



法人籌碼動態

09月16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	-17,997	-2,911	640	-17	-1,658	-37
投信	-2,363	-300	198	-3	24	0
自營商	11,880	505	-248	-65	181	-12

09月16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	-49	11	-10,742	-1,248	13,746	5,157
投信	2	0	0	0	-58	0
自營商	26	-21	14,641	1,342	12,077	7,556

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
南亞	4.19	鴻海	-4.57	台指期前十大 市場佔比	48.6%	54.3%
中信金	2.64	中租-KY	-4.30			
聯電	2.46	中鋼	-3.90			
台塑	2.10	日月光投控	-3.61			
欣興	1.99	萬海	-3.29	電子期前十大 市場佔比	62.3%	75.1%
台達電	1.71	陽明	-3.04			
中華電	1.28	富邦金	-2.66			
台光電	1.26	大立光	-2.66	金融期前十大 市場佔比	69.2%	91.0%
台聚	1.24	矽力-KY	-2.61			
研華	1.15	祥碩	-2.40	非金電期前十大 市場佔比	95.8%	96.6%
前十名合計	20.02	後十名合計	-33.05			

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

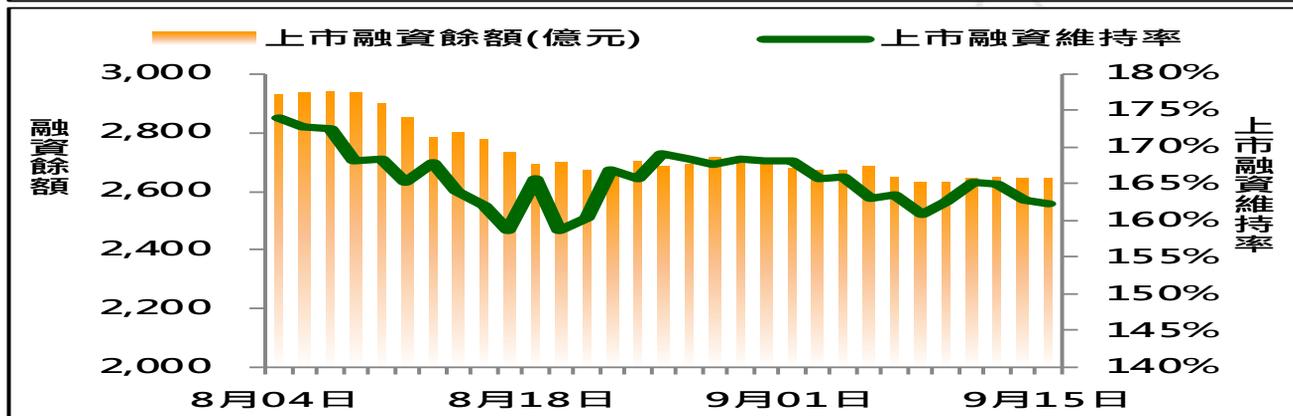
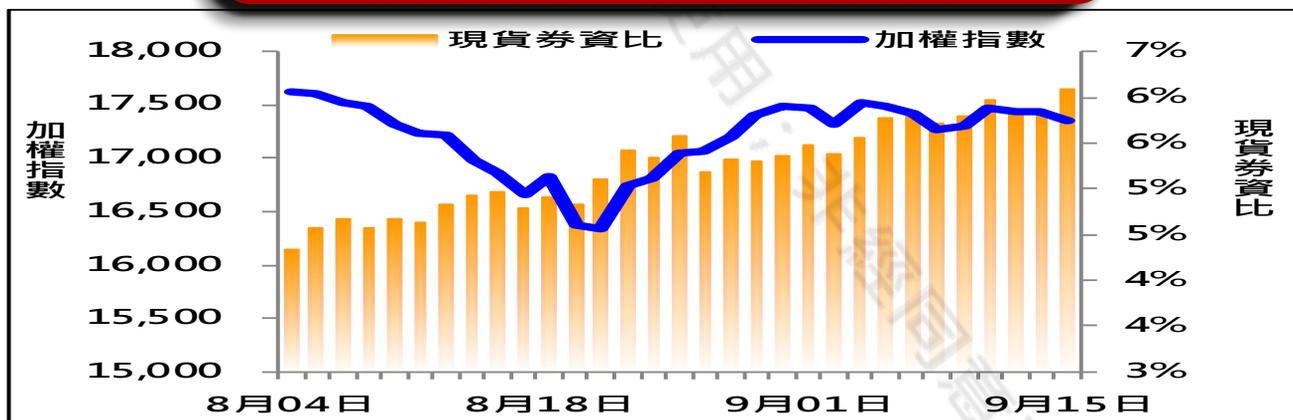


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
09月15日	18.6	-15,086	282	-78.1	11,375	4,043
09月16日	-49.5	-17,997	-2,911	-26.4	11,880	505

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
09月15日	-9,494	8,589	-18,083	13,299	4,521	8,778
09月16日	-10,742	13,746	-24,488	14,641	12,077	2,564

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。

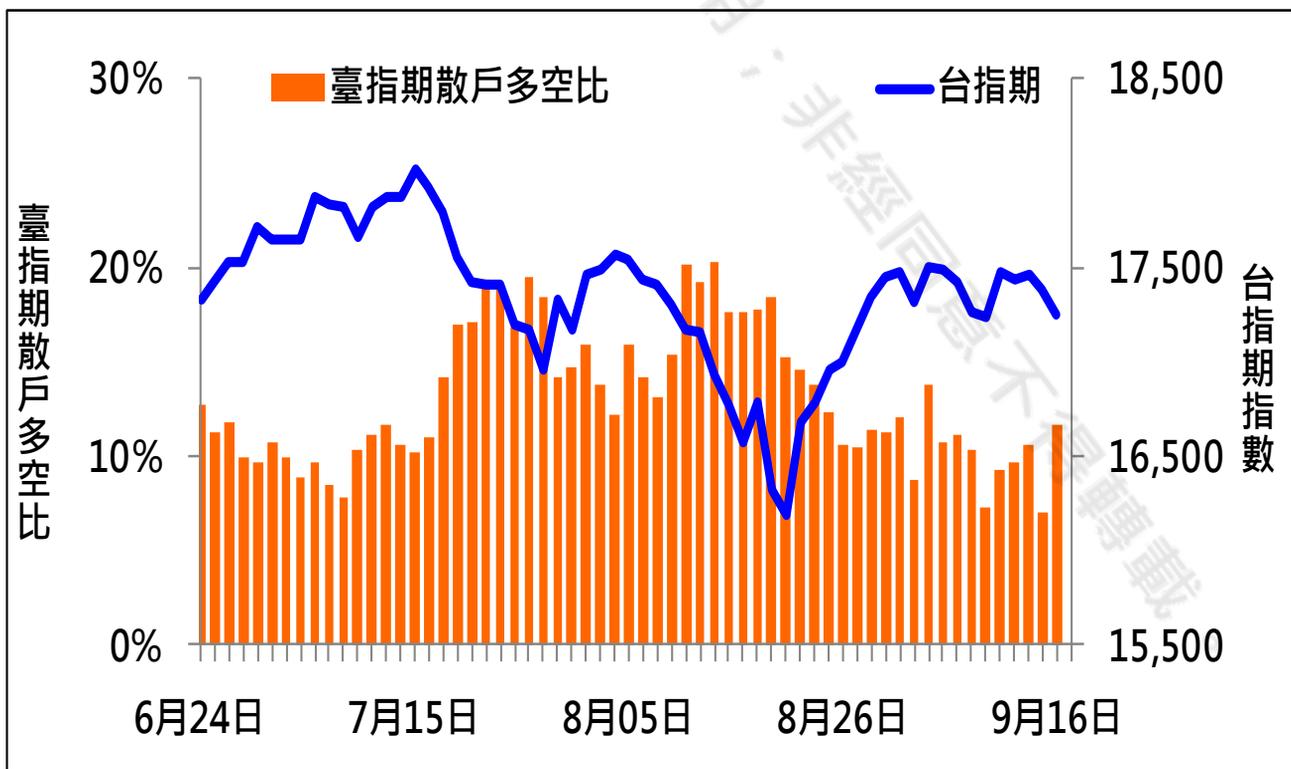
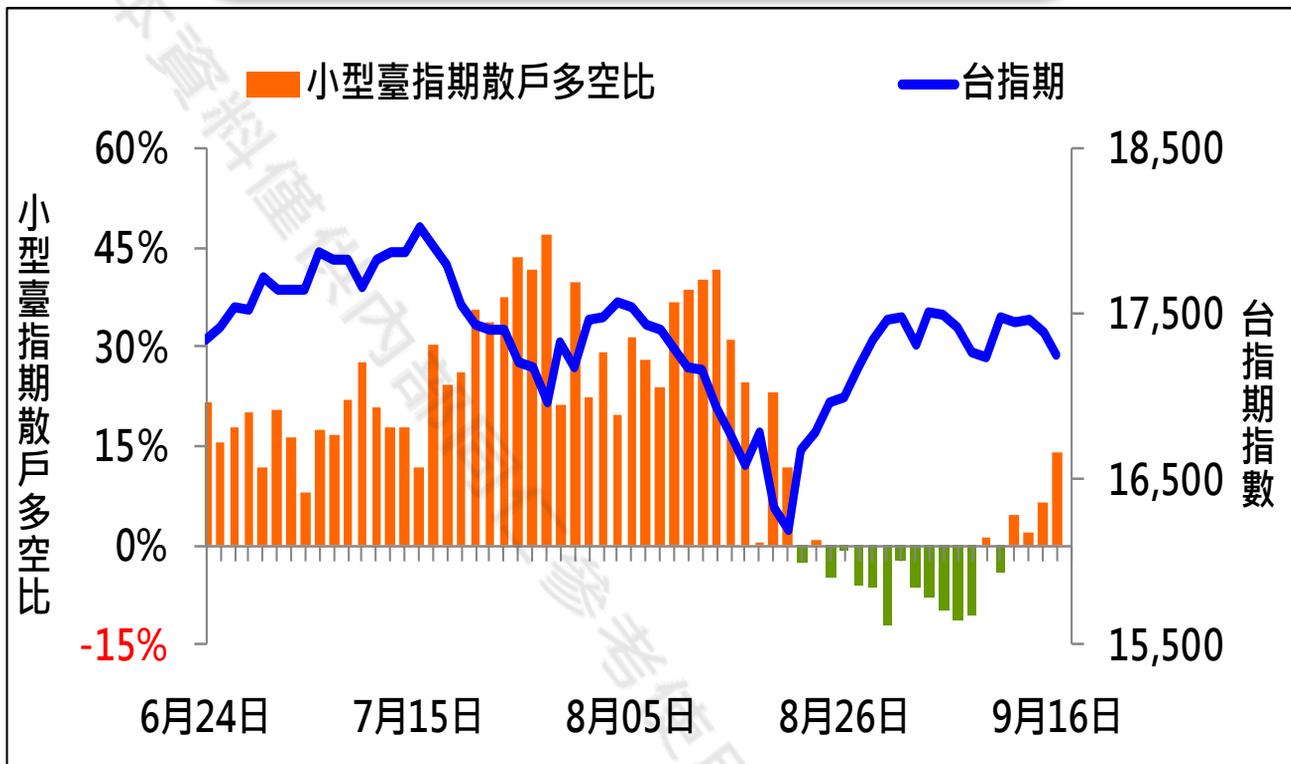
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



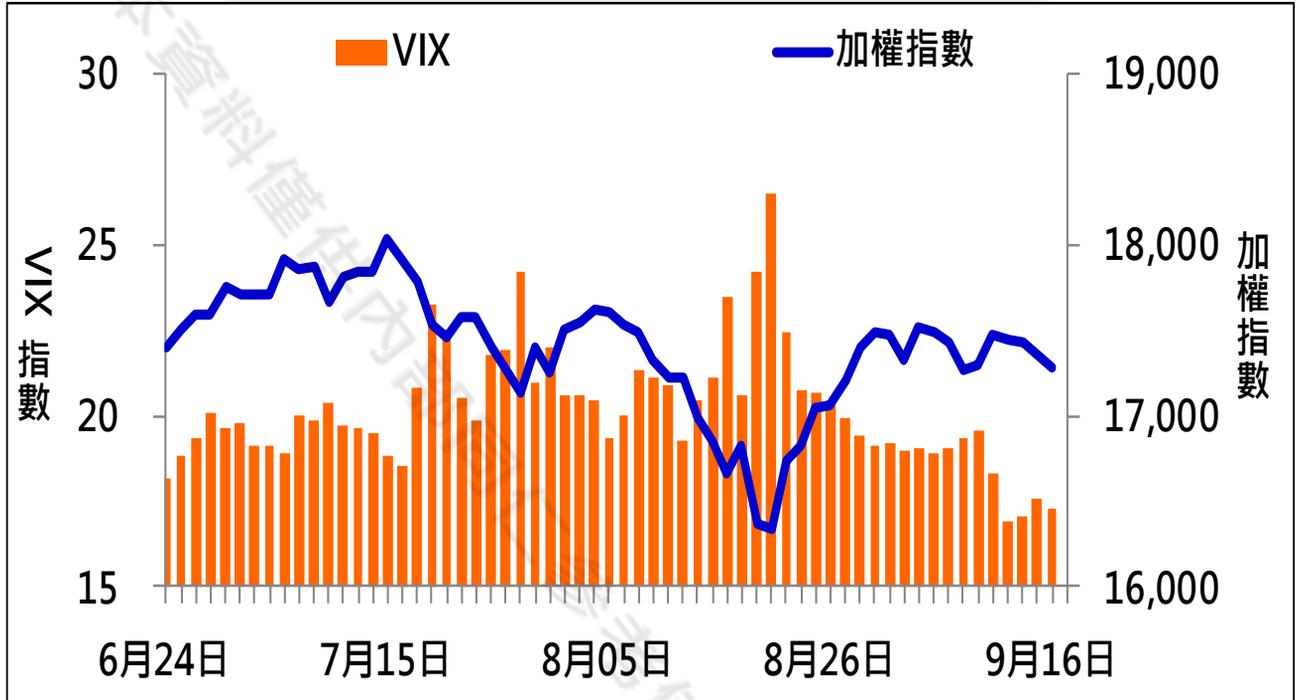
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

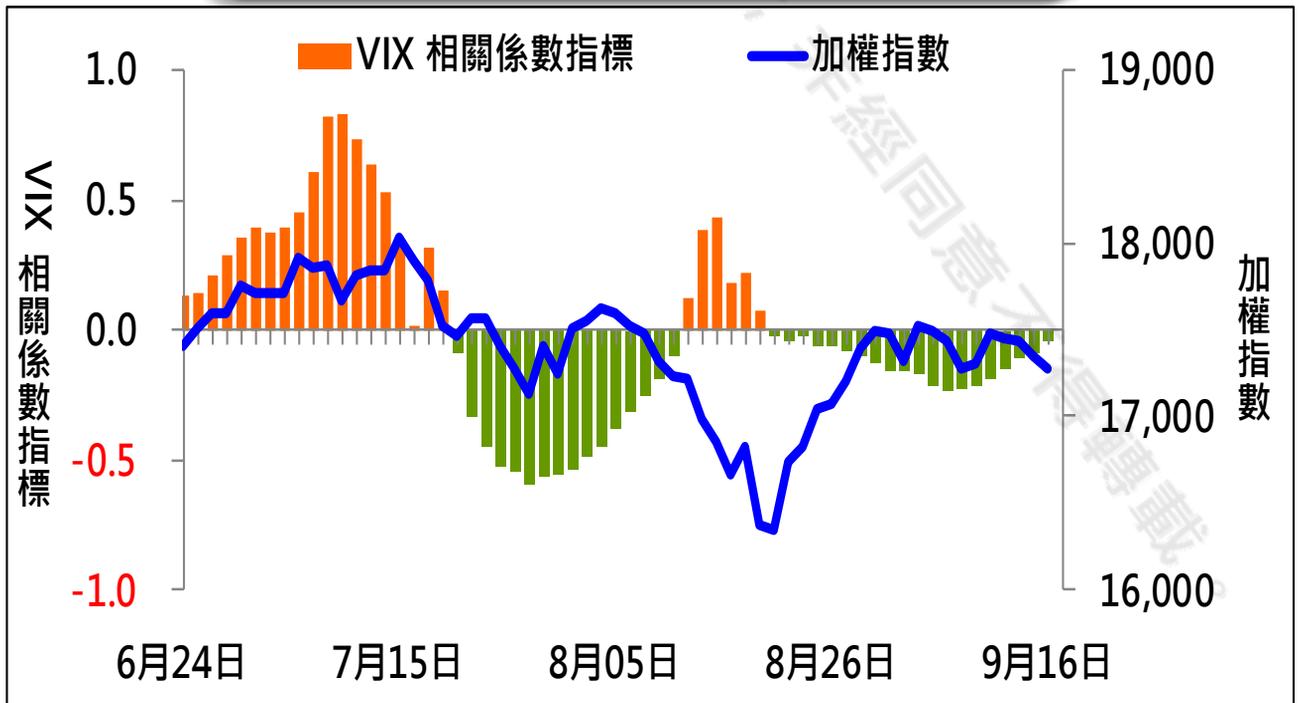
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



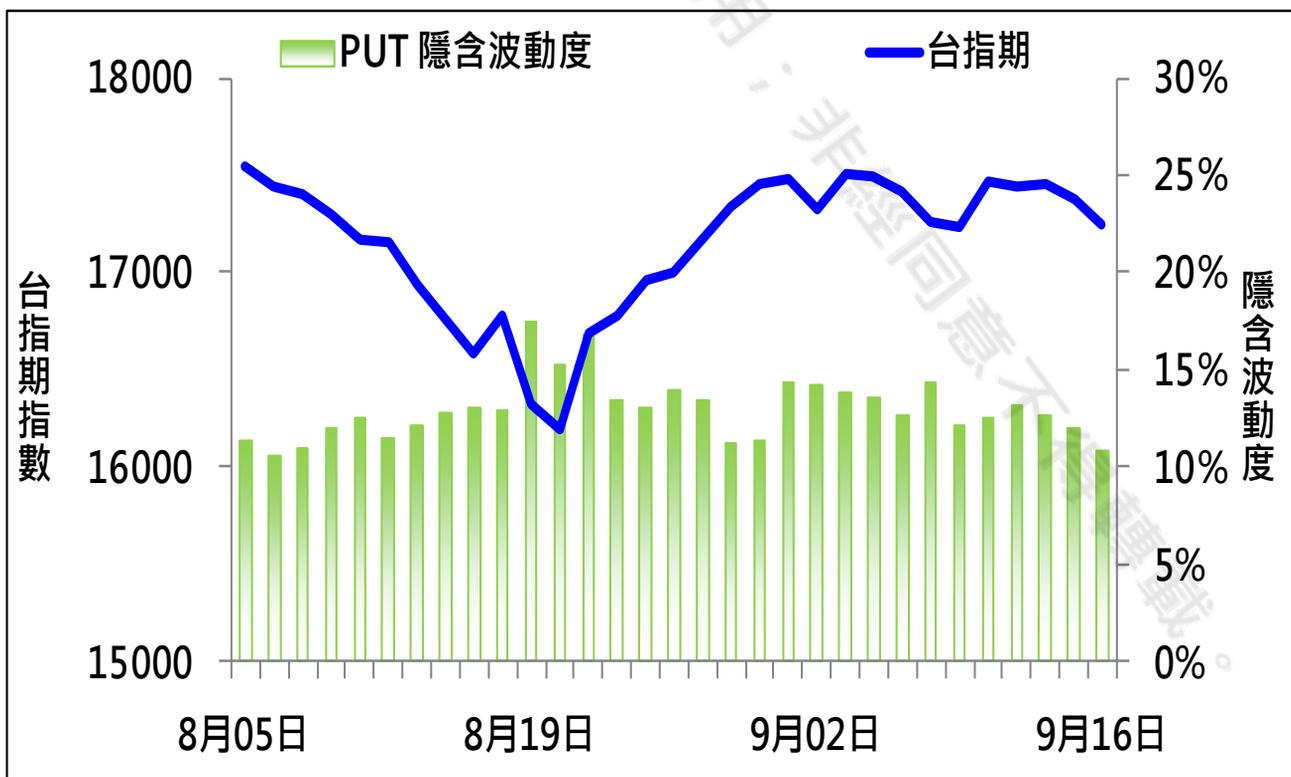
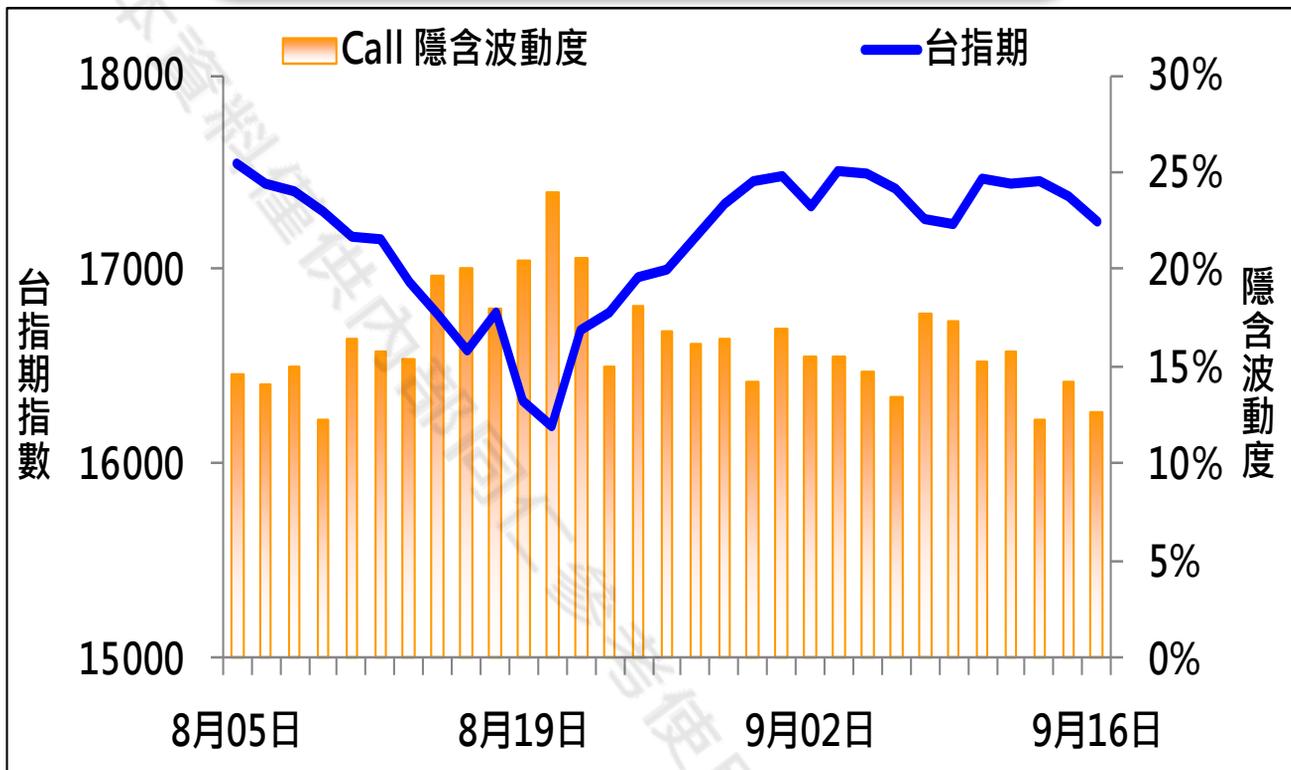
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/9/16

結算日：2021/9/22

OI 增減	Call	202109W4 履約價	Put	OI 增減
0	0	16,400	2,223	1,354
0	0	16,500	2,973	1,734
6	6	16,600	2,241	1,092
5	5	16,700	4,738	2,078
5	7	16,800	7,072	3,828
0	0	16,850	941	941
6	13	16,900	5,321	3,347
3	5	16,950	3,539	2,339
44	75	17,000	6,150	4,385
30	71	17,050	3,638	2,976
133	290	17,100	4,025	2,422
145	205	17,150	1,880	1,405
729	865	17,200	3,973	1,570
1,245	1,642	17,250	2,555	1,636
2,925	3,449	17,300	2,634	1,733
2,810	3,522	17,350	1,444	804
3,287	5,135	17,400	1,210	548
2,498	4,281	17,450	628	326
6,224	7,555	17,500	405	240
5,030	6,365	17,550	191	35
4,657	7,305	17,600	198	77
※	10,779	17,650	62	-5
5,562	8,472	17,700	30	13
1,120	2,273	17,750	2	2
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
44,593	68,201	0.9454	64,476	36,247

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：2021/9/16

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	7	15,900	815	93
0	34	16,000	3,900	700
0	27	16,100	1,359	491
0	48	16,200	1,976	1,016 ※
1	26	16,300	1,931	276
1	89	16,400	2,182	198
1	115	16,500	2,270	226
27	163	16,600	2,620	133
3	128	16,700	3,183	81
12	229	16,800	1,141	405
24	344	16,900	1,932	399
40	315	17,000	2,259	189
67	362	17,100	1,153	85
588	1,424	17,200	3,089	754
1,139	3,299	17,300	2,192	611
1,700	3,460	17,400	1,089	8
※ 2,254	4,024	17,500	316	62
229	1,830	17,600	326	12
564	2,410	17,700	132	2
347	2,901	17,800	41	12
225	2,606	17,900	113	4
1,202	4,168	18,000	22	0
818	3,686	18,100	3	0
697	2,682	18,200	1	-3
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
12,949	53,201	1.1067	58,877	10,788
昨日 P/C	1.1947	今日增減變化		-0.0880

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。

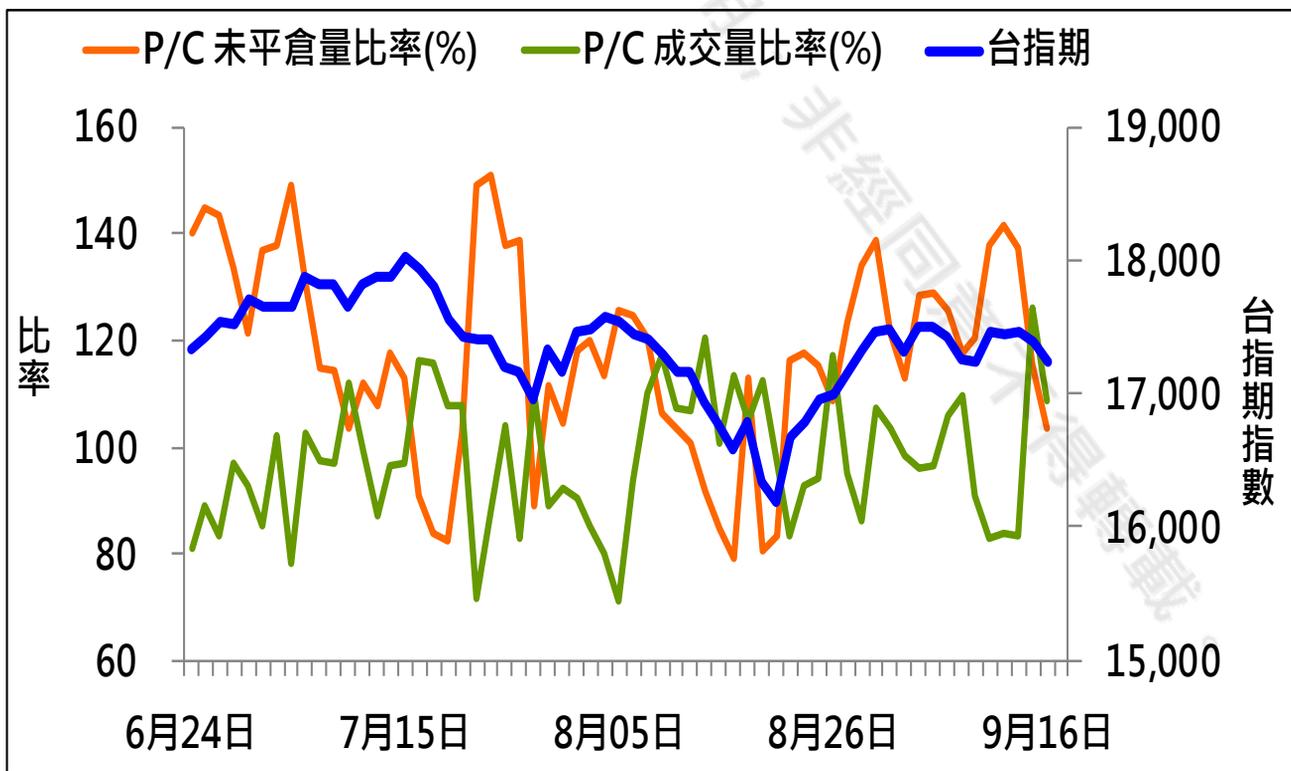
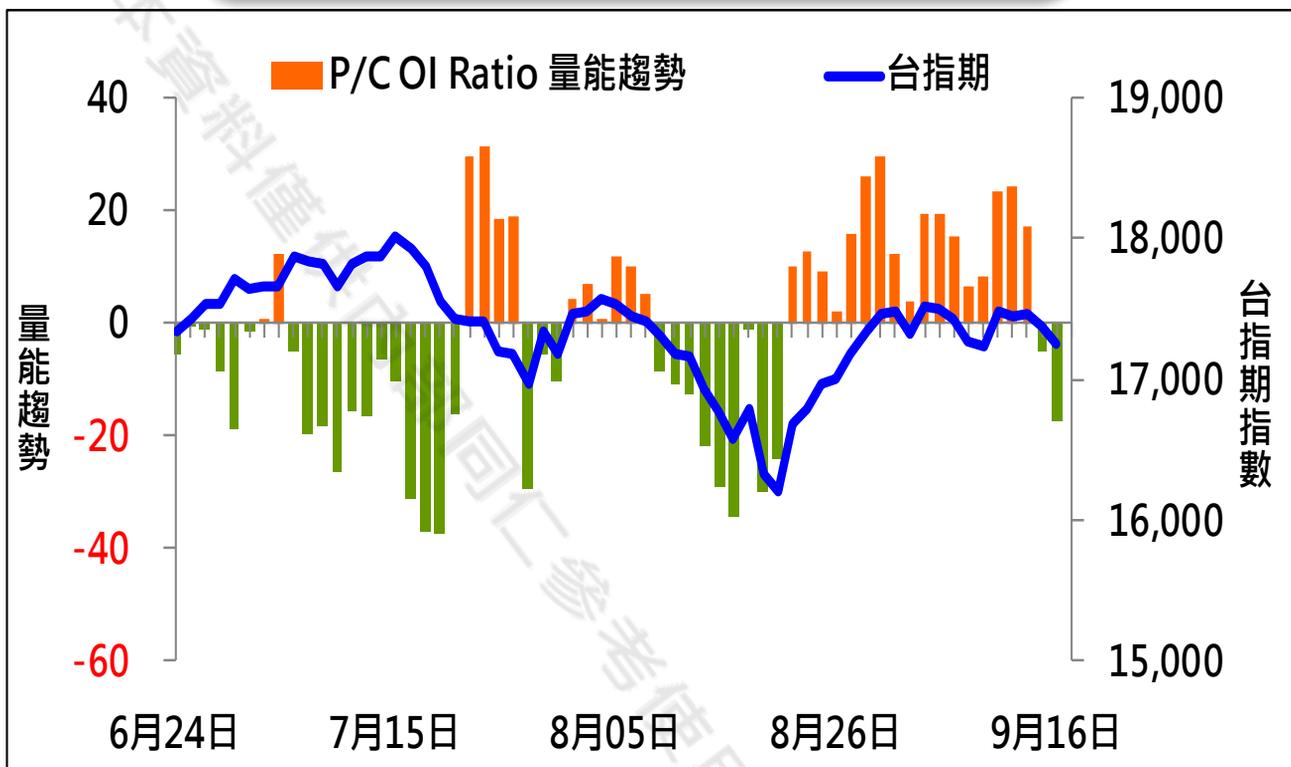
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

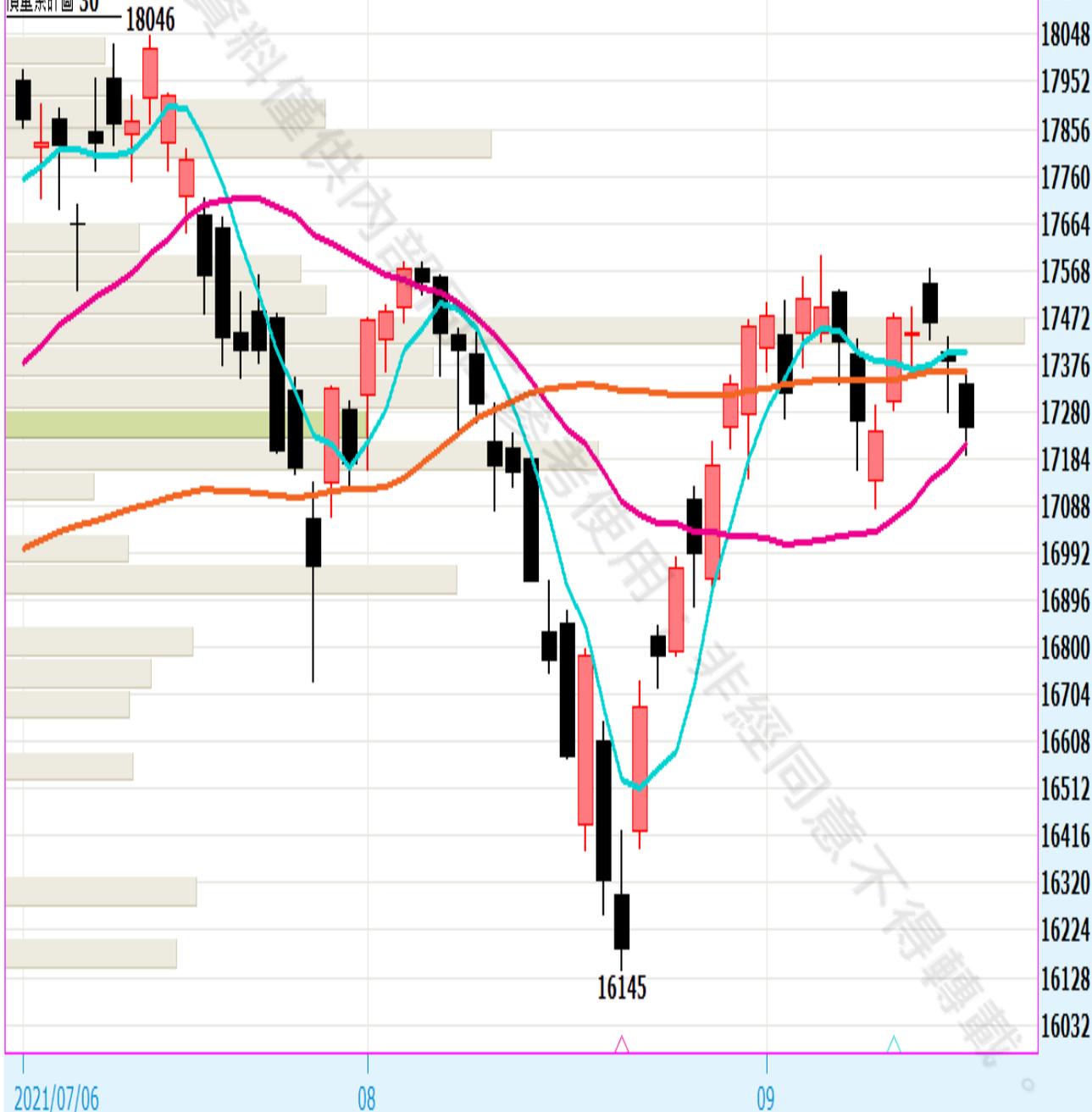


盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTTX*1) 日線圖 2021/09/16 開 17337 高 17362 收 17248 ↓ 點 量 93144 口 -134 (-0.77%)

SMA5 17401.20 ↑ SMA20 17214.35 ↑ SMA60 17362.27 ↓

價量累計圖 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



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