



## 法人籌碼動態

10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	-22,414	252	252	-24	-1,754	50
投信	-3,872	-119	163	0	24	0
自營商	16,748	37	75	-32	297	6

10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	-172	-4	1,869	18	8,932	4,991
投信	2	0	0	0	-61	0
自營商	160	-10	-5,813	1,857	14,879	-138

個股貢獻點數前十名		個股貢獻點數後十名		單位：口		
				多	空	
台達電	6.86	台積電	-34.22	台指期前十大 市場佔比	46.0%	56.1%
友達	4.92	聯電	-8.61			
日月光投控	3.76	台塑	-6.30			
欣興	3.48	台塑化	-6.29	電子期前十大 市場佔比	58.8%	70.1%
群創	2.95	南亞	-4.97			
矽力-KY	2.61	聯發科	-3.15			
鴻海	2.29	國泰金	-2.91	金融期前十大 市場佔比	66.3%	91.3%
研華	1.78	富邦金	-1.90			
智原	1.44	亞德客-KY	-1.81			
台光電	1.43	世芯-KY	-1.41	非金電期前十大 市場佔比	91.9%	95.2%
前十名合計	31.51	後十名合計	-71.55			

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

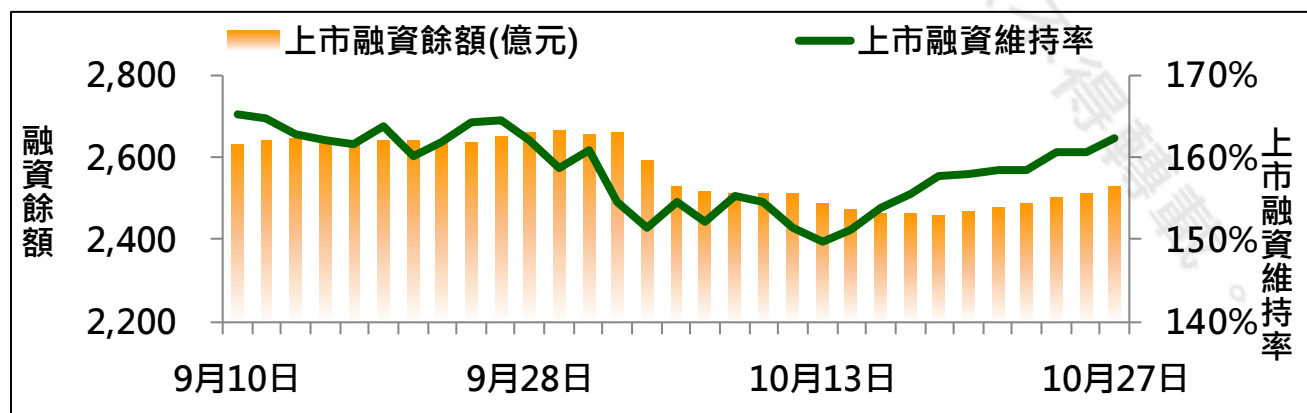
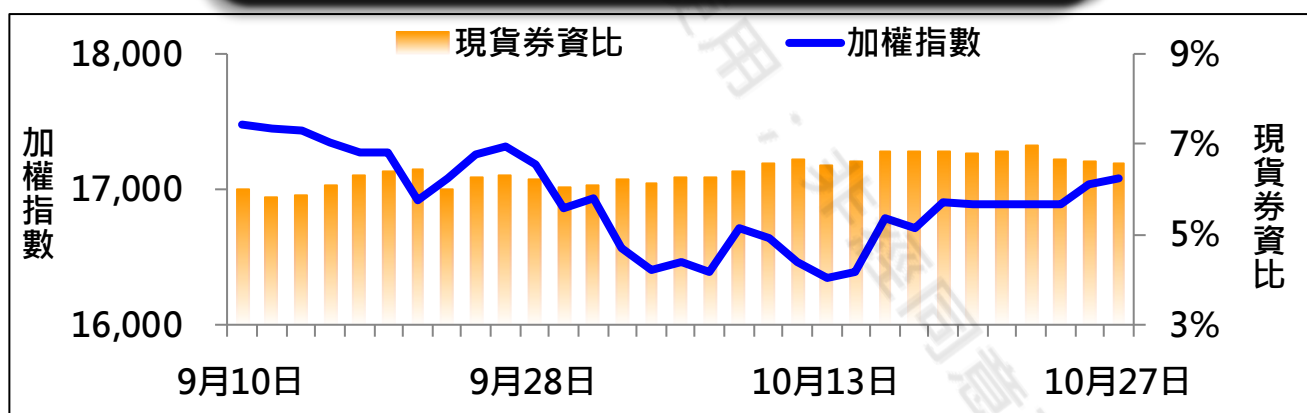


## 法人現貨、期貨&選擇權籌碼變化

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22日	-9.0	-20,002	-1,839	2.4	16,085	253
10月25日	47.1	-20,028	-26	7.2	16,008	-77
10月26日	68.6	-22,065	-2,037	11.9	14,900	-1,108
10月27日	24.6	-22,666	-601	6.2	16,711	1,811
10月28日	-73.5	-22,414	252	-8.1	16,748	37

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22日	10,473	18,452	-7,979	-2,560	7,507	-10,067
10月25日	9,971	18,383	-8,412	-266	10,433	-10,699
10月26日	8,559	18,223	-9,664	3,355	-2,221	5,576
10月27日	1,851	3,941	-2,090	-7,670	15,017	-22,687
10月28日	1,869	8,932	-7,063	-5,813	14,879	-20,692

## 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。

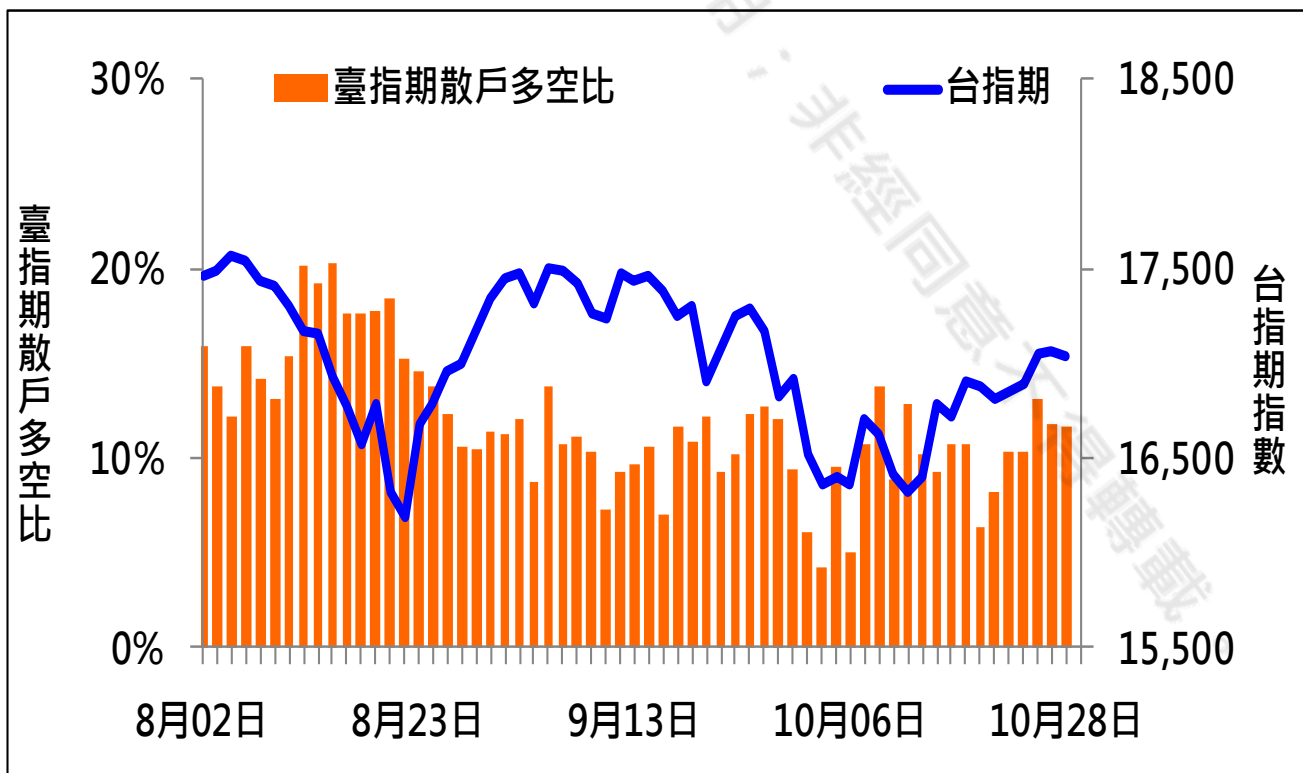
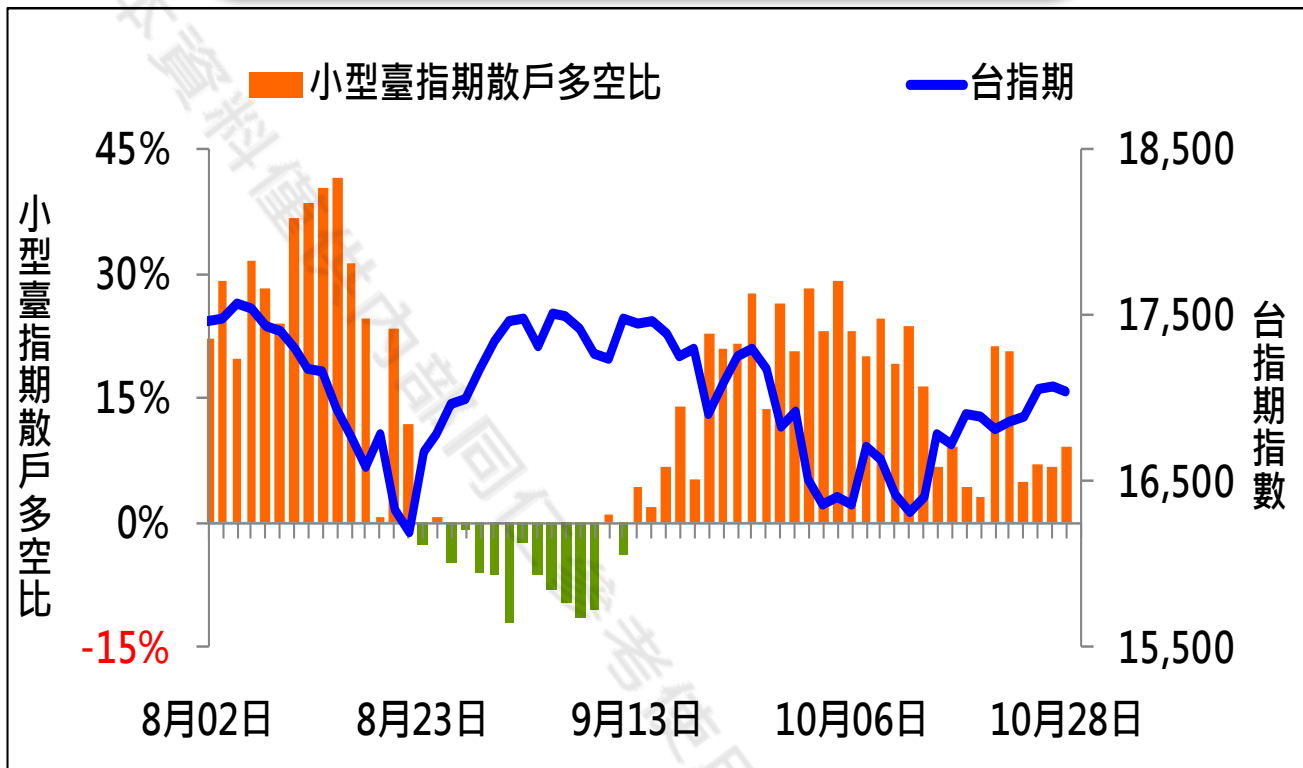
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



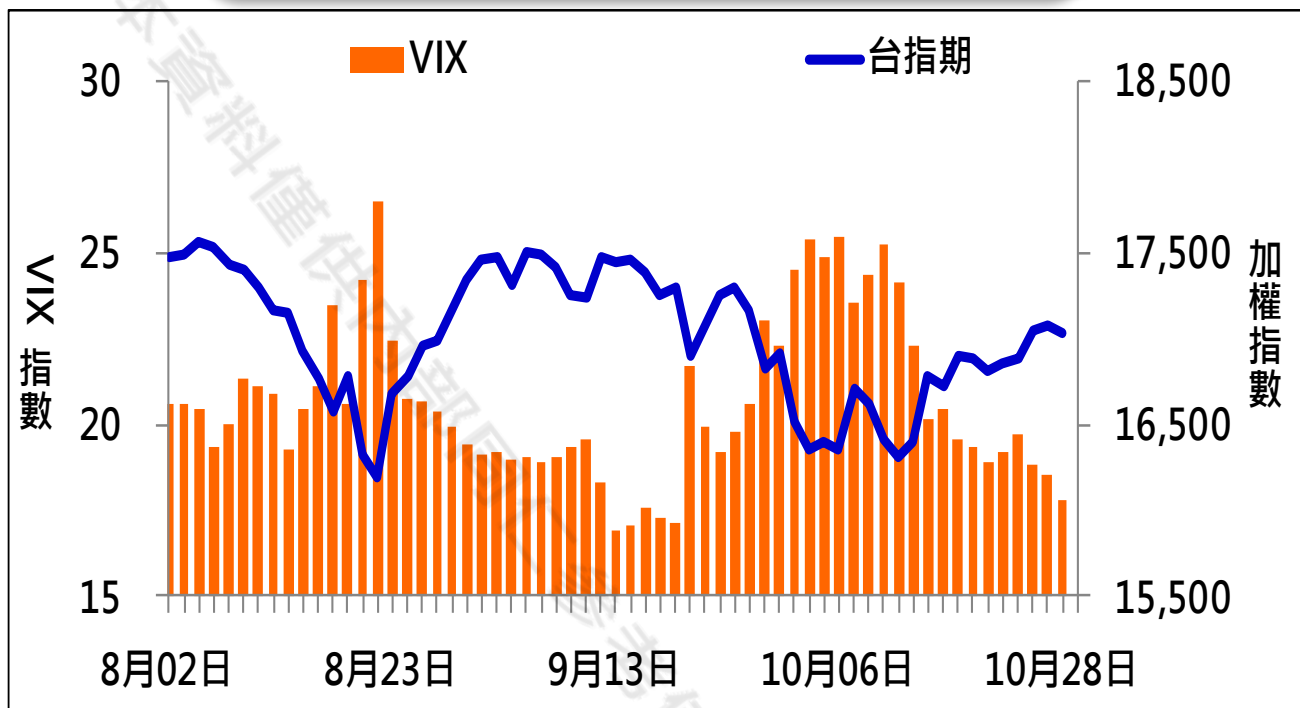
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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

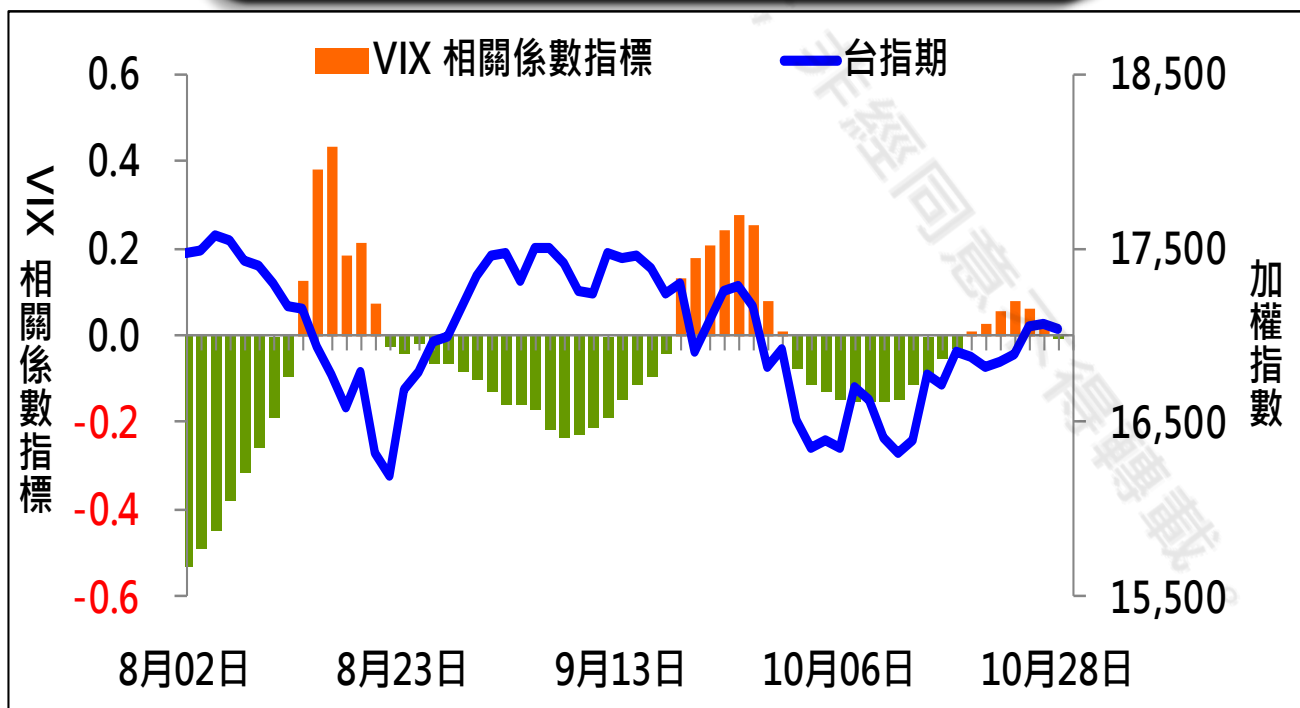
資料來源：台灣證券交易所 & 台灣期貨交易所



## VIX



## VIX 與 TWSE 相關係數指標



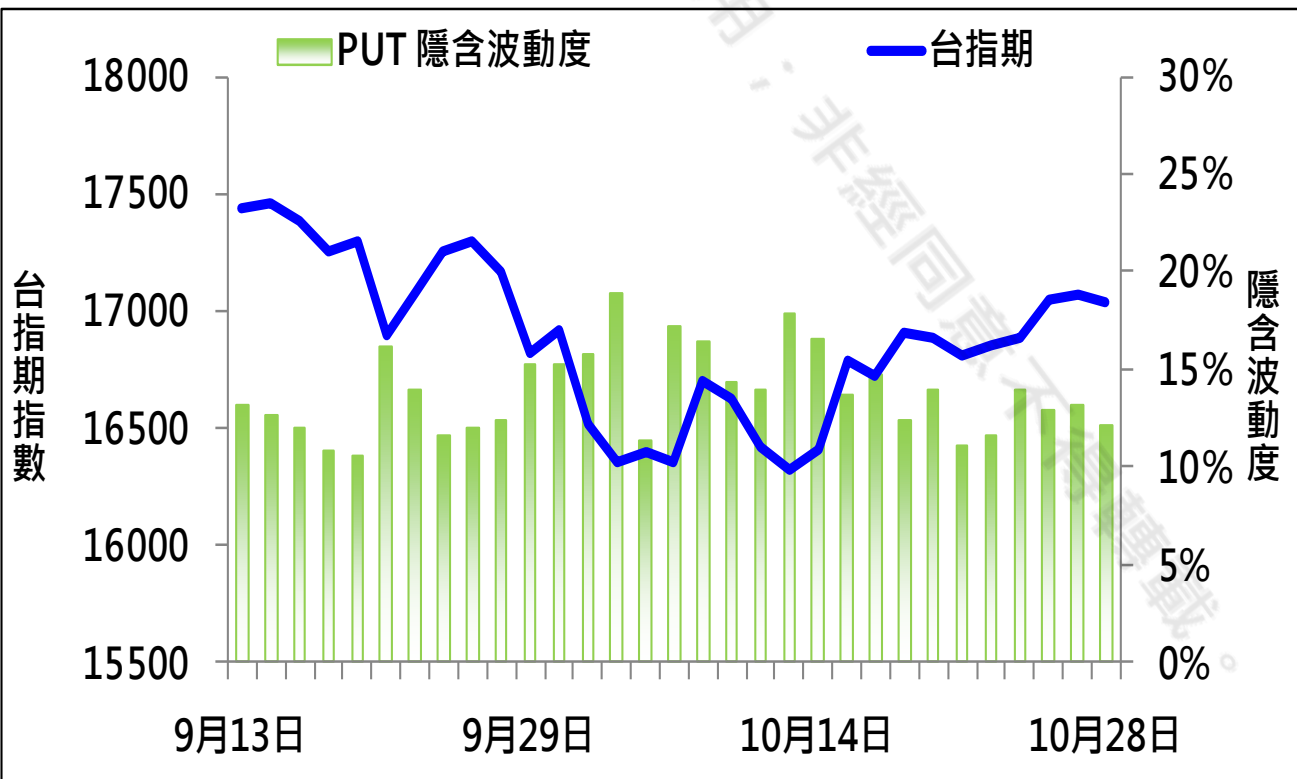
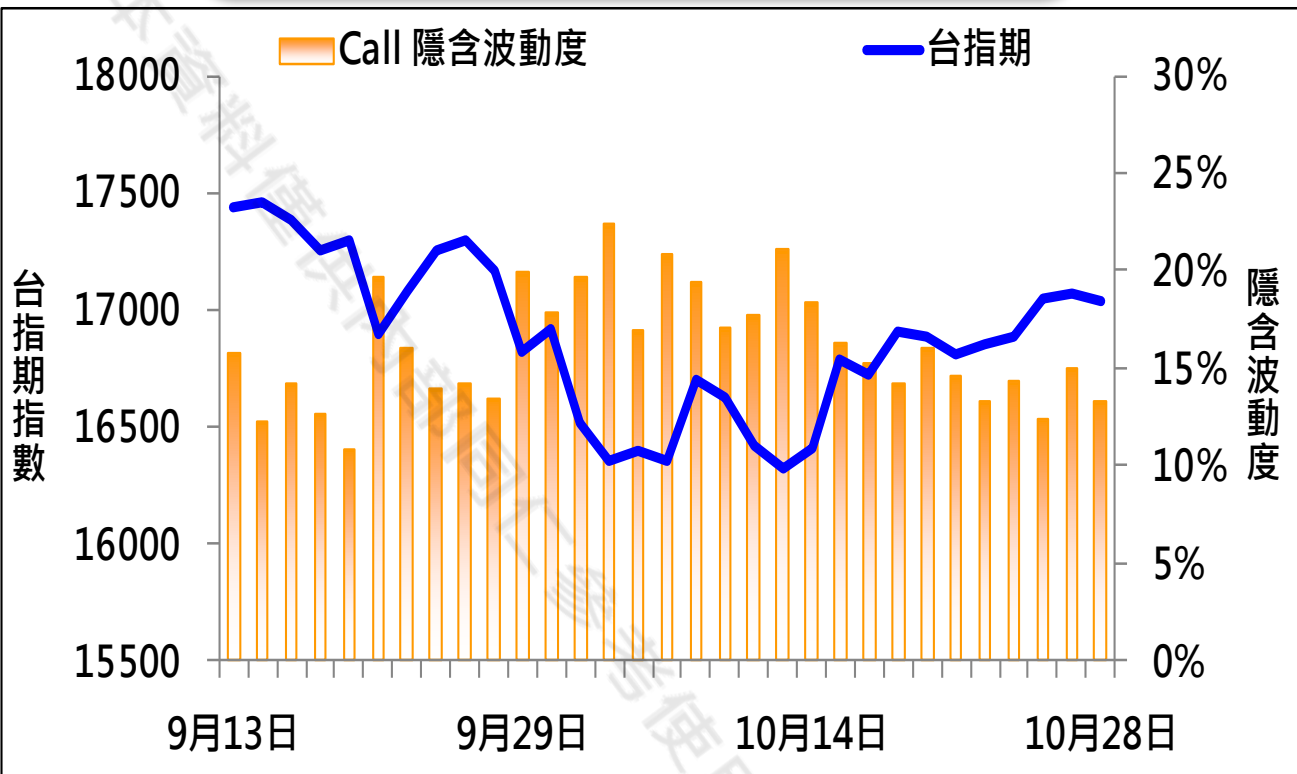
期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，並留意控管個人部位及投資風險；過去的績效及預期的表現，不得為未來績效之保證，交易人須自行判斷與負責，本公司不負任何法律責任。

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：2021/10/28

結算日：2021/11/3

OI 增減	Call	202111W1 履約價	Put	OI 增減
0	1	16,200	1,517	751
0	0	16,300	4,604	1,730
1	1	16,400	1,735	795
0	12	16,500	5,356	3,296
2	2	16,550	3,162	2,289
3	15	16,600	4,089	2,709
5	7	16,650	2,927	1,912
11	28	16,700	5,394	2,138
7	48	16,750	3,152	1,930
50	79	16,800	5,123	3,714
151	215	16,850	2,467	1,726
267	366	16,900	3,250	1,713
344	470	16,950	3,146	2,154
835	1,739	17,000	3,645	2,341
1,090	2,006	17,050	2,020	1,329
2,028	3,467	17,100	1,363	872
1,816	2,842	17,150	826	590
3,038	4,665	17,200	680	562
2,703	3,952	17,250	169	88
2,722	5,763	17,300	200	182
3,086	4,871	17,350	52	51
※ 5,465	7,886	17,400	41	11
2,387	3,856	17,450	8	8
2,685	4,422	17,500	6	5
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
30,937	52,172	1.1295	58,926	34,529

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：2021/10/28

結算日：2021/11/17

OI 增減	Call	202111月 履約價	Put	OI 增減
0	0	15,600	1,111	-779
0	0	15,700	1,907	-208
0	150	15,800	2,538	18
0	4	15,900	2,008	-111
0	45	16,000	6,371	-171
0	32	16,100	2,841	542
0	247	16,200	4,250	183
-7	693	16,300	2,835	127
16	1,228	16,400	6,133	140
-1	726	16,500	5,012	874
130	1,194	16,600	3,102	596
-6	1,616	16,700	4,173	1,363
48	1,447	16,800	3,267	-189
-1	2,627	16,900	2,006	13
75	3,466	17,000	2,091	645
122	3,032	17,100	824	121
182	2,717	17,200	1,033	-19
47	3,937	17,300	1,360	8
239	6,345	17,400	495	-1
706	7,921	17,500	48	-3
323	8,357	17,600	164	-3
※ 1,117	6,399	17,700	24	2
180	7,089	17,800	7	0
-567	2,864	17,900	9	0
增減總計	OI 總計	P/C	OI 總計	增減總計
3,076	84,481	0.9674	81,728	3,894
昨日 P/C	0.9561	今日增減變化		0.0113

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。

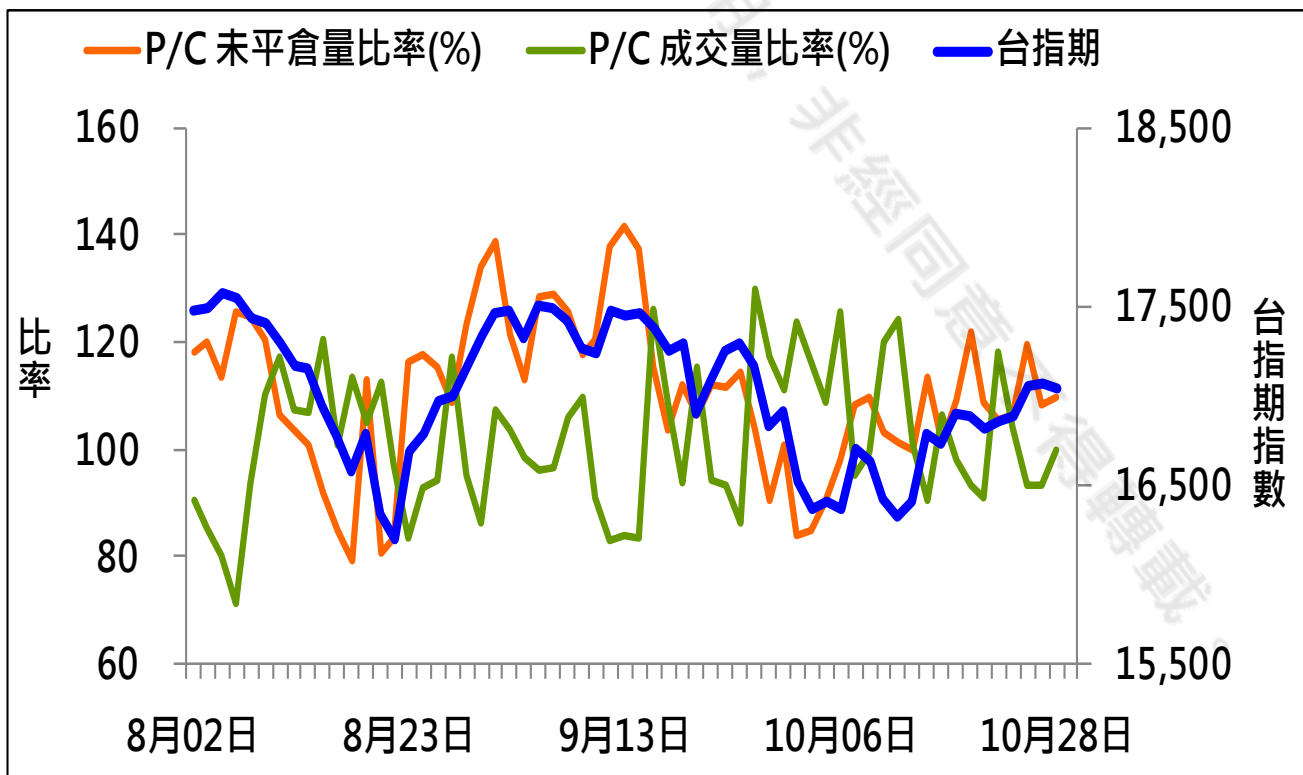
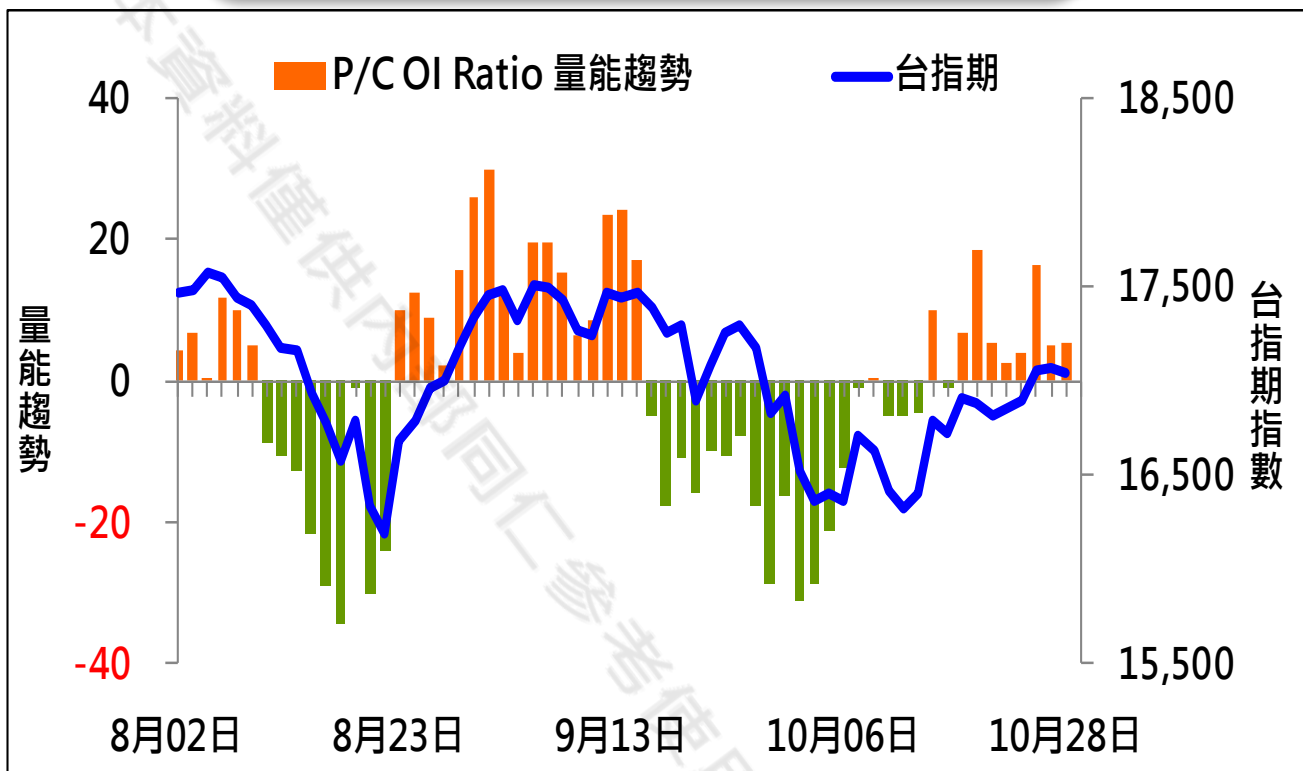
華南金融集團 華南期貨股份有限公司 (109)年金管期總字第007號

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



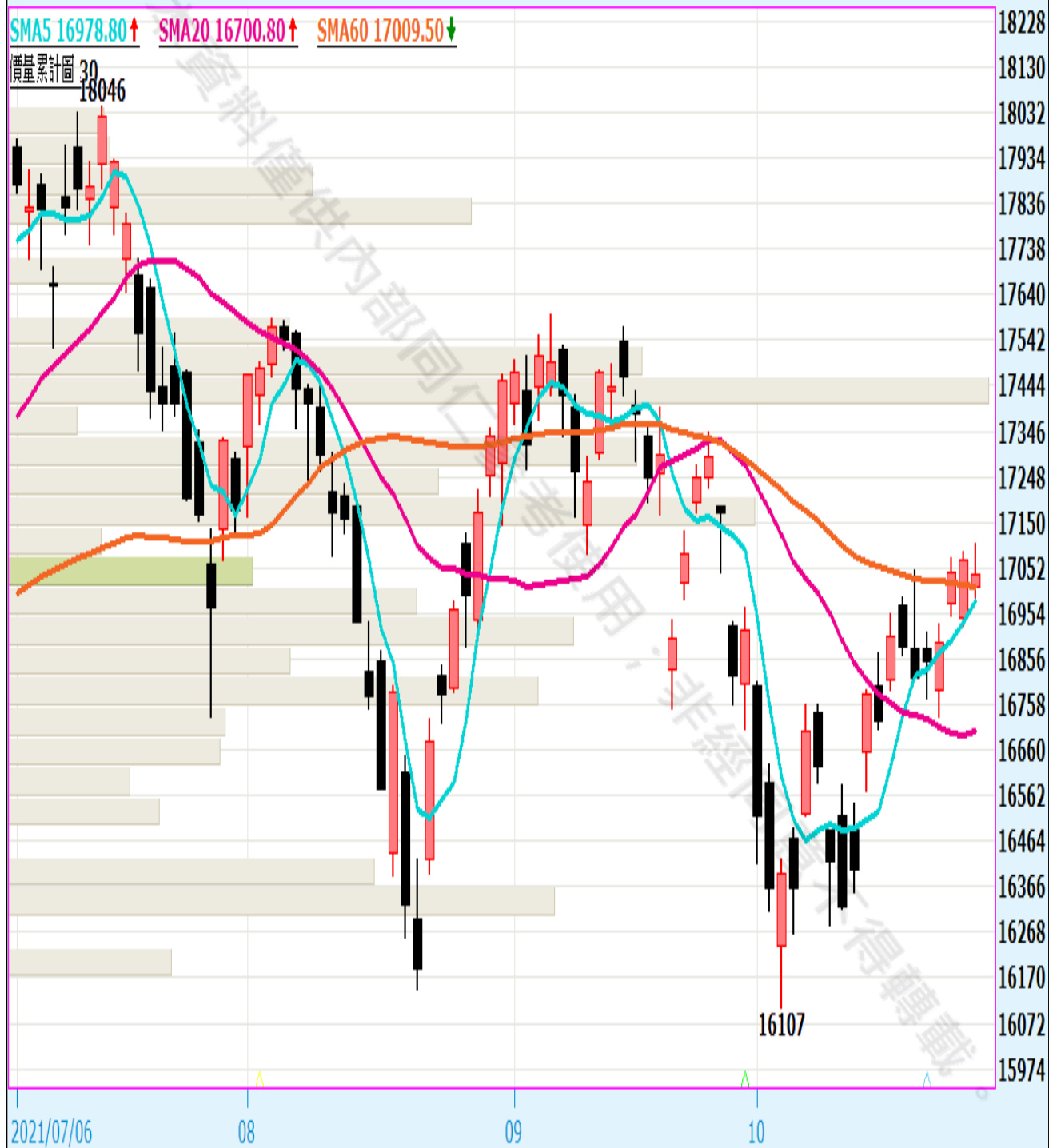


## 盤後重點觀察

台股指數近月(一般)(FTX\*1) 日線圖 2021/10/28 開 17013 高 17103 低 16984 收 17038 s 點 量 85288 口 -30 (-0.18%)

SMA5 16978.80 ↑ SMA20 16700.80 ↑ SMA60 17009.50 ↓

價量累計圖  
30  
18046



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