



## 法人籌碼動態

09月14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	-15,368	35	237	46	-1,667	-63
投信	-983	115	201	0	24	0
自營商	7,332	-1,014	264	75	129	6

09月14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	-180	4	-8,582	-1,148	29,949	4,770
投信	2	0	0	0	-61	0
自營商	170	11	17,745	7,086	-17,983	-13,316

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	10.46	台積電	-17.05	台指期前十大 市場佔比	44.2%	50.1%
矽力-KY	7.35	長榮	-14.59			
鴻海	4.56	萬海	-6.20			
中租-KY	4.53	陽明	-6.06	電子期前十大 市場佔比	66.5%	66.6%
台塑	3.14	聯電	-3.27			
台泥	2.57	富邦金	-2.27			
台塑化	2.19	大立光	-2.20	金融期前十大 市場佔比	64.8%	86.3%
南電	2.12	中鋼	-1.04			
和泰車	1.98	欣興	-0.99			
潤泰全	1.11	群創	-0.98	非金電期前十大 市場佔比	93.9%	90.5%
前十名合計	40.01	後十名合計	-54.64			

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

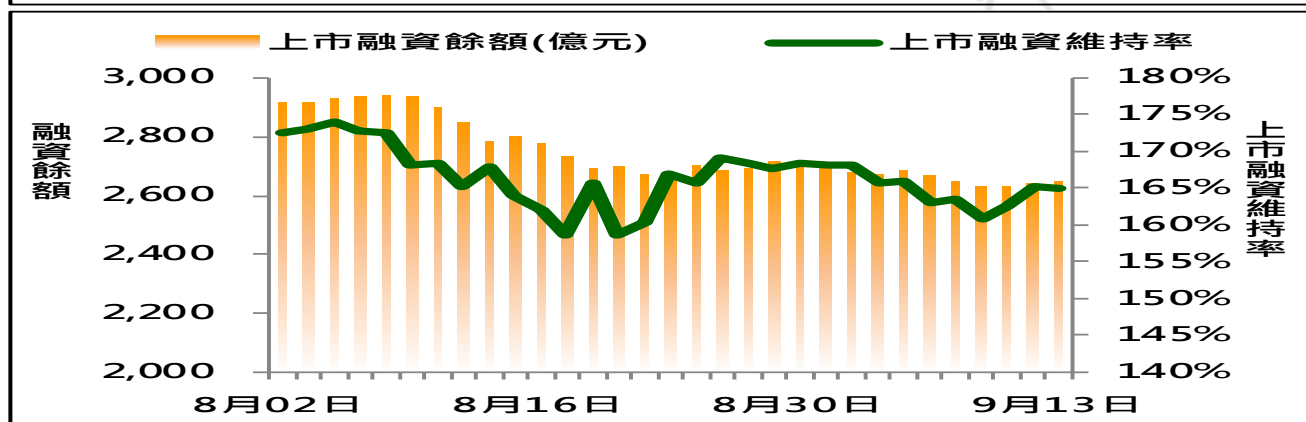
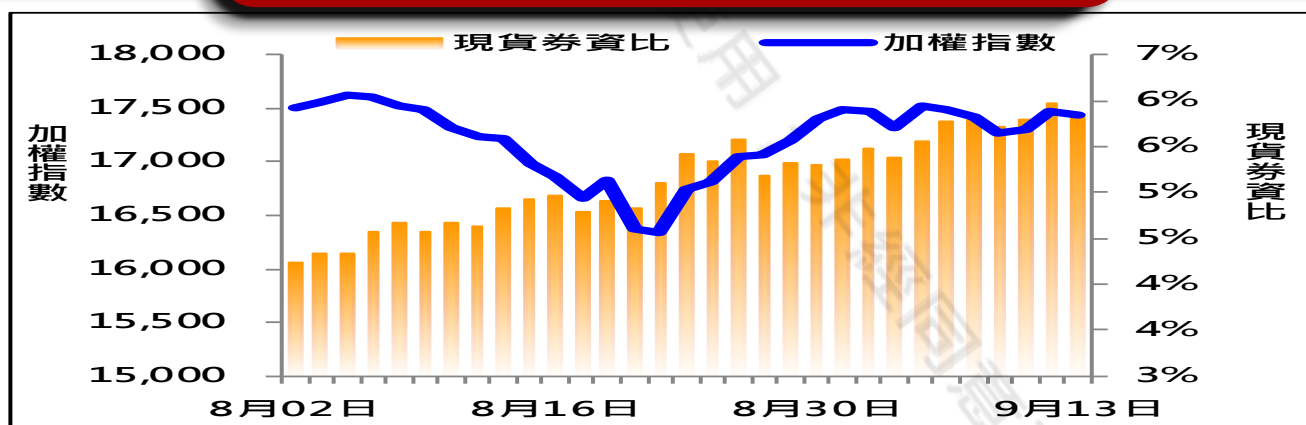


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
09月08日	-10.9	-14,197	1,383	-70.4	6,612	294
09月09日	-6.6	-11,655	2,542	-5.1	7,178	566
09月10日	150.2	-14,302	-2,647	25.7	7,455	277
09月13日	-32.7	-15,403	-1,101	-8.0	8,346	891
09月14日	65.5	-15,368	35	-7.1	7,332	-1,014

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
09月08日	-12,973	22,091	-35,064	15,864	-10,648	26,512
09月09日	-8,330	21,480	-29,810	12,642	-8,896	21,538
09月10日	-9,692	24,747	-34,439	17,404	-10,222	27,626
09月13日	-7,434	25,179	-32,613	10,659	-4,667	15,326
09月14日	-8,582	29,949	-38,531	17,745	-17,983	35,728

## 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。

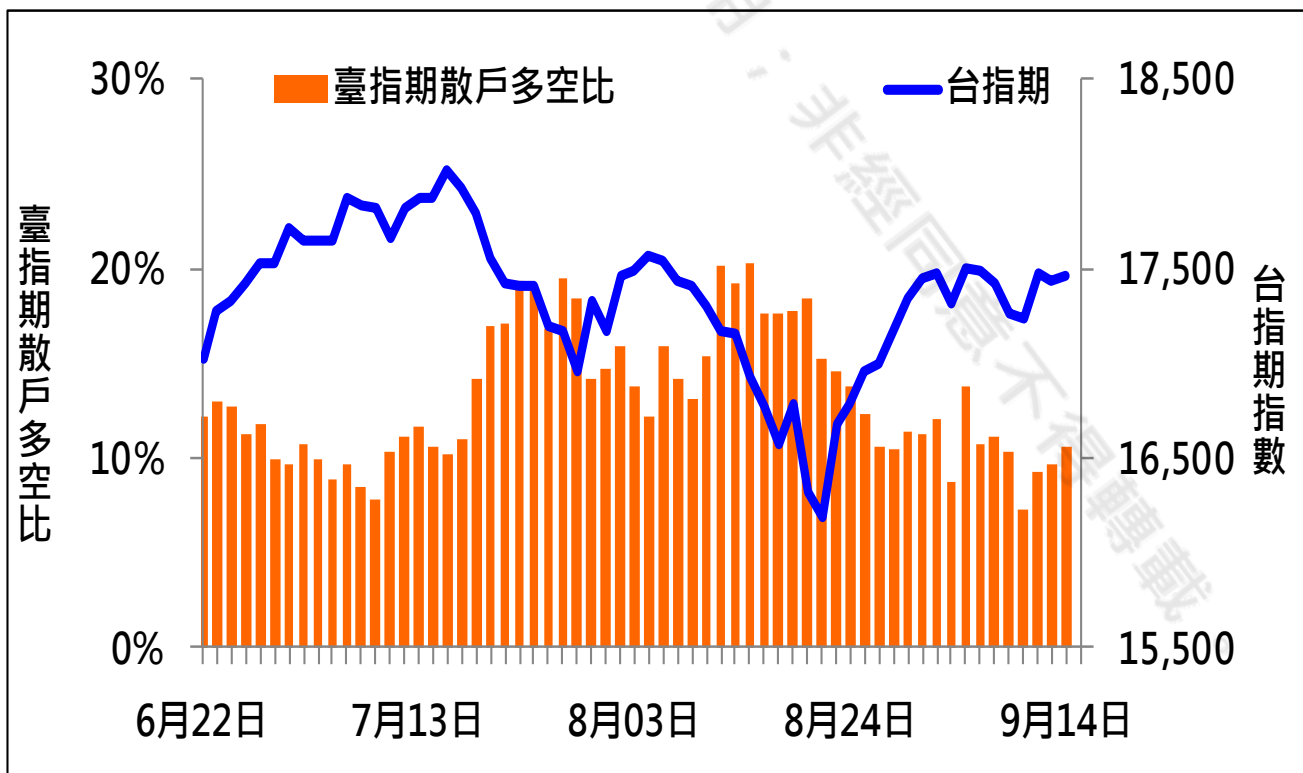
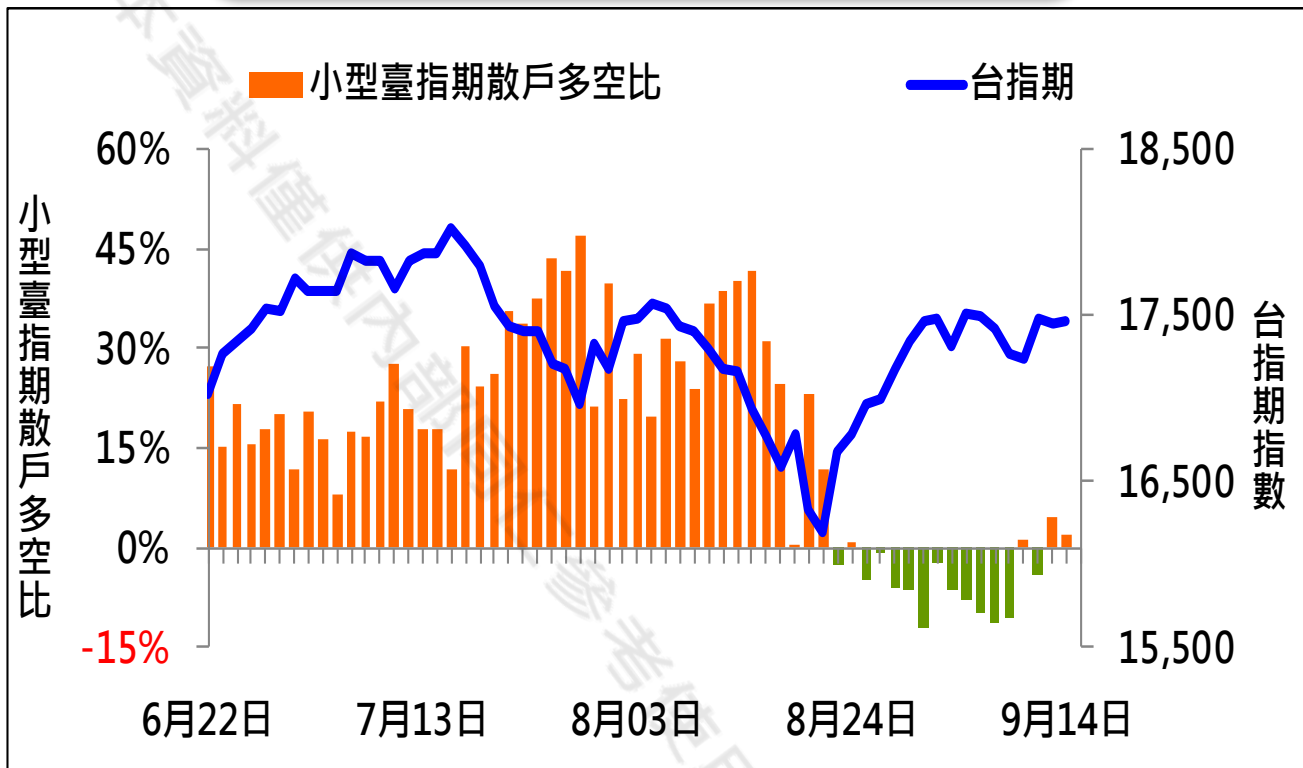
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

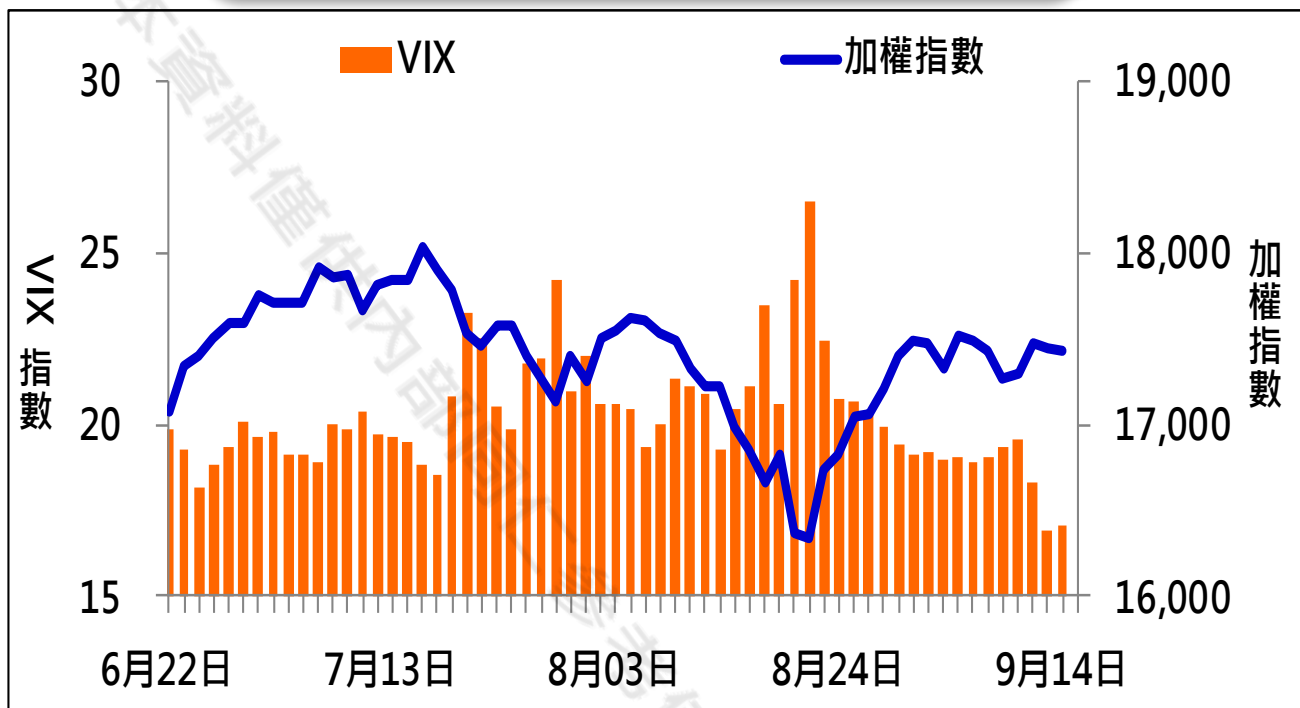
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

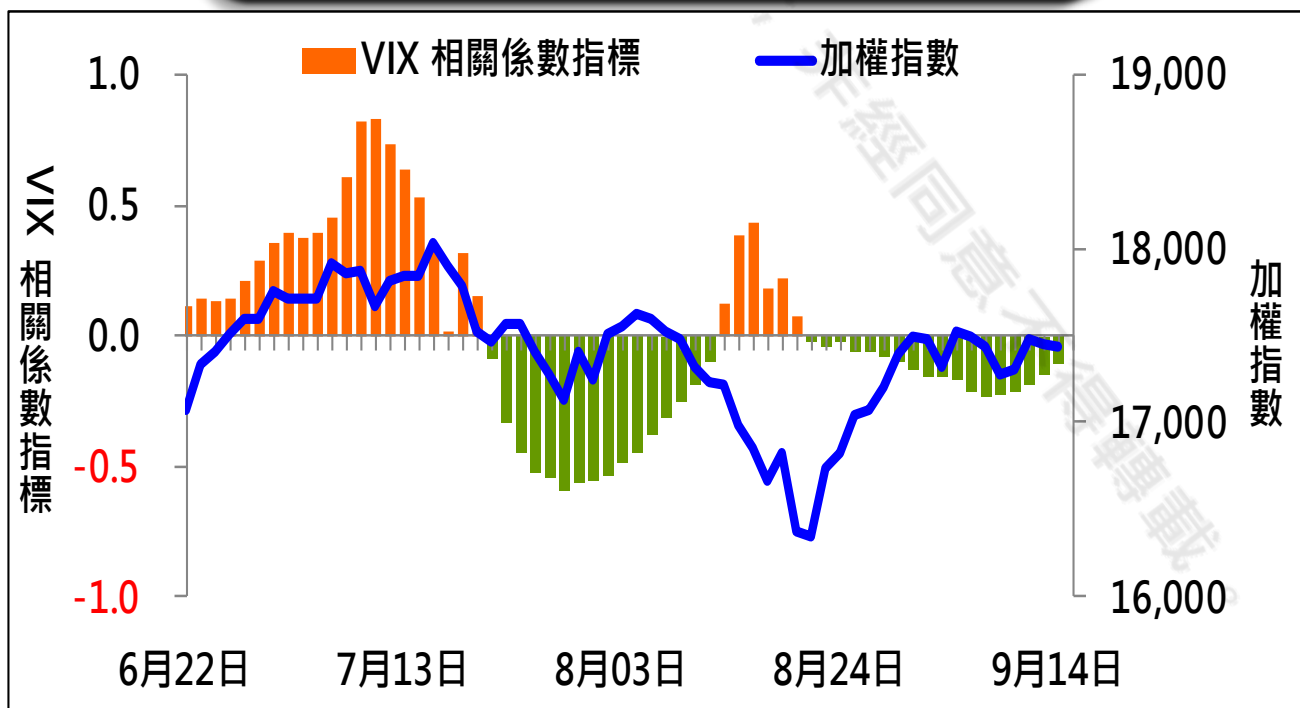
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 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。

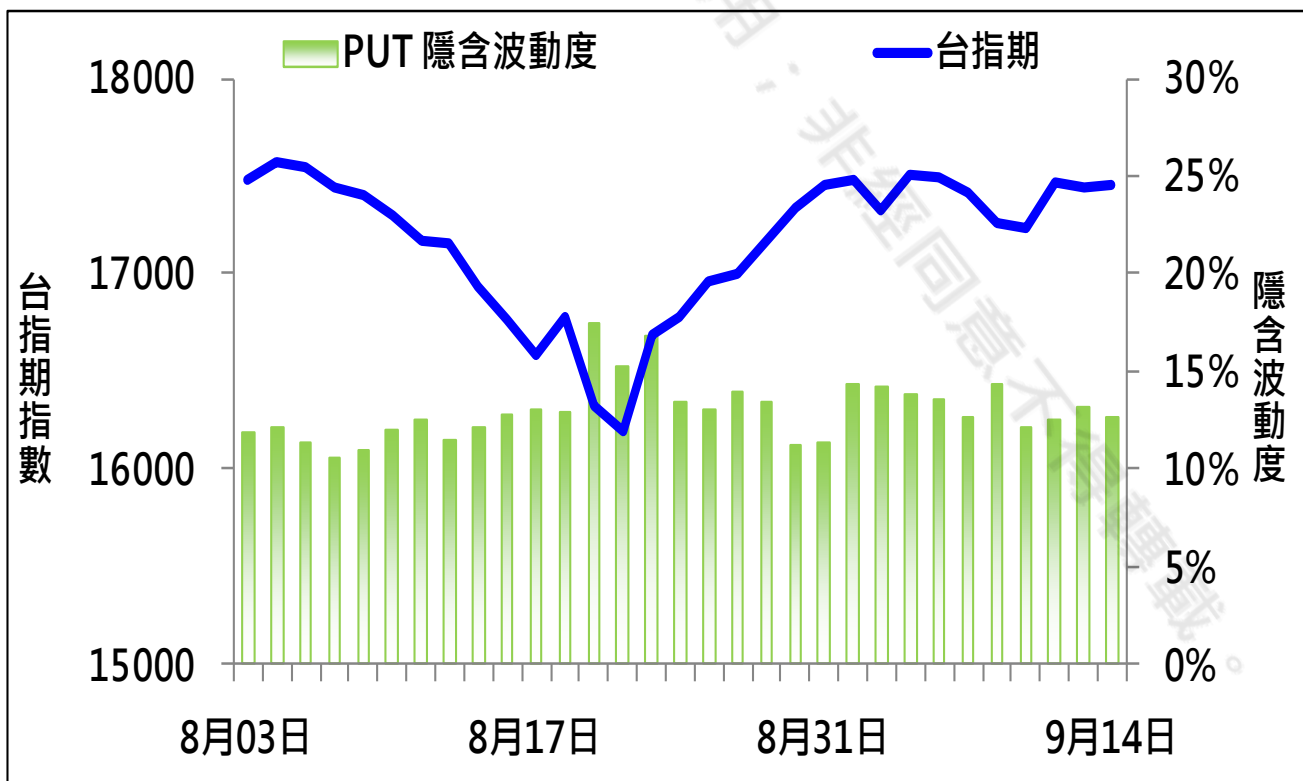
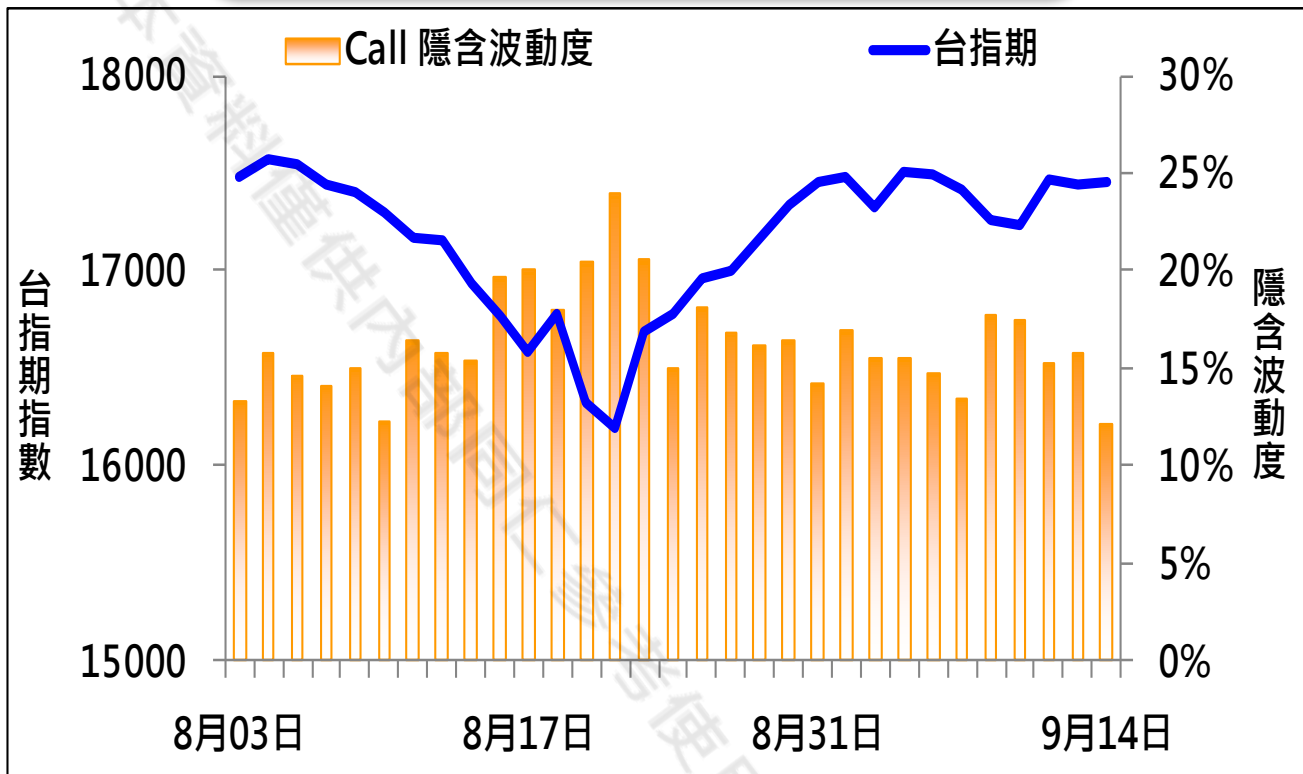
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



## 近月選擇權OI變化

日期：2021/9/14

結算日：2021/9/15

OI 增減	Call	202109 月 履約價	Put	OI 增減
-21	2,561	16,500	10,576	-161
-3	4,964	16,600	10,584	-587
-3	5,380	16,700	10,517	-747
-10	2,519	16,800	8,664	-1,065
0	9	16,850	2,860	-2,439
-23	3,599	16,900	8,566	-2,255
5	84	16,950	4,125	-1,904
-38	6,539	17,000	15,897	-932
-2	142	17,050	5,209	-1,105
-20	3,084	17,100	12,336	-828
-24	843	17,150	6,319	-129
-139	4,734	17,200	14,433	538
-148	1,298	17,250	8,424	1,705
-497	5,739	17,300	11,251	3,121
687	3,142	17,350	9,264	5,731
-591	11,949	17,400	9,678	941
594	5,397	17,450	5,606	2,029
2,029	15,433	17,500	8,418	4,634
4,329	9,926	17,550	2,404	1,783
※ 5,297	18,568	17,600	1,544	249
4,591	12,350	17,650	277	43
442	13,154	17,700	538	4
-502	6,863	17,750	49	29
-968	10,967	17,800	198	34
407	3,741	17,850	8	2
-103	5,985	17,900	104	1
-158	1,302	17,950	1	1
-348	11,626	18,000	42	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
14,245	206,533	1.3011	268,728	7,157

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



## 次月選擇權OI變化

日期：2021/9/14

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	7	15,900	720	213
0	34	16,000	2,815	-105
0	27	16,100	745	-54
0	10	16,200	928	62
0	26	16,300	1,727	102
0	88	16,400	1,889	105
1	114	16,500	1,955	520
0	133	16,600	2,352	70
0	124	16,700	2,438	40
6	214	16,800	694	-72
1	313	16,900	1,278	121
7	247	17,000	1,964	769
-9	276	17,100	707	53
6	812	17,200	2,213	212
11	648	17,300	1,349	144
33	1,153	17,400	891	454
3	892	17,500	252	111
392	1,186	17,600	225	133
237	1,261	17,700	125	102
373	2,105	17,800	30	1
137	1,571	17,900	103	7
※	442	18,000	14	0
	275	18,100	3	0
	380	18,200	4	0
	349	18,300	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,331	31,135	1.4178	44,142	7,549
昨日 P/C	1.3652	今日增減變化		0.0526

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。

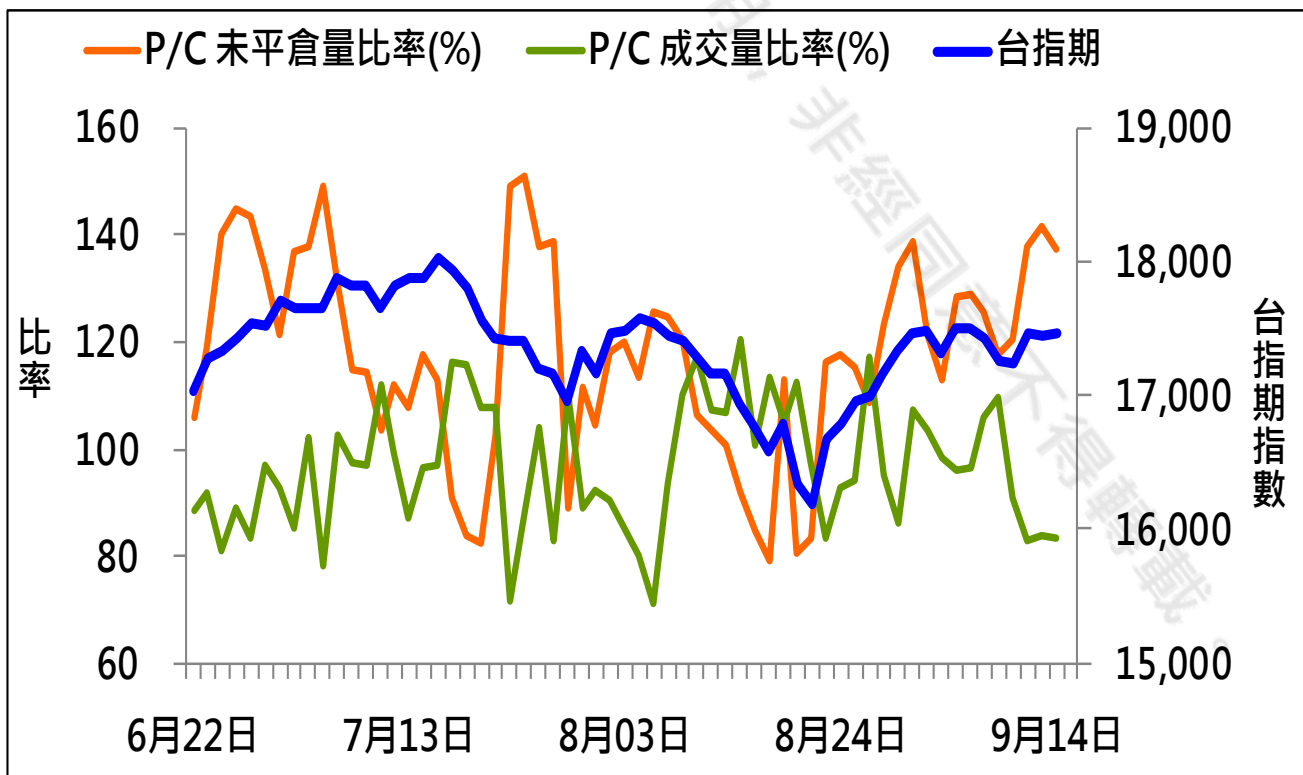
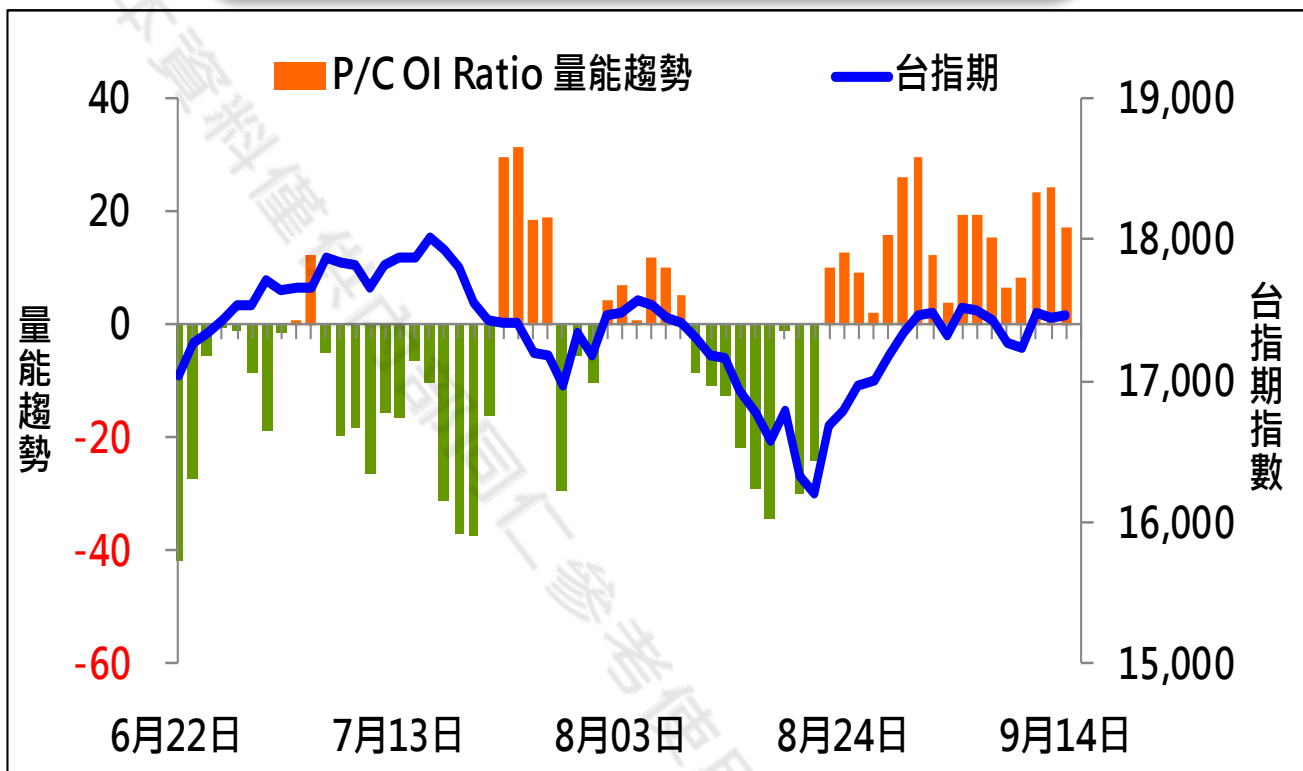
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

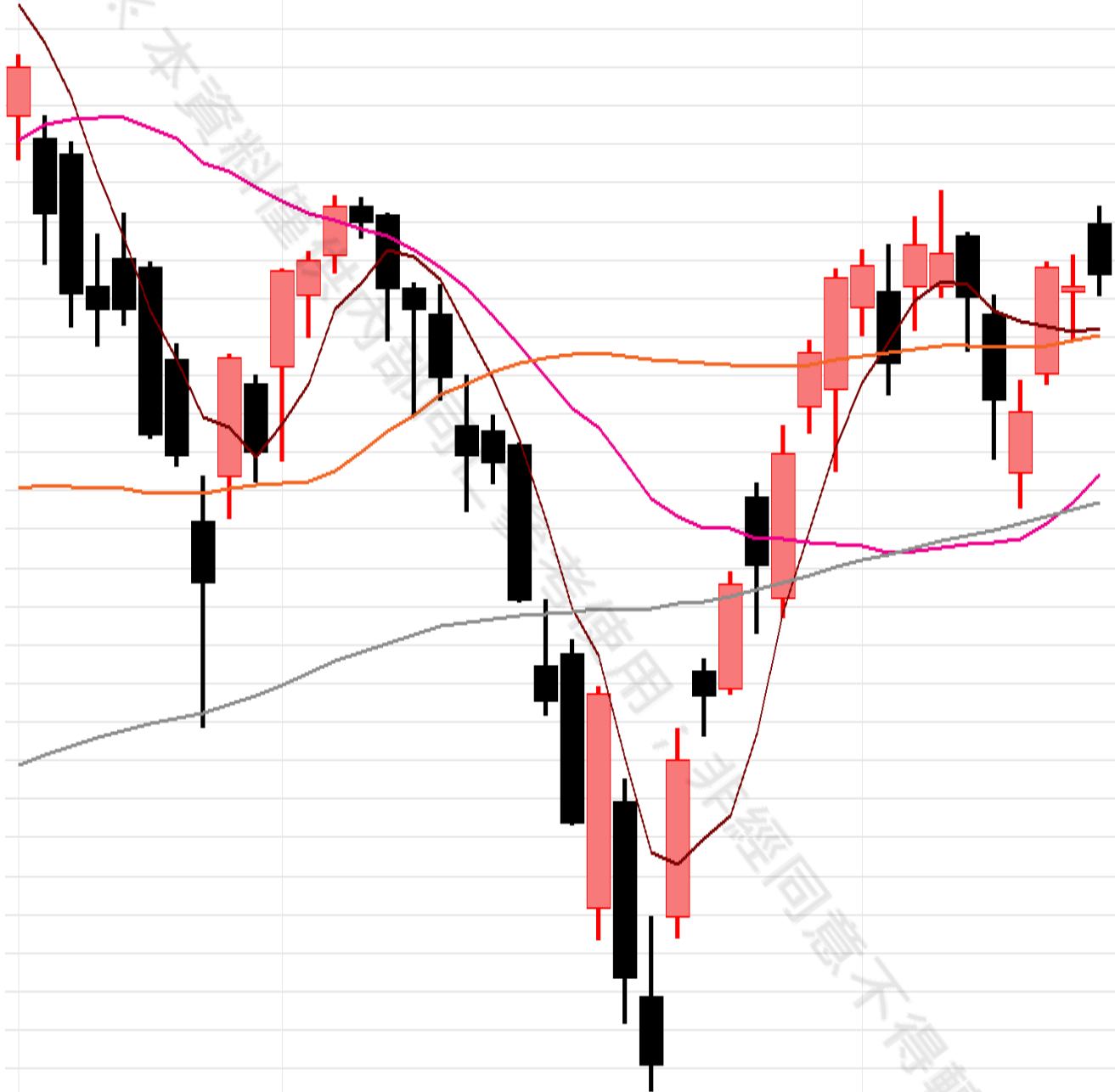
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所





## 盤後重點觀察

SMA5 17374.60↑ SMA20 17138.45↑ SMA60 17361.83↑ SMA120 17094.21↑ SMA240 15757.33↑



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