



## 法人籌碼動態

09月02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	-15,805	4,394	129	-144	-1,625	61
投信	823	-369	210	0	24	0
自營商	7,676	-750	369	105	170	10

09月02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	-253	-13	-10,989	-208	20,277	936
投信	2	0	0	0	-62	0
自營商	229	0	6,438	2,075	9,791	4,335

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	3.13	台積電	-51.00	台指期前十大 市場佔比	47.2%	53.8%
鴻海	2.27	富邦金	-5.65			
亞德客-KY	1.74	中鋼	-3.88	電子期前十大 市場佔比	67.4%	68.3%
長榮	1.71	台達電	-2.98			
中華電	1.27	南電	-2.75			
緯穎	0.92	南亞	-2.60	金融期前十大 市場佔比	67.7%	86.9%
智邦	0.92	台塑	-2.50			
陽明	0.86	國泰金	-2.41	非金電期前十大 市場佔比	92.7%	97.0%
玉山金	0.82	台化	-2.31			
威鋒電子	0.82	和泰車	-2.15			
前十名合計	14.46	後十名合計	-78.24			

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

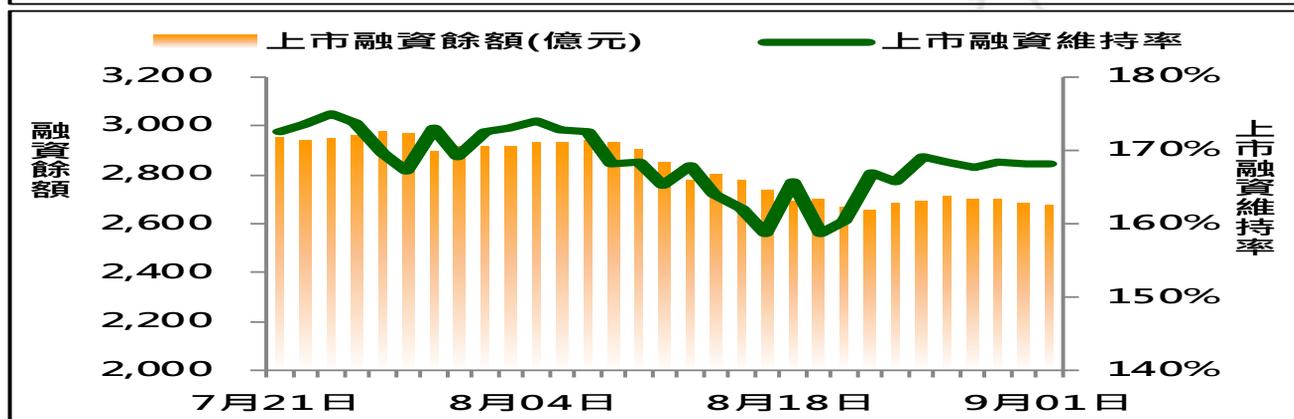
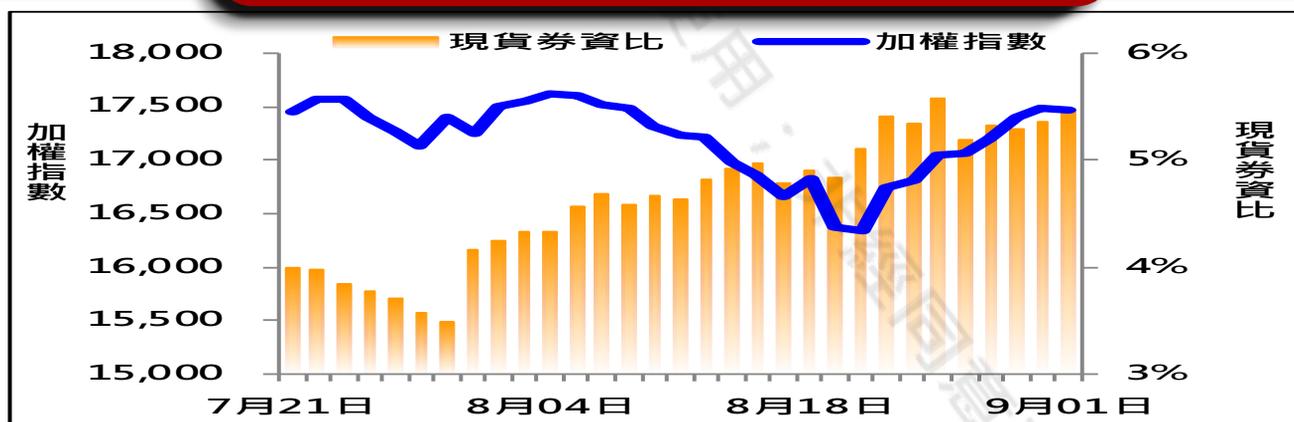


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
08月27日	182.3	-17,571	2,358	54.0	9,292	-2,043
08月30日	212.3	-19,298	-1,727	19.1	9,313	21
08月31日	242.6	-19,164	134	13.2	8,307	-1,006
09月01日	145.8	-20,199	-1,035	29.9	8,426	119
09月02日	-24.0	-15,805	4,394	-4.8	7,676	-750

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
08月27日	-9,383	11,343	-20,726	16,378	3,725	12,653
08月30日	-11,447	16,984	-28,431	16,974	2,137	14,837
08月31日	-11,275	19,007	-30,282	11,309	2,169	9,140
09月01日	-10,781	19,341	-30,122	4,363	5,456	-1,093
09月02日	-10,989	20,277	-31,266	6,438	9,791	-3,353

## 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。

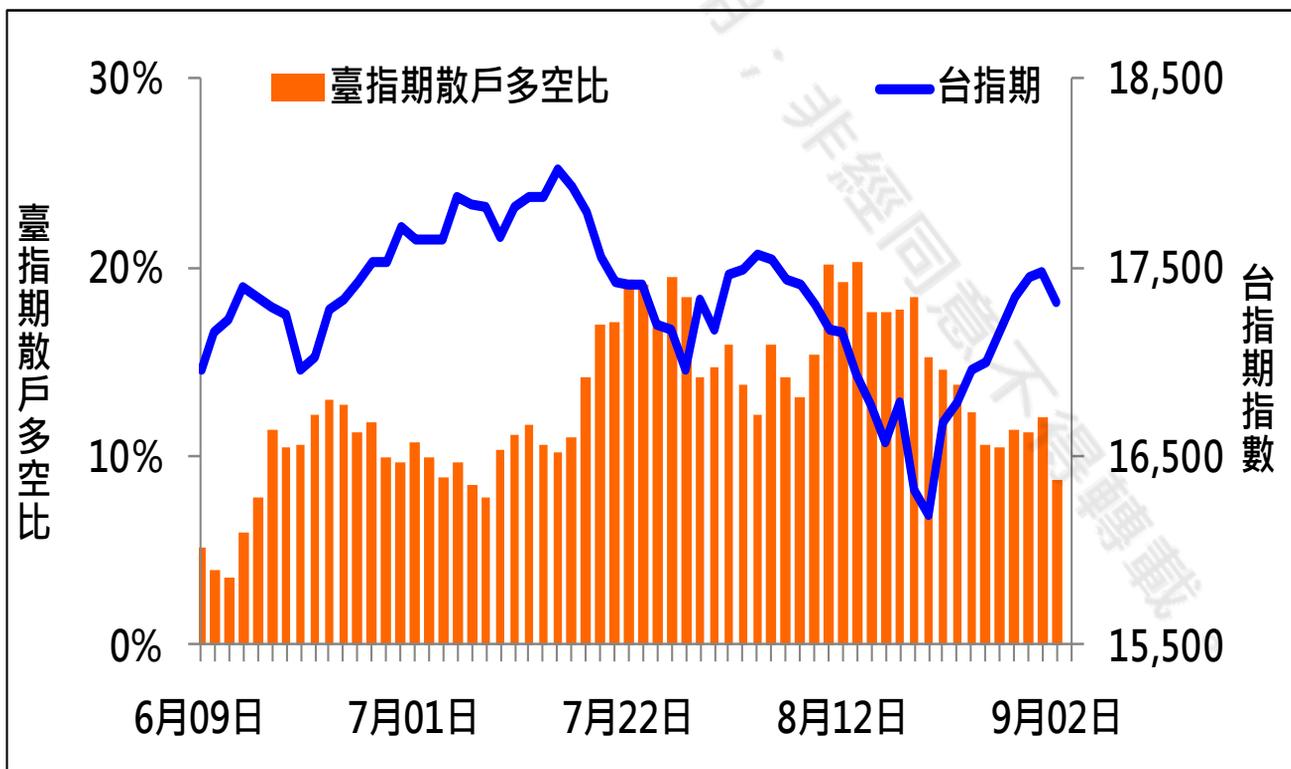
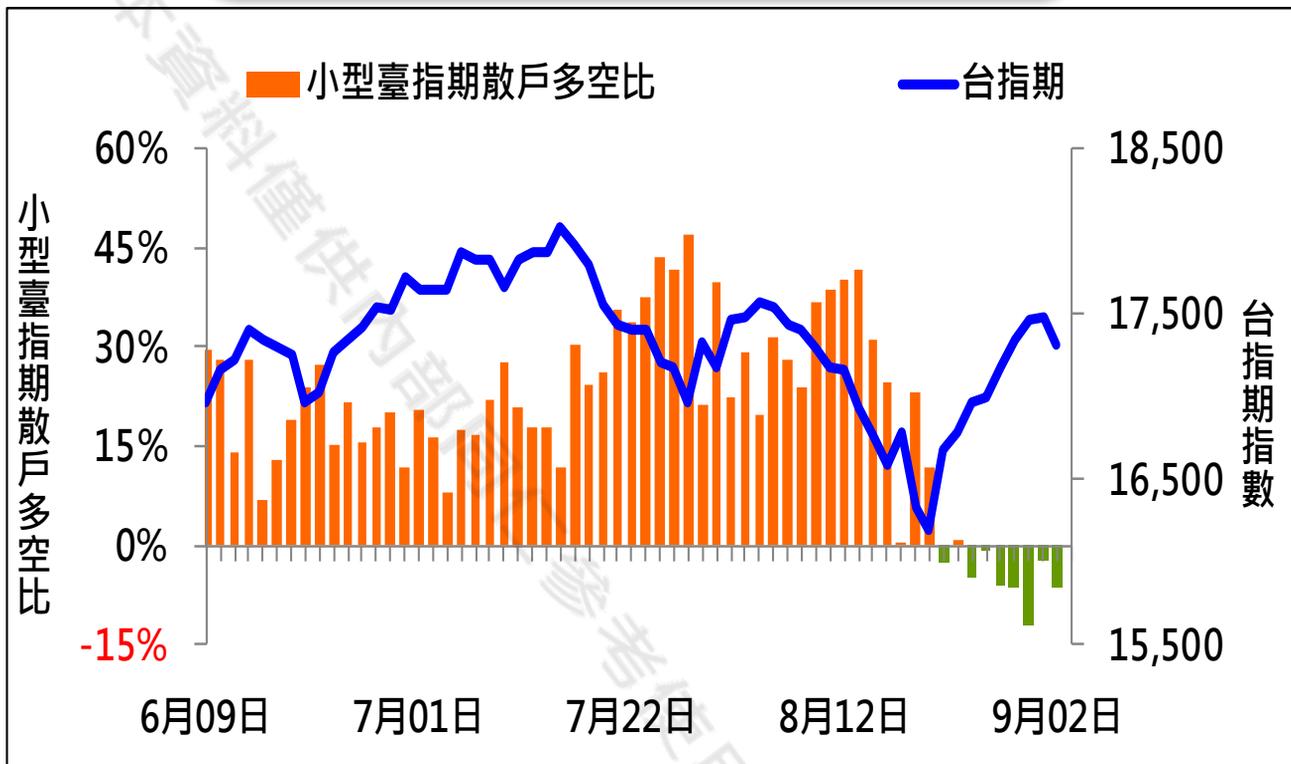
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



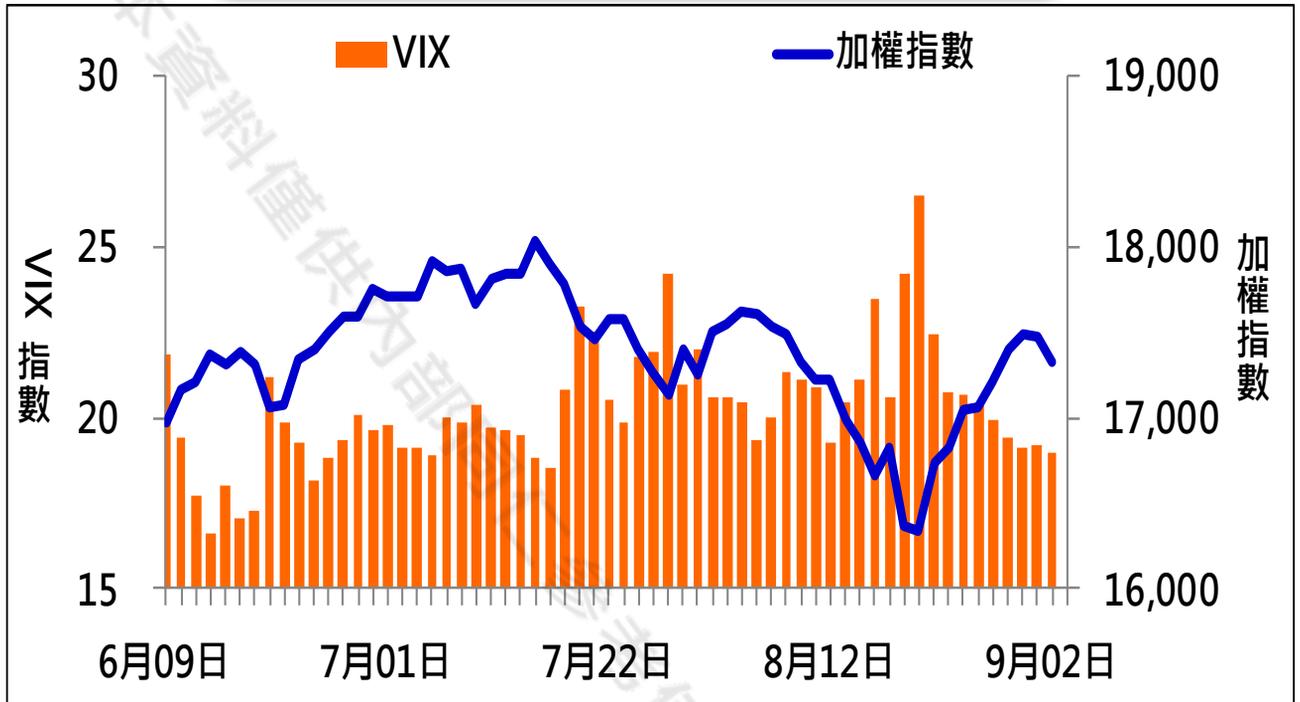
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

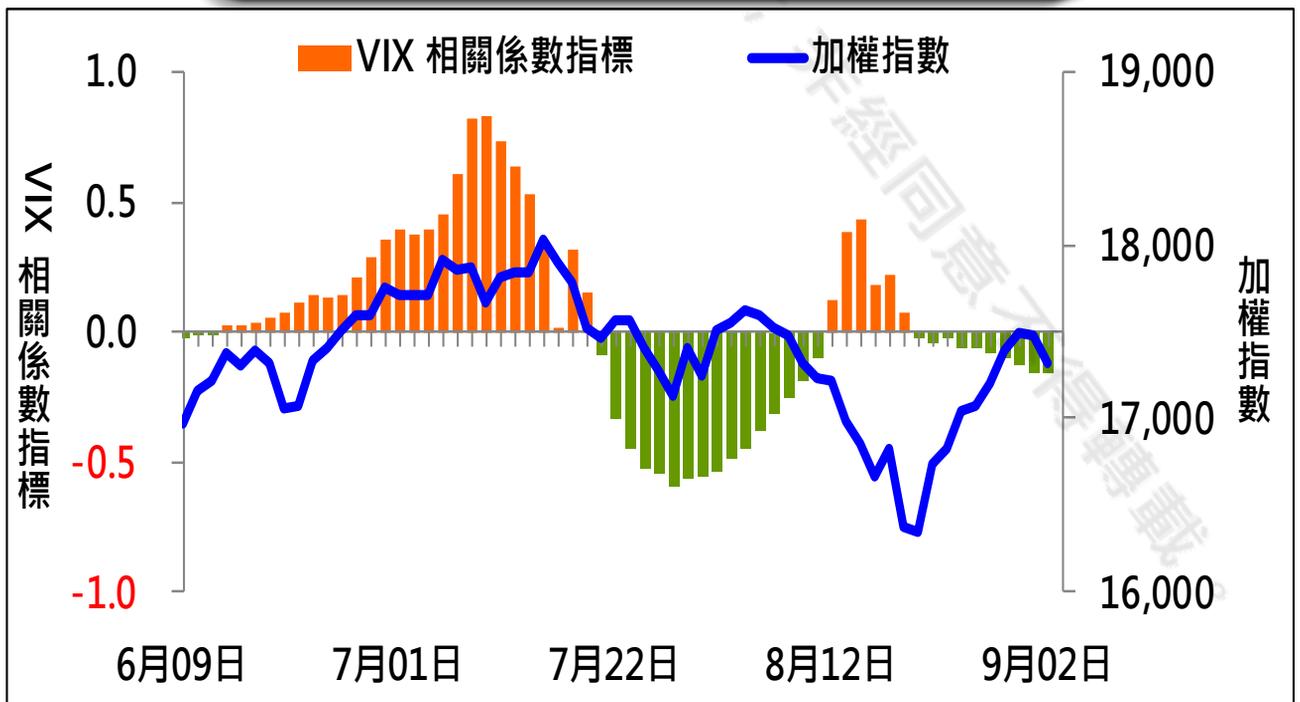
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



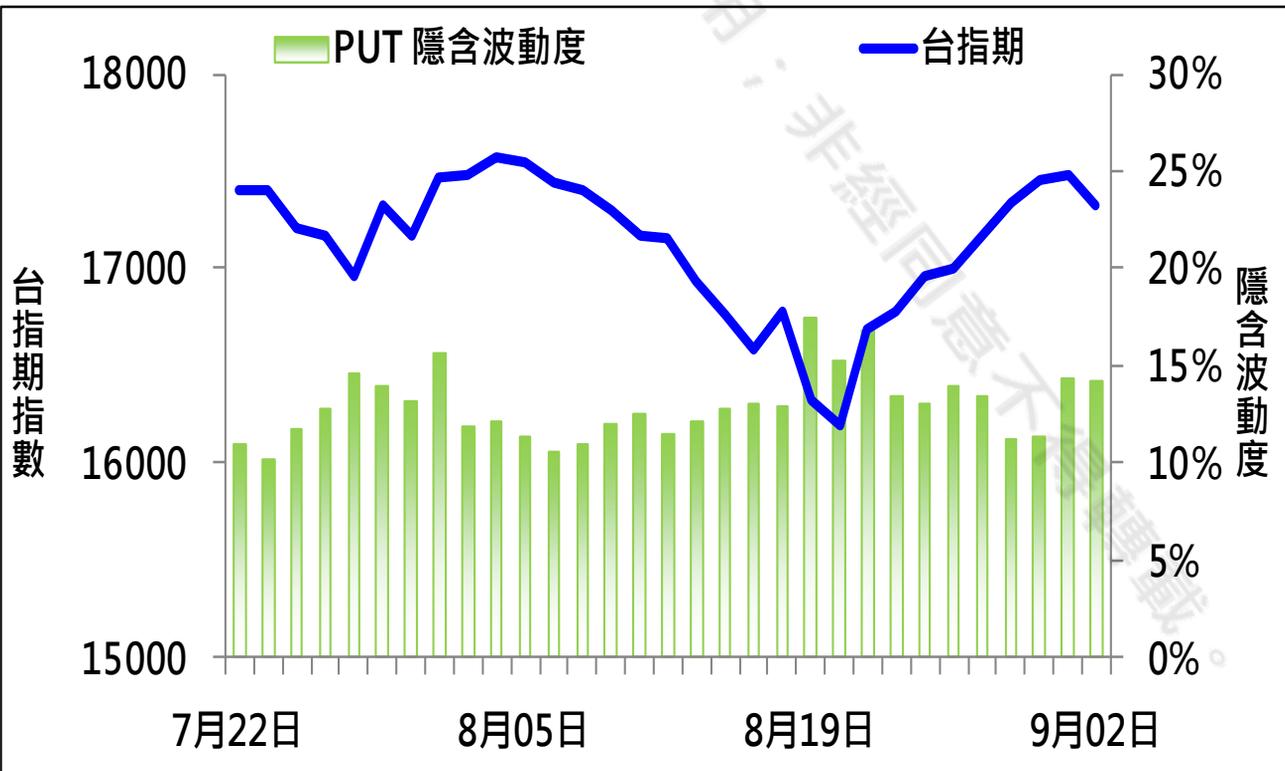
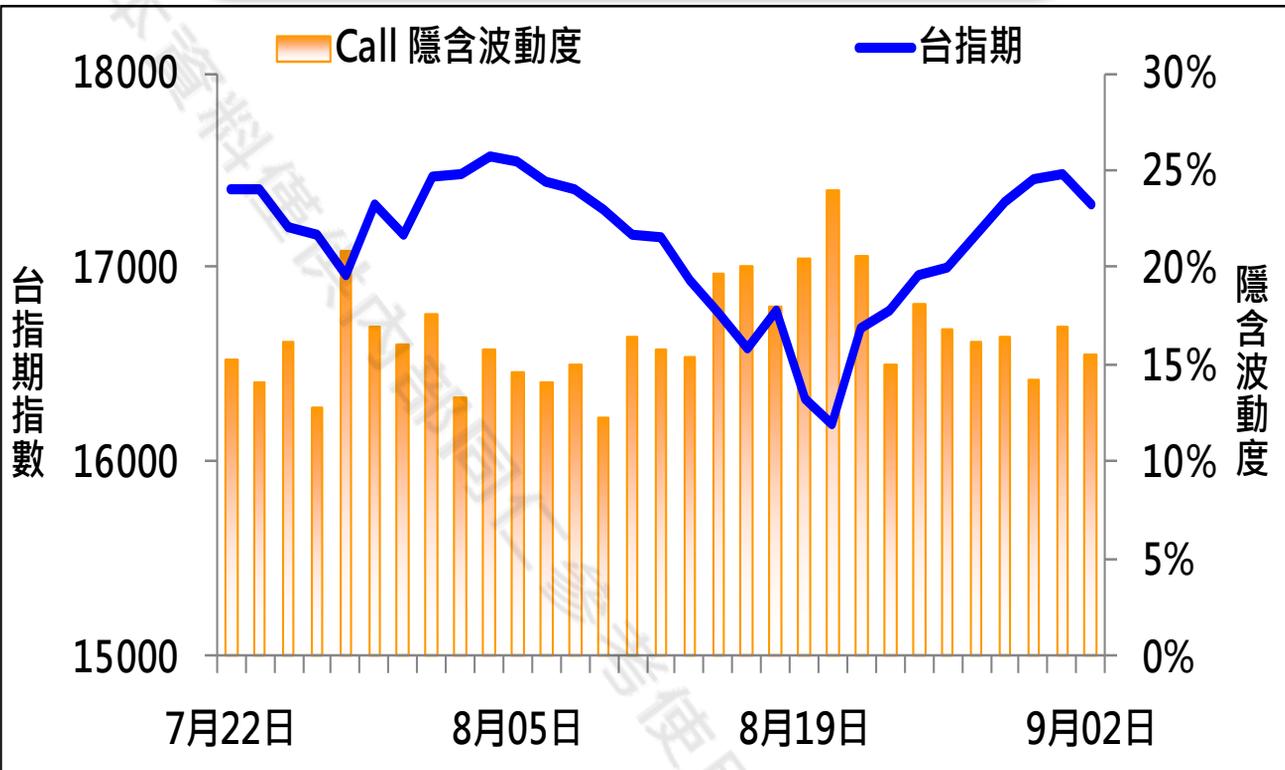
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/9/2

結算日：2021/9/8

OI 增減	Call	202109W2 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,100	1,192	870
0	0	16,200	1,185	178
0	0	16,300	1,764	582
0	0	16,400	5,337	3,959
0	0	16,500	2,681	2,013
0	0	16,600	2,383	1,227
1	1	16,700	2,525	1,402
2	2	16,800	2,912	1,917
2	6	16,900	4,283	2,883
0	0	16,950	1,926	1,926
49	64	17,000	6,911	5,213
3	6	17,050	3,876	3,027
35	108	17,100	4,176	2,509
37	72	17,150	1,719	1,393
198	288	17,200	3,010	1,750
323	361	17,250	1,973	1,456
1,017	1,076	17,300	2,913	1,811
1,078	1,123	17,350	1,753	1,200
2,201	2,777	17,400	1,822	1,118
2,296	2,669	17,450	1,173	403
5,534	7,643	17,500	1,608	899
2,697	3,379	17,550	421	242
※ 6,064	9,423	17,600	308	164
3,195	3,956	17,650	82	22
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
49,110	72,222	0.8334	60,188	39,346

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：2021/9/2

結算日：2021/9/15

OI 增減	Call	202109月 履約價	Put	OI 增減
0	166	15,800	5,342	-113
0	21	15,900	2,505	-413
-5	178	16,000	8,741	645
0	109	16,100	2,723	-110
-1	451	16,200	3,606	-46
-23	688	16,300	4,213	228
3	2,595	16,400	4,697	331
2	2,619	16,500	6,679	1,384
-19	5,024	16,600	6,029	302
-17	5,601	16,700	5,765	-151
-46	2,674	16,800	4,858	518
-15	3,859	16,900	4,309	147
-18	6,695	17,000	6,537	980
-13	3,040	17,100	3,343	-75
-252	4,360	17,200	3,833	664
-298	3,875	17,300	2,092	276
-34	7,898	17,400	1,890	-47
361	5,684	17,500	1,052	338
1,151	5,582	17,600	288	-36
448	5,235	17,700	318	26
501	5,557	17,800	105	34
966	4,221	17,900	53	-4
1,442	8,108	18,000	16	6
※	1,766	18,100	7	1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
6,364	115,706	1.2477	144,362	8,002
昨日 P/C	1.3234	今日增減變化		-0.0757

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。

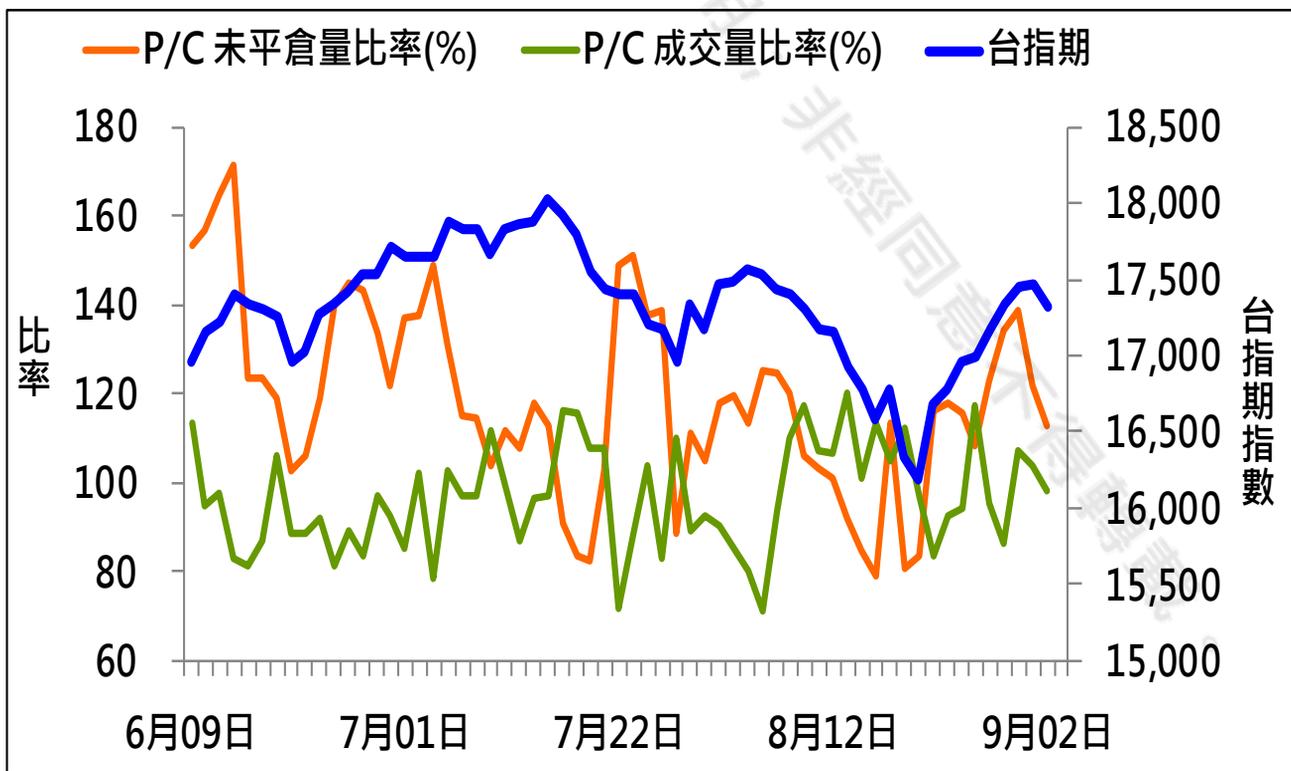
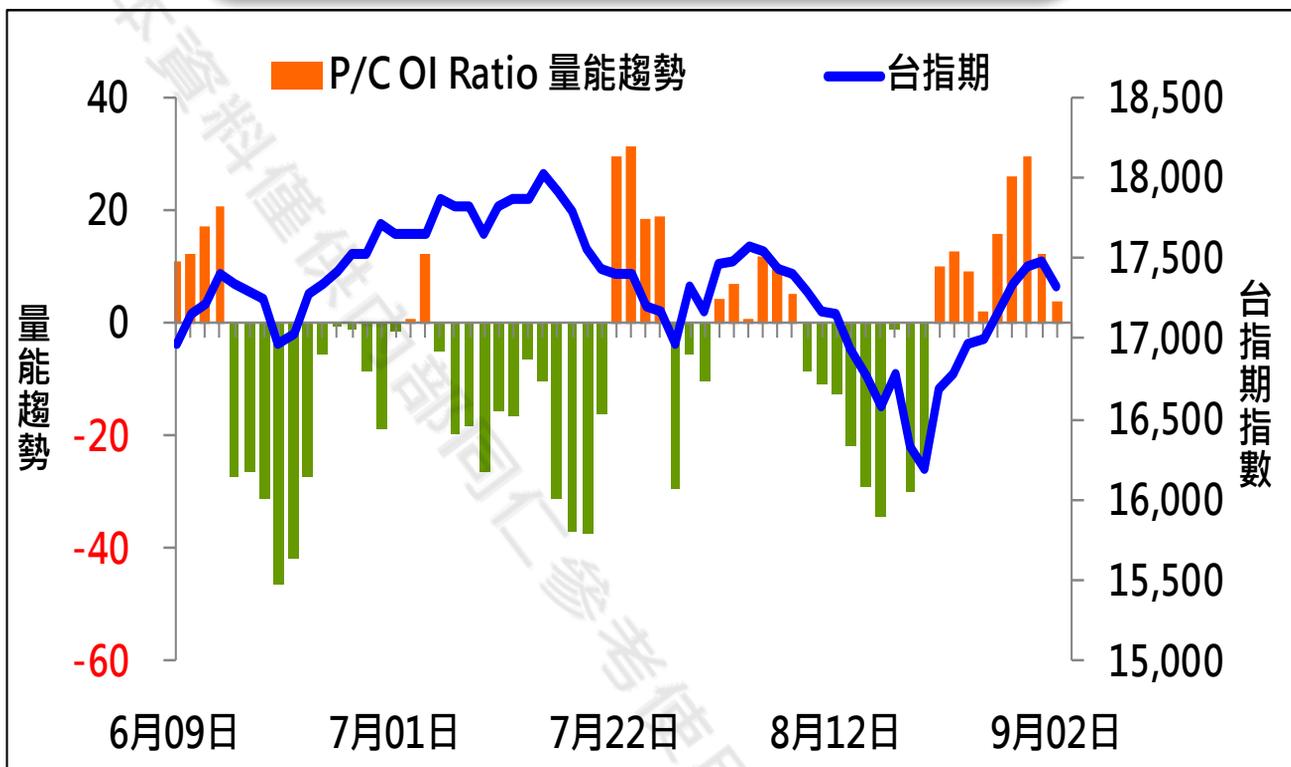
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/09/02 開 17434 高 17507 收 17320 s 點 量 136643 口 -154 (-0.88%)

SMA5 17351.20 ↑ SMA20 17011.40 ↓ SMA60 17334.47 ↑

成交量圖 30



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



## 個股除權息公告表

除權息日期	除權息標的	股期代碼	現金股息	股票股利	預估扣除點數
2021/9/3	2634 漢翔	--	0.2	0.0	0.06
2021/9/3	2636 台驊投控	--	3.0	0.0	0.13
2021/9/3	2030 彰源	--	0.5	0.0	0.05
2021/9/3	3209 全科	--	1.4	0.6	0.09
2021/9/3	2461 光群雷	--	0.5	0.0	0.03
2021/9/3	1530 亞崴	--	2.5	0.0	0.08
2021/9/3	6671 三能-KY	--	3.0	0.0	0.06
2021/9/3	1445 大宇	--	0.2	0.0	0.01
2021/9/6	2881 富邦金	CEF	0.0	1.0	0.00
2021/9/6	3711 日月光投控	OZF	4.2	0.0	6.02
2021/9/6	2323 中環	CUF	0.7	0.0	0.27
2021/9/6	4306 炎洲	--	0.0	0.6	0.00
2021/9/6	4912 聯德控股-KY	--	0.0	1.5	0.00
2021/9/6	4439 冠星-KY	--	6.5	0.0	0.07

## 每週預估扣除點數

	202109W2	202109	202109W4	202109W5	202110W1
單週點數	17.37	8.19	3.05	1.32	0.03
累計點數	17.37	25.56	28.61	29.94	29.97

- 1.本公告表資訊來源為台灣證券交易所及嘉實資訊。
- 2.本公告表資訊以報告當日該標的及加權指數之收盤價為基礎，其公式如下：

$$\text{預扣點數} = \frac{\text{標的除息之市值}}{\text{加權指數收盤總市值}} \times \text{加權指數收盤價}$$

- 3.本資料僅供參考，詳情請查閱台灣證券交易所資訊。

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