



法人籌碼動態

09月28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	-18,446	880	470	84	-1,734	-79
投信	-4,206	-864	189	-9	24	0
自營商	12,408	-92	-162	-7	254	24

09月28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	-88	-4	113	-1,251	22,283	-467
投信	2	0	0	0	-59	0
自營商	76	20	9,055	-17,501	4,248	2,576

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台塑化	9.72	台積電	-68.29	台指期前十大 市場佔比	45.2%	53.8%
台塑	5.24	長榮	-10.31			
南亞	1.83	富邦媒	-5.99			
南亞科	1.73	陽明	-4.76	電子期前十大 市場佔比	58.0%	73.0%
亞德客-KY	1.62	台達電	-4.70			
國泰金	1.45	鴻海	-4.56			
台化	1.35	日月光投控	-4.32	金融期前十大 市場佔比	64.8%	91.0%
中信金	0.99	聯電	-4.09			
潤泰全	0.84	萬海	-3.29			
永大	0.77	大立光	-2.21	非金電期前十大 市場佔比	91.2%	95.9%
前十名合計	25.54	後十名合計	-112.53			

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

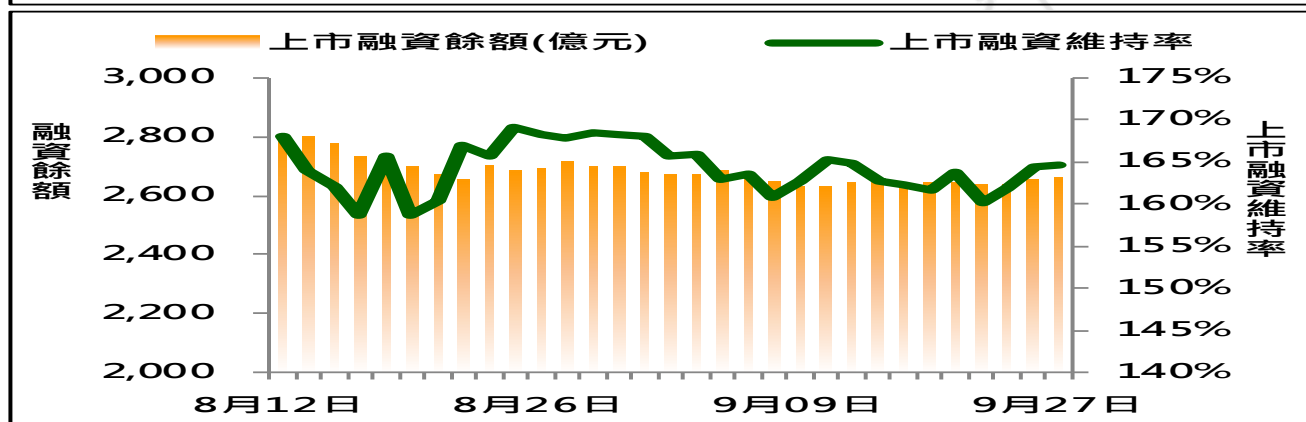
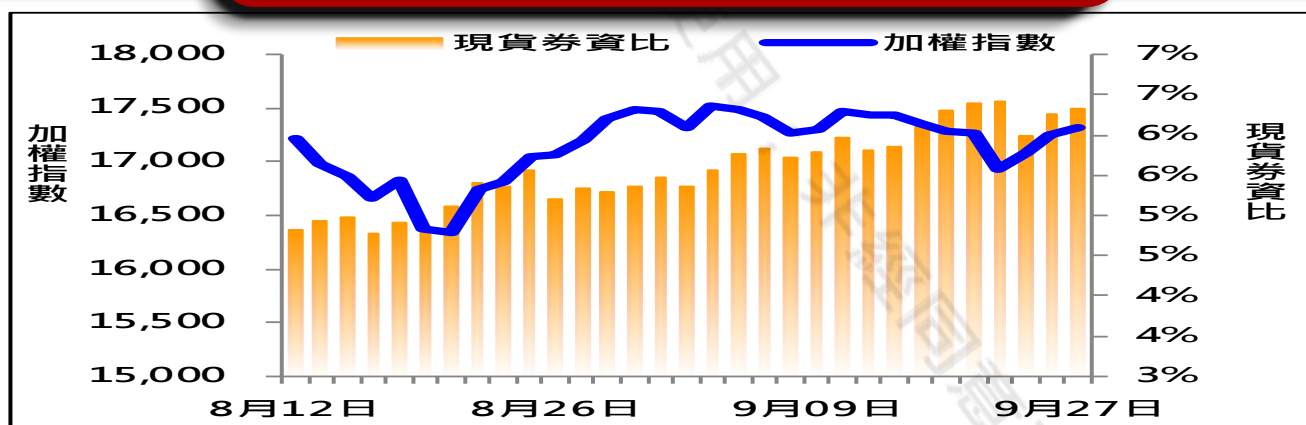


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
09月24日	79.4	-17,463	-995	8.6	12,566	-463
09月27日	38.6	-19,326	-1,863	2.0	12,500	-66
09月28日	-139.6	-18,446	880	-10.4	12,408	-92

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
09月24日	-827	21,026	-21,853	30,417	806	29,611
09月27日	1,364	22,750	-21,386	26,556	1,672	24,884
09月28日	113	22,283	-22,170	9,055	4,248	4,807

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。

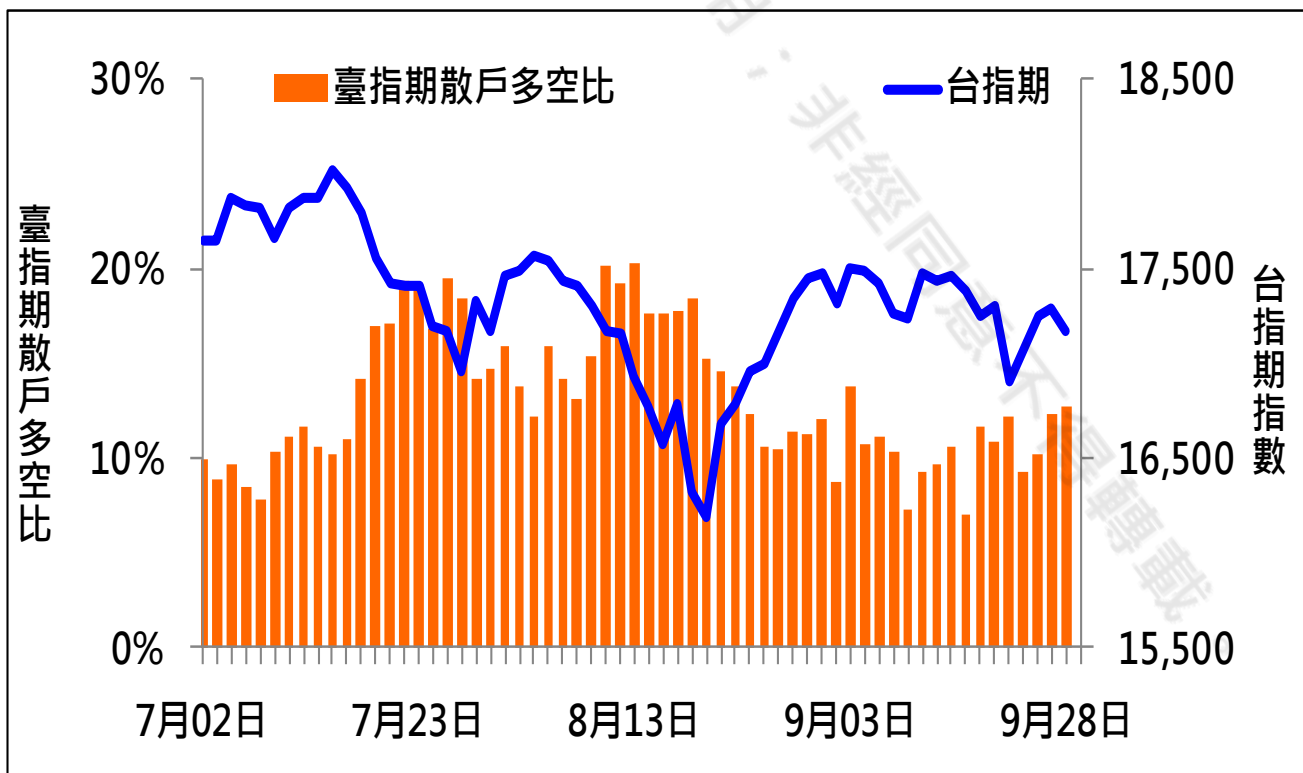
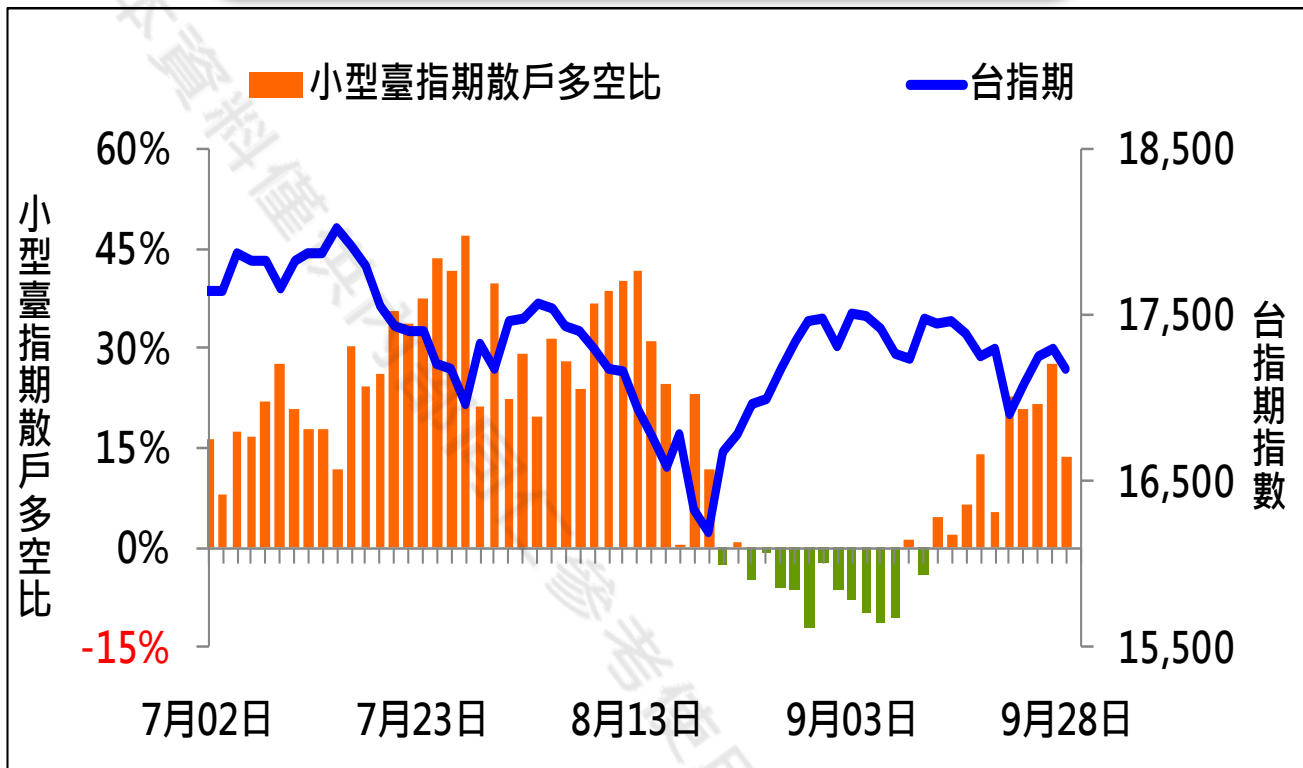
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

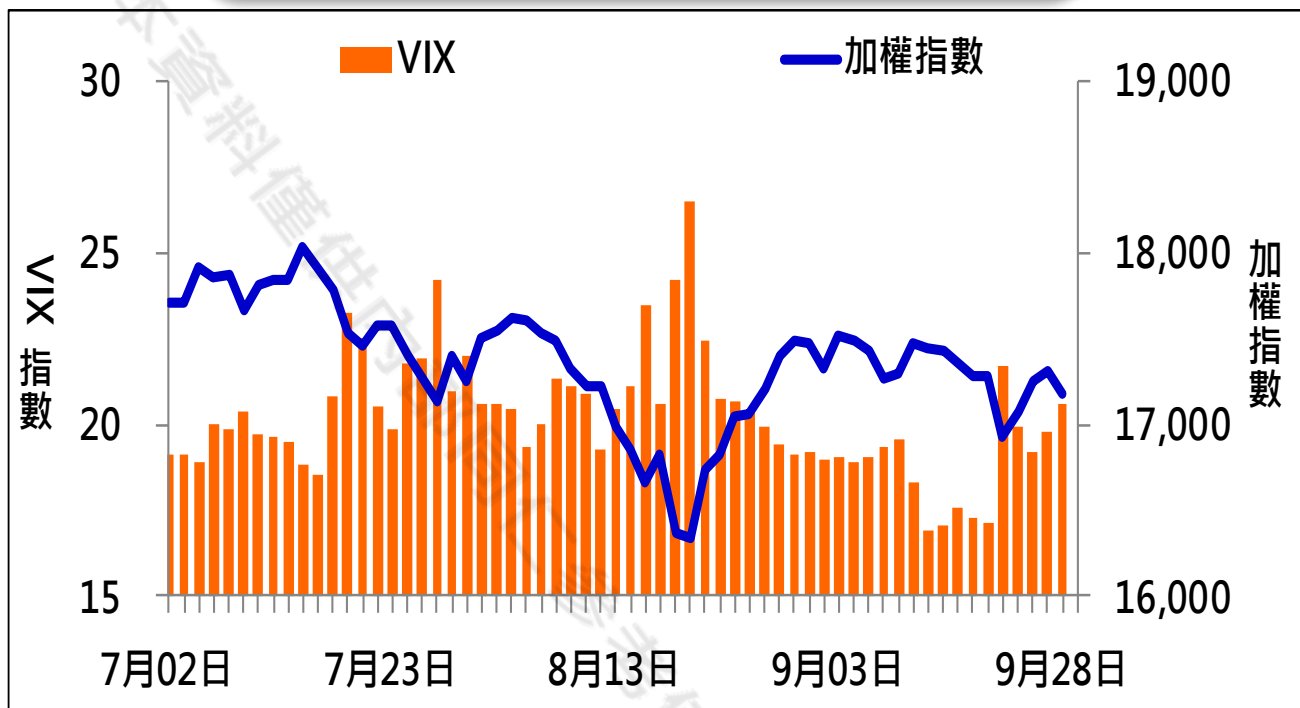
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

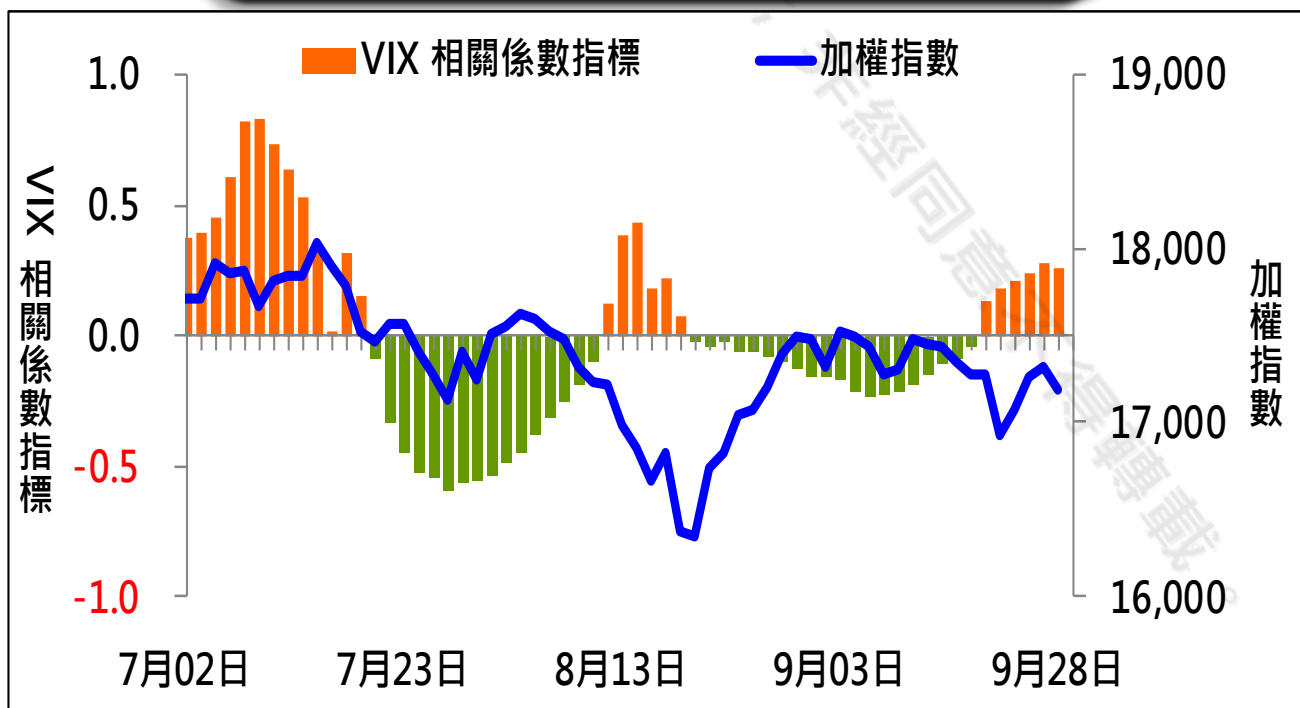
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

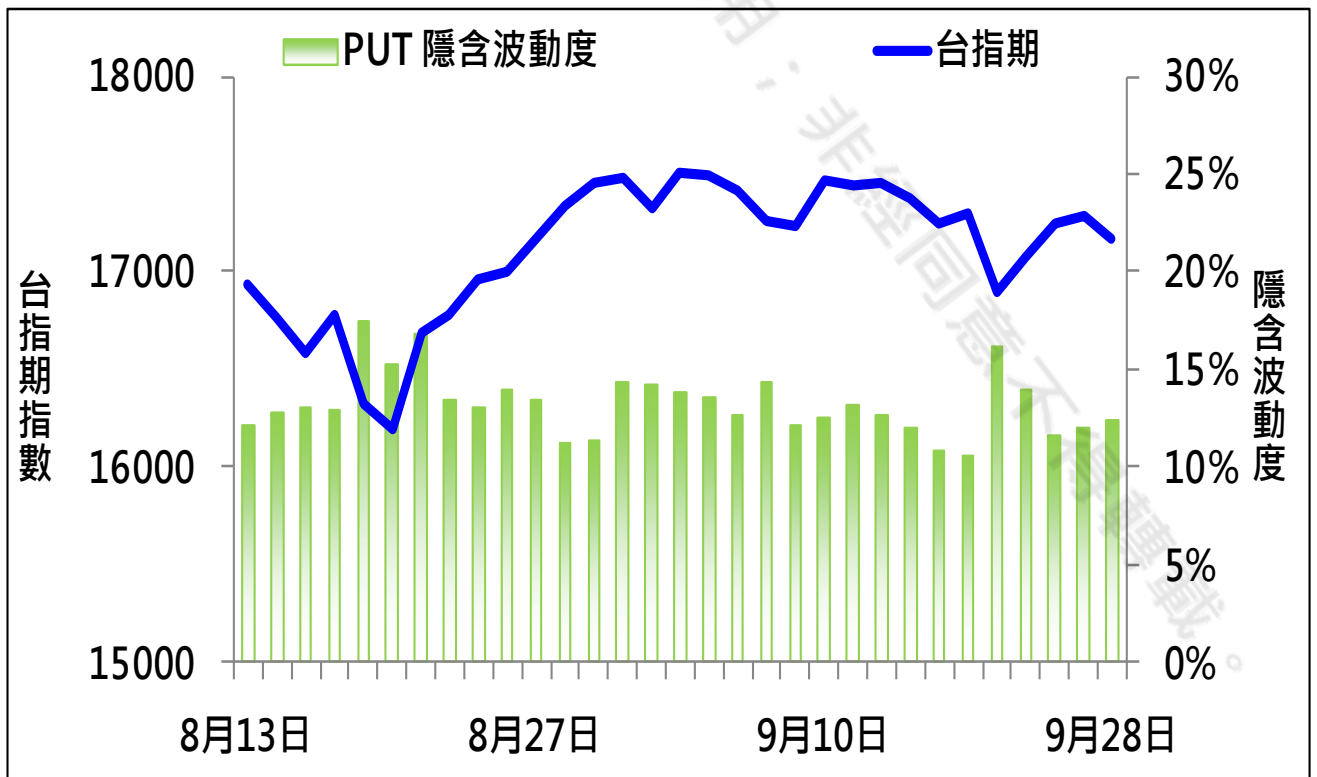
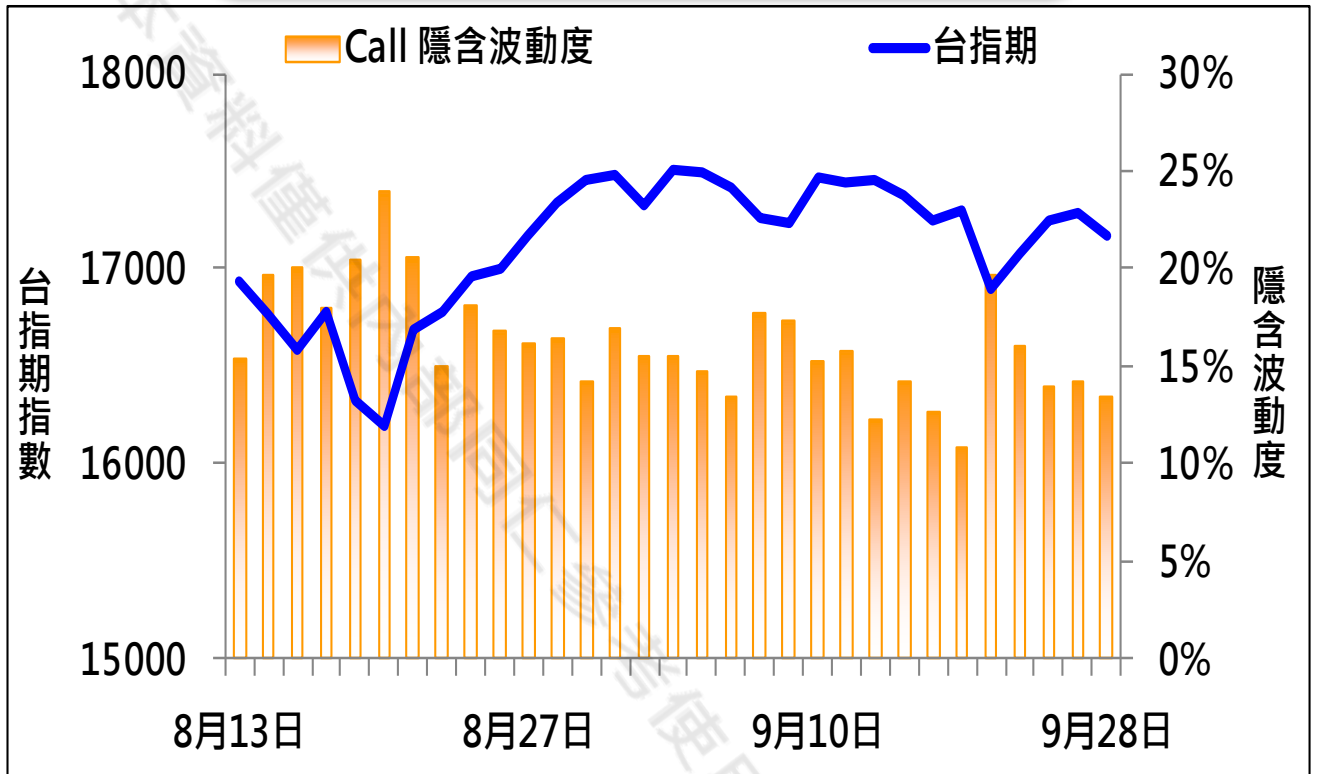
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/9/28

結算日：2021/9/29

OI 增減	Call	202109W5 履約價	Put	OI 增減
1	122	16,600	4,127	-215
1	9	16,650	2,124	92
-12	168	16,700	5,270	611
7	9	16,750	4,140	101
9	390	16,800	5,360	-581
-74	269	16,850	4,688	1,345
80	819	16,900	7,502	1,168
57	718	16,950	5,471	905
405	2,389	17,000	8,088	-85
444	2,028	17,050	8,679	2,530
2,147	5,690	17,100	11,009	2,467
3,603	5,730	17,150	6,088	917
6,243	9,983	17,200	5,153	665
5,460	9,518	17,250	3,329	-322
※ 7,924	17,232	17,300	2,953	-432
4,755	11,405	17,350	1,191	-289
4,682	13,341	17,400	1,364	-296
-2,212	7,589	17,450	316	-26
-3,472	8,005	17,500	152	-88
-3,377	3,968	17,550	35	-8
75	4,072	17,600	27	2
25	2,122	17,650	4	-1
222	1,506	17,700	7	-4
-221	872	17,750	2	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
26,195	110,691	1.0515	116,388	7,414

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：2021/9/28

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
0	7	15,900	2,020	-154
0	34	16,000	10,545	3,429
0	28	16,100	2,252	60
0	60	16,200	4,033	116
0	26	16,300	3,049	38
1	92	16,400	3,066	172
0	164	16,500	4,605	183
407	938	16,600	5,641	26
349	1,123	16,700	4,167	-8
23	1,026	16,800	3,709	296
-21	856	16,900	3,198	52
-58	1,206	17,000	4,707	-48
566	2,015	17,100	2,268	451
435	3,179	17,200	3,988	-18
1,122	5,835	17,300	2,678	152
865	6,182	17,400	1,283	11
376	6,265	17,500	502	-29
1,445	7,135	17,600	440	-26
1,099	4,171	17,700	176	11
※ 2,056	7,344	17,800	31	2
1,823	6,887	17,900	112	0
1,431	8,629	18,000	20	0
635	7,265	18,100	6	0
128	8,213	18,200	0	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
12,730	105,507	0.9598	101,266	11,045
昨日 P/C	0.9725	今日增減變化		-0.0126

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。

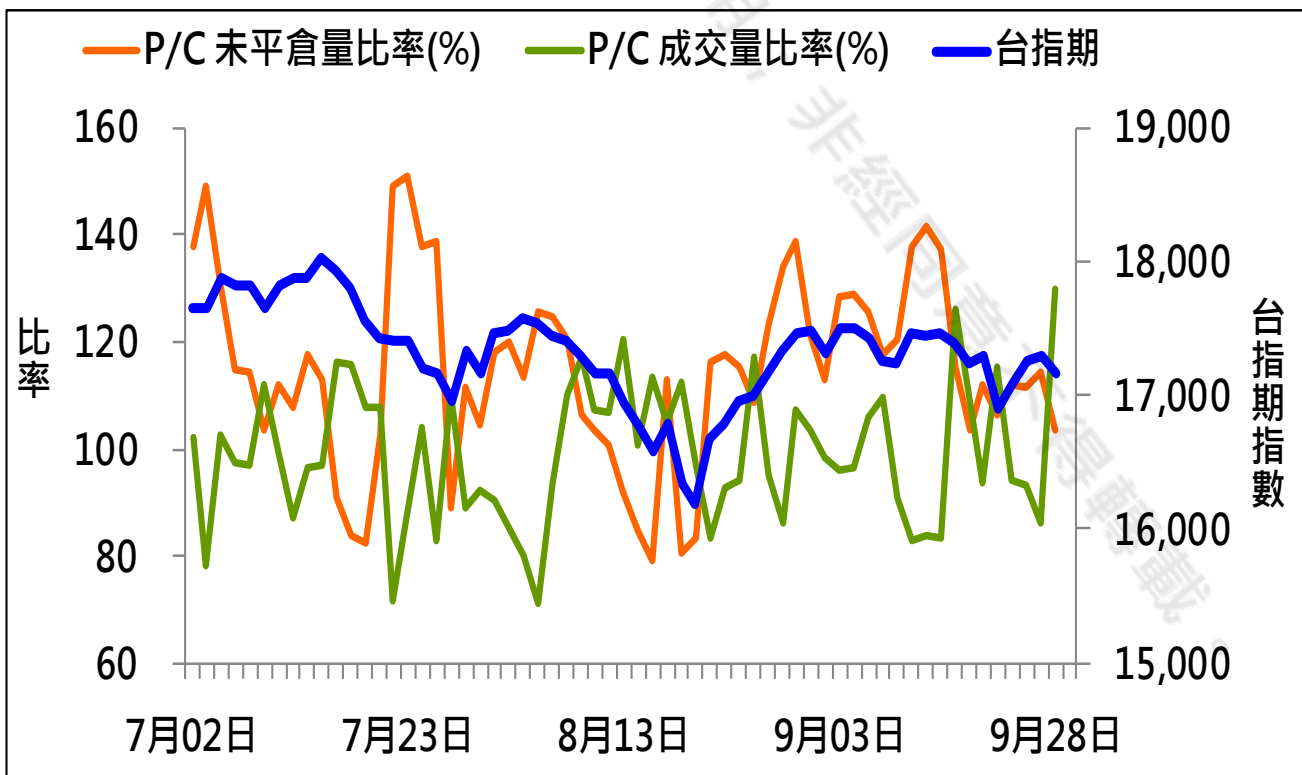
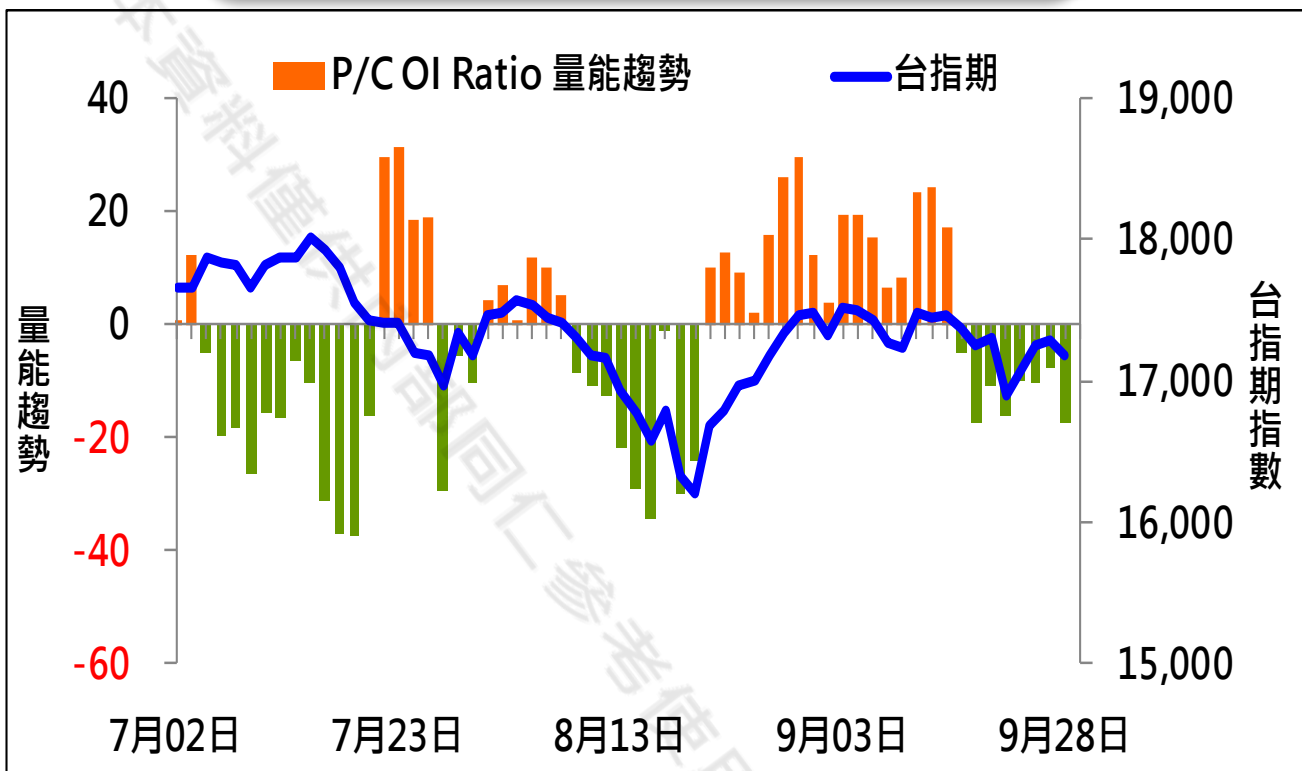
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/09/28 開 17182 高 17183 收 17170 ↓ 點 量 103595 口 -122 (-0.71%)

SMA5 17138.00 ↓ SMA20 17324.75 ↓ SMA60 17320.43 ↓

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



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