



法人籌碼動態

10月15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	-17,650	-1,523	315	-75	-1,604	73
投信	-3,806	1,499	165	-2	24	0
自營商	13,282	662	50	162	207	-41

10月15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	-262	-18	14,846	7,006	40,162	2,563
投信	2	0	0	0	-60	-1
自營商	233	33	-4,659	-855	-3,994	-10,870

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	230.86	萬海	-2.56	台指期前十大 市場佔比	44.5%	49.9%
鴻海	13.71	長榮	-2.41			
聯電	9.83	緯穎	-1.56			
聯發科	8.92	智邦	-1.20	電子期前十大 市場佔比	52.7%	66.7%
國泰金	8.24	儒鴻	-0.72			
台塑化	6.28	廣達	-0.64			
南電	4.47	聚陽	-0.48	金融期前十大 市場佔比	64.3%	89.0%
欣興	4.47	豐泰	-0.44			
矽力-KY	3.99	上銀	-0.27			
台達電	3.85	可成	-0.25	非金電期前十大 市場佔比	91.5%	92.9%
前十名合計	294.64	後十名合計	-10.53			

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

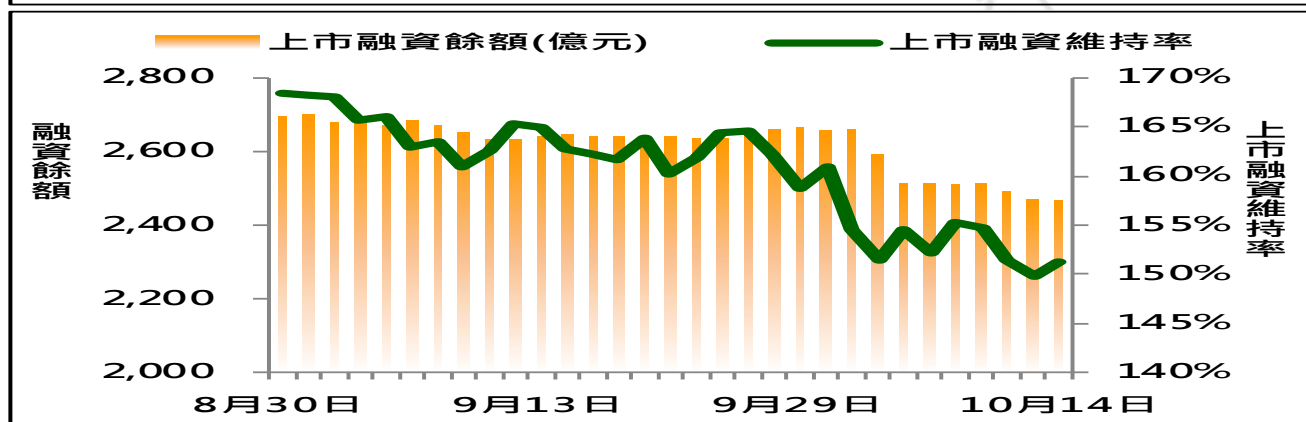
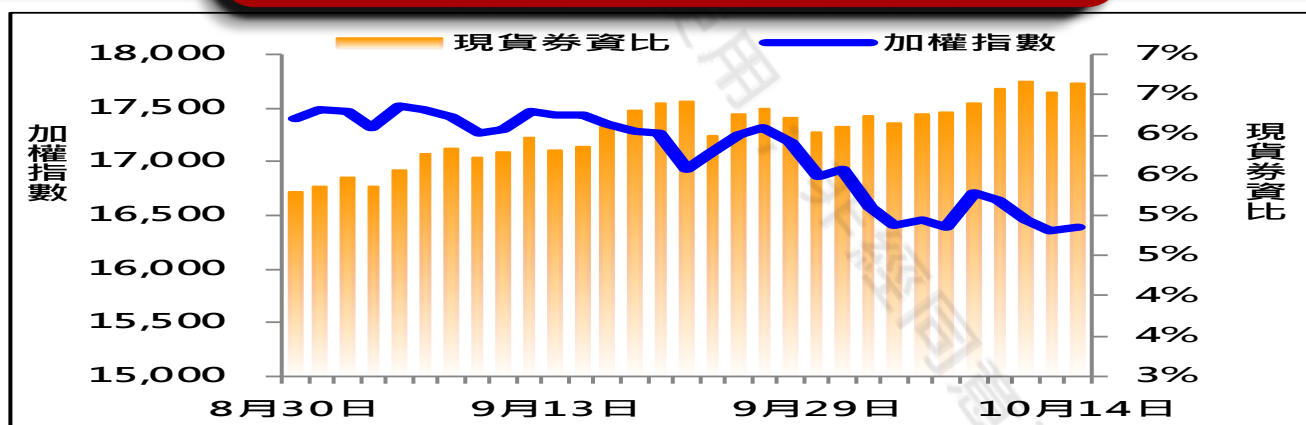


法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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)
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
10月15日	279.0	-17,650	-1,523	24.8	13,282	662

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
10月15日	14,846	40,162	-25,316	-4,659	-3,994	-665

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。

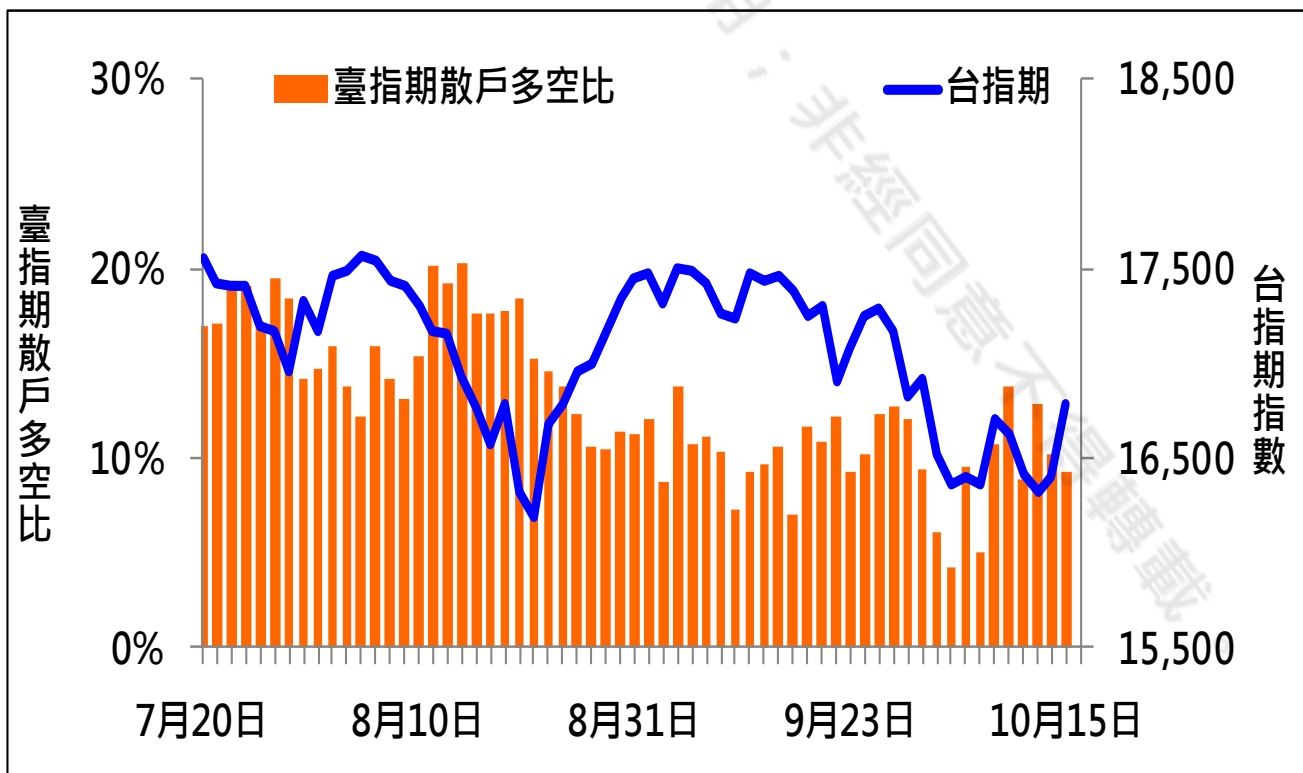
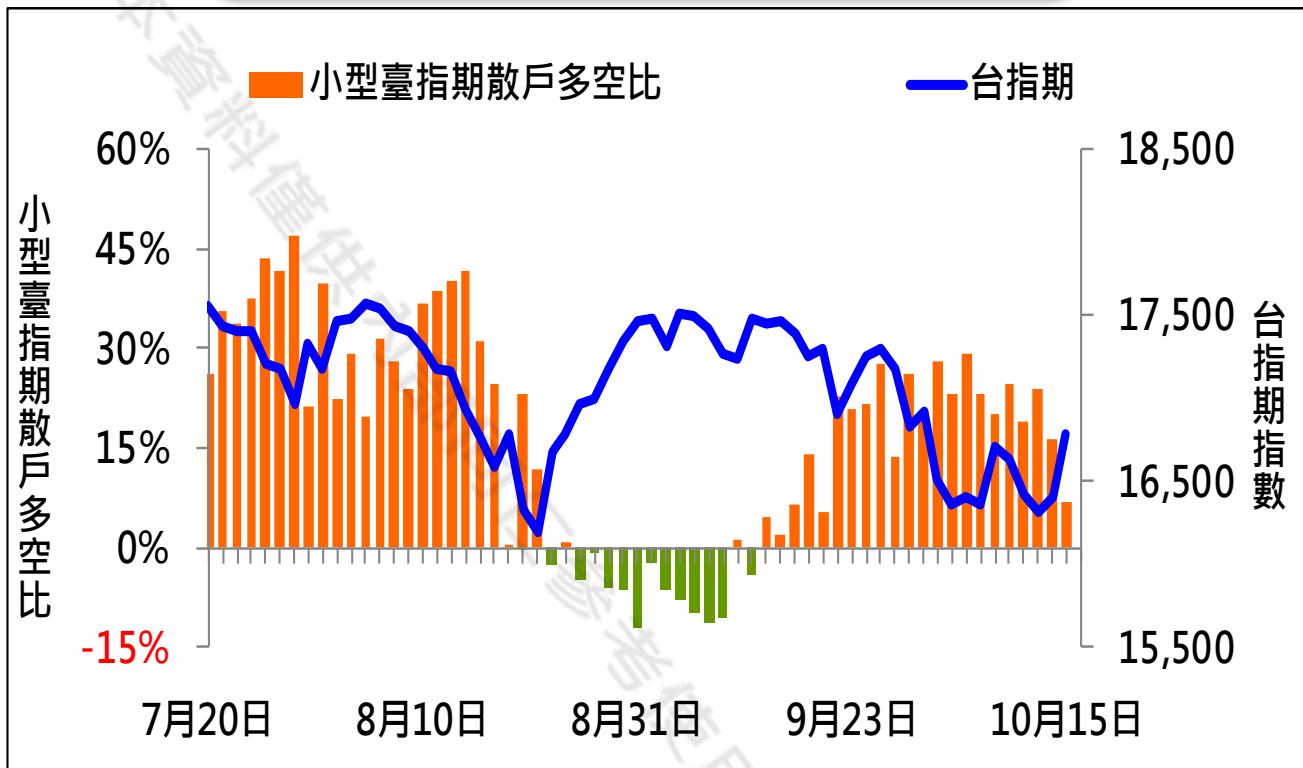
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

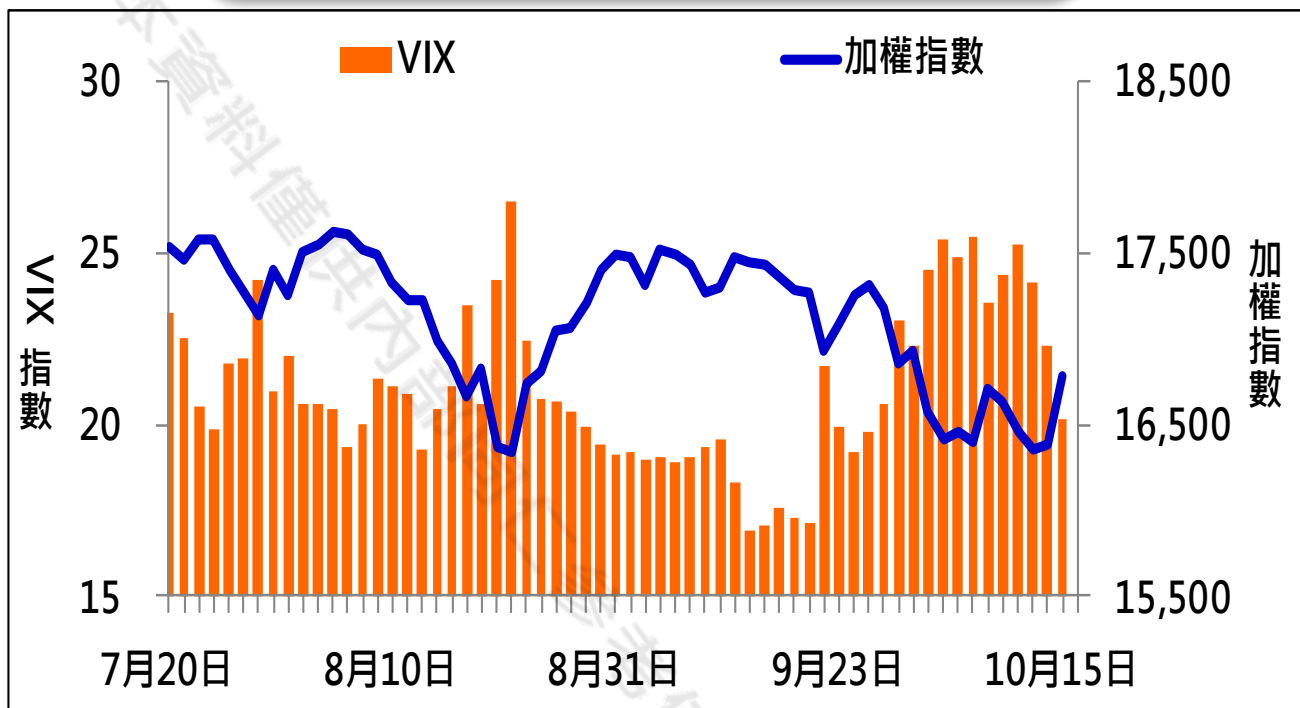
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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

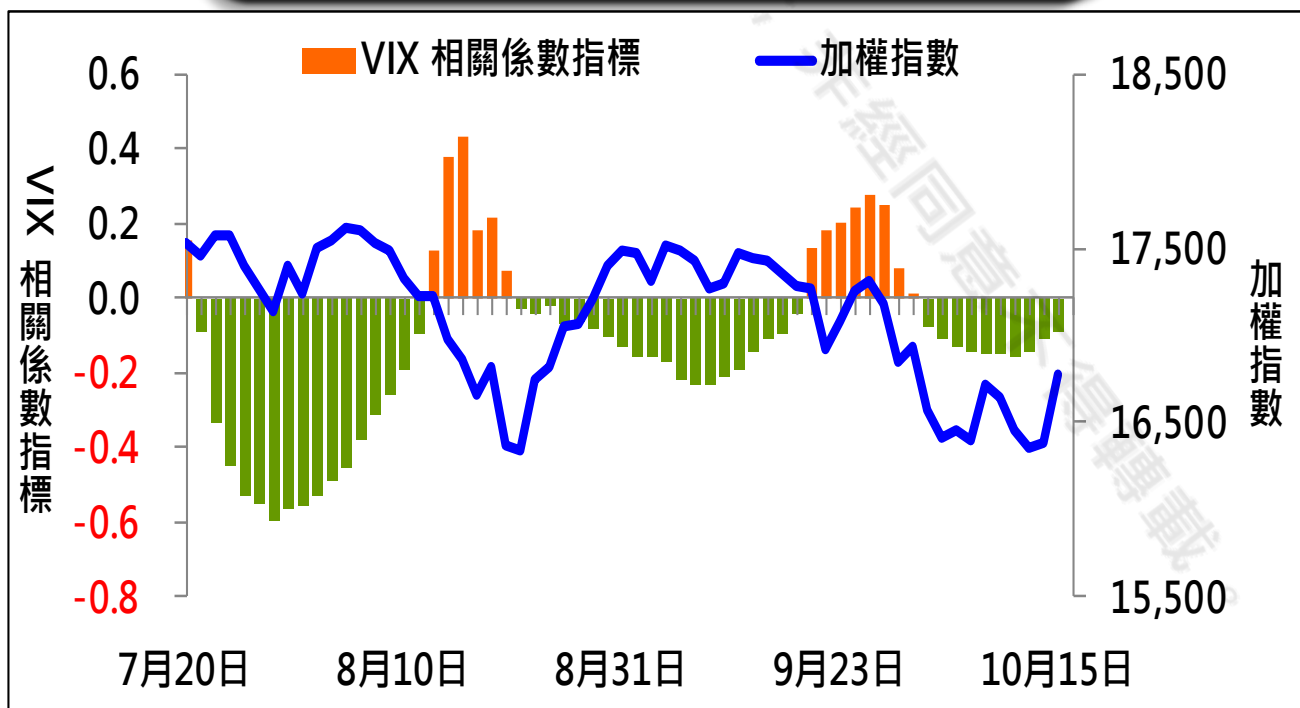
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



VIX



VIX 與 TWSE 相關係數指標



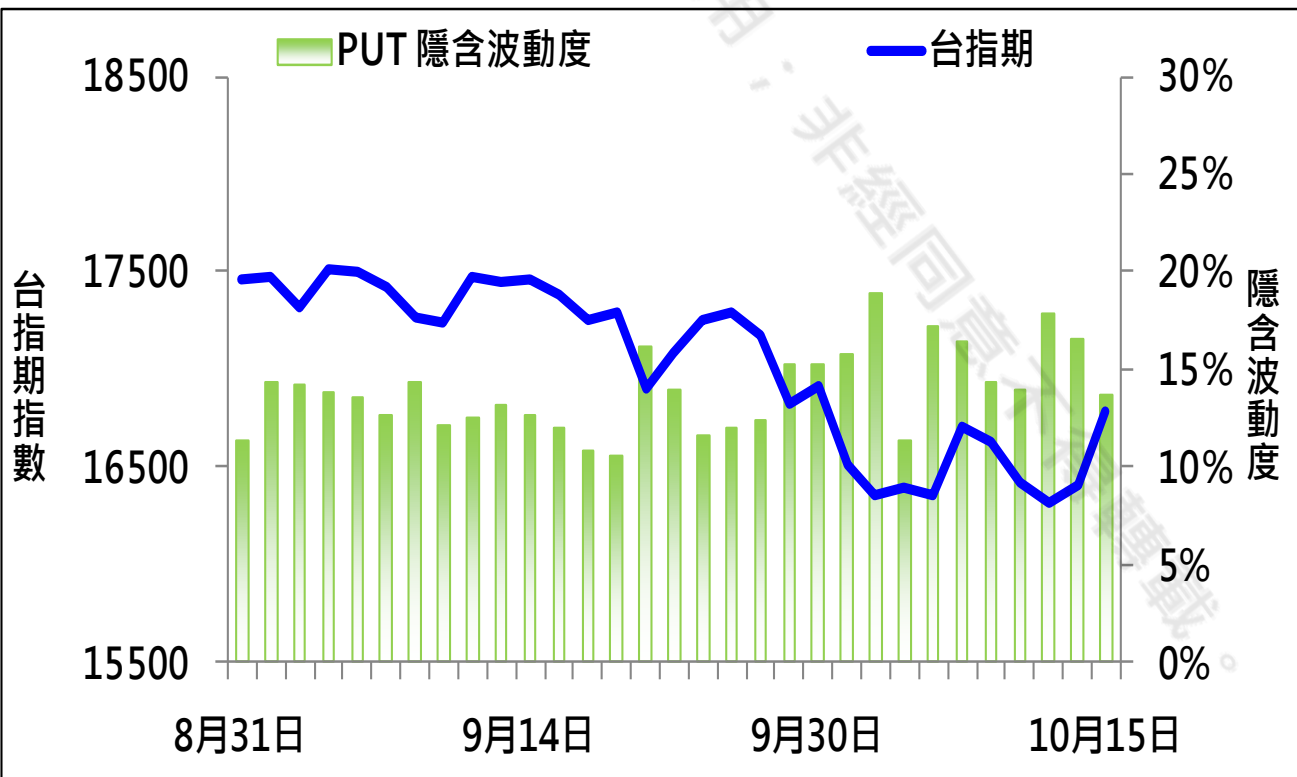
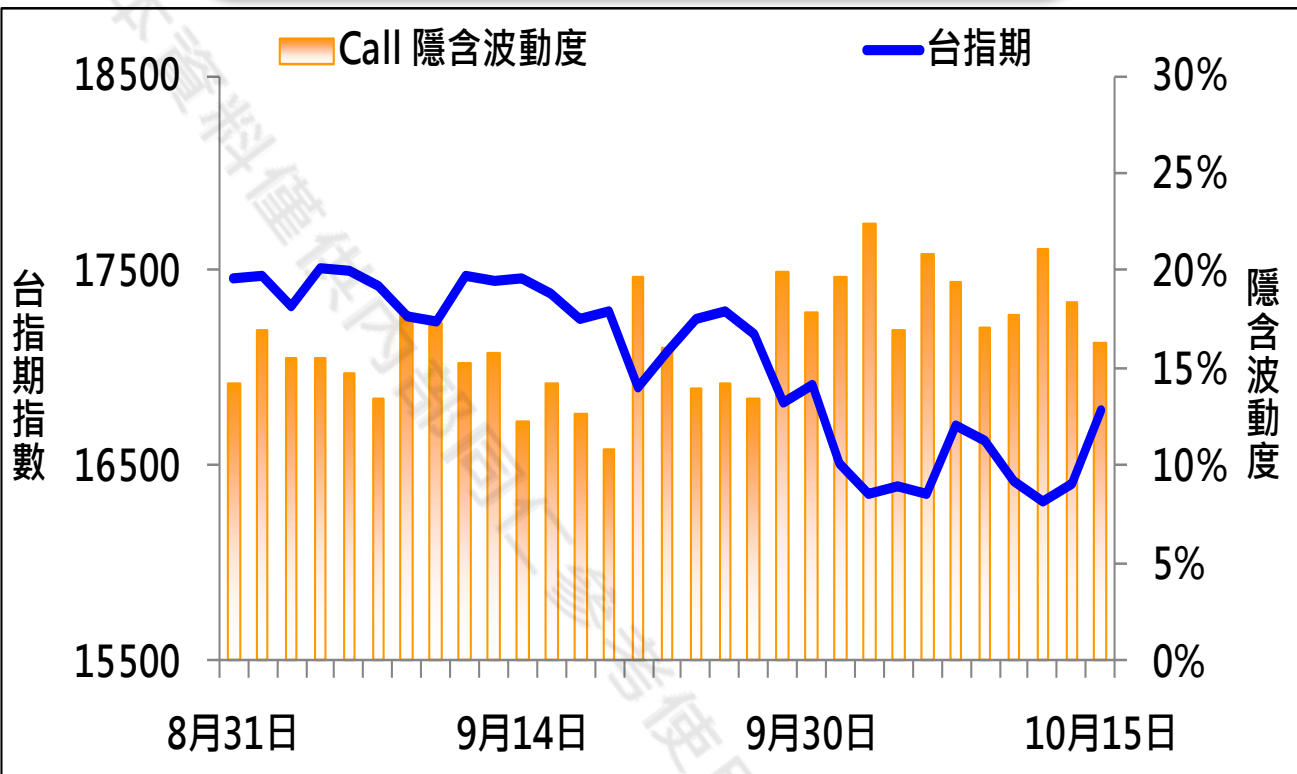
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/10/15

結算日：2021/10/20

OI 增減	Call	202110月 履約價	Put	OI 增減
-58	239	16,000	16,066	38
-1	14	16,050	2,394	504
-55	244	16,100	9,035	1,079
8	59	16,150	3,035	1,558
-102	651	16,200	10,369	1,299
-65	115	16,250	3,105	1,579
-510	1,649	16,300	10,212	3,904
-159	512	16,350	4,777	2,941
-881	4,895	16,400	14,709	5,728
-667	1,048	16,450	3,334	2,147
-1,665	4,931	16,500	11,759	6,909
-390	1,765	16,550	3,408	3,026
-1,790	7,095	16,600	9,393	3,478
-649	2,845	16,650	2,107	2,013
-996	8,019	16,700	10,047	5,352
-142	3,625	16,750	2,077	2,022
989	13,067	16,800	5,075	1,844
2,144	6,870	16,850	335	334
-400	13,735	16,900	3,067	420
780	4,567	16,950	50	49
2,407	17,787	17,000	3,164	21
※ 4,332	13,491	17,100	1,941	-106
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,153	208,601	1.0946	228,331	38,753

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：2021/10/15

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111 月 履約價	Put	OI 增減
142	668	16,600	3,592	76
125	844	16,700	2,625	69
291	768	16,800	484	122
127	777	16,900	557	42
411	1,233	17,000	459	21
351	2,121	17,100	395	3
56	1,266	17,200	772	-7
348	1,322	17,300	1,346	3
222	1,023	17,400	465	3
399	1,509	17,500	24	0
※ 506	1,785	17,600	10	1
256	1,466	17,700	7	0
248	906	17,800	2	0
33	550	17,900	11	0
317	2,310	18,000	3	0
55	647	18,100	3	0
39	471	18,200	0	0
50	488	18,300	0	0
83	310	18,400	120	0
-34	269	18,500	0	0
58	550	18,600	0	0
-1	58	18,700	0	0
2	129	18,800	0	0
2	42	18,900	0	0
3	218	19,000	0	0
0	59	19,100	0	0
0	26	19,200	0	0
301	408	19,300	0	0
50	102	19,400	0	0
193	371	19,500	0	0
0	44	19,600	0	0
0	409	19,700	0	0
1	413	19,800	0	0
0	413	19,900	0	0
0	1,173	20,000	0	0
51	1,132	20,100	0	0
151	2,538	20,200	1	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
4,878	32,114	1.0984	35,275	5,068
昨日 P/C	1.1091	今日增減變化		-0.0107

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。

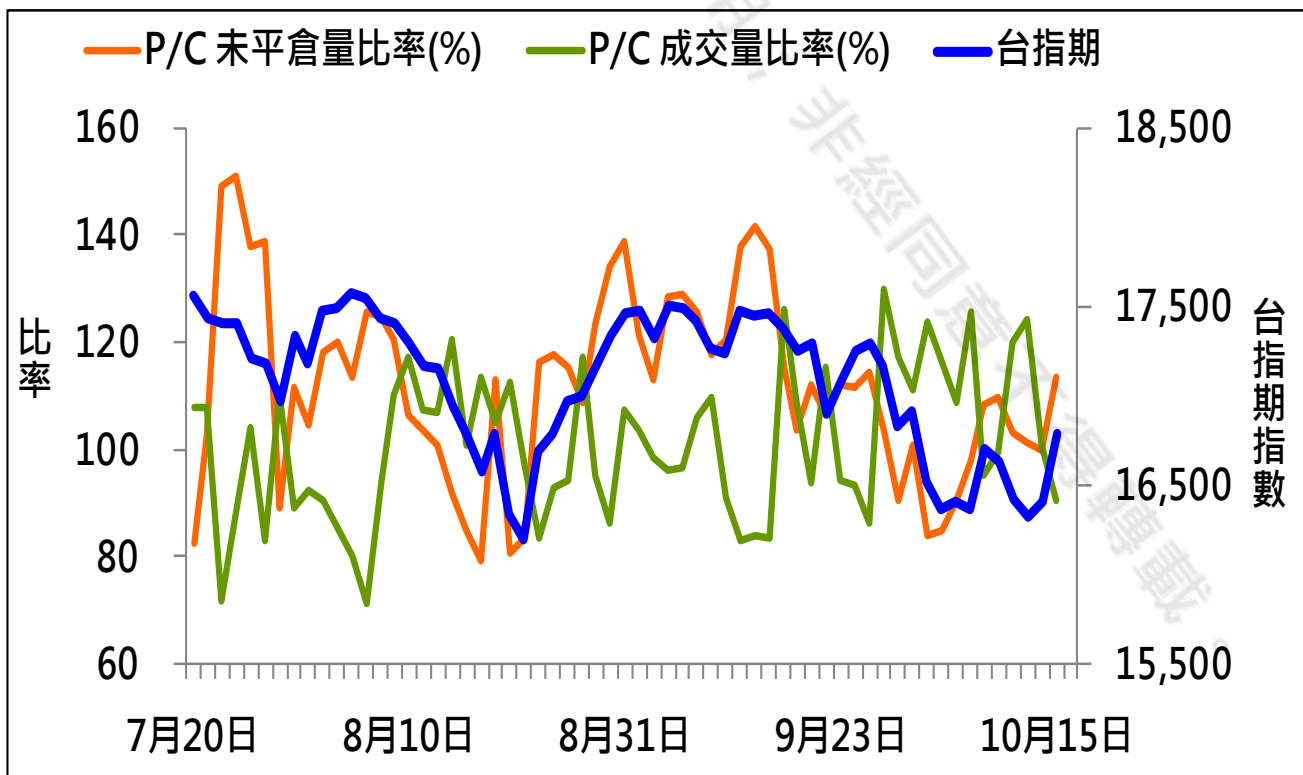
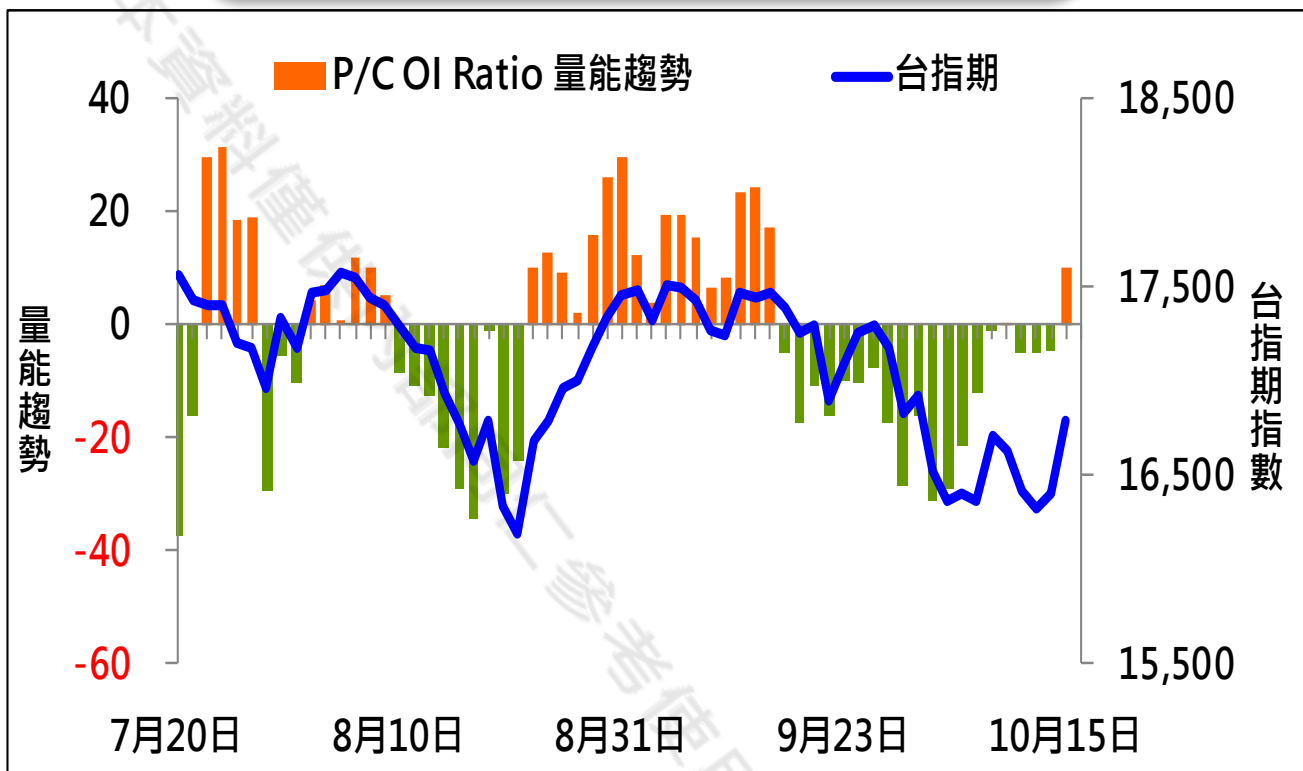
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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。

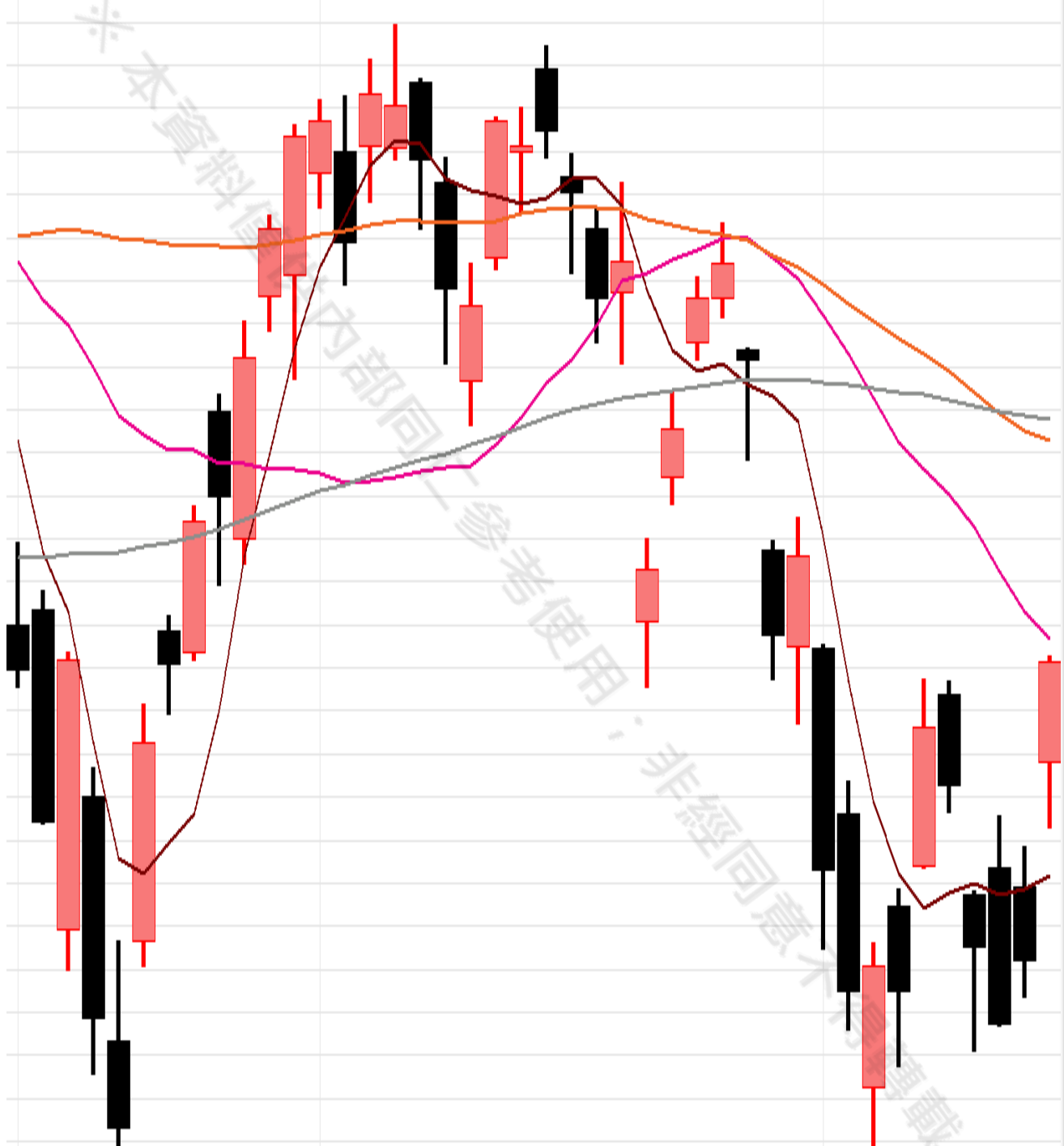
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號
台北市民生東路四段54號3樓之9 TEL: 02-27180000 FAX: 02-25463700

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 16509.80↑ SMA20 16811.70↓ SMA60 17065.07↓ SMA120 17093.10↓ SMA240 16102.84↑



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