



## 法人籌碼動態

10月12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	-15,634	5,510	346	-15	-1,640	12
投信	-5,231	-568	167	0	24	0
自營商	13,230	-708	-112	-5	254	-13

10月12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	-206	4	12,621	5,006	37,408	-1,037
投信	2	0	0	0	-59	0
自營商	173	-7	1,988	-2,143	5,105	978

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
旭隼	2.02	長榮	-16.34	台指期前十大 市場佔比	46.8%	51.3%
大立光	1.99	鴻海	-13.70			
台塑化	1.57	聯發科	-12.05			
中鋼	1.04	萬海	-11.69	電子期前十大 市場佔比	53.3%	73.1%
技嘉	0.94	聯電	-10.64			
聯合再生	0.92	陽明	-8.15			
兆豐金	0.90	南亞	-7.06	金融期前十大 市場佔比	64.6%	89.5%
和碩	0.79	矽力-KY	-4.91			
和泰車	0.72	富邦媒	-4.38			
國巨	0.66	日月光投控	-3.90	非金電期前十大 市場佔比	89.3%	95.4%
前十名合計	11.54	後十名合計	-92.83			

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

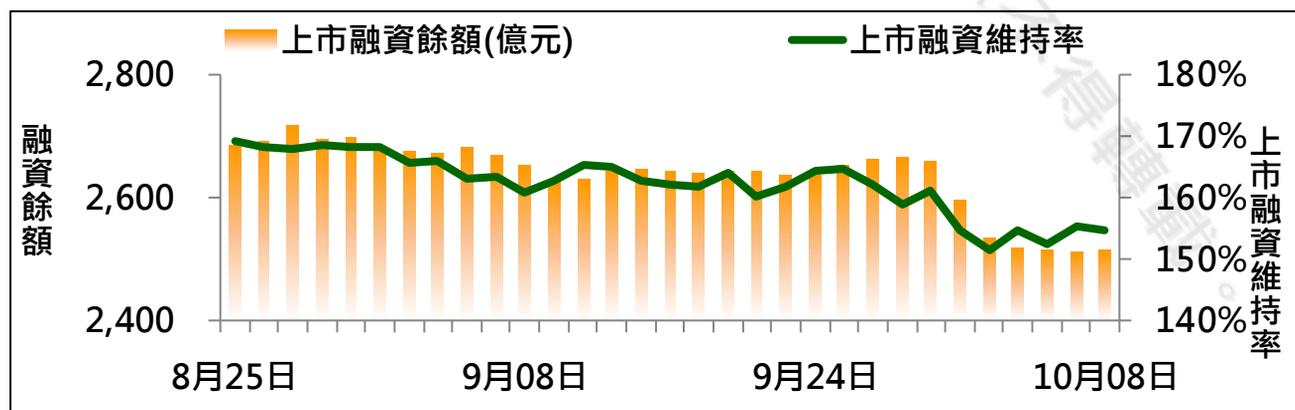
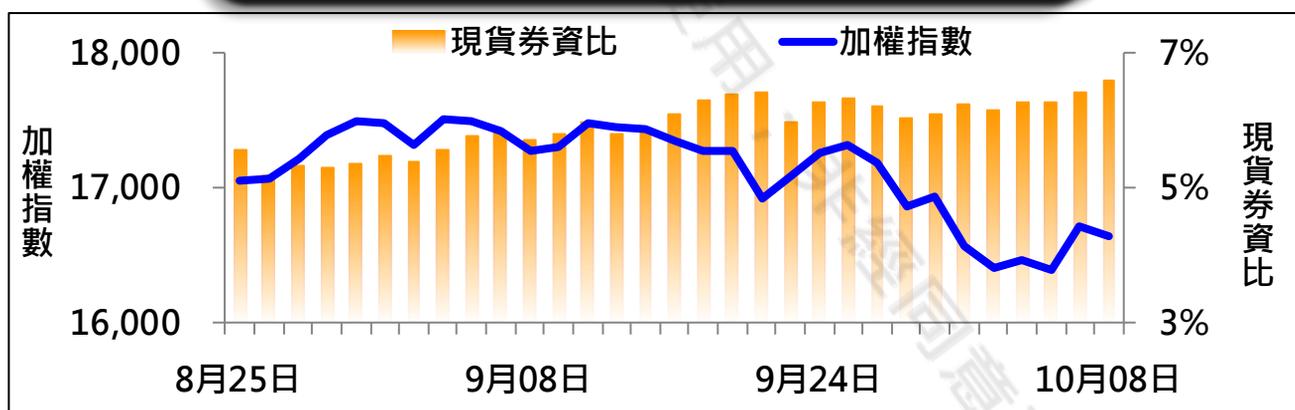


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
10月05日	-163.4	-17,129	-5,972	6.3	14,679	1,248
10月06日	-238.5	-13,742	3,387	-50.7	15,102	423
10月07日	236.3	-18,280	-4,538	30.8	13,264	-1,838
10月08日	-145.8	-21,144	-2,864	9.4	13,938	674
10月12日	-167.6	-15,634	5,510	-14.9	13,230	-708

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
10月05日	-2,993	34,202	-37,195	-16,576	14,027	-30,603
10月06日	-3,142	33,864	-37,006	4,366	7,872	-3,506
10月07日	2,261	37,017	-34,756	8,349	-543	8,892
10月08日	7,615	38,445	-30,830	4,131	4,127	4
10月12日	12,621	37,408	-24,787	1,988	5,105	-3,117

## 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。

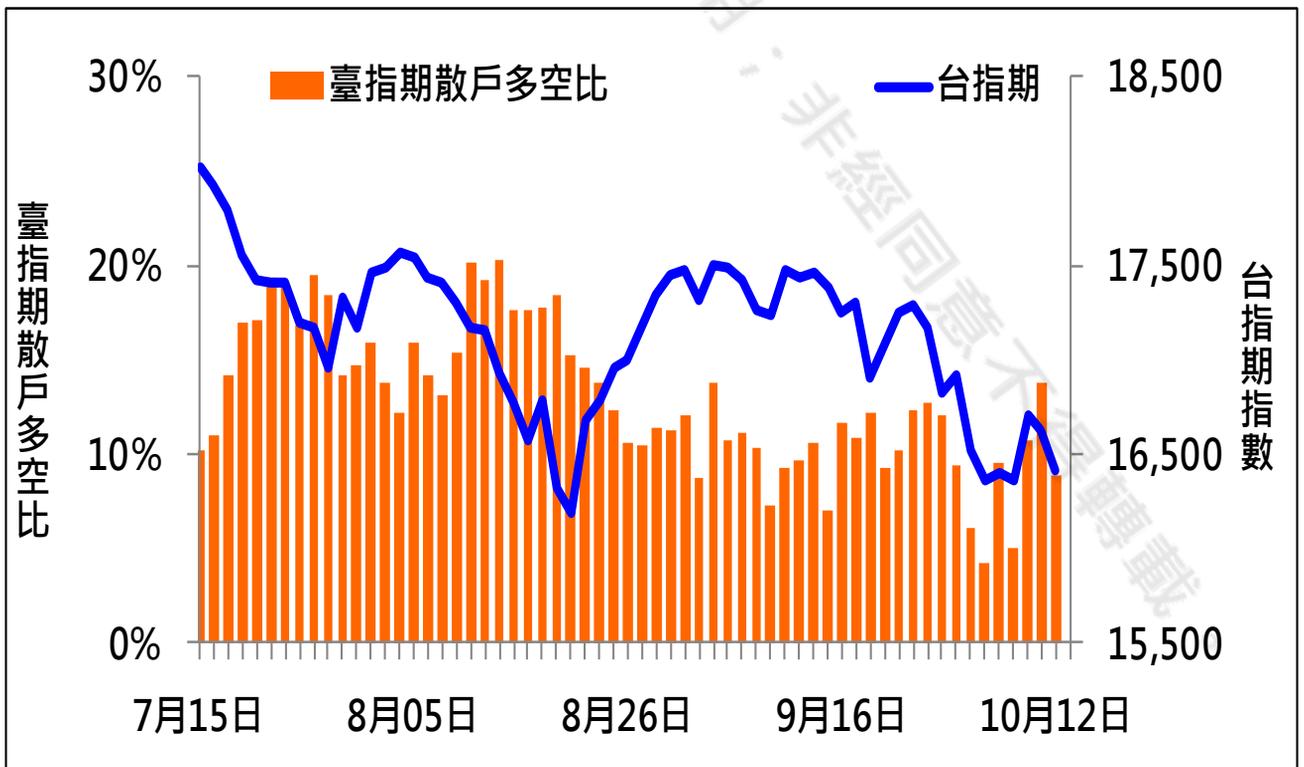
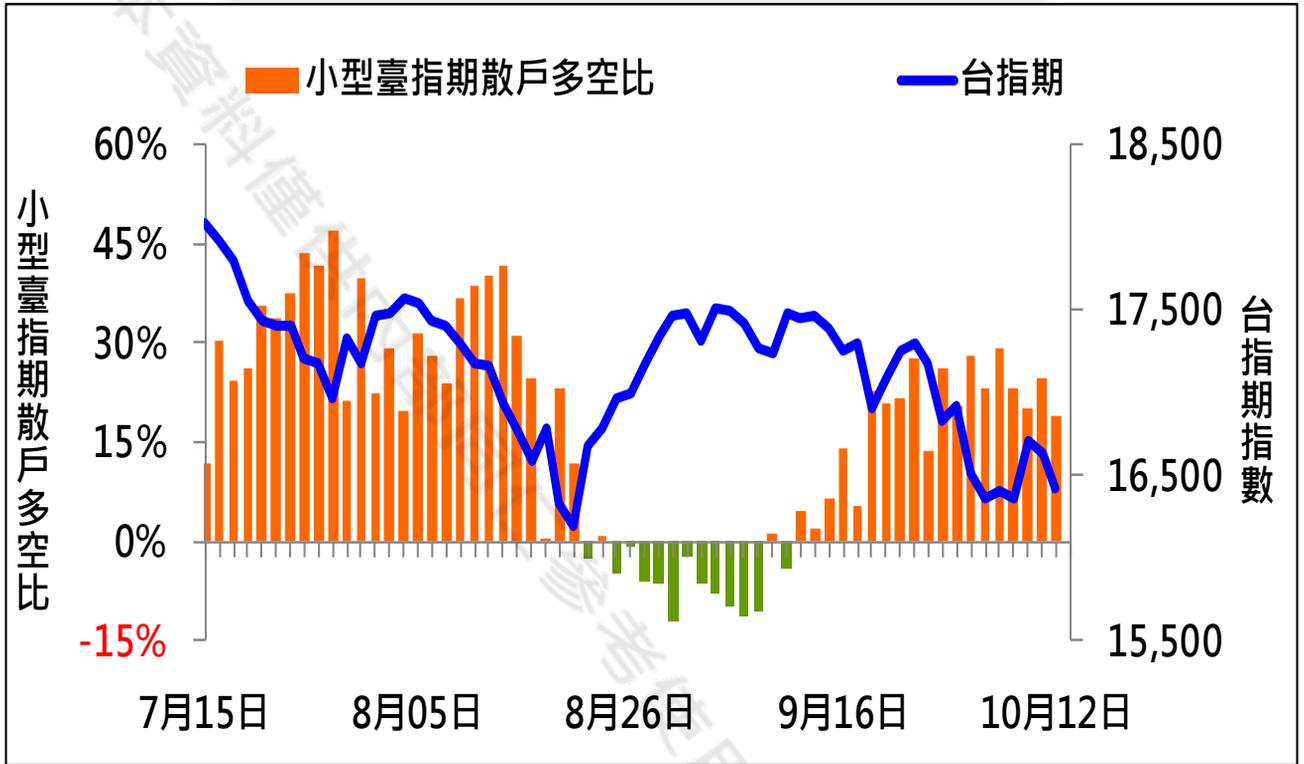
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



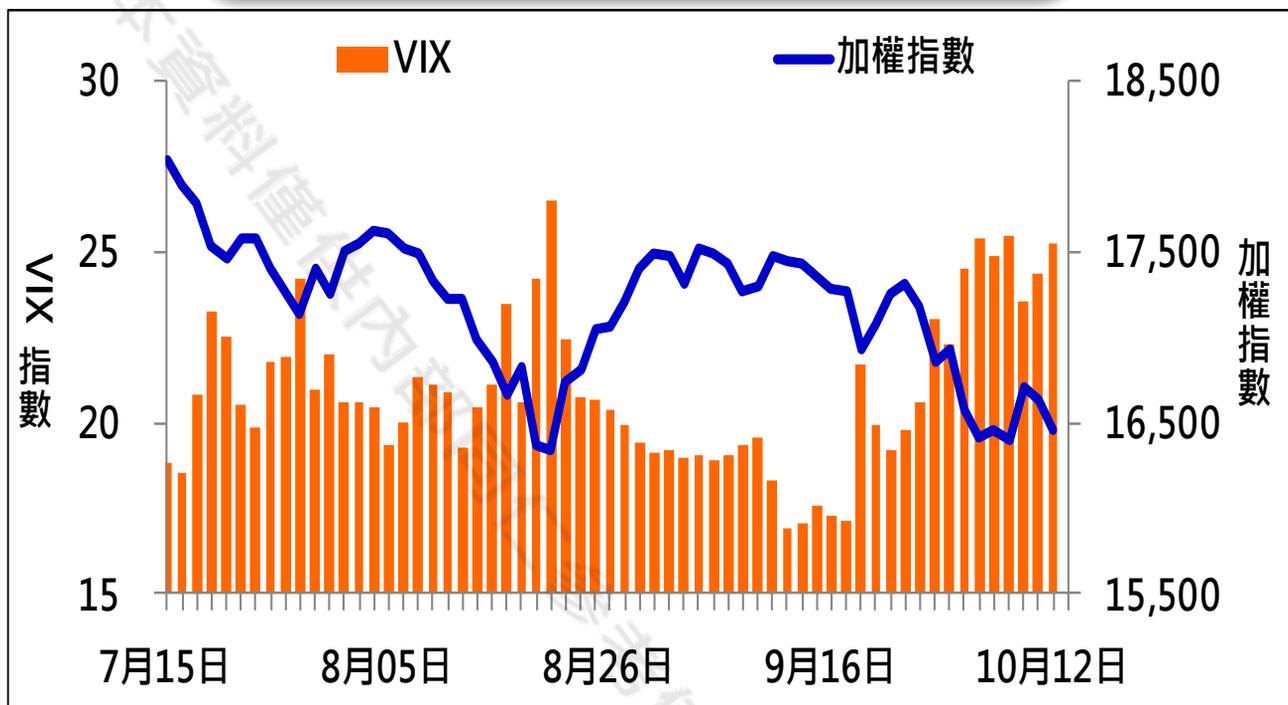
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

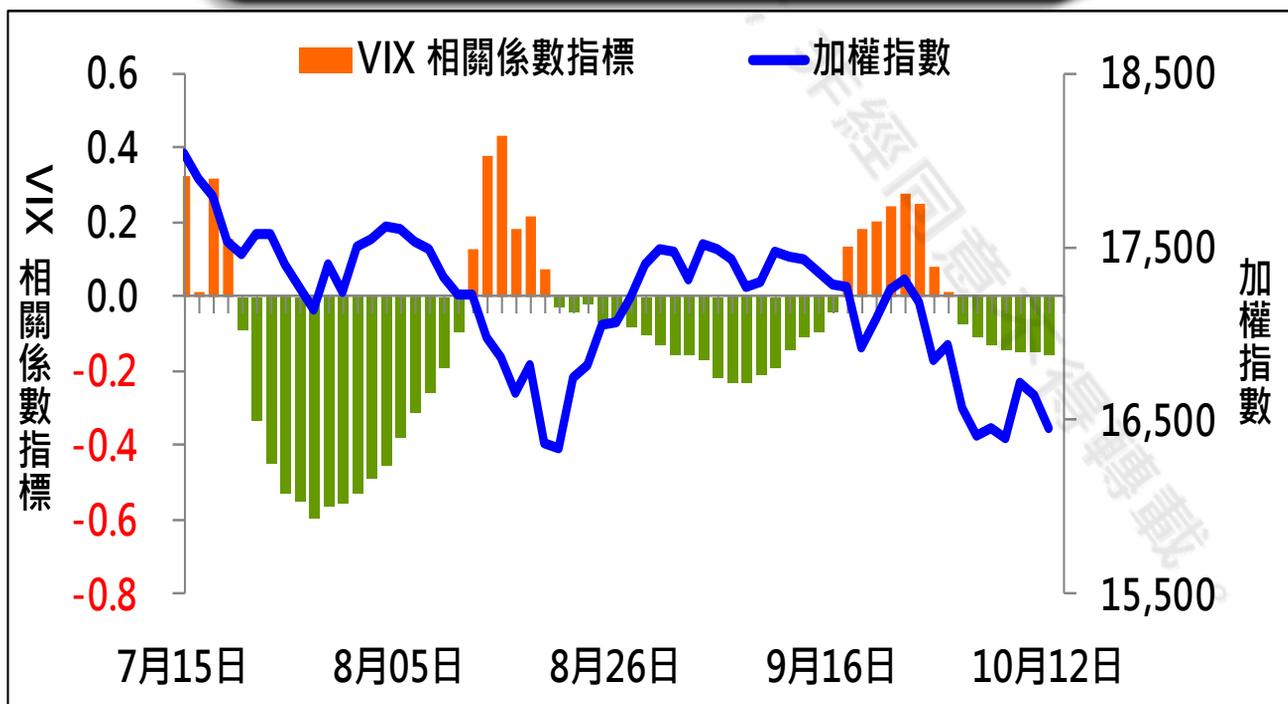
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## 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。

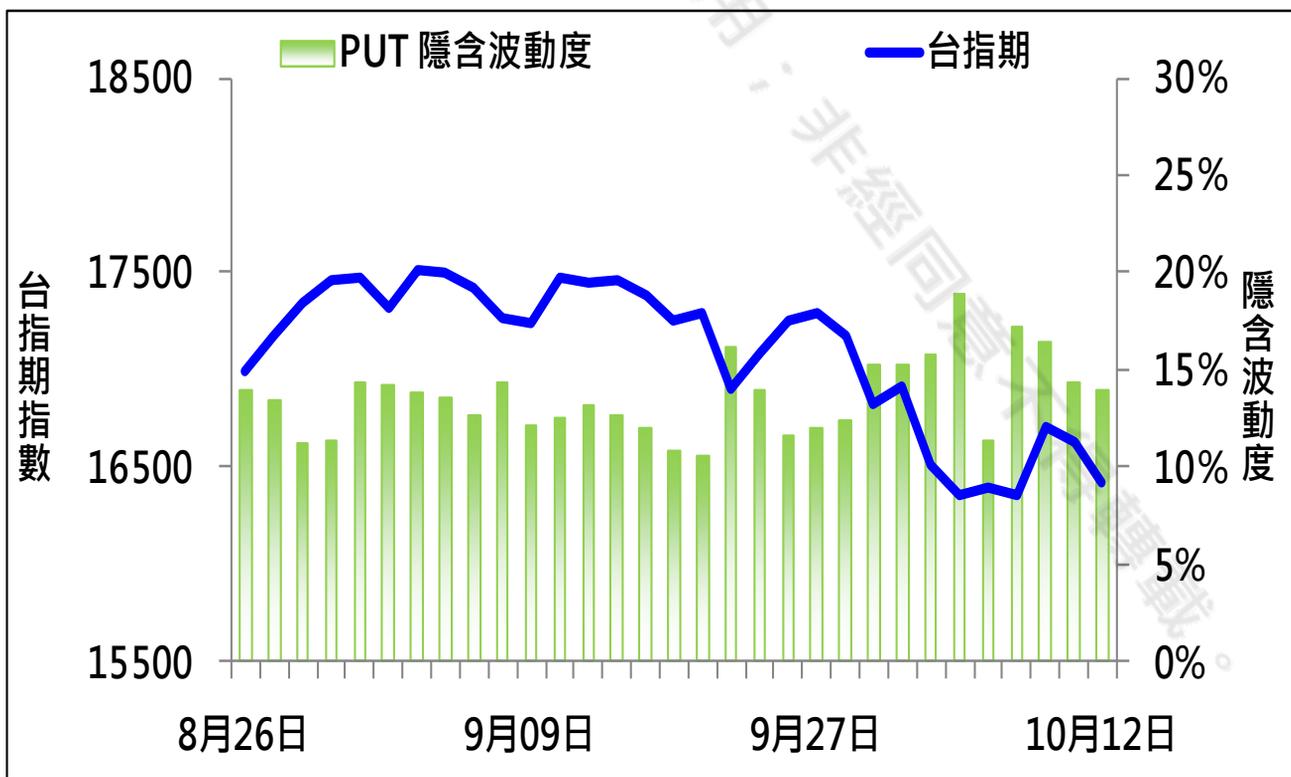
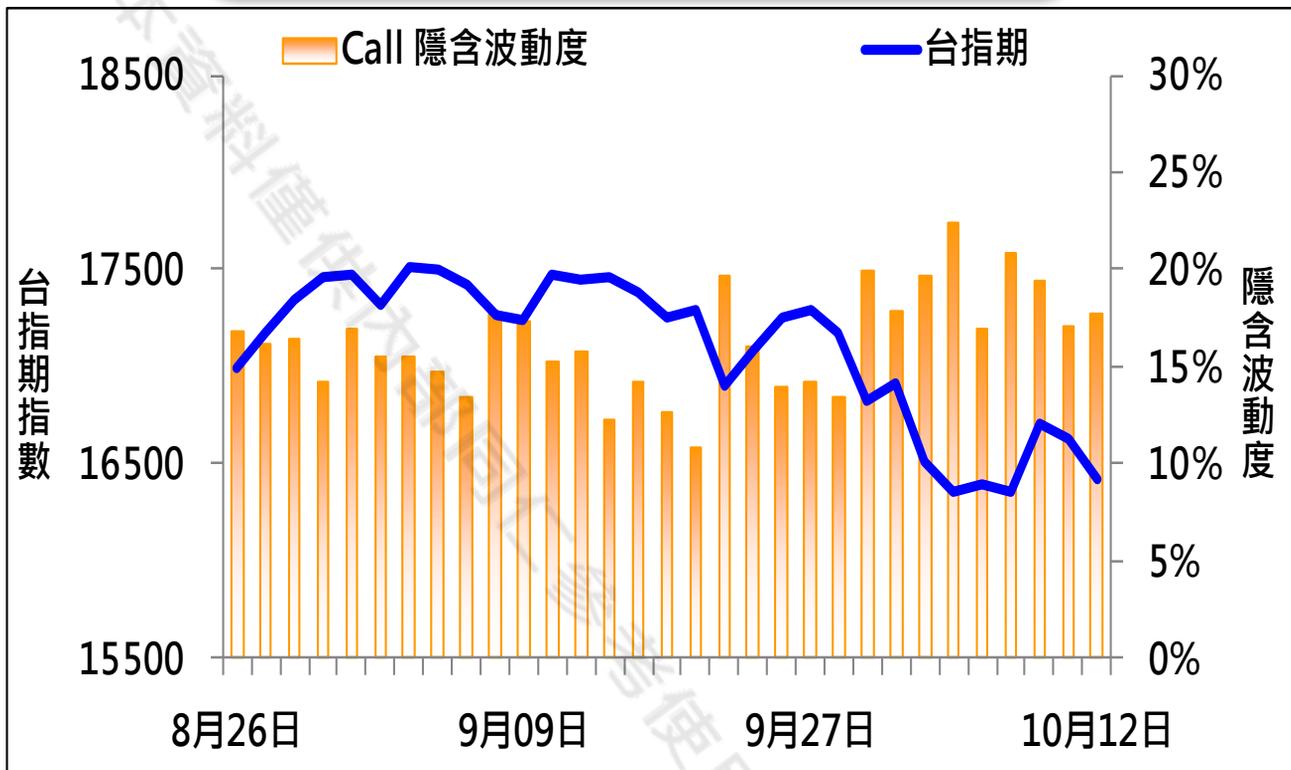
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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：2021/10/12

結算日：2021/10/13

OI 增減	Call	202110W2 履約價	Put	OI 增減
0	16	15,900	5,252	1,933
5	5	15,950	2,538	1,135
4	77	16,000	6,624	1,159
61	73	16,050	3,961	1,366
14	153	16,100	5,593	2,185
0	168	16,150	3,103	1,121
87	300	16,200	6,891	1,568
68	623	16,250	6,320	3,361
583	1,152	16,300	7,798	1,075
634	1,562	16,350	6,307	3,486
4,672	5,726	16,400	6,763	853
4,176	5,093	16,450	2,880	179
6,899	8,507	16,500	3,589	-1,163
6,513	7,630	16,550	2,071	16
※ 10,814	13,670	16,600	3,671	-1,406
7,623	10,192	16,650	2,350	-243
4,023	7,434	16,700	2,500	-919
1,597	4,873	16,750	1,241	-90
-724	6,331	16,800	1,154	-232
-885	4,517	16,850	440	-36
-1,154	5,131	16,900	477	20
-1,448	3,488	16,950	66	-29
-2,329	6,879	17,000	129	-48
-2,799	1,838	17,050	0	-1
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
34,422	112,318	0.9560	107,372	17,089

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：2021/10/12

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110 月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,000	14,963	328
0	0	15,100	2,772	77
0	32	15,200	4,231	-57
0	0	15,300	2,527	168
0	0	15,400	3,478	365
0	181	15,500	4,792	551
0	43	15,600	3,470	382
0	17	15,700	3,112	-162
2	194	15,800	5,889	277
7	93	15,900	4,295	311
-48	236	16,000	13,465	516
-26	257	16,100	6,354	488
252	852	16,200	7,247	-36
446	1,685	16,300	4,713	-153
499	2,271	16,400	7,747	3,187
824	3,204	16,500	4,284	216
190	5,428	16,600	5,807	361
1,423	5,565	16,700	4,852	-337
362	5,660	16,800	3,227	-150
※ 1,851	7,738	16,900	2,665	-61
1,232	9,436	17,000	3,140	-36
267	6,288	17,100	2,108	-13
615	7,880	17,200	3,585	-12
431	7,568	17,300	2,544	-2
358	7,340	17,400	1,379	-9
-979	9,997	17,500	347	-3
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,295	152,508	0.9760	148,855	6,218
昨日 P/C	0.9689	今日增減變化		0.0071

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。

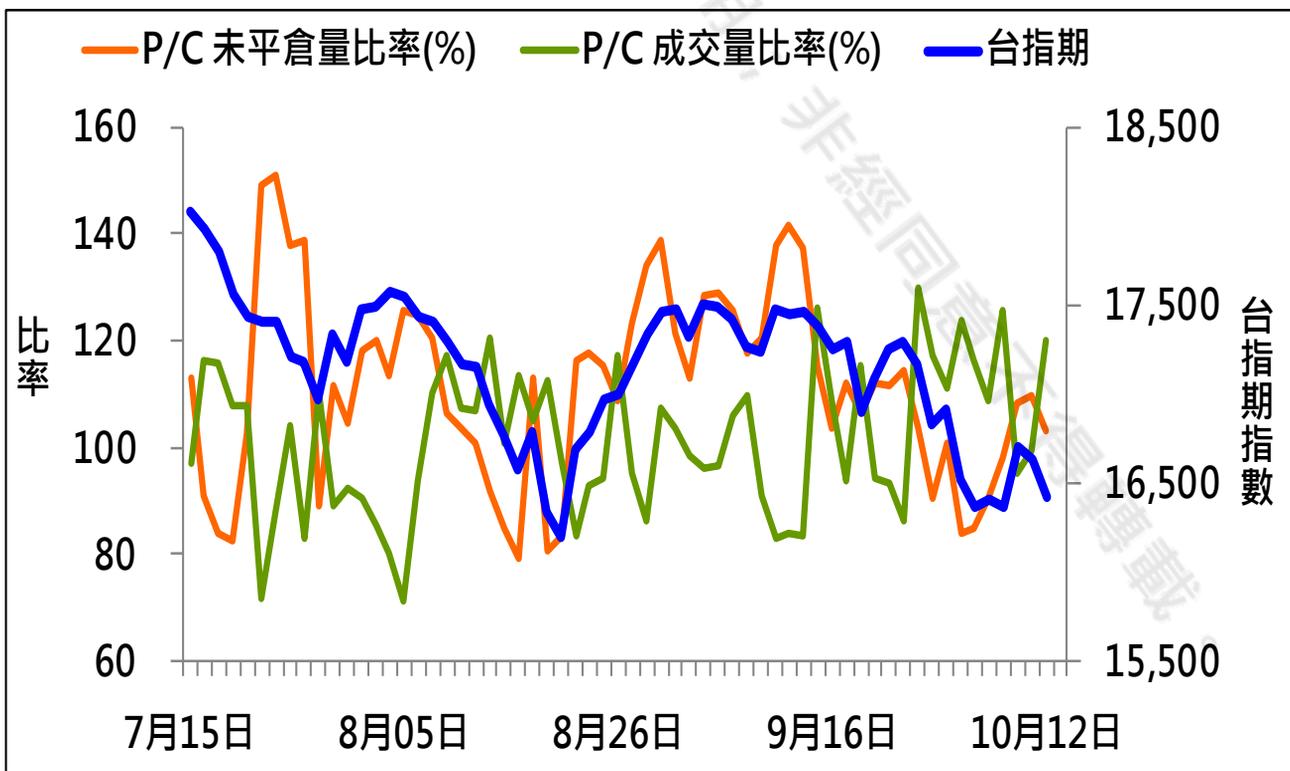
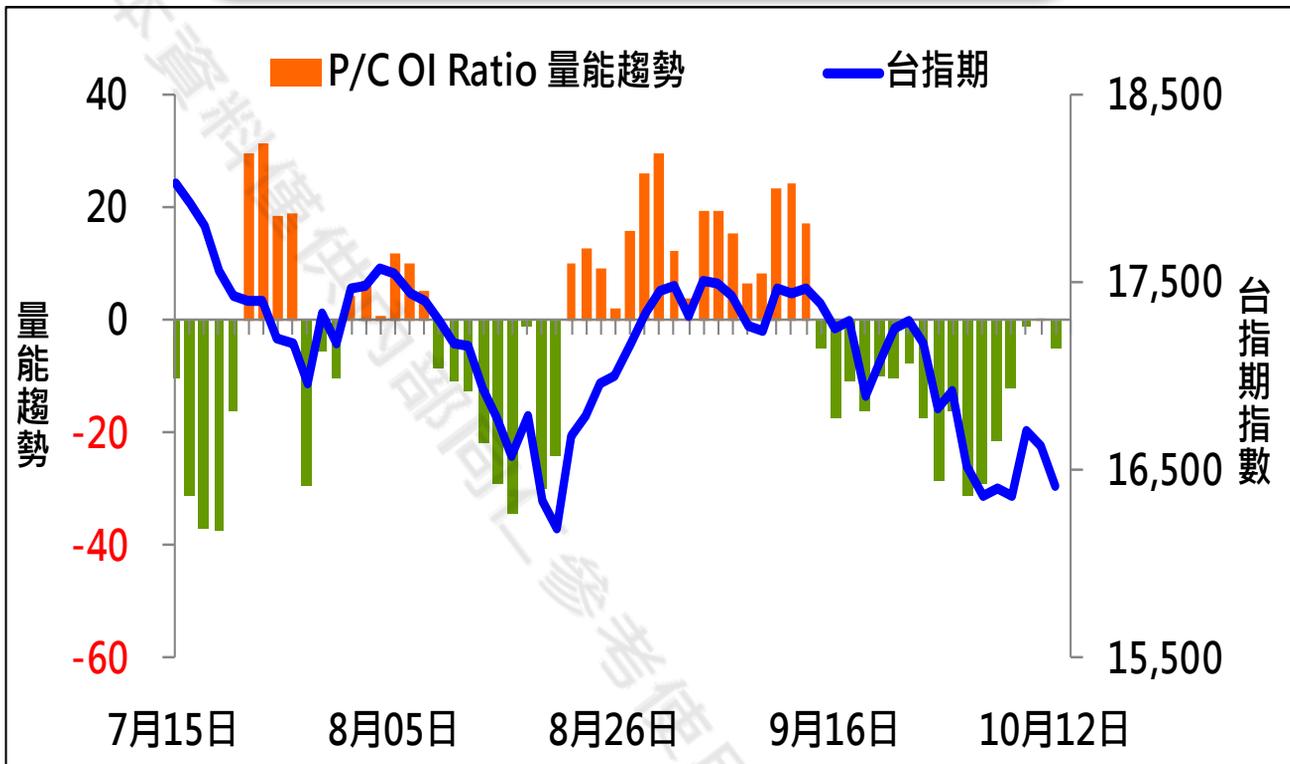
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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 2021/10/12 開 16485 高 16489 收 16418 ↓ 點 量 138434 口 -207 (-1.25%)

SMA5 16499.80 ↑ SMA20 16955.20 ↓ SMA60 17127.88 ↓

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