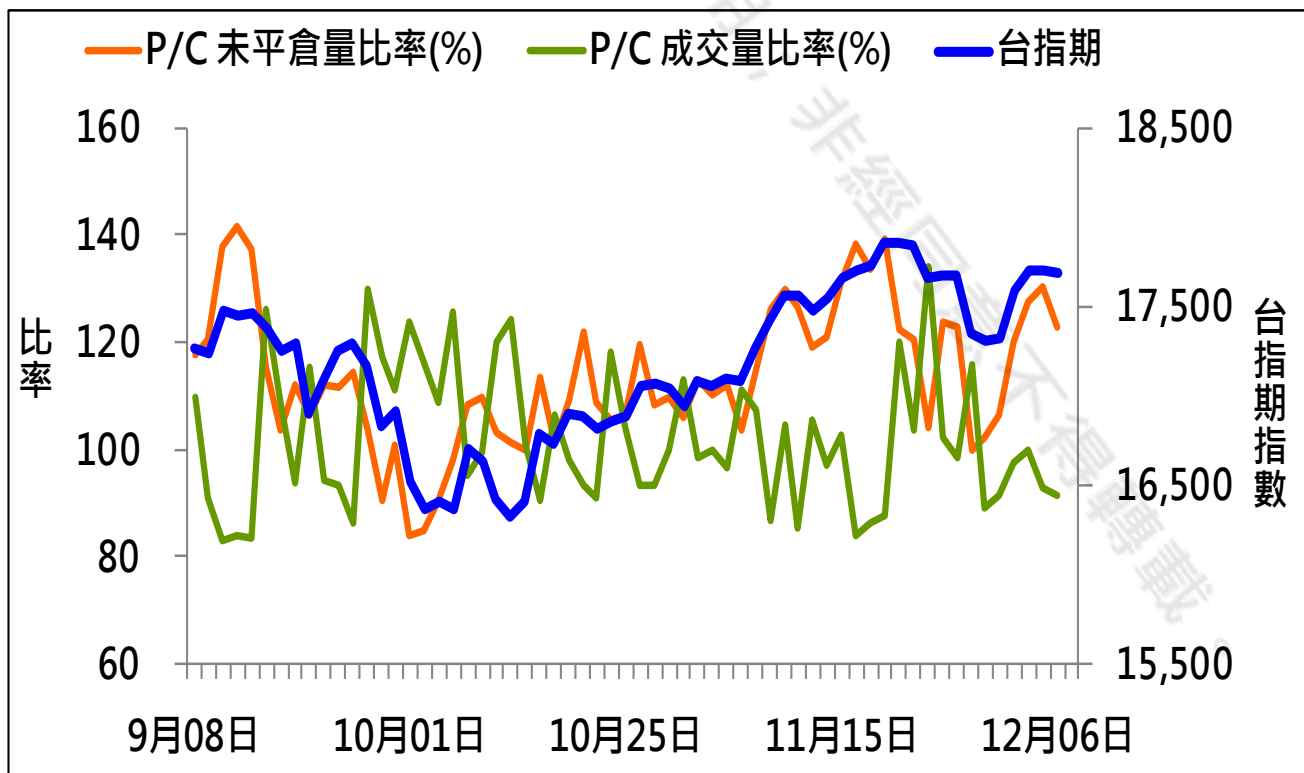
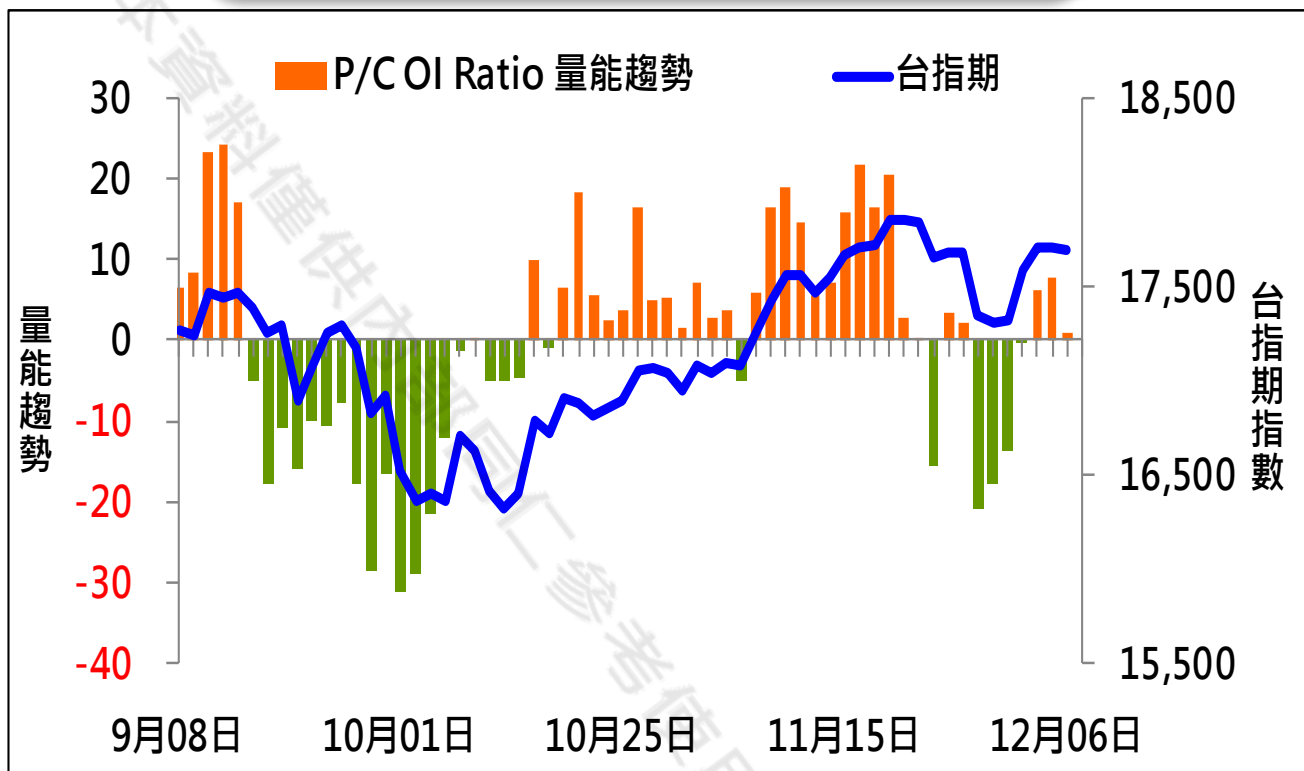
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/12/06 開 17619 高 17736 低 17527 收 17693 s 點 量 91121 口 -13 (-0.07%)

SMA5 17603.40 ↑ SMA20 17621.80 ↑ SMA60 17173.78 ↑ SMA120 17258.85 ↑ SMA200 16995.28 ↑



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