



法人籌碼動態

10月14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	-16,127	2,309	390	17	-1,677	-3
投信	-5,305	47	167	0	24	0
自營商	12,620	-195	-112	41	248	-14

10月14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	-244	-37	7,840	2,097	37,599	675
投信	2	0	0	0	-59	0
自營商	200	31	-3,804	-512	6,876	476

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	17.12	聯發科	-11.55	台指期前十大 市場佔比	46.9%	51.4%
萬海	6.95	台達電	-9.43			
富邦媒	6.70	台塑化	-6.29			
鴻海	4.58	大立光	-3.54	電子期前十大 市場佔比	52.3%	70.2%
長榮	4.14	台塑	-3.15			
陽明	3.39	中華電	-2.56			
南亞科	2.96	華碩	-2.45	金融期前十大 市場佔比	64.3%	91.0%
矽力-KY	2.46	南亞	-1.83			
瑞昱	2.19	台泥	-1.19			
國泰金	1.94	台肥	-1.07	非金電期前十大 市場佔比	87.7%	94.1%
前十名合計	52.43	後十名合計	-43.06			

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

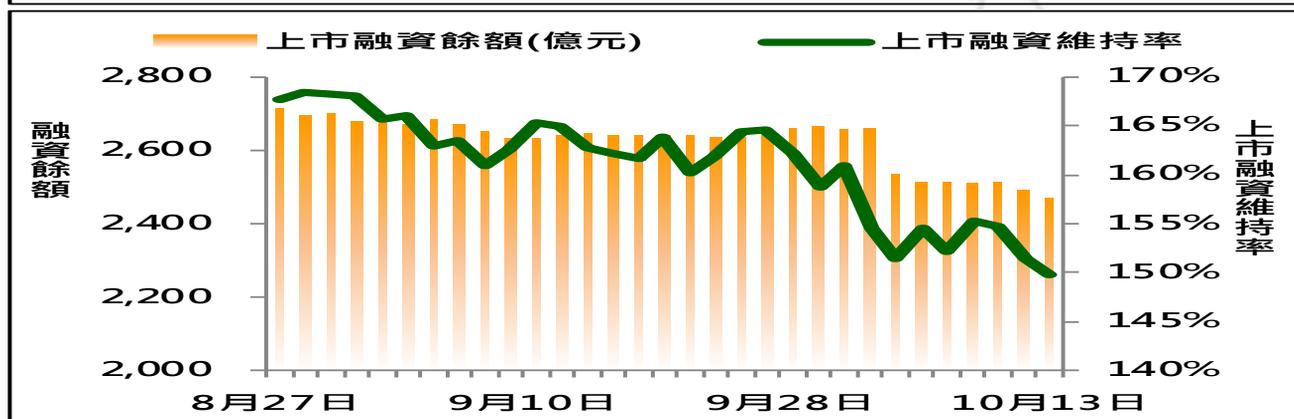
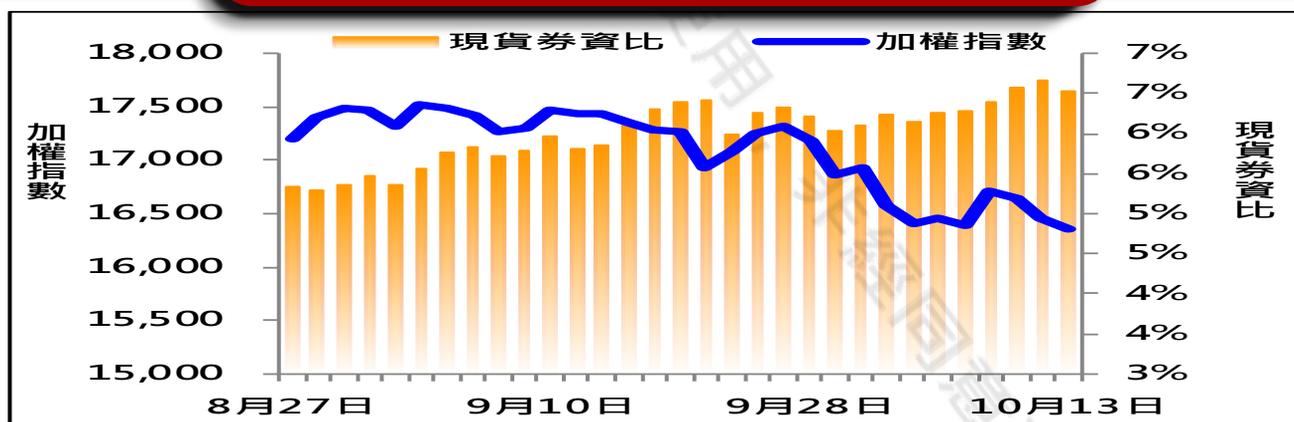


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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
10月13日	-85.3	-18,436	-2,802	-7.4	12,815	-415
10月14日	34.3	-16,127	2,309	-8.4	12,620	-195

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
10月13日	5,743	36,924	-31,181	-3,292	6,400	-9,692
10月14日	7,840	37,599	-29,759	-3,804	6,876	-10,680

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。

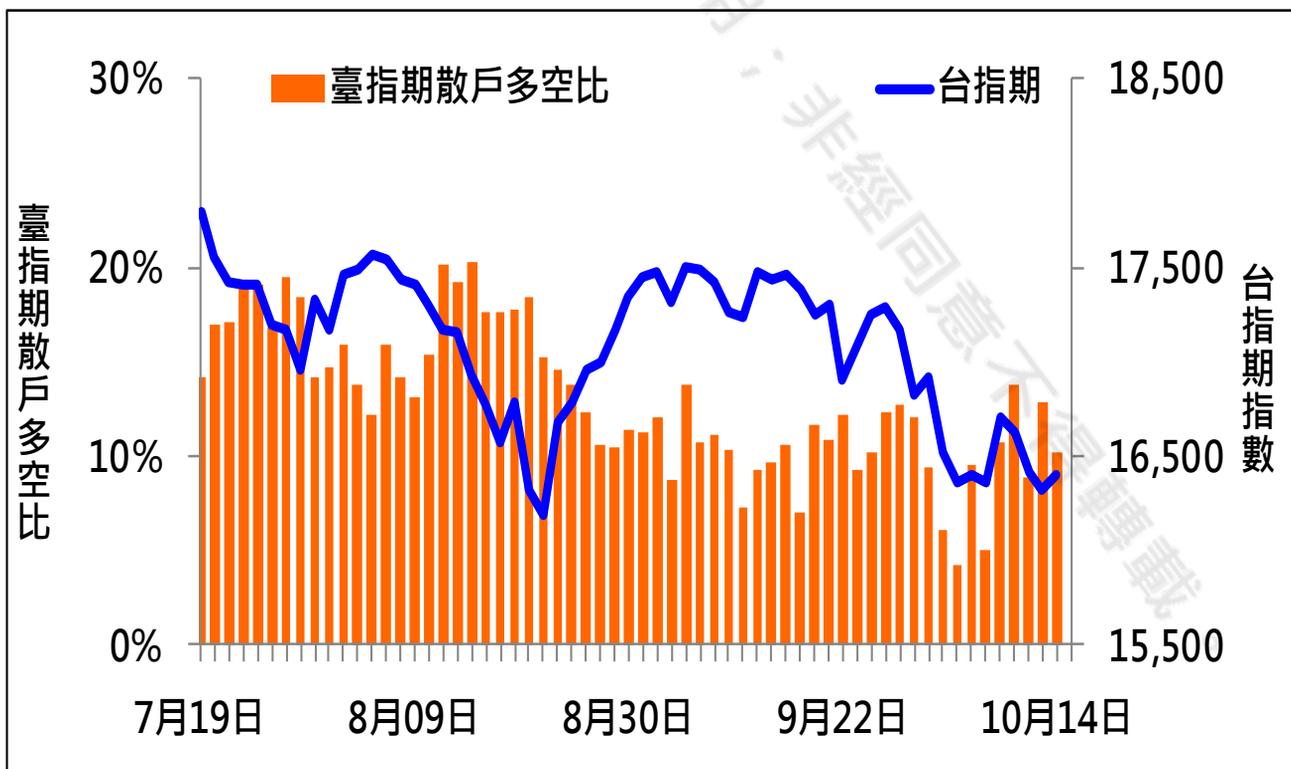
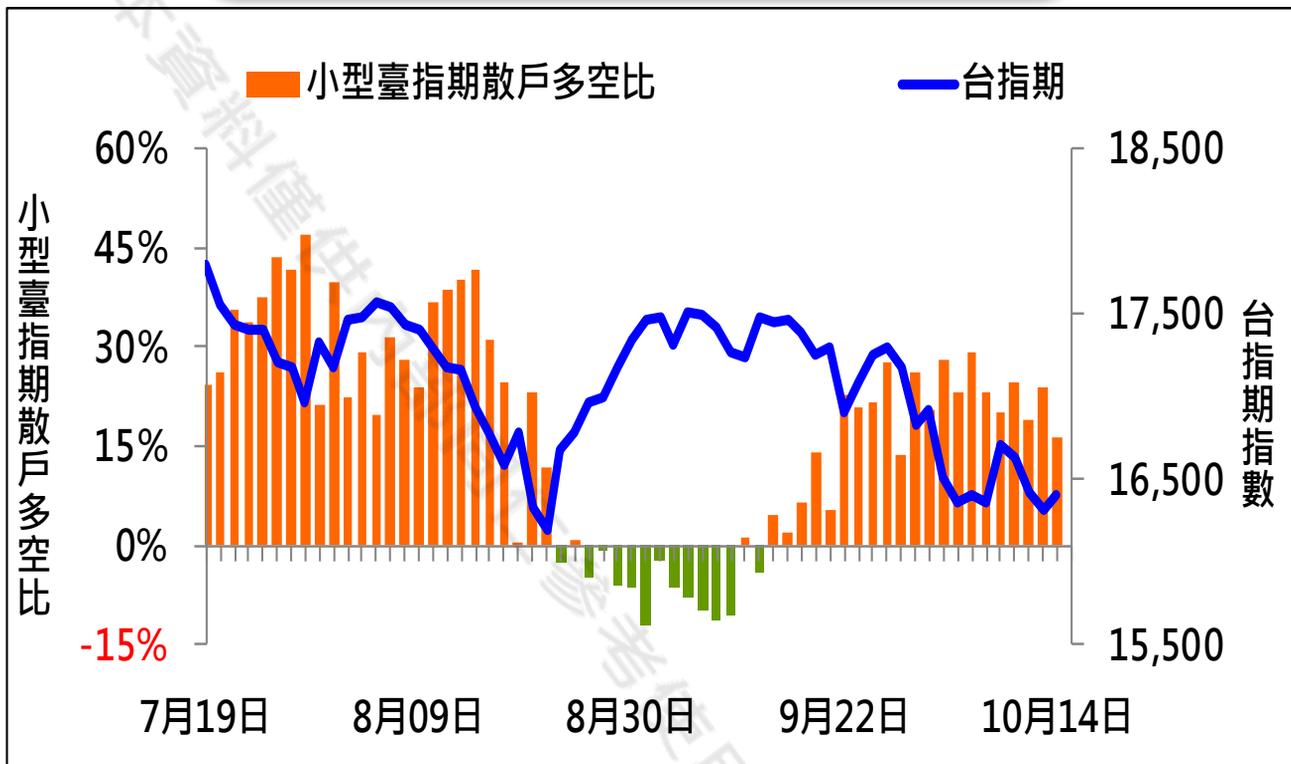
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

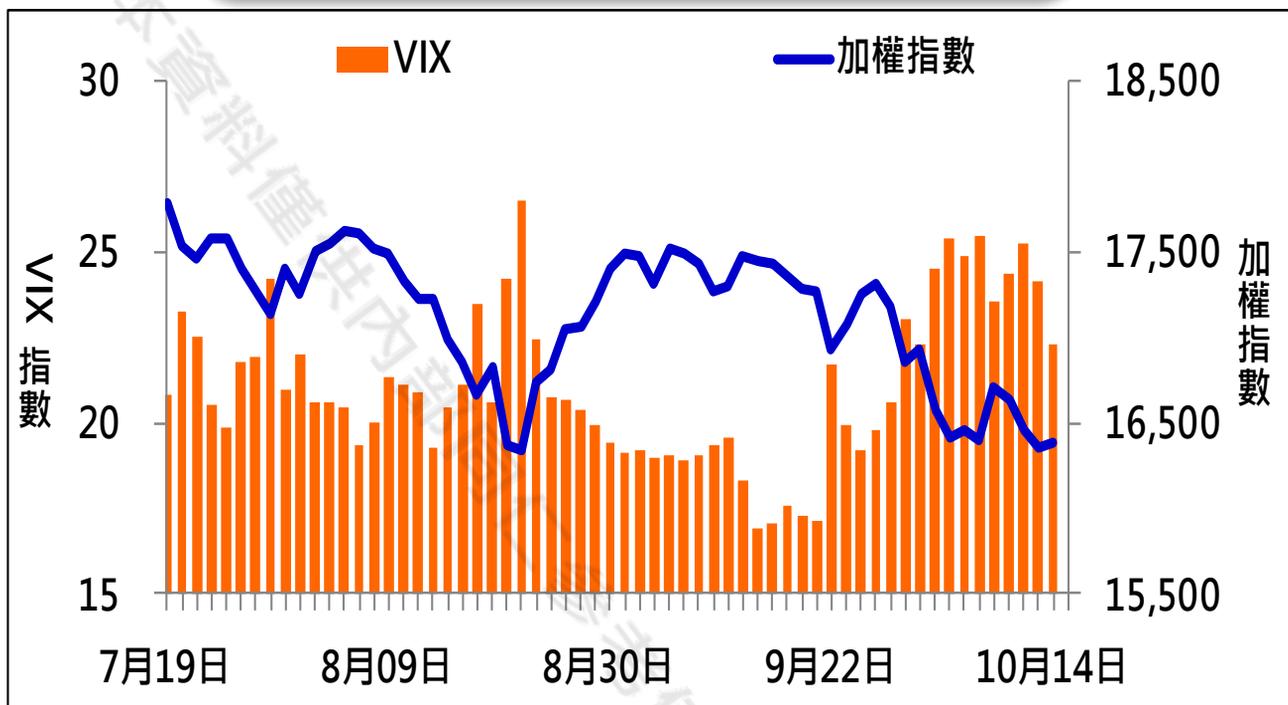
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

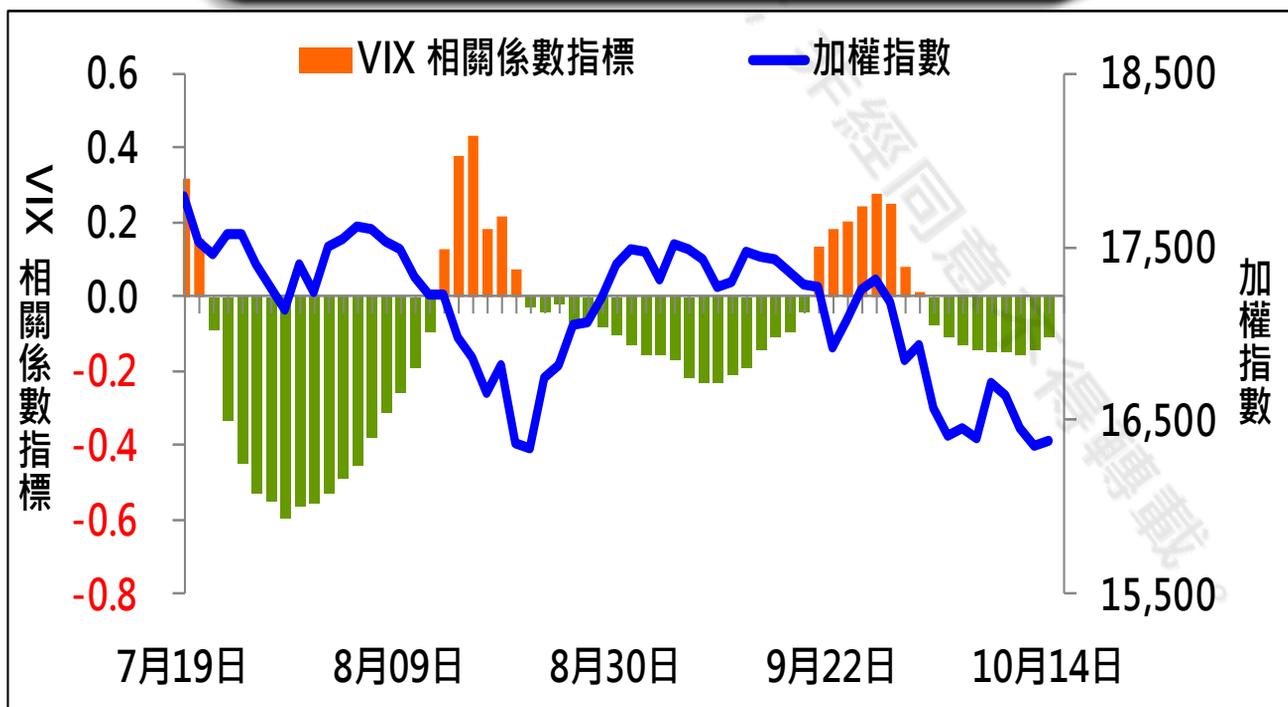
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



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。

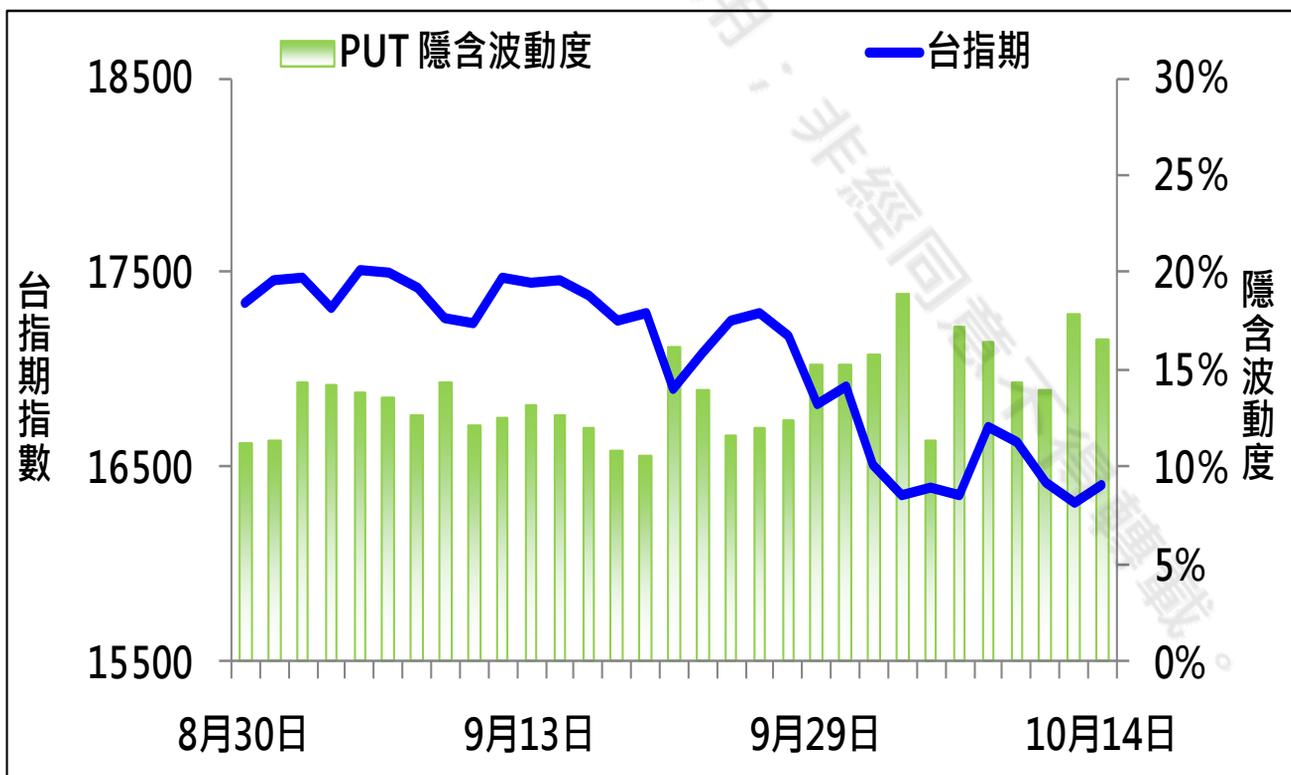
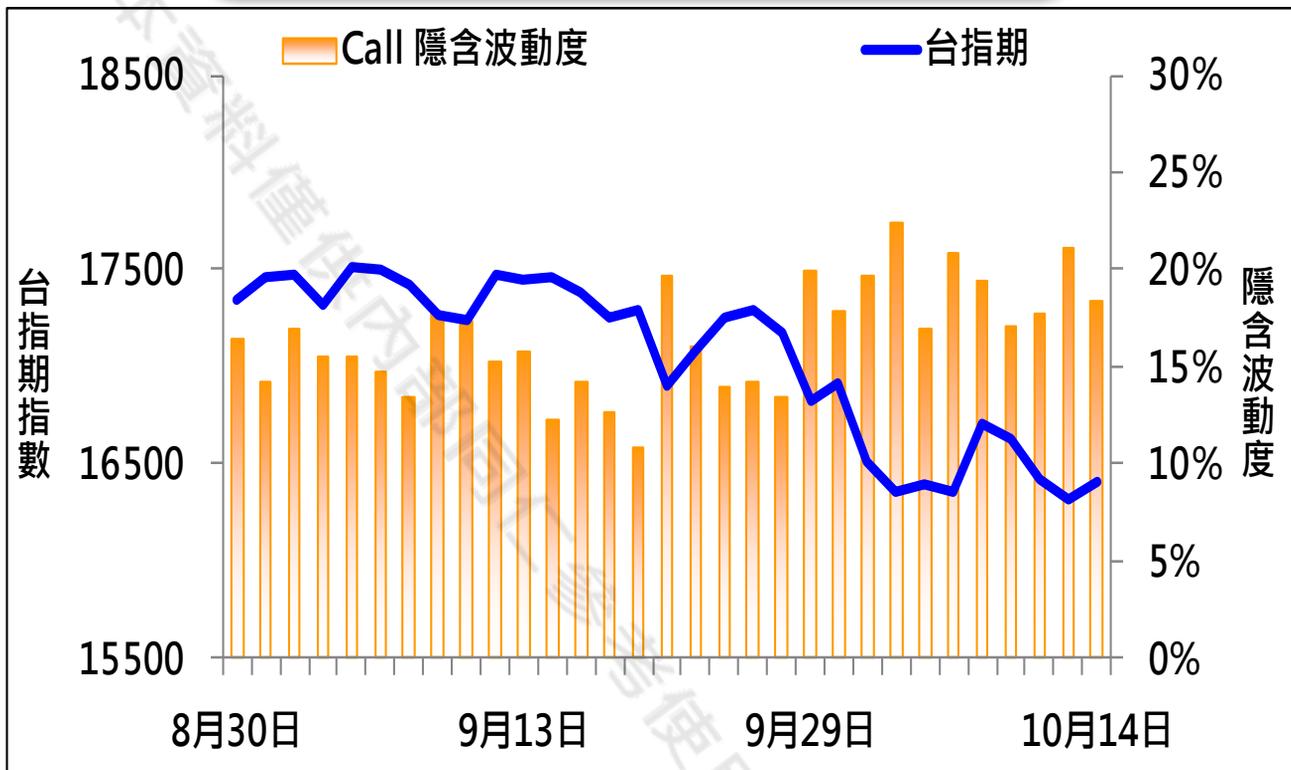
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



近月選擇權OI變化

日期：2021/10/14

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
1	1	15,950	1,589	1,589
40	297	16,000	16,028	885
9	15	16,050	1,890	1,136
34	299	16,100	7,956	1,222
47	51	16,150	1,477	1,077
101	753	16,200	9,070	1,310
92	180	16,250	1,526	1,111
306	2,159	16,300	6,308	1,185
331	671	16,350	1,836	1,199
930	5,776	16,400	8,981	1,143
946	1,715	16,450	1,187	1,001
2,507	6,596	16,500	4,850	479
1,102	2,155	16,550	382	276
1,990	8,885	16,600	5,915	252
1,637	3,494	16,650	94	77
1,462	9,015	16,700	4,695	24
2,160	3,767	16,750	55	36
※ 3,836	12,078	16,800	3,231	-18
2,783	4,726	16,850	1	0
3,774	14,135	16,900	2,647	-37
2,152	3,787	16,950	1	0
2,377	15,380	17,000	3,143	-7
1,373	9,159	17,100	2,047	-11
3	9,287	17,200	3,562	-11
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
27,891	205,448	0.9228	189,578	26,378

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



次月選擇權OI變化

日期：2021/10/14

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
148	1,259	16,400	1,480	155
380	654	16,500	2,355	17
281	526	16,600	3,516	23
71	719	16,700	2,556	-10
91	477	16,800	362	-4
251	650	16,900	515	-5
341	822	17,000	438	0
※ 777	1,770	17,100	392	0
301	1,210	17,200	779	-1
123	974	17,300	1,343	0
180	801	17,400	462	0
216	1,110	17,500	24	0
277	1,279	17,600	9	1
101	1,210	17,700	7	0
56	658	17,800	2	0
109	517	17,900	11	0
319	1,993	18,000	3	0
72	592	18,100	3	0
68	432	18,200	0	0
45	438	18,300	0	0
-5	227	18,400	120	0
11	303	18,500	0	0
-51	492	18,600	0	0
-2	59	18,700	0	0
-1	127	18,800	0	0
-10	40	18,900	0	0
1	215	19,000	0	0
-5	59	19,100	0	0
-56	26	19,200	0	0
100	107	19,300	0	0
0	52	19,400	0	0
-14	178	19,500	0	0
-50	44	19,600	0	0
0	409	19,700	0	0
0	412	19,800	0	0
0	413	19,900	0	0
219	1,173	20,000	0	0
272	1,081	20,100	0	0
339	2,387	20,200	1	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
5,181	27,236	1.1091	30,207	2,820
昨日 P/C	1.2418	今日增減變化		-0.1327

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。

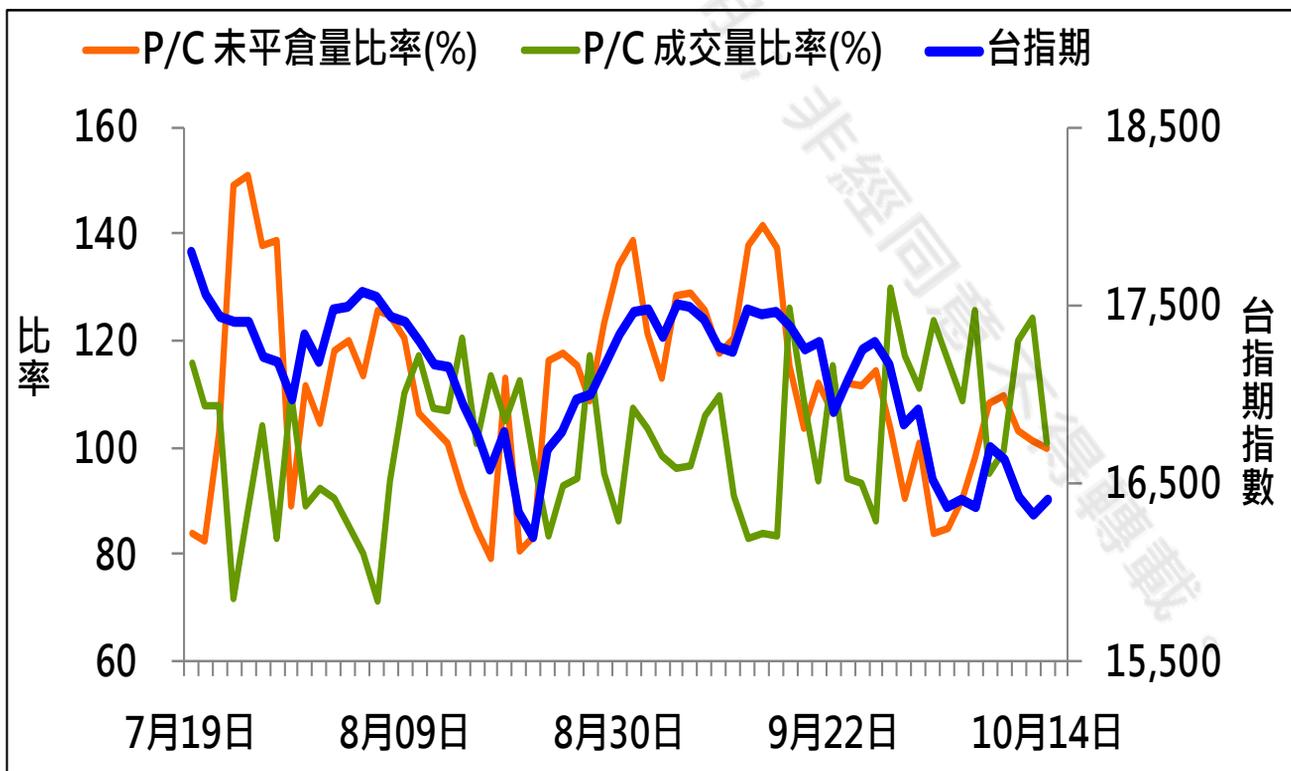
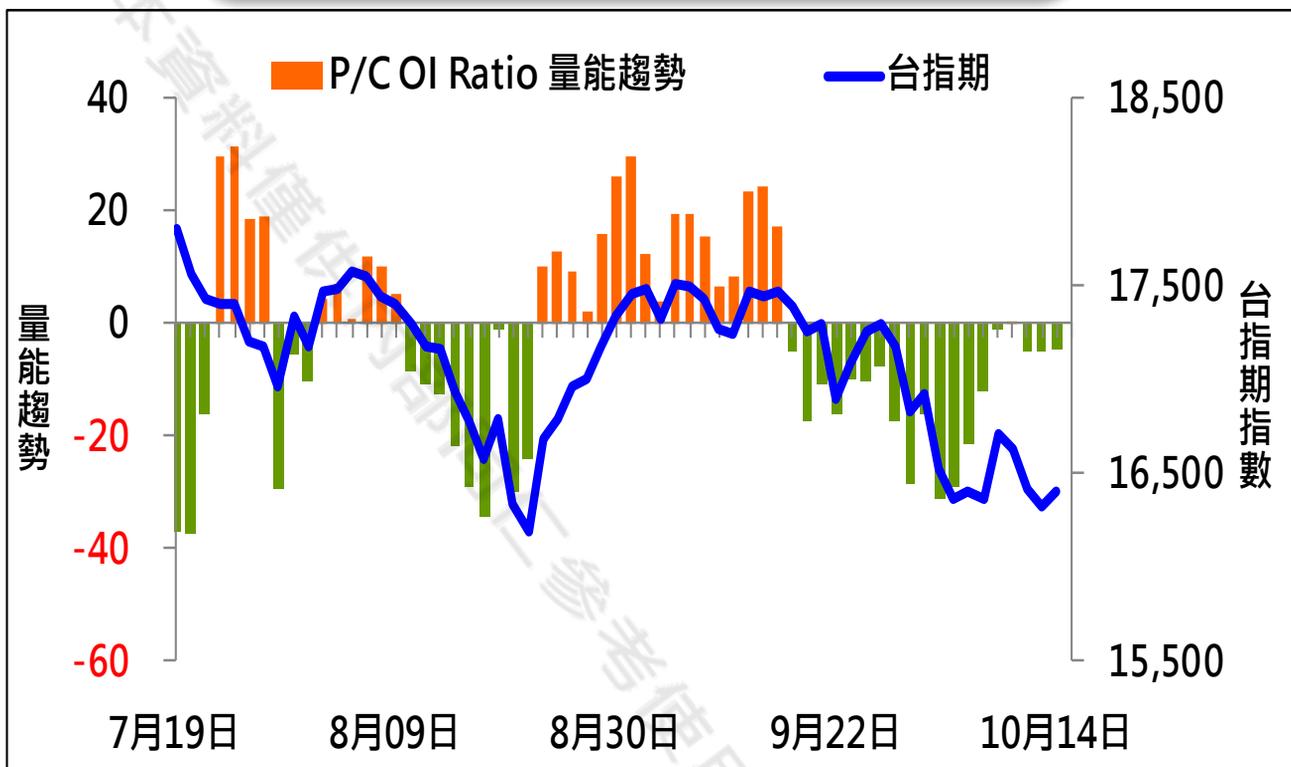
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

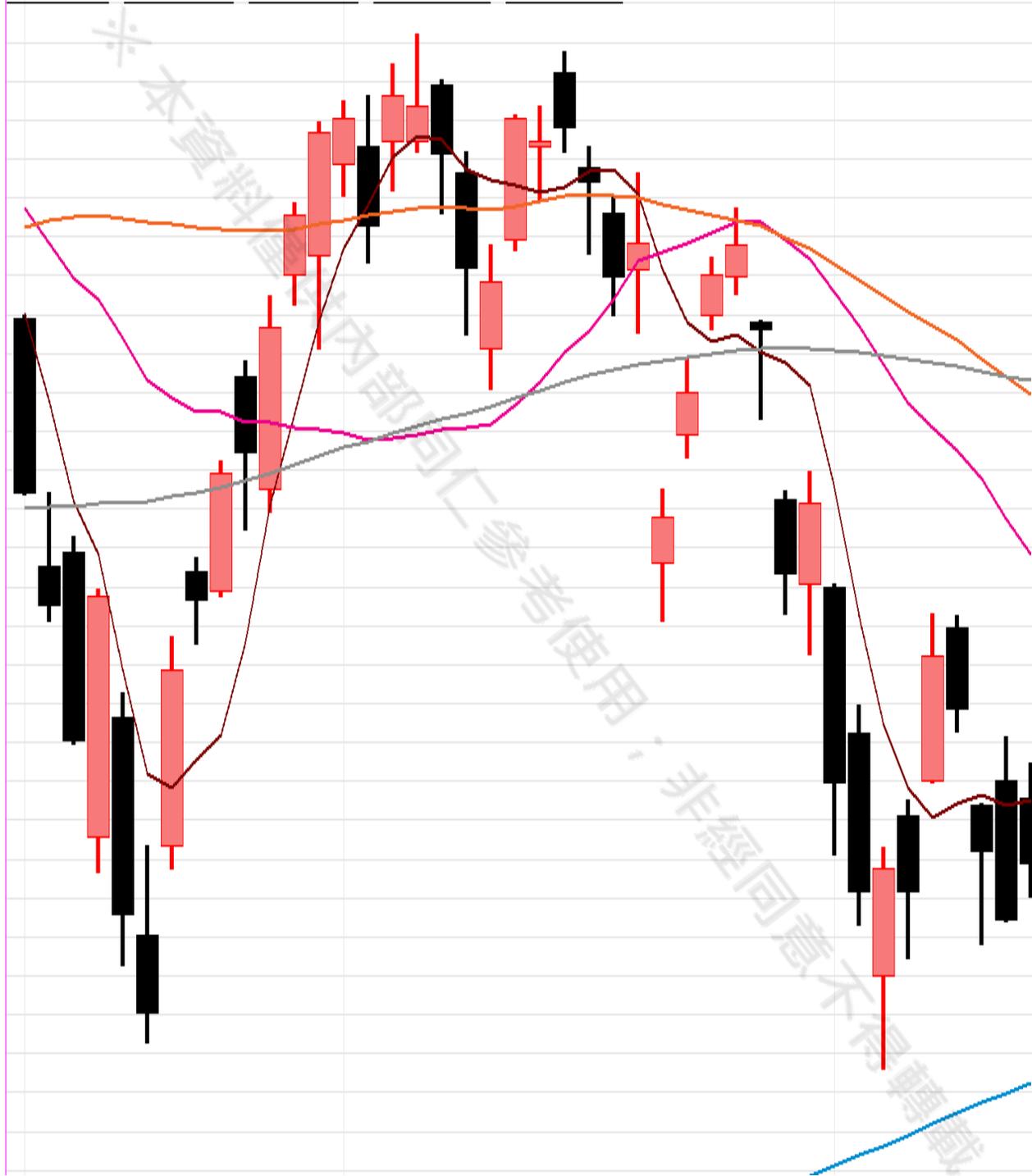
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



盤後重點觀察

SMA5 16493.20↑ SMA20 16845.70↓ SMA60 17078.00↓ SMA120 17097.04↓ SMA240 16086.40↑



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