



## 法人籌碼動態

09月23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	-16,468	1,360	468	78	-1,439	-71
投信	-3,812	439	198	0	24	0
自營商	13,029	56	-252	31	133	14

09月23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	15	-2	-7,472	2,248	18,874	4,493
投信	2	0	0	0	-59	0
自營商	-46	5	28,966	13,931	8,687	979

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	17.08	富邦煤	-2.54	台指期前十大 市場佔比	44.1%	51.9%
南電	5.64	鴻海	-2.28			
台塑化	5.33	祥碩	-1.48			
台塑	5.24	聯合再生	-0.97	電子期前十大 市場佔比	60.1%	74.1%
長榮	4.30	中鋼	-0.78			
南亞	4.18	群創	-0.65			
旭隼	3.89	台勝科	-0.64	金融期前十大 市場佔比	69.3%	90.0%
瑞昱	3.45	美利達	-0.59			
國泰金	3.39	華邦電	-0.52			
萬海	3.29	漢唐	-0.38	非金電期前十大 市場佔比	85.7%	93.9%
前十名合計	55.77	後十名合計	-10.83			

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

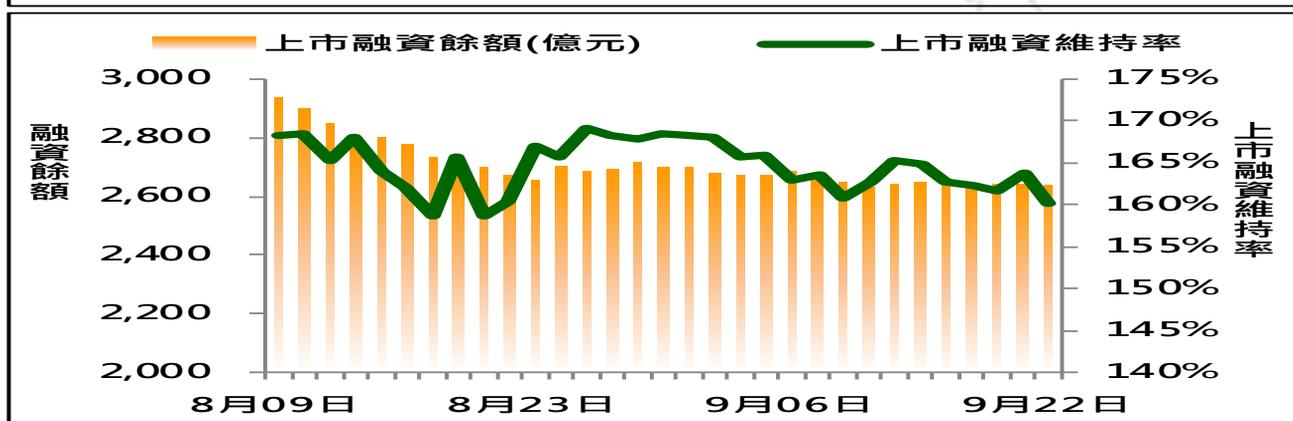
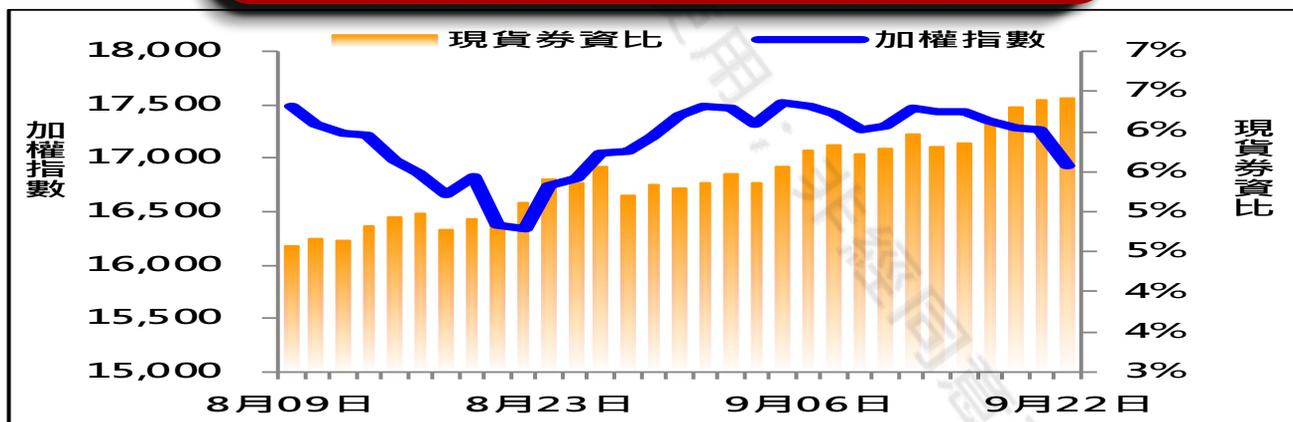


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
09月17日	16.0	-16,613	1,384	5.6	10,753	-1,127
09月22日	-355.0	-17,828	-1,215	-93.4	12,973	2,220
09月23日	35.9	-16,468	1,360	-7.7	13,029	56

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
09月17日	-9,562	16,736	-26,298	23,151	6,830	16,321
09月22日	-9,720	14,381	-24,101	15,035	7,708	7,327
09月23日	-7,472	18,874	-26,346	28,966	8,687	20,279

## 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。

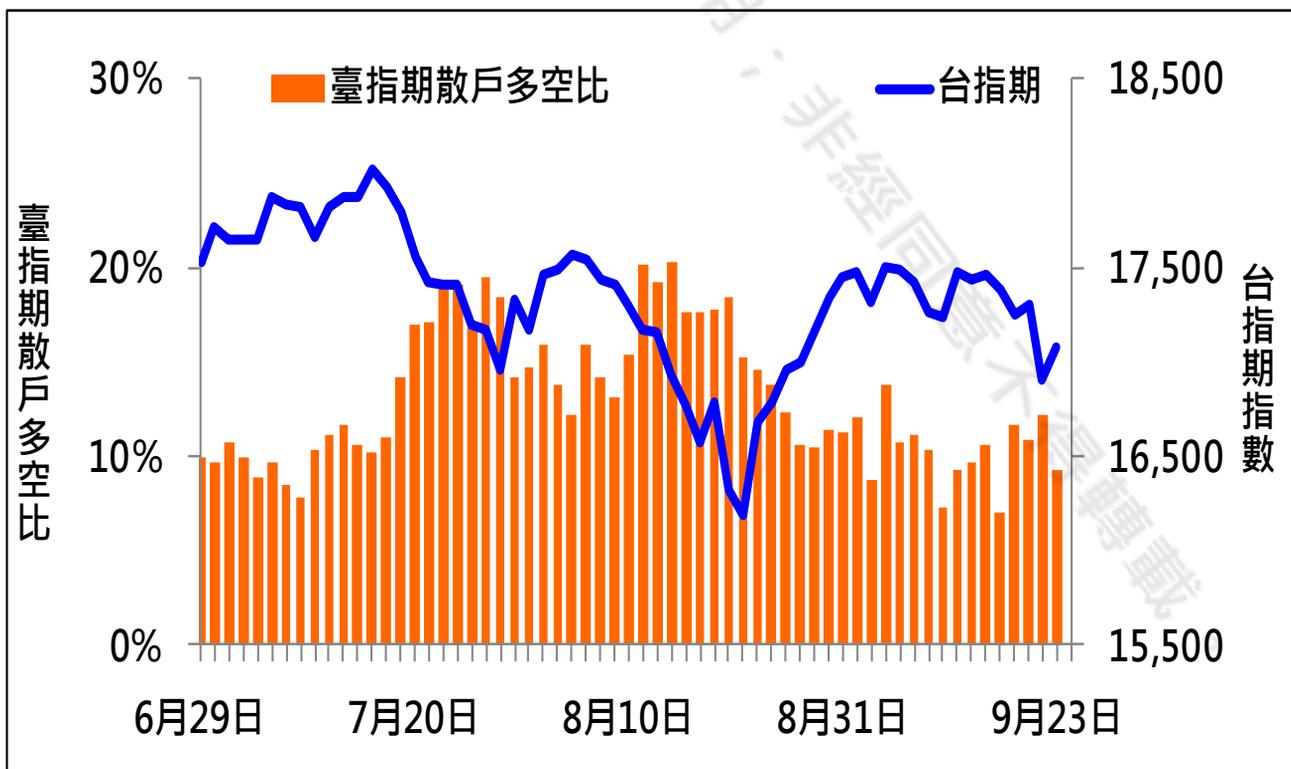
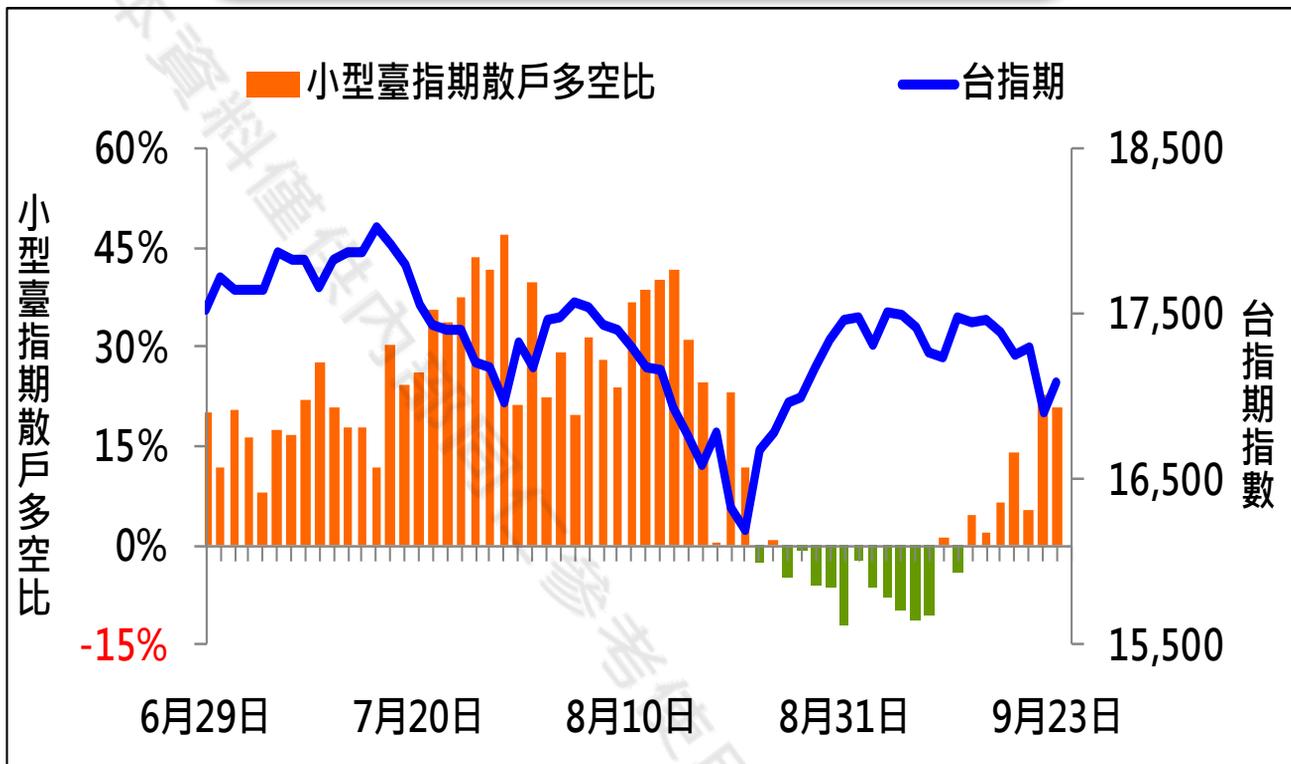
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

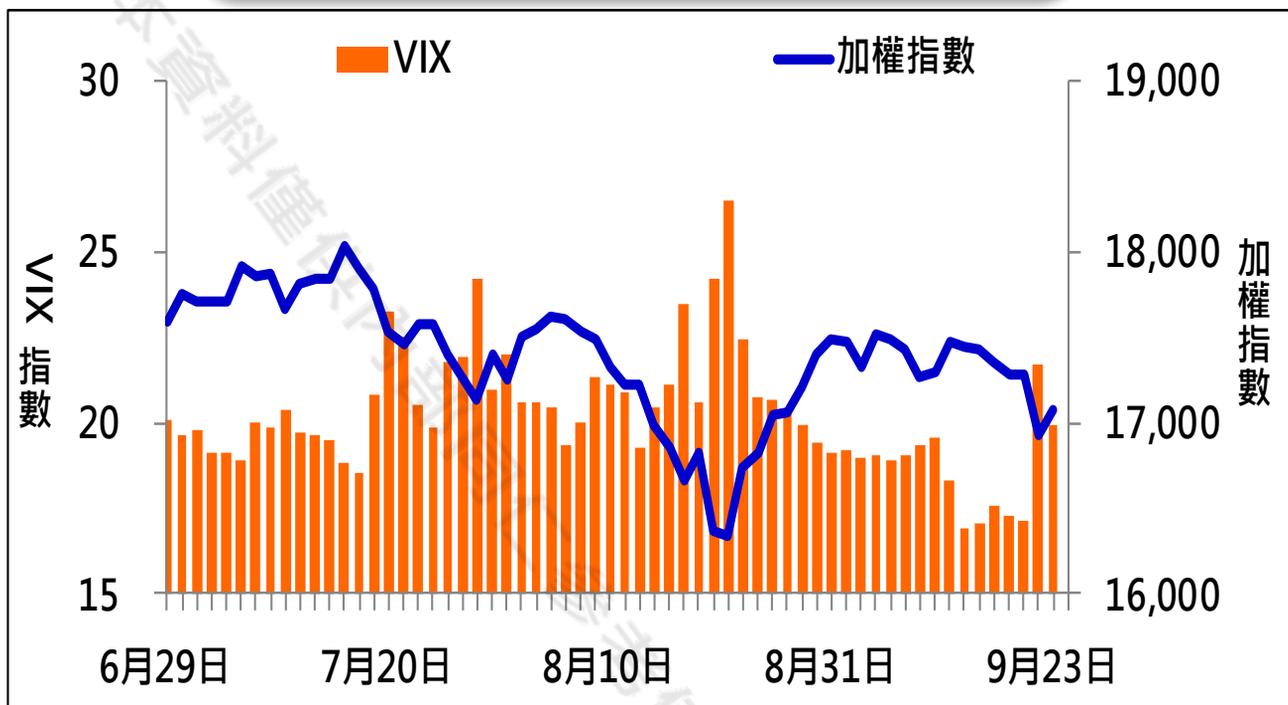
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

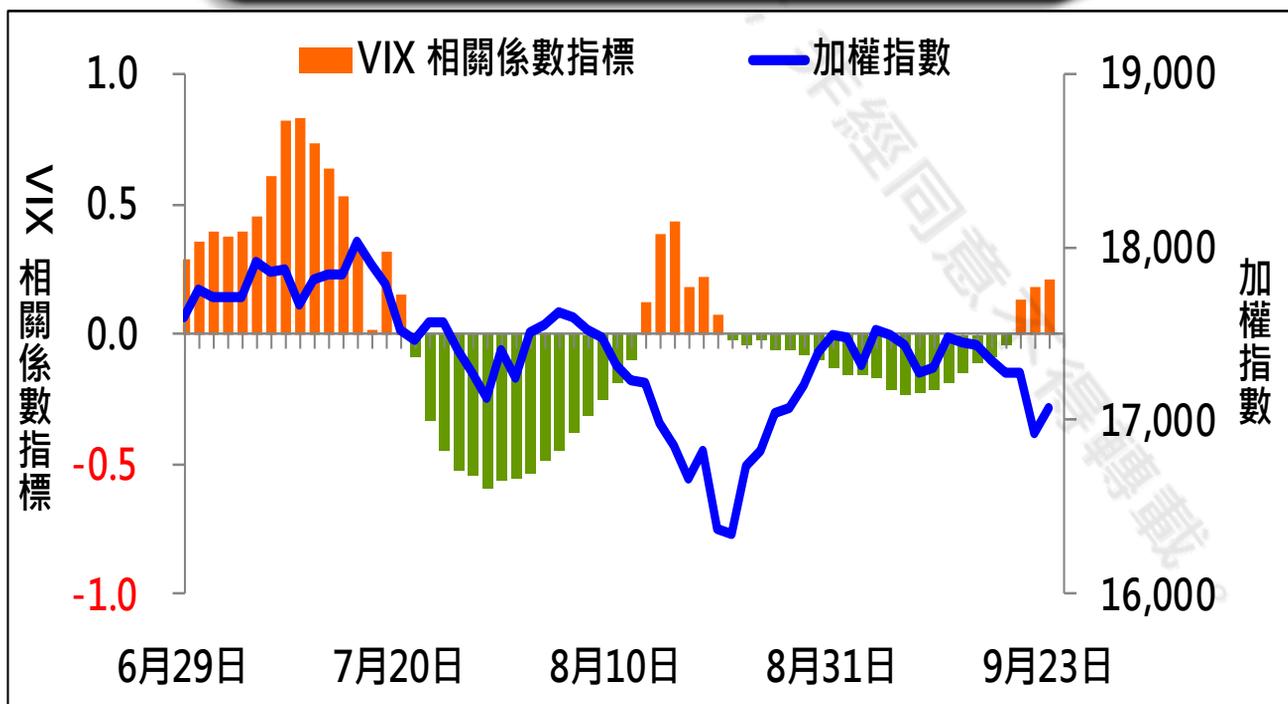
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



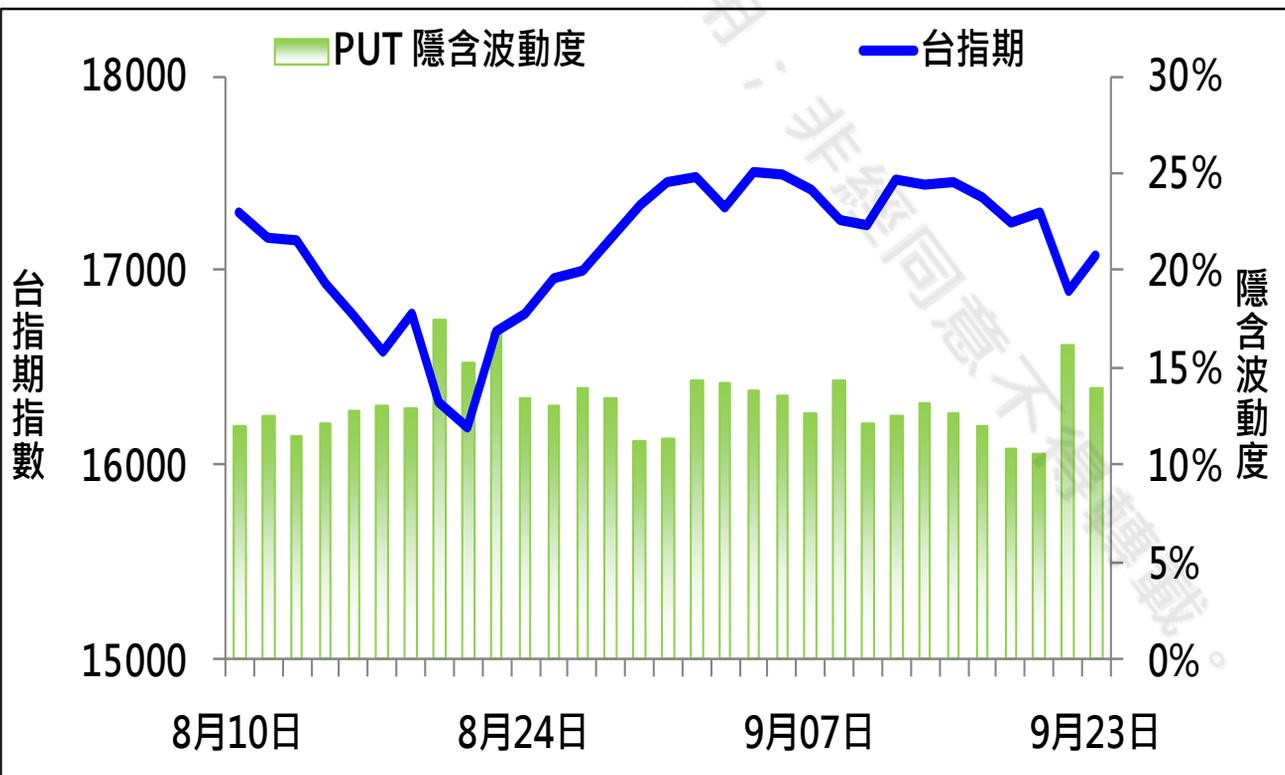
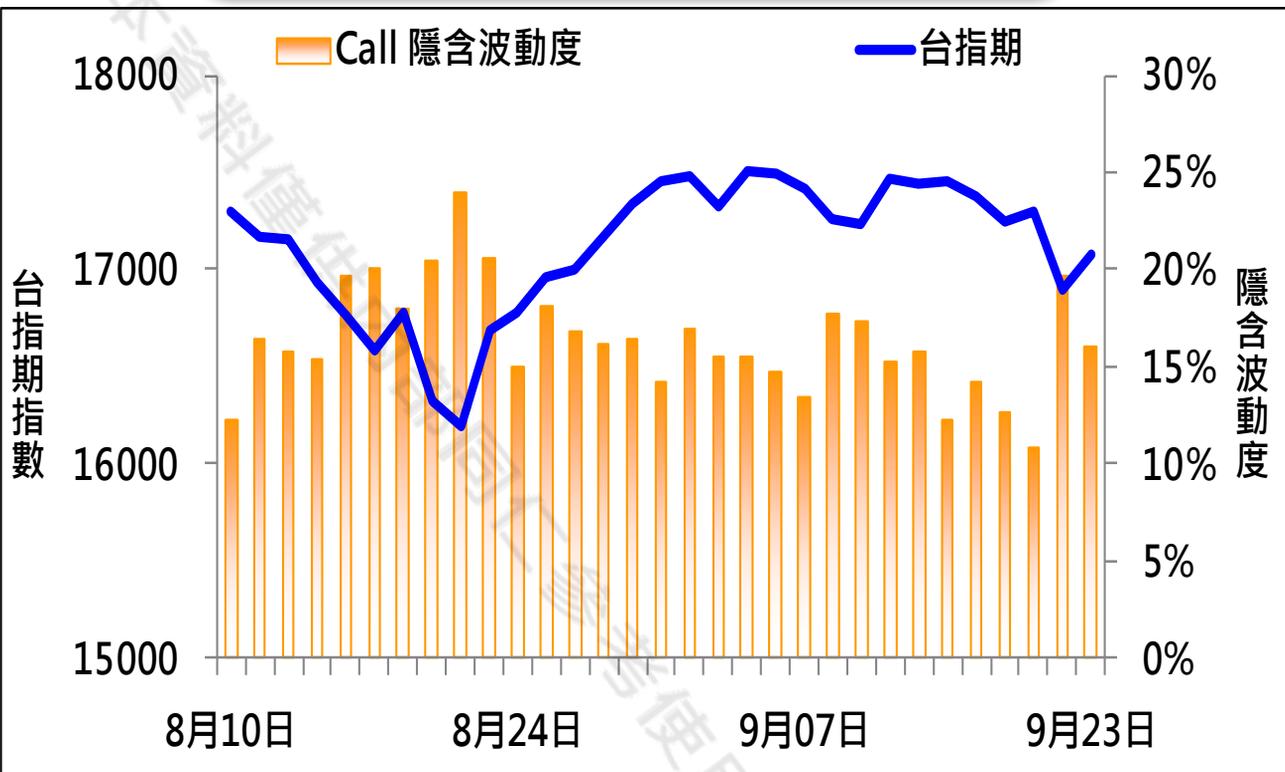
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/9/23

結算日：2021/9/29

OI 增減	Call	202109W5 履約價	Put	OI 增減
-12	2	16,300	6,264	5,341 ※
46	55	16,400	6,121	4,529
0	0	16,450	1,288	1,288
13	120	16,500	3,348	1,378
0	0	16,550	1,248	1,248
5	121	16,600	4,089	1,908
8	8	16,650	1,759	1,759
51	190	16,700	4,955	3,993
2	2	16,750	1,264	1,264
17	398	16,800	3,456	2,222
119	362	16,850	1,741	1,329
109	938	16,900	3,099	2,139
248	744	16,950	1,552	1,241
934	2,305	17,000	2,564	2,167
904	1,697	17,050	1,600	1,548
2,178	3,643	17,100	2,449	2,358
711	2,630	17,150	586	542
1,610	4,136	17,200	595	573
1,605	2,774	17,250	171	168
2,394	4,628	17,300	215	186
2,819	4,278	17,350	30	28
※ 3,172	5,789	17,400	55	33
2,997	4,450	17,500	28	7
821	1,352	17,600	2	2
257	787	17,700	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
22,020	44,359	1.4110	62,589	41,495

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：2021/9/23

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	7	15,900	1,851	155
0	34	16,000	6,944	626
-2	28	16,100	1,722	64
0	64	16,200	3,152	124
0	26	16,300	2,505	290
-1	91	16,400	2,628	173
22	195	16,500	4,013	999
5	186	16,600	4,891	1,281
3	221	16,700	3,952	258
-10	757	16,800	2,548	272
78	930	16,900	2,448	393
182	1,488	17,000	3,563	527
248	1,524	17,100	1,256	83
62	2,182	17,200	3,135	2
199	4,745	17,300	2,242	-46
848	5,054	17,400	1,149	22
326	5,357	17,500	472	4
※ 1,078	4,034	17,600	507	61
-126	3,111	17,700	164	0
197	4,058	17,800	39	0
552	3,802	17,900	109	-1
499	6,778	18,000	23	0
151	4,470	18,100	4	0
136	3,336	18,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
7,982	77,907	1.0330	80,477	4,244
昨日 P/C	1.0902	今日增減變化		-0.0572

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。

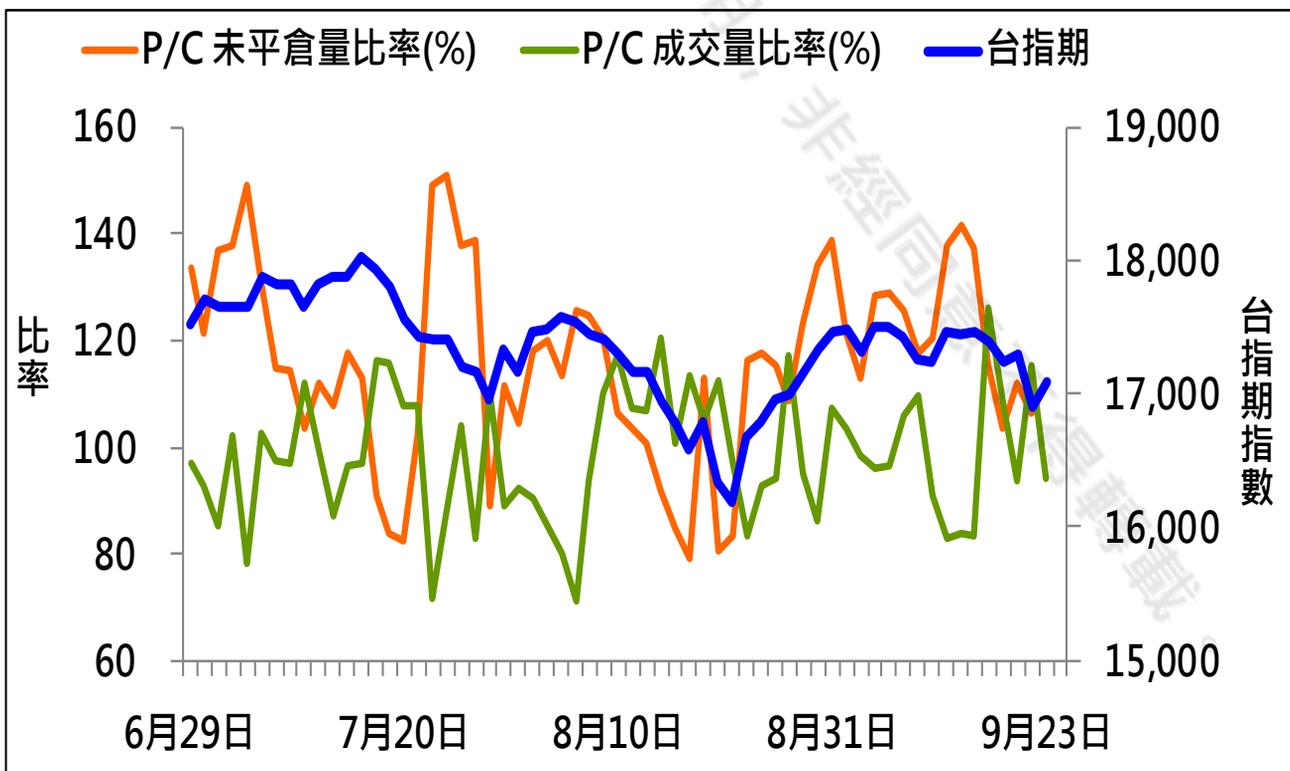
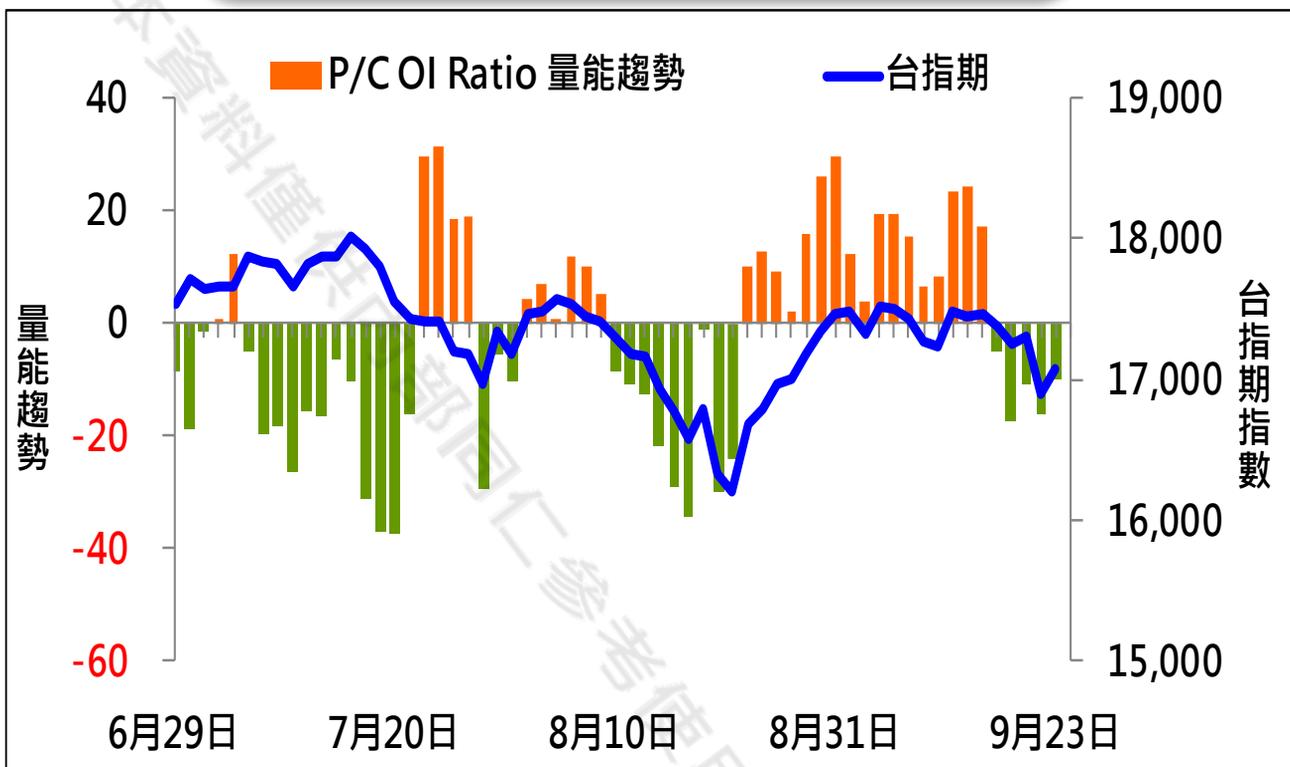
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

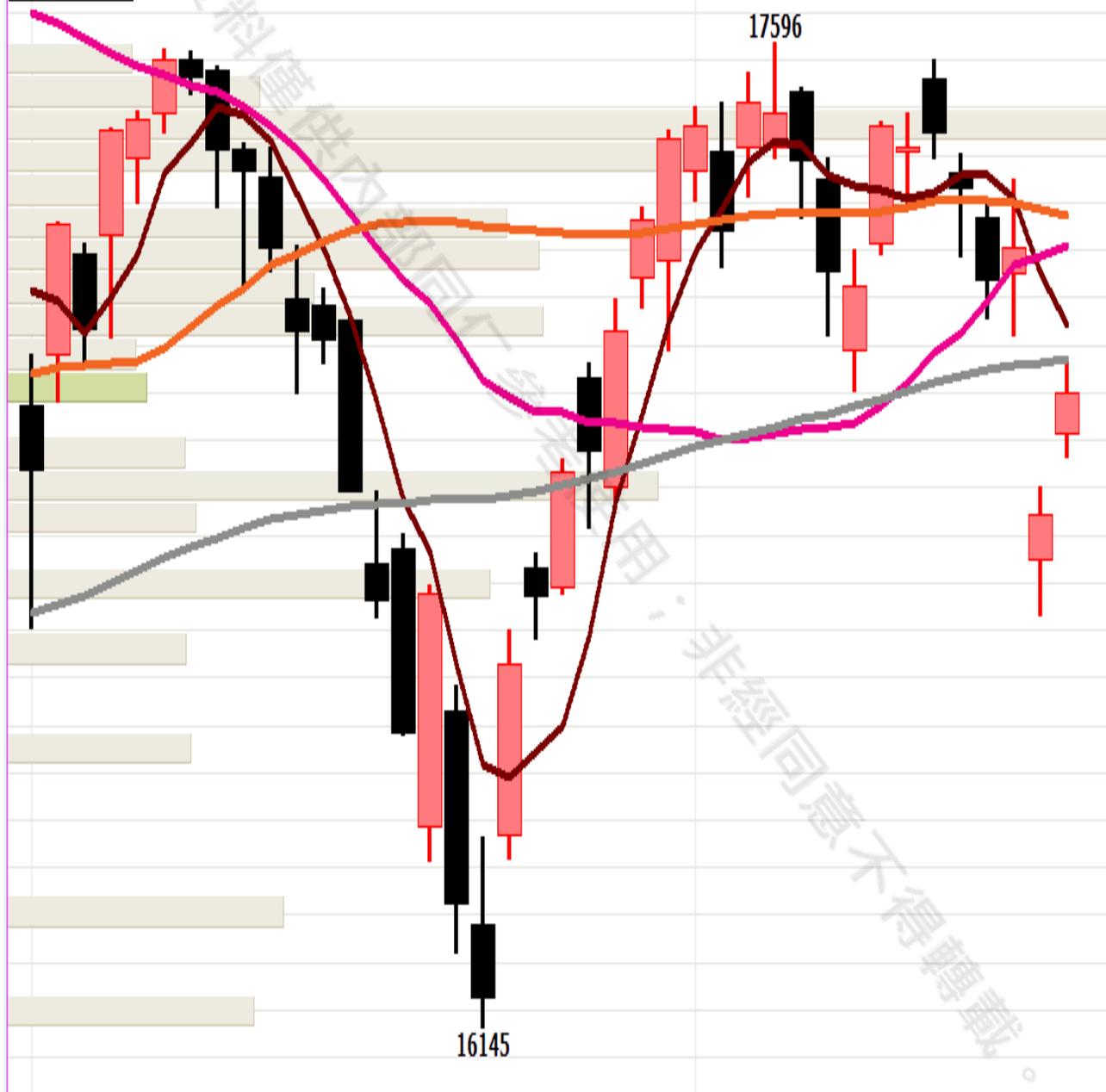


## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FITX\*1) 日線圖 2021/09/23 開 17020 高 17130 低 16985 收 17080 s點 量 99807 口 +180

SMA5 17180.60↓ SMA20 17295.60↑ SMA60 17342.05↓ SMA120 17129.53↑

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