



法人籌碼動態

09月30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	-16,731	1,439	545	80	-1,772	26
投信	-4,992	534	185	0	24	0
自營商	13,752	146	-336	-138	240	-44

09月30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	-64	41	-1,462	3,813	24,657	5,745
投信	2	0	0	0	-60	0
自營商	48	-27	6,475	556	8,162	677

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
中鋼	5.71	台塑化	-8.78	台指期前十大 市場佔比	43.1%	51.9%
長榮	5.16	聯發科	-4.19			
日月光投控	4.33	中華電	-2.55			
聯電	4.09	緯穎	-2.07	電子期前十大 市場佔比	55.9%	69.7%
南電	3.40	祥碩	-1.48			
中租-KY	3.03	光寶科	-1.47			
台達電	2.99	友達	-1.43	金融期前十大 市場佔比	66.0%	92.1%
陽明	2.60	南亞科	-1.33			
萬海	2.19	矽力-KY	-1.23			
旭隼	2.01	台聚	-0.86	非金電期前十大 市場佔比	87.8%	95.9%
前十名合計	35.51	後十名合計	-25.39			

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

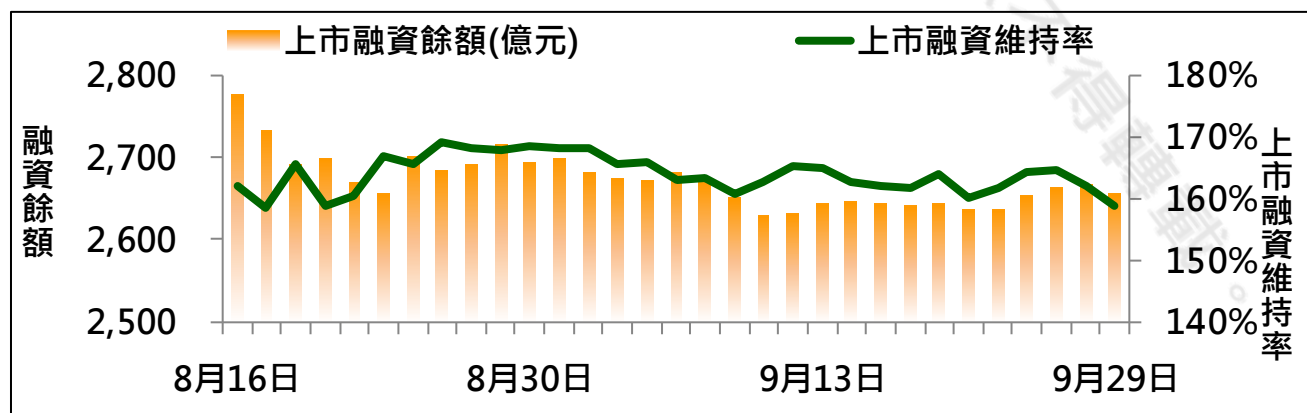
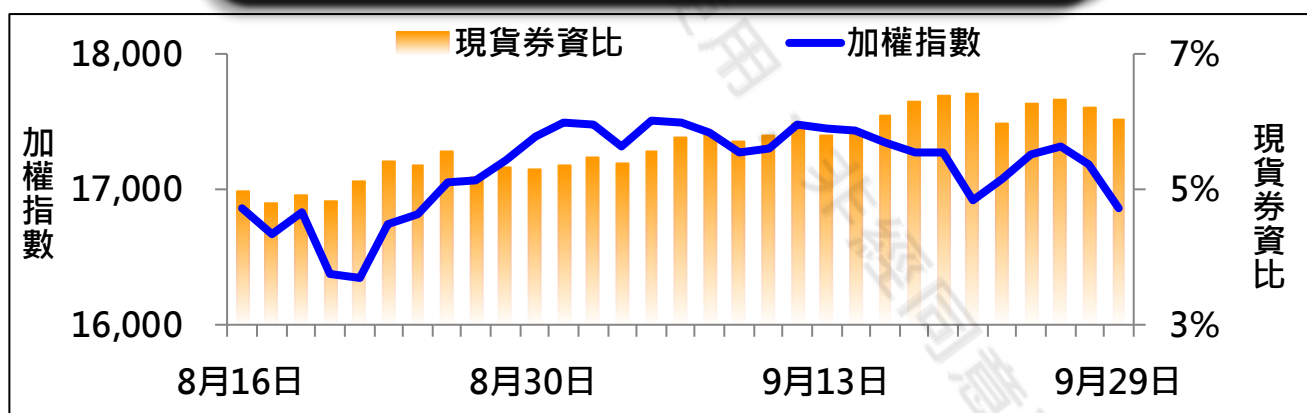


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
09月29日	-354.6	-18,170	276	-106.9	13,606	1,198
09月30日	-78.9	-16,731	1,439	-8.0	13,752	146

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
09月29日	-5,275	18,912	-24,187	5,919	7,485	-1,566
09月30日	-1,462	24,657	-26,119	6,475	8,162	-1,687

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。

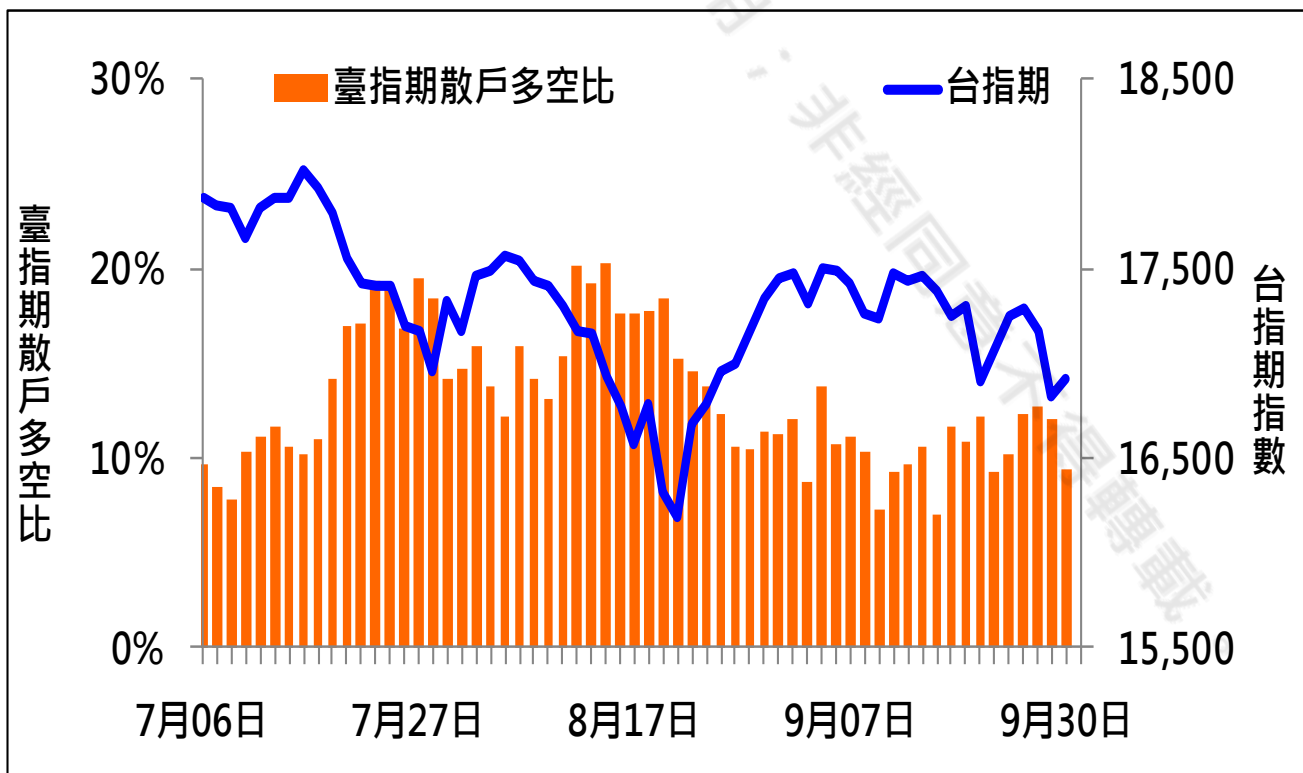
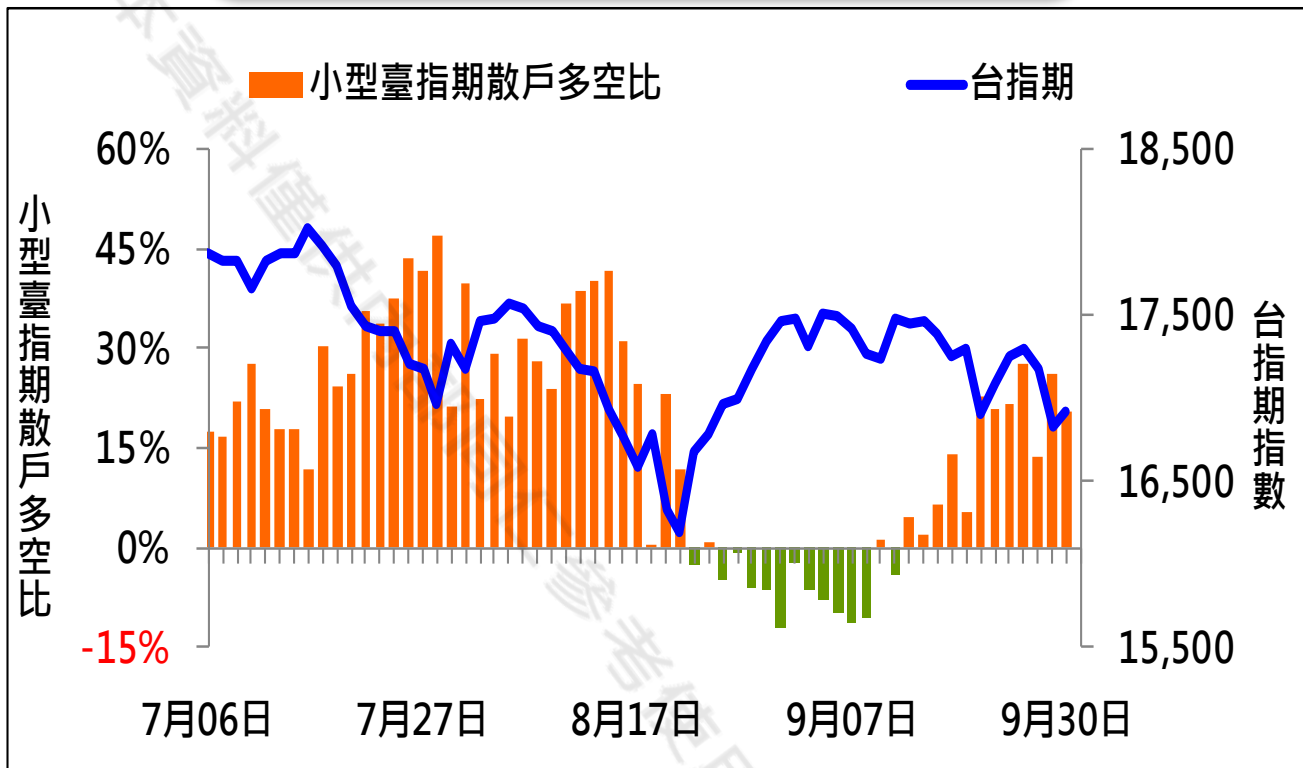
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

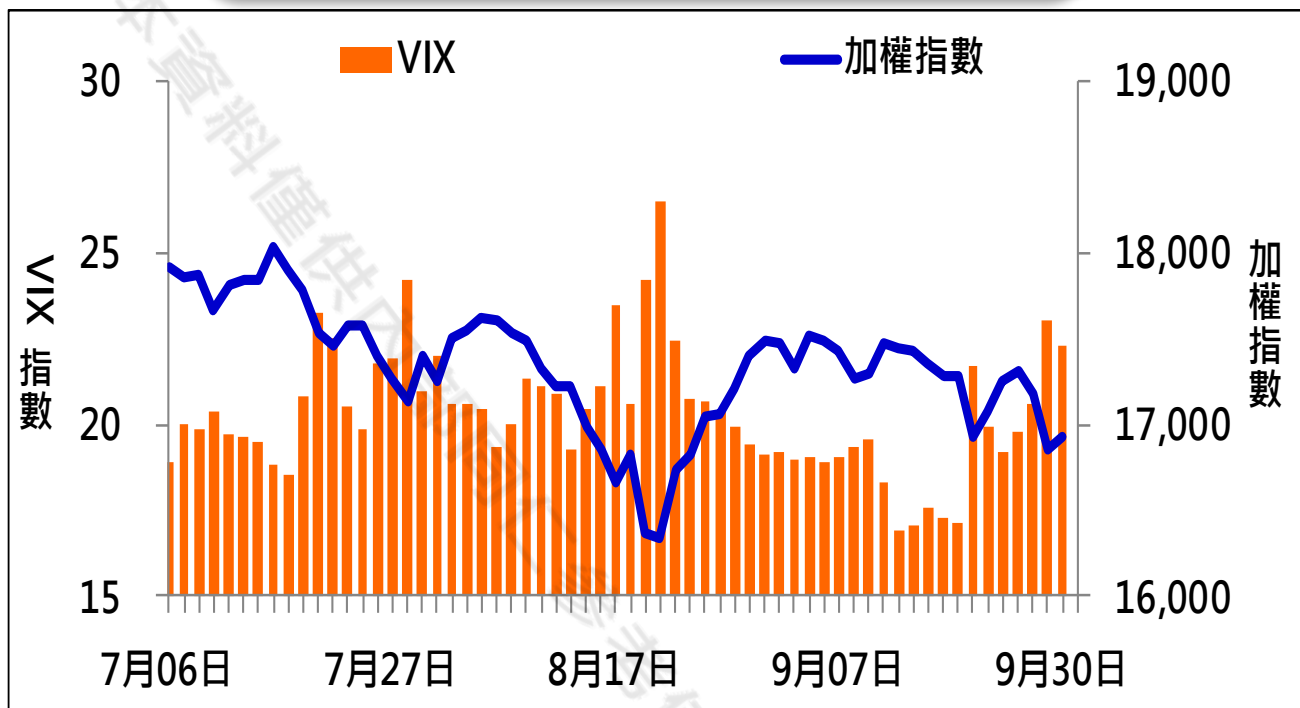
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

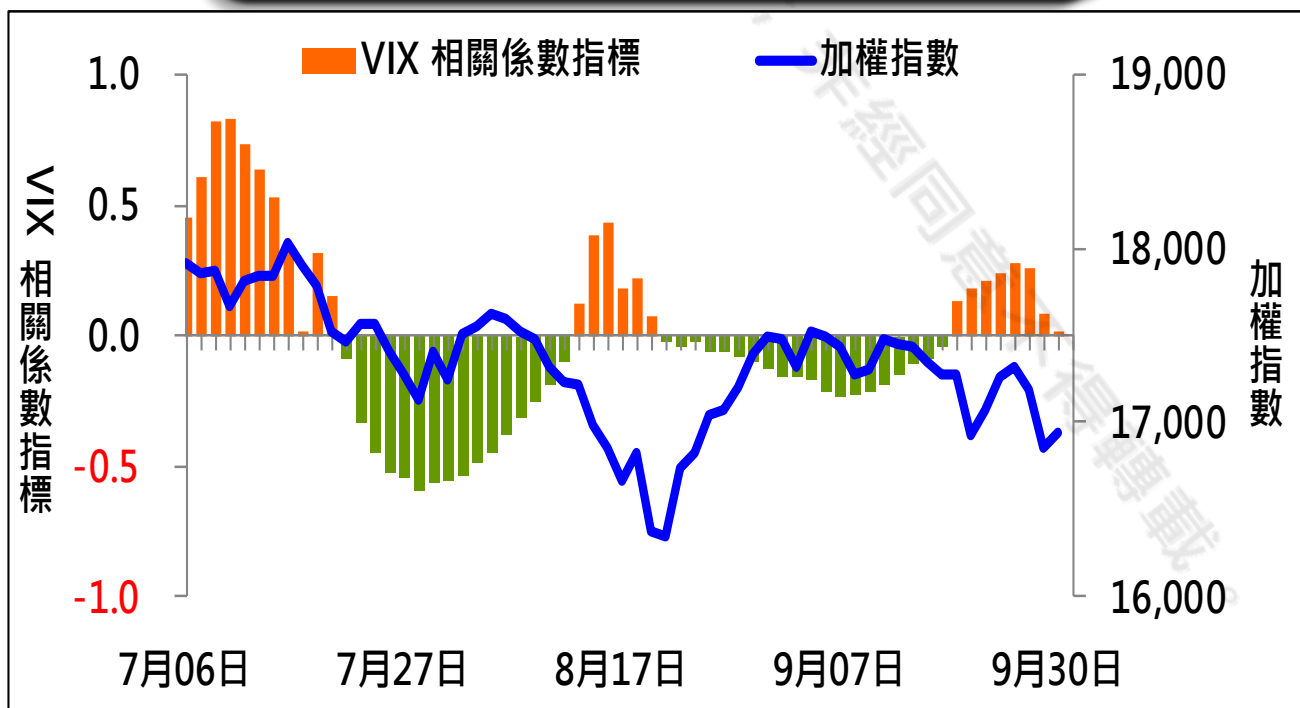
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

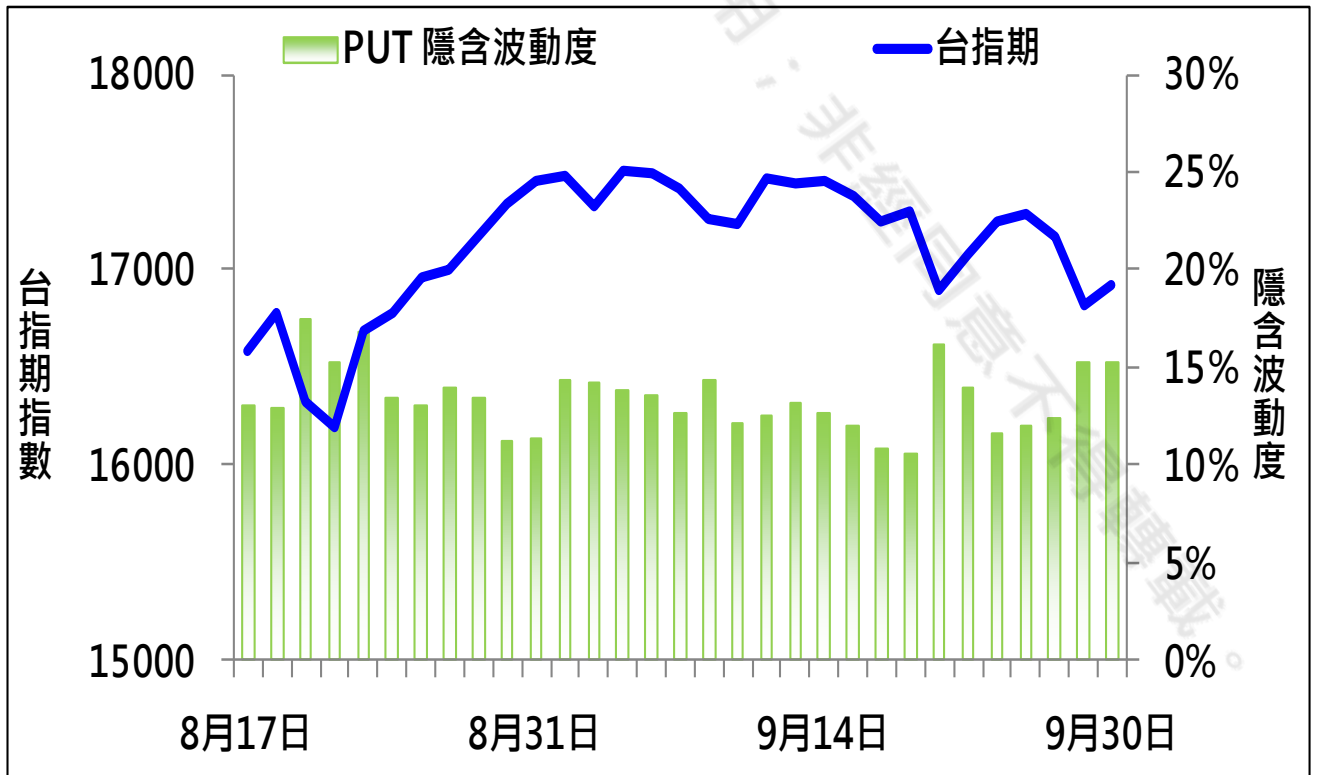
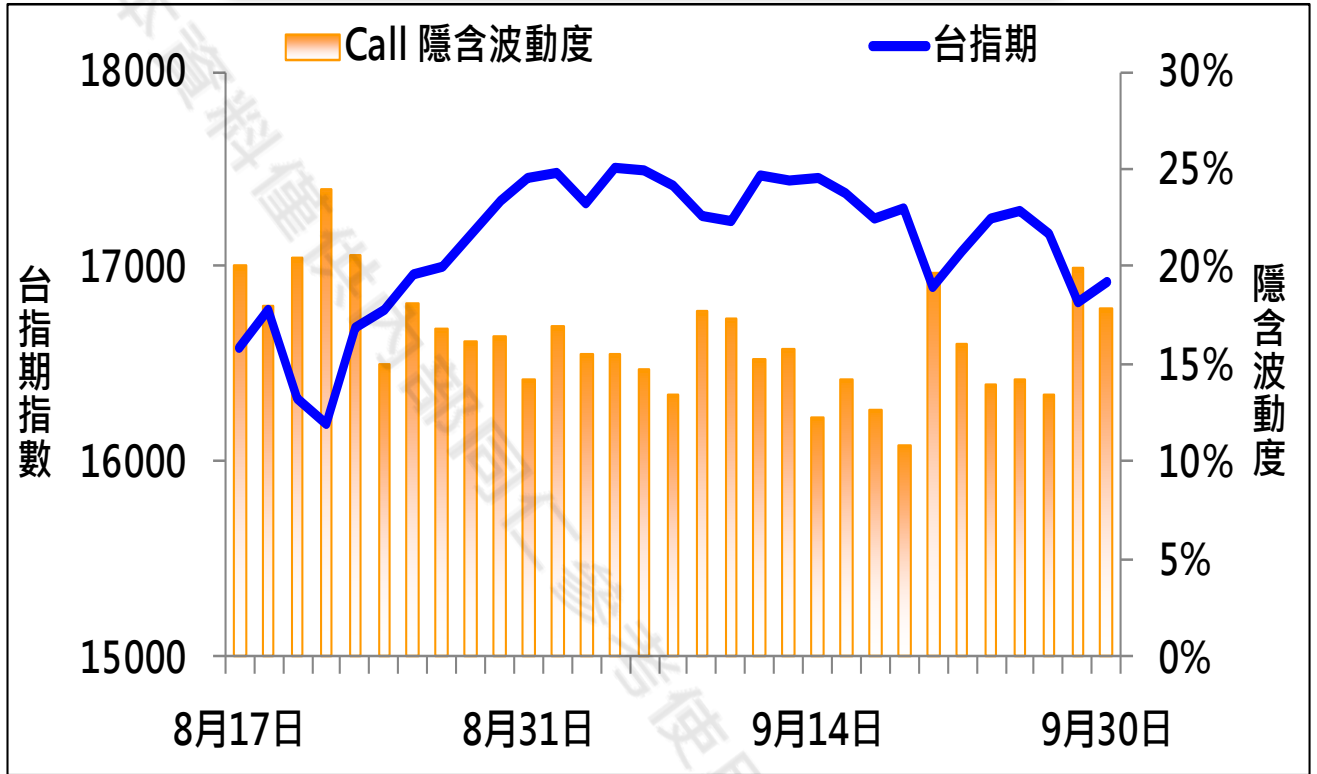
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/9/30

結算日：2021/10/6

OI 增減	Call	202110W1 履約價	Put	OI 增減
5	7	16,200	3,559	2,337
9	15	16,300	4,406	2,559
5	5	16,350	624	624
8	40	16,400	3,244	1,804
25	25	16,450	1,169	1,169
128	151	16,500	5,345	3,325
31	31	16,550	1,167	1,167
65	107	16,600	4,862	3,791
28	28	16,650	1,427	1,427
485	656	16,700	2,886	2,171
601	688	16,750	1,465	989
795	1,204	16,800	2,663	2,051
1,003	1,463	16,850	2,164	1,715
1,132	2,200	16,900	1,552	1,087
1,302	1,840	16,950	773	534
1,789	3,612	17,000	705	594
1,084	2,128	17,050	252	226
※	2,995	17,100	322	273
1,783	3,667	17,150	76	71
2,746	4,921	17,200	93	81
1,817	3,613	17,250	35	12
2,257	4,763	17,300	36	15
1,663	3,695	17,350	5	5
1,510	3,297	17,400	4	4
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
26,093	51,803	1.1215	58,098	37,535

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：2021/9/30

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
4	162	15,800	3,857	298
16	23	15,900	2,515	313
0	35	16,000	11,088	718
0	28	16,100	3,692	1,305
-3	66	16,200	6,294	2,164 ※
3	45	16,300	3,899	282
3	97	16,400	4,234	505
23	220	16,500	5,182	658
66	1,731	16,600	4,349	22
-35	1,318	16,700	4,109	67
601	2,091	16,800	4,166	693
-52	2,365	16,900	3,348	204
※ 2,414	4,999	17,000	4,854	265
482	3,092	17,100	2,169	-32
290	5,095	17,200	3,958	13
329	7,496	17,300	2,536	-54
848	7,022	17,400	1,287	61
590	8,688	17,500	450	-7
543	8,117	17,600	410	-15
1,293	6,110	17,700	178	3
1,675	9,904	17,800	60	31
-35	7,776	17,900	106	0
-250	9,465	18,000	21	1
-349	6,920	18,100	6	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
7,973	126,840	0.8948	113,497	11,833
昨日 P/C	0.8553	今日增減變化		0.0395

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。

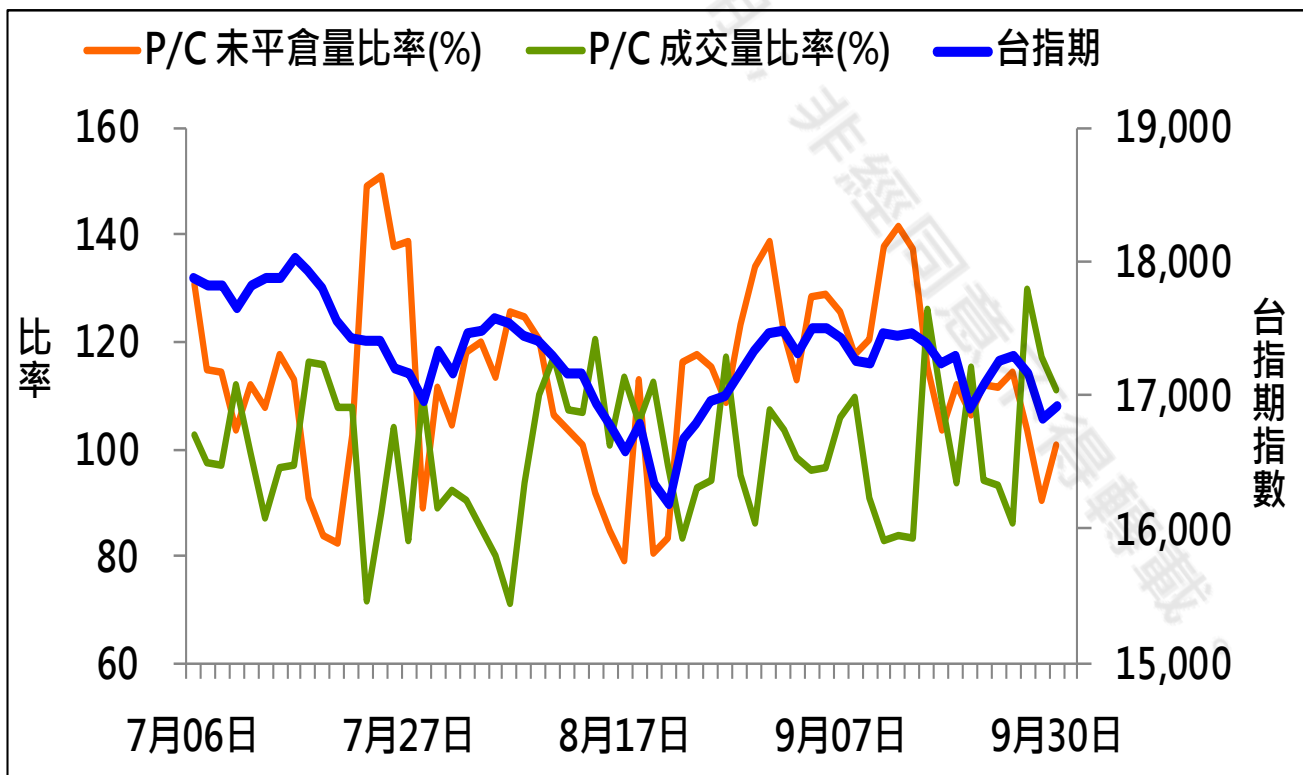
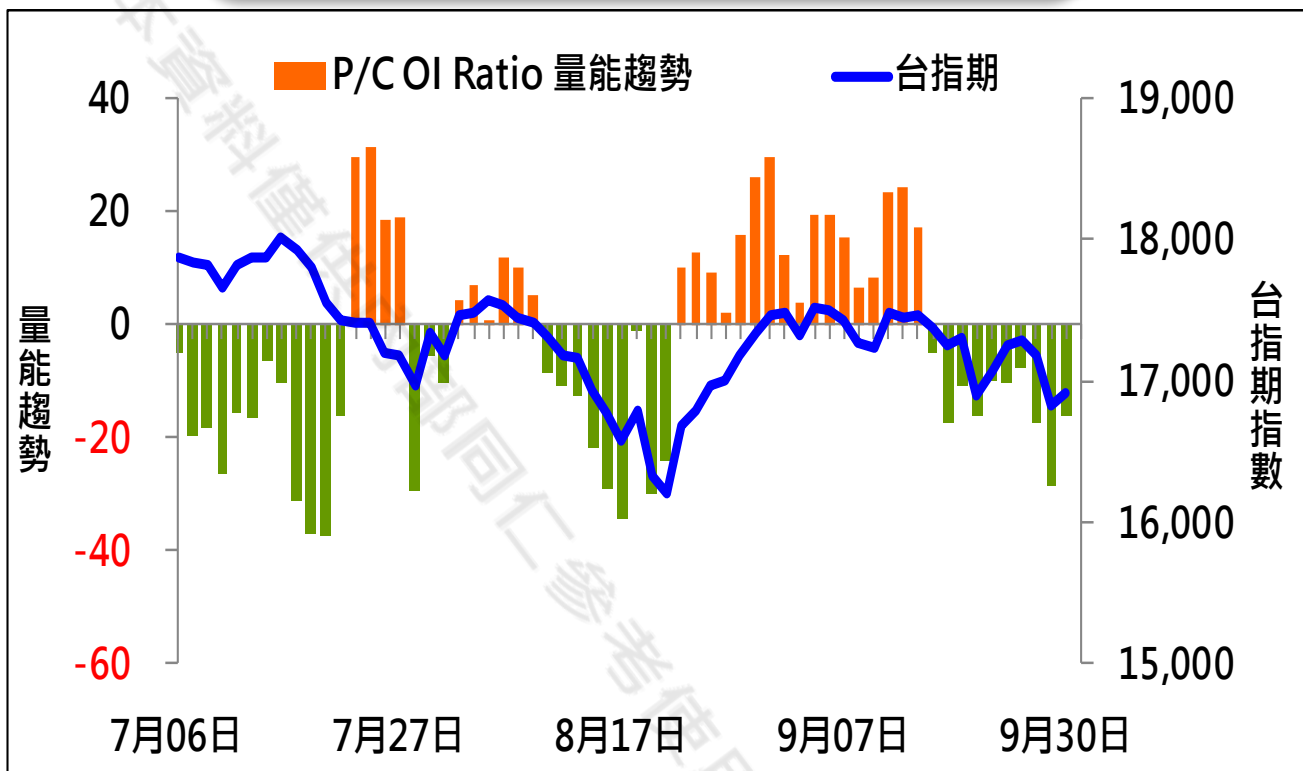
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

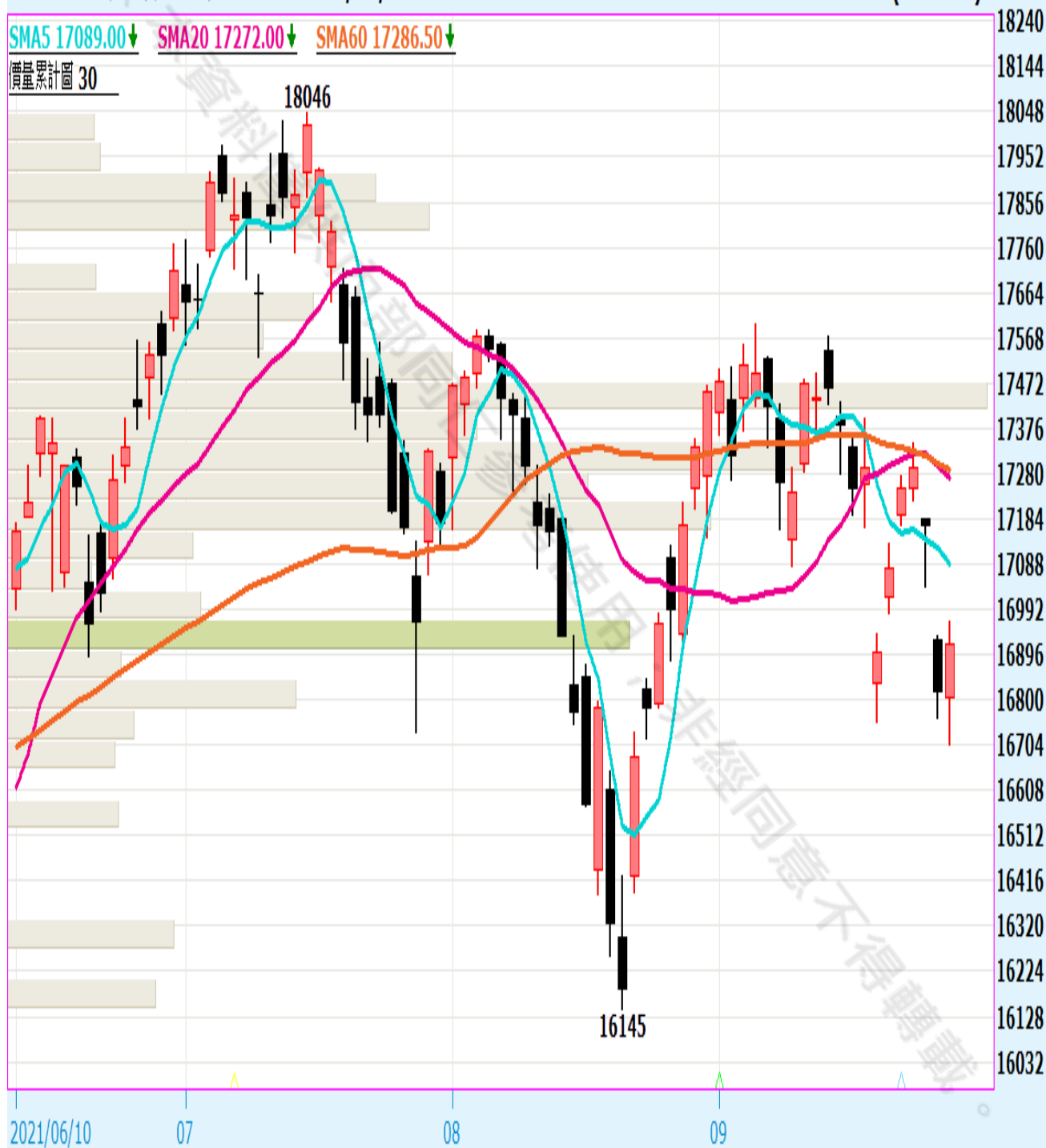


盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FITX*1) 日線圖 2021/09/30 開 16803 高 16966 收 16917 ↑ 點 量 129062 口 +99 (+0.59%)

SMA5 17089.00 ↓ SMA20 17272.00 ↓ SMA60 17286.50 ↓

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