

法人籌碼動態

12月11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	-7,881	-2,313	-204	-35	-303	-17
投信	8,619	715	161	1	8	0
自營商	-1,227	1,081	-2	46	-99	1
12月11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	-16	4	32,760	-1,322	32,399	1,929
投信	0	0	0	0	19	0
自營商	42	-5	-4,423	-7,901	28,943	-2,321

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	33.16	創意	-3.00	台指期前十大 市場佔比	46.9%	50.2%
世芯-KY	4.07	金像電	-2.75			
研華	3.15	華城	-2.34			
長榮	2.37	鴻海	-2.22	電子期前十大 市場佔比	56.8%	58.8%
大立光	2.13	中鋼	-2.02			
日月光投控	2.10	威盛	-1.99			
聯電	2.00	光寶科	-1.89	金融期前十大 市場佔比	52.9%	73.7%
國巨	1.76	遠傳	-1.88			
欣興	1.71	台達電	-1.66			
中華	1.42	群光	-1.58	非金電期前十大 市場佔比	95.5%	91.0%
前十名合計	53.87	後十名合計	-21.32			

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 (112)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

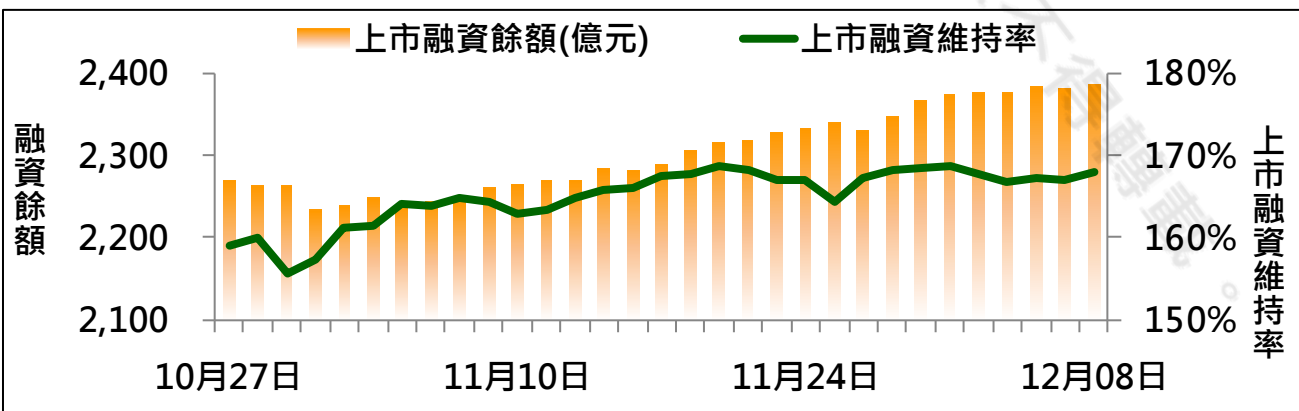
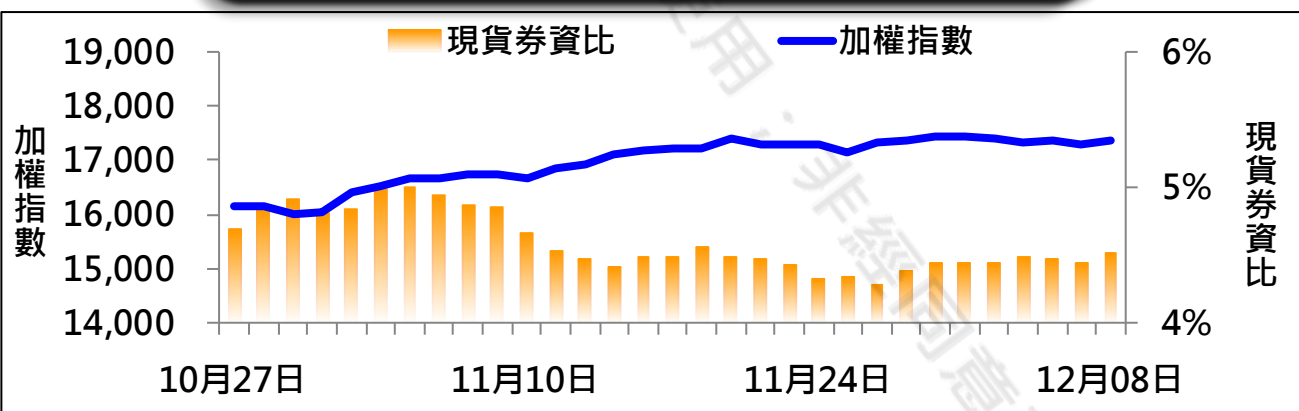
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所

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)
12月05日	-104.5	-5,906	-1,553	-60.5	-1,598	76
12月06日	2.3	-6,349	-443	-10.2	-1,571	27
12月07日	-51.6	-7,320	-971	-55.7	-869	702
12月08日	152.1	-5,568	1,752	-35.9	-2,308	-1,439
12月11日	11.9	-7,881	-2,313	-33.0	-1,227	1,081

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
12月05日	30,265	26,585	3,680	2,954	39,918	-36,964
12月06日	30,679	26,037	4,642	-1,516	36,872	-38,388
12月07日	30,993	29,656	1,337	-4,682	46,567	-51,249
12月08日	34,082	30,470	3,612	3,478	31,264	-27,786
12月11日	32,760	32,399	361	-4,423	28,943	-33,366

現貨券資比 & 上市融資維持率



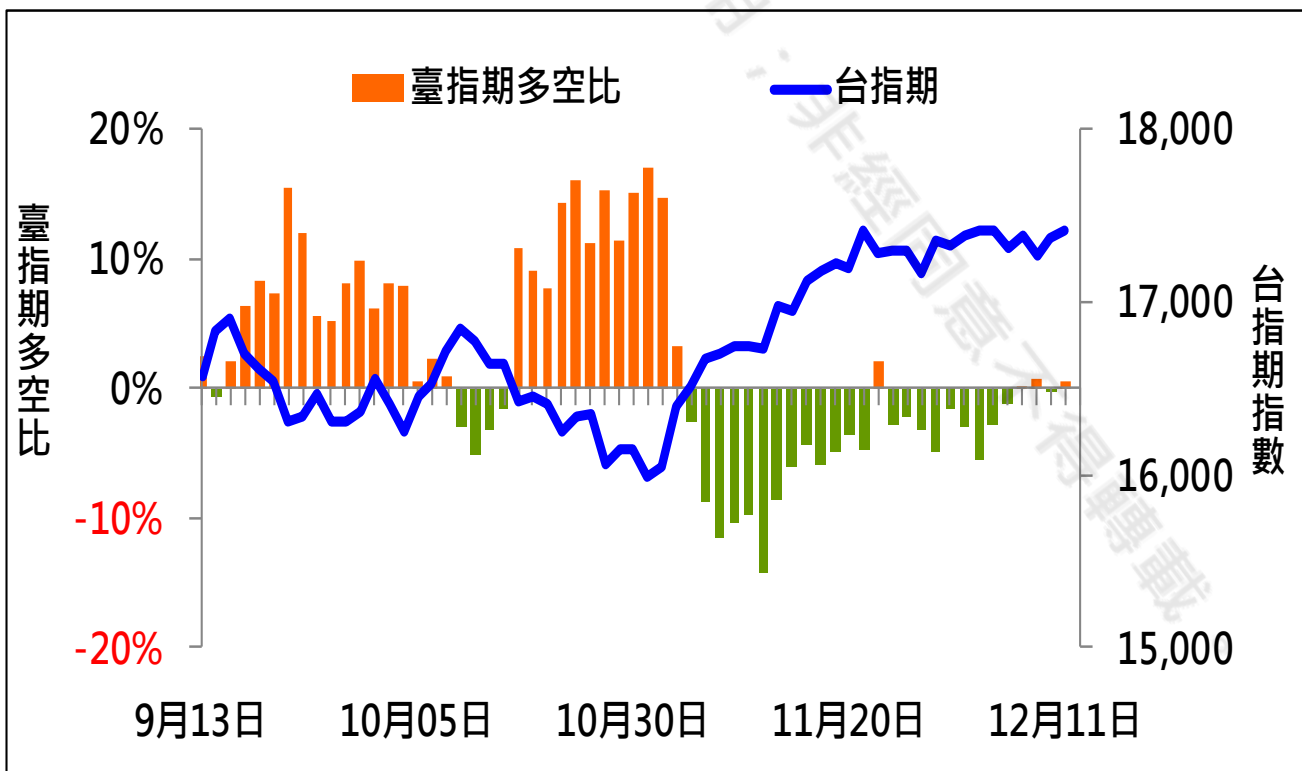
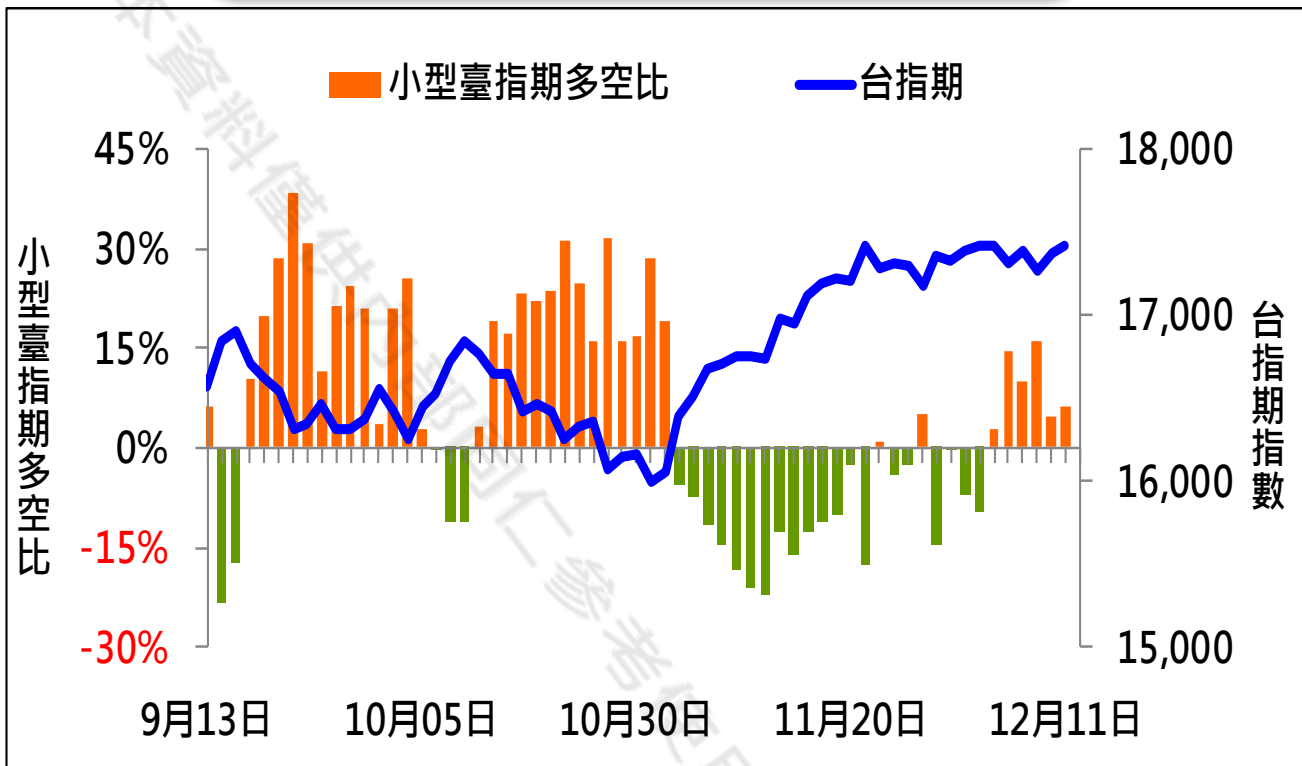
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年管期總字第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



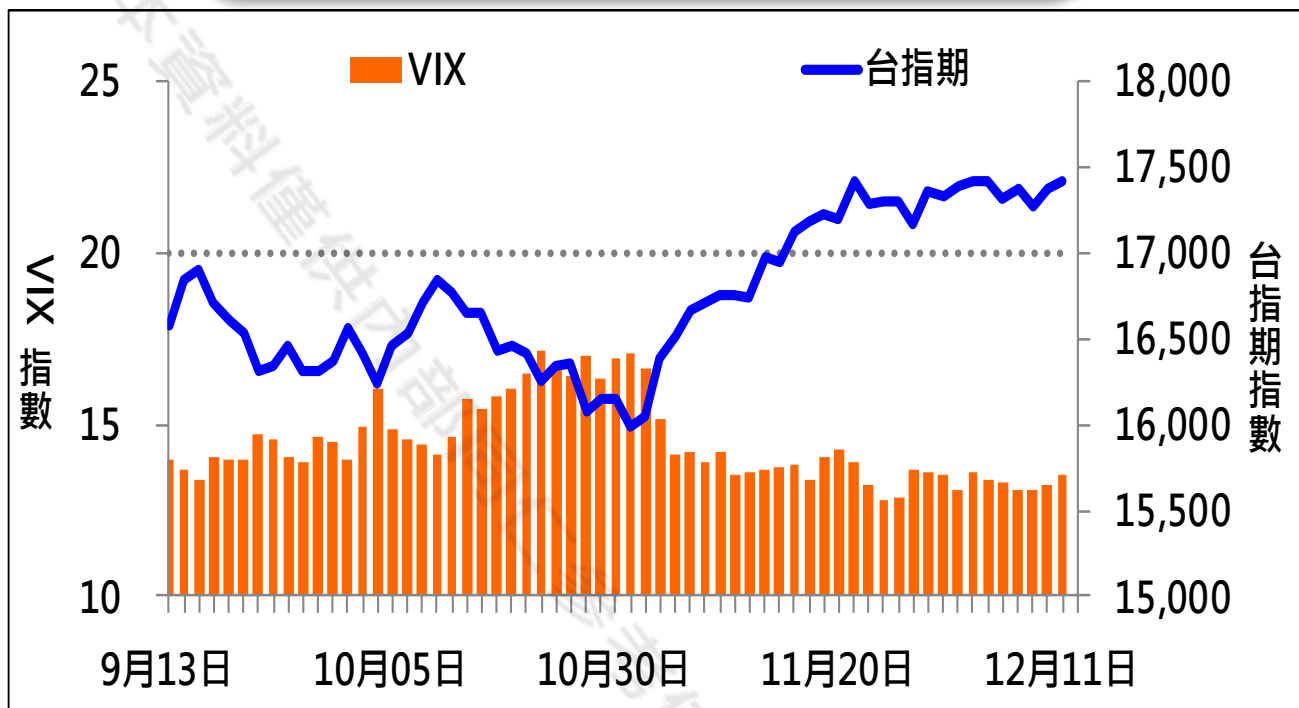
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)年金管期總字第007號

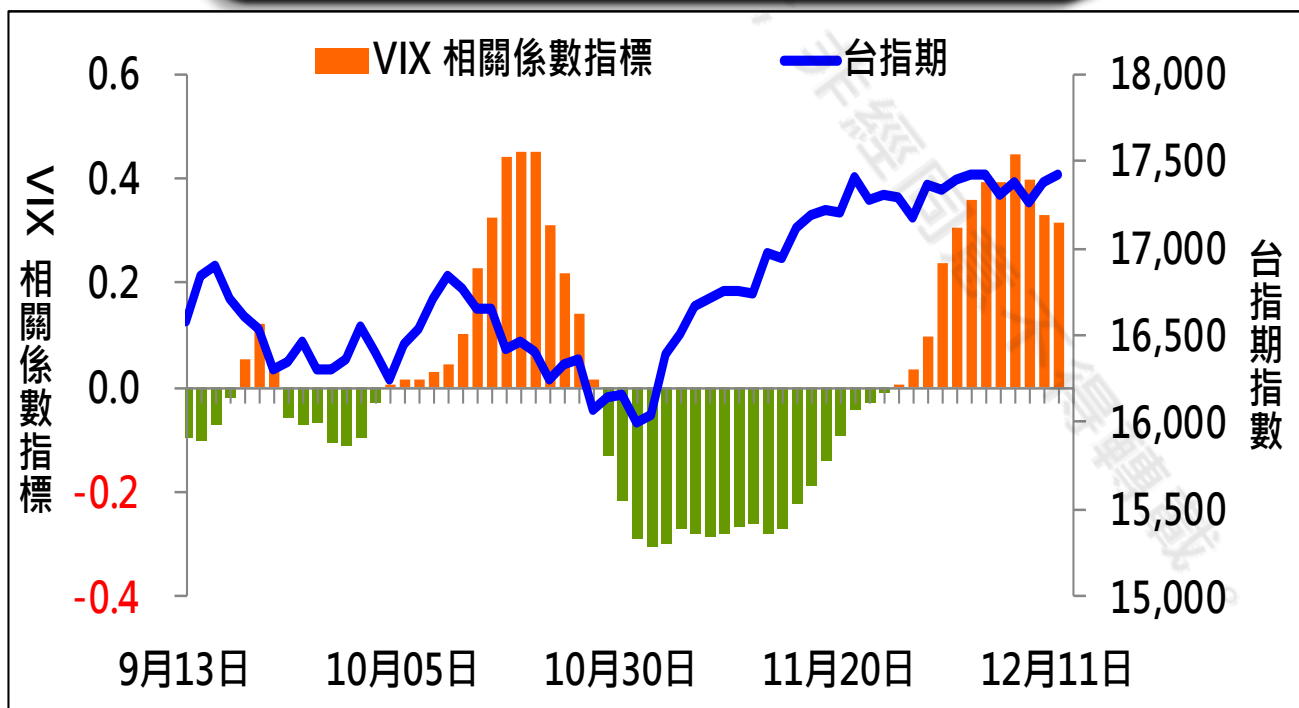
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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



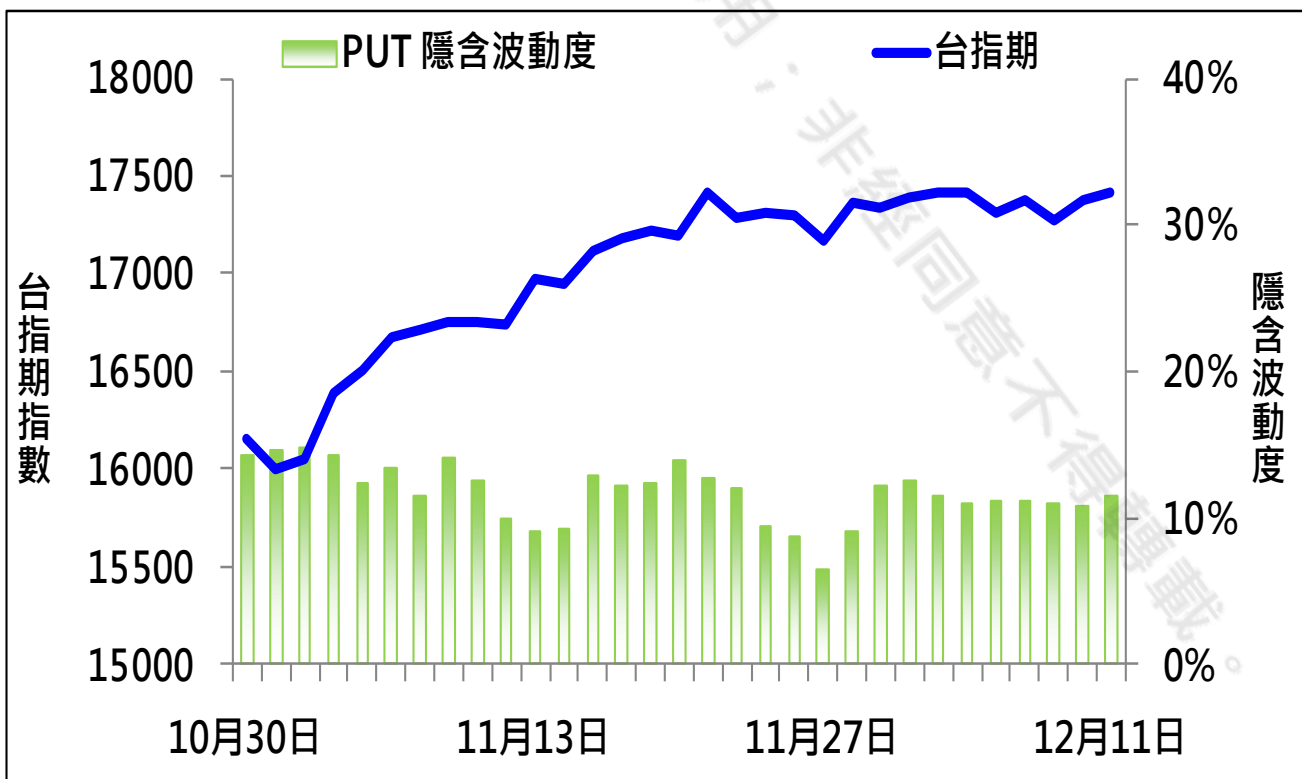
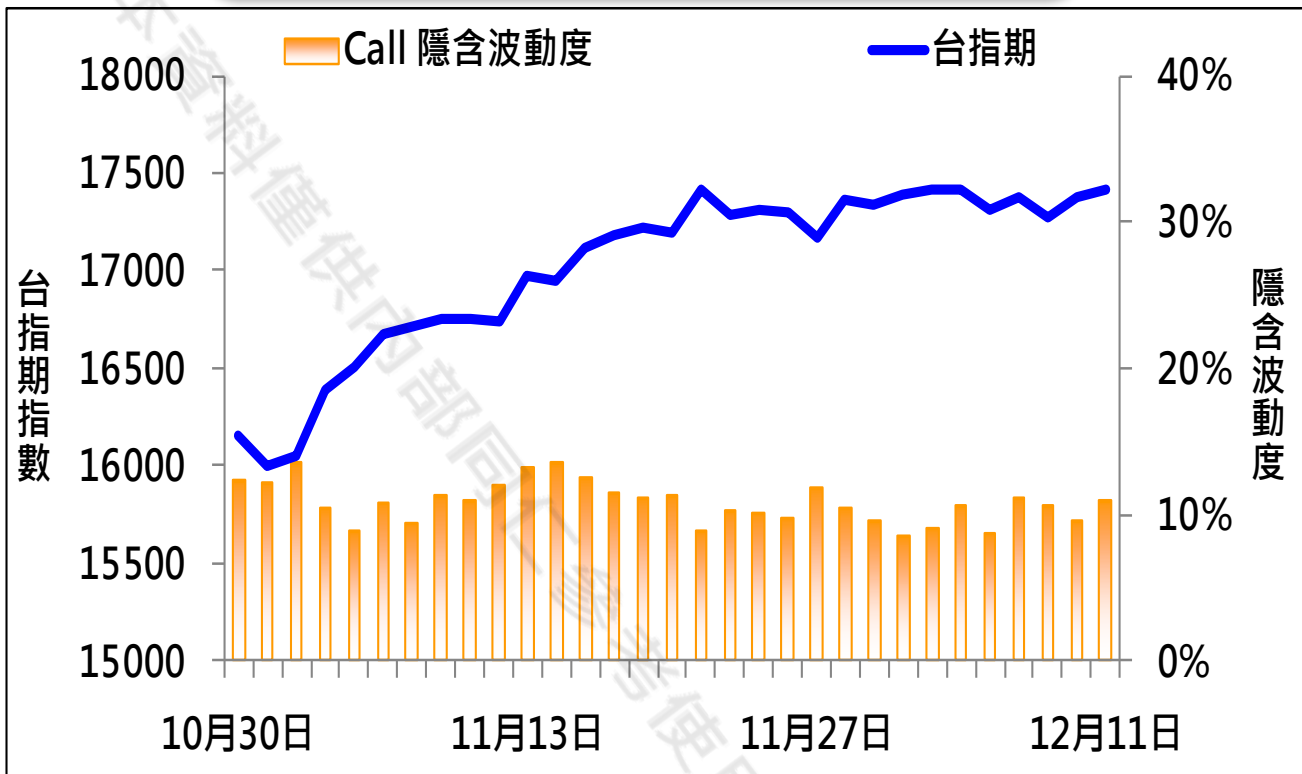
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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

資料日期：2023/12/11

結算日：2023/12/13

OI 增減	Call	202312W2 履約價	Put	OI 增減
4	39	16,850	4,512	342
-5	50	16,900	4,648	-469
0	9	16,950	6,030	185
4	91	17,000	10,298	591
7	76	17,050	7,395	-143
-41	155	17,100	10,454	208
-7	246	17,150	11,428	-334
-91	818	17,200	16,083	5,700
51	1,263	17,250	12,913	2,520
52	1,794	17,300	10,288	2,584
538	3,737	17,350	7,212	2,293
234	5,727	17,400	7,094	2,427
2,421	8,729	17,450	2,493	820
※ 3,229	10,920	17,500	1,443	528
3,017	10,309	17,550	514	-182
2,819	13,722	17,600	762	303
309	10,089	17,650	73	22
-146	10,848	17,700	118	-31
650	5,422	17,750	12	1
369	5,157	17,800	10	-1
96	2,840	17,850	4	3
42	3,478	17,900	13	1
111	3,165	17,950	5	5
13,569	102,458	總計	125,964	18,211
P/C	1.2294		增減	0.0172

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 (112)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

資料日期：2023/12/11

結算日：2024/1/17

OI 增減	Call	202401 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	-	0	0
0	8	16,200	565	27
0	6	16,300	819	104
-2	2,011	16,400	2,905	71
0	57	16,500	1,530	56
0	57	16,600	2,925	214
0	79	16,700	1,738	68
8	58	16,800	2,497	116
0	61	16,900	2,574	42
4	396	17,000	1,376	168
1	615	17,100	748	183
0	1,130	17,200	1,241	304
20	602	17,300	1,360	267
16	3,237	17,400	3,804	201
71	1,183	17,500	142	13
-9	1,986	17,600	88	11
14	971	17,700	86	25
※ 114	3,286	17,800	60	8
16	3,128	17,900	26	0
218	4,270	18,000	23	0
456	1,543	18,100	2	0
117	2,236	18,200	1	0
29	970	18,300	0	0
110	1,297	18,400	1	0
1,643	37,122	總計	35,103	2,869
P/C	0.9456		增減	0.0371

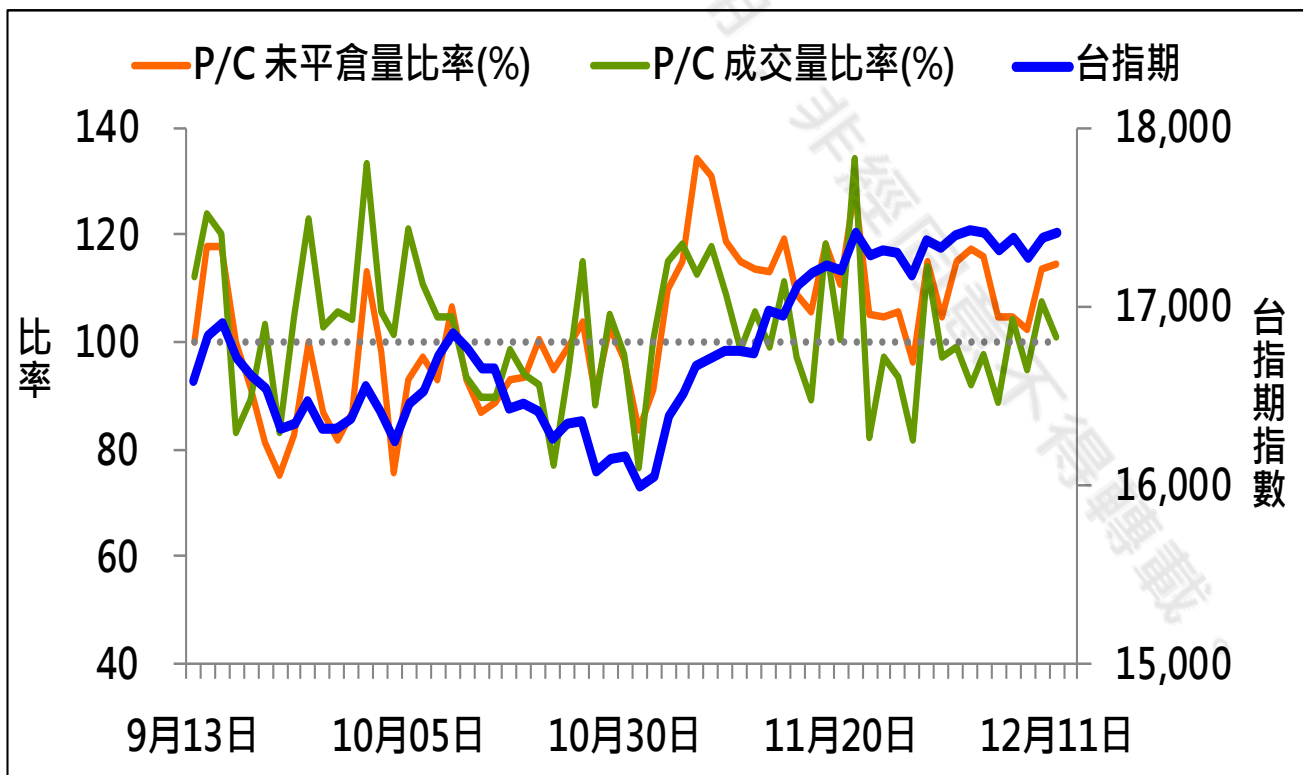
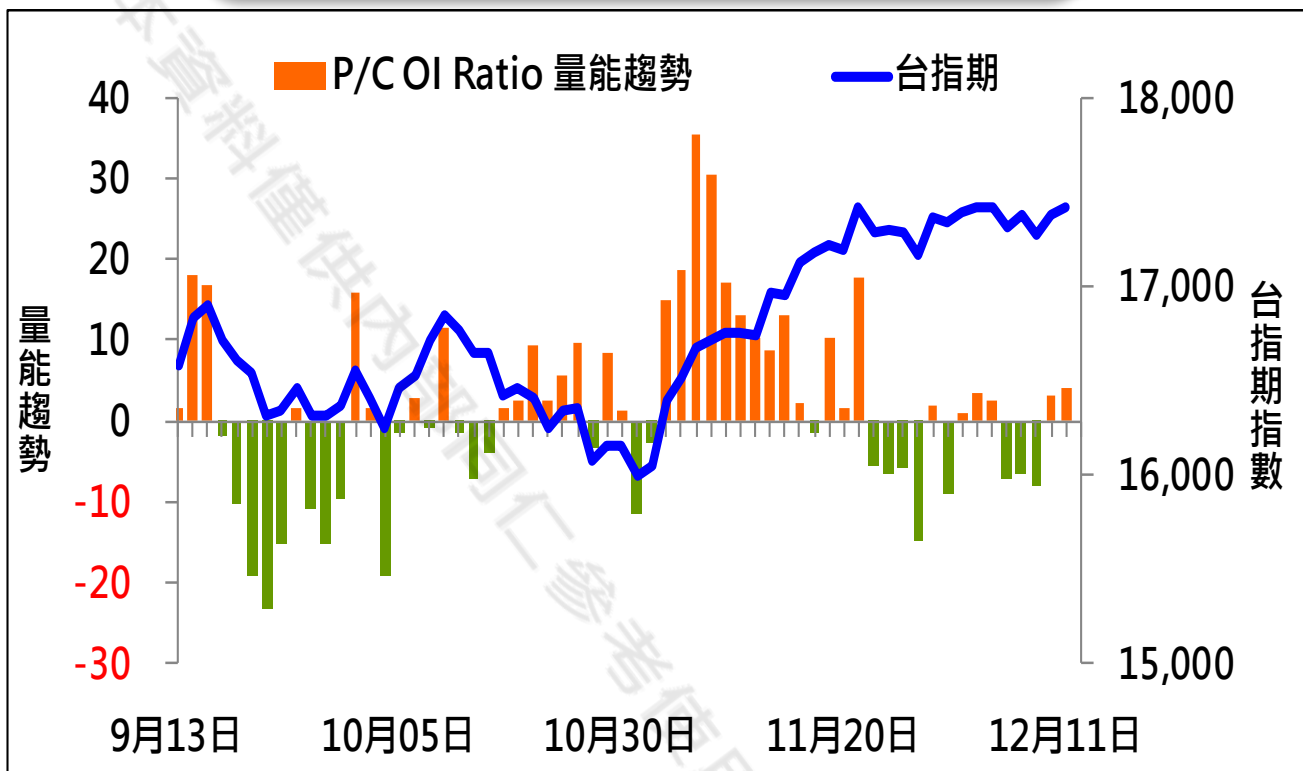
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (112)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 (112)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)(FITX*1) 日線圖 2023/12/11 收 **17418** s點 量 65150 口 +43 (+0.25%)



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 (112)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